

受益者のみなさまへ

毎々、格別のお引き立てにあずかり、厚くお礼申し上げます。
さて、「フィデリティ・資産分散投信(安定型)」と「フィデリティ・資産分散投信(成長型)」は、第32期決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

■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 | 原則無期限です。 |
| 運用方針 | <p>「フィデリティ・資産分散投信(安定型)」と「フィデリティ・資産分散投信(成長型)」は主として投資信託証券への投資を通じて、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券、世界の不動産投資信託(リート)、コモディティ、国内短期債券・短期金融商品へ実質的に分散投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的に運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●基本資産配分は、主として各資産クラスのリスク・リターン特性、資産クラス間の相関等を考慮して決定します。資産配分は原則として基本配分に対して概ね、中立を維持します。ただし、市場環境の変化等を考慮して、構成する資産クラスや、その配分が将来的に変更される場合があります。 ●基本資産配分に関する運用にあたっては、FILインベストメント・マネジメント(香港)・リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。 ●ファンドの運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルに、上記以外のファンドの運用の指図に関する権限を委託することがあります。 ●株式運用では、主として、国内外の取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式に投資を行います。 ●海外債券運用では、先進国投資適格債券の他、米ドル建てハイ・イールド債券、ユーロ建てハイ・イールド債券、エマージング債券にも投資を行います。 ●国内債券運用では、主として、日本の公社債(国債・地方債、政府保証債、利付金融債、事業債等)に投資を行います。(ただし、海外政府、海外企業が発行する円建て債券にも投資を行うことができます。) ●世界の不動産投資信託(リート)運用では、国別比率の検討において、国ごとの配当利回りの水準を考慮して運用を行います。 ●コモディティの運用では、国際商品市況指数の騰落率に連動する運用成果を目指す投資信託証券に投資します。 ●国内短期債券・短期金融商品運用では、主として、信用度が高く、残存期間の短い円建て公社債等に投資を行います。 ●組入れ投資信託証券は、外貨建資産の為替ヘッジを行わないものに投資することを原則とします。ただし、主として国内債券、または国内短期債券・短期金融商品に投資する投資信託証券に関しては、外貨建資産は為替ヘッジを行うものに投資することを原則とします。 ●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては上記のような運用ができない場合もあります。 |
| 主要運用対象 | 主として、投資信託証券に投資を行います。投資信託証券には国内投資信託および外国投資信託の受益証券、投資法人ならびに外国投資法人の投資証券が含まれます。 |
| 組入制限 | 投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | <p>毎決算時(原則4月、10月の各20日。同日が休業日の場合は翌営業日。)、原則として以下の収益分配方針に基づき分配を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

■当期の分配金のお知らせ

| 1万円当たり 分配金(税込) | (安定型) | (成長型) |
|-------------------|-------|-------|
| | 0円 | 0円 |

〈お問合せ先〉

フィデリティ投信株式会社 カスタマー・コミュニケーション部
東京都港区六本木七丁目7番7号 TRI-SEVEN ROPPONGI

 0120-00-8051 (無料)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

 <https://www.fidelity.co.jp/>

お客様の口座内容などに関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお尋ねください。

フィデリティ・資産分散投信
(安定型／成長型)

フィデリティ投信株式会社



《フィデリティ・資産分散投信（安定型）》

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 投資組 資産入 信証比 託券率 | 投資組 資産入 証比 券率 | 純資産 総額 |
|------------------|-------------|---------------|--------------|--------------------------|------------------------|------------|
| | (分配落) | 税分 配 込金 | 騰 落 中率 | | | |
| 28期(2021年4月20日) | 円 14,869 | 円 0 | % 8.6 | % 64.0 | % 34.2 | 百万円 860 |
| 29期(2021年10月20日) | 15,766 | 0 | 6.0 | 63.3 | 35.0 | 902 |
| 30期(2022年4月20日) | 15,567 | 0 | △1.3 | 54.7 | 43.4 | 868 |
| 31期(2022年10月20日) | 15,109 | 0 | △2.9 | 56.0 | 42.5 | 825 |
| 32期(2023年4月20日) | 15,305 | 0 | 1.3 | 68.2 | 29.7 | 826 |

(注1) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」、「投資証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

■当期中の基準価額等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 投資組 資産入 信証比 託券率 | 投資組 資産入 証比 券率 |
|---------------------|-------------|-------------|--------------------------|------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期首) 2022年10月20日 | 円 15,109 | % — | % 56.0 | % 42.5 |
| 10月末 | 15,222 | 0.7 | 55.7 | 39.9 |
| 11月末 | 15,247 | 0.9 | 69.2 | 29.2 |
| 12月末 | 14,631 | △3.2 | 67.8 | 30.1 |
| 2023年1月末 | 14,959 | △1.0 | 67.6 | 30.7 |
| 2月末 | 15,059 | △0.3 | 67.6 | 30.2 |
| 3月末 | 15,096 | △0.1 | 68.2 | 29.5 |
| (期末) 2023年4月20日 | 15,305 | 1.3 | 68.2 | 29.7 |

(注) 騰落率は期首比です。

《フィデリティ・資産分散投信（成長型）》

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 投資組 資産入 信証比 | 託券率 | 投資組 資産入 証比 | 純資産 総額 |
|------------------|-------------|---------|---------------------|-------------------|-----------|------------------|-----------|
| | (分配落) | 税分 配 | 込金 期騰 落 中率 | | | | |
| 28期(2021年4月20日) | 円 15,877 | 円 0 | % 13.3 | % 55.4 | % 44.3 | 百万円 4,086 | |
| 29期(2021年10月20日) | 17,309 | 0 | 9.0 | 54.9 | 44.8 | 4,337 | |
| 30期(2022年4月20日) | 17,069 | 0 | △1.4 | 41.2 | 58.4 | 4,175 | |
| 31期(2022年10月20日) | 16,486 | 0 | △3.4 | 41.7 | 57.7 | 3,997 | |
| 32期(2023年4月20日) | 16,851 | 0 | 2.2 | 62.2 | 37.2 | 4,038 | |

(注1) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定していません。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「投資信託受益証券組入比率」、「投資証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

■当期中の基準価額等の推移

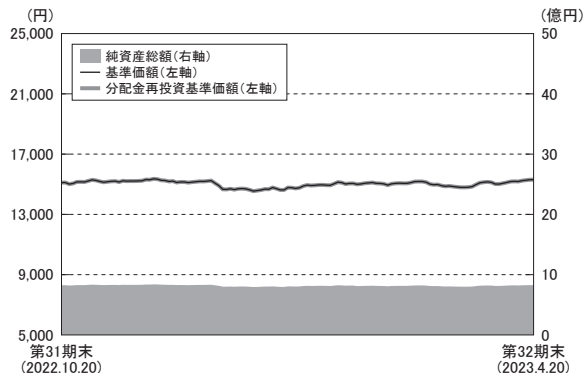
| 年月日 | 基準価額 | | 投資組 資産入 信証比 | 託券率 | 投資組 資産入 証比 | 券率 |
|---------------------|-------------|--------|-------------------|-----------|------------------|----|
| | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| (期首) 2022年10月20日 | 円 16,486 | % — | % 41.7 | % 57.7 | | |
| 10月末 | 16,650 | 1.0 | 41.3 | 55.1 | | |
| 11月末 | 16,740 | 1.5 | 63.1 | 36.3 | | |
| 12月末 | 15,838 | △3.9 | 61.4 | 37.7 | | |
| 2023年1月末 | 16,356 | △0.8 | 61.2 | 38.0 | | |
| 2月末 | 16,475 | △0.1 | 61.1 | 38.2 | | |
| 3月末 | 16,467 | △0.1 | 62.1 | 37.5 | | |
| (期末) 2023年4月20日 | 16,851 | 2.2 | 62.2 | 37.2 | | |

(注) 騰落率は期首比です。

■運用経過の説明

●基準価額等の推移

(安定型)

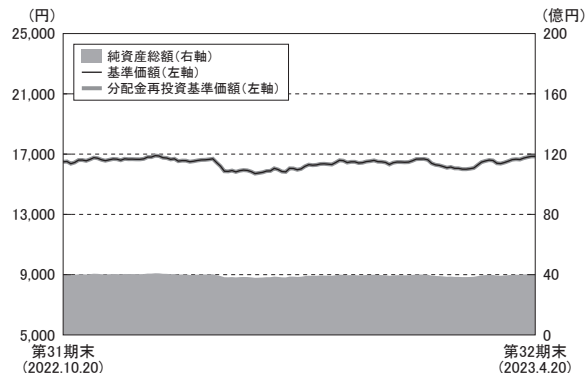


第32期首: 15,109円

第32期末: 15,305円(既払分配金0円)

騰落率: 1.3%(分配金再投資ベース)

(成長型)



第32期首: 16,486円

第32期末: 16,851円(既払分配金0円)

騰落率: 2.2%(分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、2022年10月20日の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

※当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

●基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドの騰落率は、安定型が+1.3%、成長型が+2.2%でした。

<プラス要因>

- ・国内債券市場及び新興国債券市場が堅調に推移したこと。
- ・日本及び海外株式市場が上昇したこと。

<マイナス要因>

- ・不動産投資信託(リート)及びコモディティが低迷したこと。
- ・日本を除く世界の国債が軟調だったこと。
- ・円に対して米ドルが下落したこと。

●投資環境

【世界株式】

当期の世界の株式市場はボラティリティの上昇が目立つ展開となる中、上昇して期を終えました。期初から2022年年末にかけては、インフレの鈍化や景気減速が見込まれれば、各国中央銀行が金融引き締めペースを緩めるのではないかと観測が浮上し、市場は堅調に推移しました。米連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）は2022年12月に利上げペースを減速させましたが、インフレ目標を上回る水準の物価上昇が続いたことなどから、主要中央銀行がタカ派的な姿勢を維持したため、市場のボラティリティが上昇しました。期終盤の3月に入ると、米国のシリコンバレー銀行の経営破綻をきっかけに銀行セクターの混乱が生じ、金融システムの健全性に対する懸念が広がりましたが、主要中央銀行が迅速に対応したことなどから、市場は落ち着きを取り戻しました。このような状況の下、主要株式市場は上昇し、とりわけ欧州（除く英国）は予想外に堅調な経済動向を受け、大幅に上昇しました。また、新興国の株式市場についても、中国が2022年12月に新型コロナウイルスを巡る防疫策を大幅に緩和した他、景気を下支えするための経済対策を講じたことなどから経済活動再開に楽観的な見方が広がり上昇しました。業種別では、資本財・サービス、素材、情報技術などが上昇しました。

【世界債券】

当期の世界の債券市場は上昇しました。期前半の2022年年末にかけては、インフレ率の鈍化や景気減速が見込まれれば、各国中央銀行が金融引き締めペースを緩めるのではないかと観測から、市場は上昇し、堅調に推移しました。しかし、インフレ率の高止まりを背景に、FRBやECBなどの主要中央銀行はタカ派的な姿勢を維持し、インフレ抑制を優先する姿勢を明確に示しました。一方、日銀が12月に長期金利の変動幅の上限を従来の0.25%程度から0.5%程度に拡大するイールドカーブ・コントロールの修正を発表したことが日本国債の売り圧力につながりました。2023年に入ると、中国の経済活動再開に伴う景気回復の動きや欧州の天然ガス価格の下落などを受けて、世界経済の先行きに前向きな兆しが見られたことなどが市場を下支えしました。しかし、3月に入ると、米国のシリコンバレー銀行の経営破綻をきっかけに、信用不安が銀行システム全体に波及するのではないかと懸念が広がり、市場のボラティリティが上昇しました。銀行セクターの混乱が投資家の安全資産への逃避につながり、米国2年債の利回りは急速に低下し、1987年以来となる低下幅となりました。この流れを受けて日本国債の利回りも大幅に低下しました。また、幅広い地域でクレジット・スプレッドが縮小したことから、社債市場は上昇しました。

【世界の不動産投資信託（リート）】

当期の世界のリート市場は下落しました。国別にみると、米国ではFRBがインフレ抑制のため、過去6カ月間に4回に亘って利上げを実施したことが引き続き住宅市場への下押し圧力となりました。ドイツの不動産市場は住宅ローンの需要に大きな影響をもたらした借入コストの上昇により、住宅需要が弱含んだことから、軟調に推移しました。英国については、英イングランド銀行（BOE）がインフレ抑制のため利上げを継続したものの、不動産市場はプラス圏で推移しました。アジアでは、中国が不動産市場の支援策として、銀行に対して開発資金の融資期間の延長や住宅ローン金利の引き下げなどを促したことを受けて、香港の不動産銘柄は上昇しました。日本では、日銀が2022年12月に長期金利の変動幅の上限を従来の0.25%程度から0.5%程度に拡大したことから、金融政策を修正するのではないかと観測が高まり、日本の不動産市場に下押し圧力がかかりました。

【コモディティ】

当期のコモディティ市場はエネルギーを中心に下落しました。暖冬の影響や季節的な需要の減退を受けて天然ガスが下落した他、灯油や軽油も下落しました。工業用金属については、世界最大の消費国である中国が新型コロナウイルスの防疫策を解除して経済活動再開に向けて動き出したことや、不動産市場の支援策を講じたことなどから上昇しました。とりわけ、錫と銅が大幅に上昇しました。貴金属では、期初に銀やプラチナが上昇しました。また、米国のシリコンバレー銀行の経営破綻による影響から、安全な逃避先を求める資金が流入したことを受けて金が上昇しました。農産物では、ウクライナからの供給が増加したことを受けて小麦が下落しました。

●ポートフォリオ

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券、世界の不動産投資信託（リート）、コモディティ、国内短期債券・短期金融商品へ実質的に分散投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目指して運用を行っています。当期の基本資産配分は、主として各資産クラスのリスク・リターン特性、資産クラス間の相関等を考慮して決定いたしました。

当期末現在で組入れている投資信託証券は以下の通りでした。

| 組入れ投資信託証券 | 組入れ比率 (当期末現在) | |
|--|------------------|-------|
| | 安定型 | 成長型 |
| DLIBJ公社債オープン(中期コース) | 33.7% | 9.5% |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ファンド(適格機関投資家転売制限付き) | 20.6% | 32.2% |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 6.8% | 10.1% |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用) | 6.1% | 7.8% |
| フィデリティ・ファンズーUSドル・ボンド・ファンド | 6.1% | 5.1% |
| フィデリティ・ファンズーエマージング・マーケット・デット・ファンド | 5.8% | 7.6% |
| フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用) | 4.9% | 8.0% |
| フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ハイ・イールド・ファンド | 4.2% | 5.1% |
| フィデリティ・ファンズーユーロ・ボンド・ファンド | 3.9% | 4.8% |
| iシェアーズ・ディバースファイド・コモディティ・スワップ UCITS ETF | 2.7% | 4.3% |
| フィデリティ・インベストメント・ファンズーIXーフィデリティ・サステナブル・UK・アグリゲート・ボンド・ファンド | 2.0% | 3.0% |
| フィデリティ・ファンズーヨーロッパ・ダイナミック・グロース・ファンド | 1.0% | 1.5% |
| フィデリティ・欧州中小型株・オープン(適格機関投資家専用) | 0.2% | 0.4% |
| フィデリティ・ファンズーアジア・パシフィック・オポチュニティーズ・ファンド | 0.2% | 0.3% |
| フィデリティ・ファンズーサステナブル・アジア株式ファンド | 0.1% | 0.2% |

※組入れ比率は、対純資産総額比率

●ベンチマークとの差異

当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

■分配金

(安定型)

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきました。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

●分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第32期 |
|-----------|------------------------|
| | 2022年10月21日～2023年4月20日 |
| 当期分配金 | 0 |
| (対基準価額比率) | －% |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,043 |

(成長型)

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきました。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

●分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第32期 |
|-----------|------------------------|
| | 2022年10月21日～2023年4月20日 |
| 当期分配金 | 0 |
| (対基準価額比率) | －% |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,652 |

*「当期の収益」および「当期の収益以外」は円未満切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

* 当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金(税引前)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。

* 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」が当該決算期末日時点の基準価額を上回ることがありますが、実際には基準価額を超えて分配金が支払われることはありません。

■ 今後の運用方針

当ファンドは、市場の短期的な動きにかかわらず、長期的な観点からリスクを分散し、投資信託財産の成長を図ることを目的に運用を行っています。今後も、投資信託証券への投資を通じ、基本資産配分比率から大きく乖離しない形で、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券、世界の不動産投資信託(リート)、コモディティ、国内短期債券・短期金融商品へ分散投資を行ってまいります。

《フィデリティ・資産分散投信（安定型）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目 | 第32期 | | 項目の概要 |
|-------------|------------------------|---------|---|
| | 2022年10月21日～2023年4月20日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 53円 | 0.351% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は15,025円です。 |
| （投信会社） | (8) | (0.055) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (41) | (0.274) | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの 管理及び事務手続き等の対価 |
| （受託会社） | (3) | (0.022) | 運用財産の保管・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 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （投資証券） | (0) | (0.000) | 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （投資証券） | (0) | (0.001) | 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 8 | 0.052 | (d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （保管費用） | (0) | (0.002) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外 における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。 |
| （監査費用） | (1) | (0.006) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用 |
| （その他） | (7) | (0.044) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、 印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま れます。 |
| 合計 | 61 | 0.405 | |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

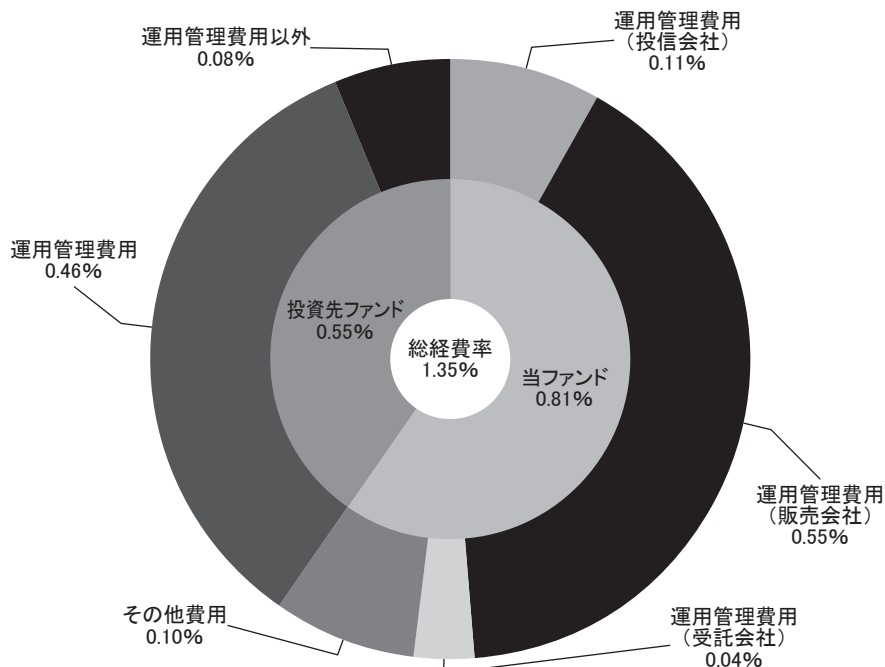
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.35%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 1.35% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.81% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.46% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.08% |

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

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

(注3)その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4)各比率は、年率換算した値です。

(注5)投資先ファンドとは、当ファンドが実質的に組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注6)①の費用は、マザーファンド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7)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■ 売買及び取引の状況 (2022年10月21日から2023年4月20日まで)

● 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|--|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
| | 単位数又は口数 | 金 額 | 単位数又は口数 | 金 額 |
| 国内 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| フィデリティ・欧州中小型株・オープン (適格機関投資家専用) | — (—) | — (—) | 407,547 (—) | 904 (—) |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ファンド (適格機関投資家転売制限付き) | 61,819.625 (—) | 112,472 (—) | 1,510.607 (—) | 2,769 (—) |
| D L I B J 公社債オープン (中期コース) | — (—) | — (—) | 11,136.678 (—) | 10,766 (—) |
| 外国 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| FIDELITY FUNDS-JAPAN VALUE FUND A-ACC-JPY | — (—) | — (—) | 39,74249 (—) | 112,472 (—) |
| FID INVE FUNDS IX - FID SUSTAINABLE UK AGGREGATE BOND FD I-ACC | 千口 (—) | 千イギリス・ポンド (—) | 千口 (—) | 千イギリス・ポンド (—) |
| FF-EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND A | 千口 (—) | 千ユーロ (—) | 千口 (—) | 千ユーロ (—) |
| FF-ASIA PACIFIC OPPORTUNITIES A-ACC-EURO | — (—) | — (—) | 0.15583 (—) | 11 (—) |
| | — (—) | — (—) | 0.20382 (—) | 6 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付 () 内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付 () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年10月21日から2023年4月20日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 千口 4,251 | 千円 8,158 | 千口 1,716 | 千円 3,584 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等（2022年10月21日から2023年4月20日まで）

〈フィデリティ・資産分散投信（安定型）〉

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|----------|------------|-------------------------|---------------|-----------|-------------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託受益証券 | 百万円 112 | 百万円 112 | % 100.0 | 百万円 14 | 百万円 14 | % 100.0 |
| 投資証券 | — | — | — | 116 | 116 | 100.0 |
| 為替 | 0 | — | — | 117 | 115 | 97.6 |

(2) 期中の利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 | | 期 |
|---------|----------|------------|------------|
| | 買付額 | 売付額 | 期末保有額 |
| その他有価証券 | 百万円 — | 百万円 116 | 百万円 192 |

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 | 期 |
|-----------------|-----|---|
| 売買委託手数料総額(A) | 0千円 | |
| うち利害関係人への支払額(B) | — | |
| (B) / (A) | — | |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

〈フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド〉

● 期中の利害関係人との取引状況

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

※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あり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL DISTRIBUTORS、FIL INVESTMENT SERVICES UK LIMITED、FIL LUXEMBOURG SAです。

■組入資産の明細（2023年4月20日現在）

(1) 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

| ファンド名 | 当 期 末 | | |
|--|---------------|-------------|----------|
| | 単位数又は口数 | 評 価 額 | 比 率 |
| フィデリティ・欧州中小型株・オープン（適格機関投資家専用） | 千口 830,813 | 千円 1,928 | % 0.2 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式 ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用） | 31,703,193 | 40,335 | 4.9 |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ ファンド（適格機関投資家転売制限付き） | 88,539,981 | 170,076 | 20.6 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（適格機関投資家専用） | 63,419,277 | 50,361 | 6.1 |
| D L I B J 公社債オープン（中期コース） | 286,910,604 | 278,819 | 33.7 |
| 合 計 | 471,403,868 | 541,521 | 65.5 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | | |
|--|----------------|------------------|--------------|----------|
| | 単位数又は口数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| ISHARES DIVERSIFIED COMMDY ETF | 千口 23,583 | 千アメリカ・ドル 163 | 千円 22,018 | % 2.7 |
| FF-SUSTAINABLE ASIA EQUITY FUND A | 0.70267 | 7 | 985 | 0.1 |
| FF-US DOLLAR BOND FUND (class1) A | 51.90262 | 371 | 50,132 | 6.1 |
| FF-EMERGING MARKET DEBT FUND A-ACC-USD | 20.59053 | 354 | 47,810 | 5.8 |
| FID INVE FUNDS IX - FID SUSTAINABLE UK AGGREGATE BOND FD I-ACC | 千口 52,98104 | 千イギリス・ポンド 100 | 千円 16,915 | 2.0 |
| FF-EURO BOND FUND A | 千口 18,5023 | 千ユーロ 219 | 千円 32,491 | 3.9 |
| FF-EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND A | 0.681 | 53 | 7,949 | 1.0 |
| FF-EURO HIGH YIELD A | 27.21122 | 234 | 34,608 | 4.2 |
| FF-ASIA PACIFIC OPPORTUNITIES A-ACC-EURO | 0.3363 | 9 | 1,432 | 0.2 |
| 合 計 | 196.49068 | — | 214,345 | 25.9 |

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

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 千口 25,005 | 千口 27,540 | 千円 56,432 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成 (2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 563,539 | % 67.8 |
| 投 資 証 券 | 192,326 | 23.1 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 56,432 | 6.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 18,568 | 2.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 830,867 | 100.0 |

(注1) 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。

なお、4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.92円、1シンガポール・ドル=101.10円、1イギリス・ポンド=167.69円、1ユーロ=147.82円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(214,616千円)の投資信託財産総額(830,867千円)に対する比率は、25.8%です。

(注3) フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(4,663,712千円)の投資信託財産総額(4,851,332千円)に対する比率は、96.1%です。

(注4) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 831,078,327 |
| コール・ローン等 | 18,521,829 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 563,539,642 |
| 投 資 証 券(評価額) | 192,326,910 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド(評価額) | 56,432,320 |
| 未 収 入 金 | 211,042 |
| そ の 他 未 収 収 益 | 46,584 |
| (B) 負 債 | 4,620,086 |
| 未 払 金 | 211,123 |
| 未 払 解 約 金 | 1,128,599 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 2,871,982 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 408,382 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 826,458,241 |
| 元 本 | 539,995,668 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 286,462,573 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 539,995,668口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 15,305円 |

(注1) 当期における期首元本額546,063,964円、期中追加設定元本額4,962,165円、期中一部解約元本額11,030,461円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年10月21日 至2023年4月20日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,690,962 |
| 受 取 配 当 金 | 2,249,159 |
| 受 取 利 息 | 812 |
| そ の 他 収 益 金 | 440,991 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 11,156,227 |
| 売 買 益 | 28,715,012 |
| 売 買 損 | △17,558,785 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △3,292,680 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 10,554,509 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 248,372,626 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 27,535,438 |
| (配 当 等 相 当 額) | (37,444,862) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△9,909,424) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 286,462,573 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 286,462,573 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 27,535,438 |
| (配 当 等 相 当 額) | (37,445,292) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△9,909,854) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 288,894,460 |
| 繰 越 損 益 金 | △29,967,325 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした債権から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|--------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 2,793,948円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 37,445,292円 |
| (d) 分配準備積立金 | 286,100,512円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 326,339,752円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 可 能 額 | 6,043.38円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 金 額(税引前) | 0円 |

《フィデリティ・資産分散投信（成長型）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目 | 第32期 | | 項目の概要 |
|-------------|------------------------|---------|---|
| | 2022年10月21日～2023年4月20日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 69円 | 0.419% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は16,403円です。 |
| （投信会社） | (11) | (0.069) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (54) | (0.329) | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの 管理及び事務手続き等の対価 |
| （受託会社） | (4) | (0.022) | 運用財産の保管・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 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （投資証券） | (0) | (0.000) | 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （投資証券） | (0) | (0.002) | 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 6 | 0.038 | (d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （保管費用） | (0) | (0.001) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外 における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。 |
| （監査費用） | (1) | (0.005) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用 |
| （その他） | (5) | (0.032) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、 印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま れます。 |
| 合計 | 75 | 0.459 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

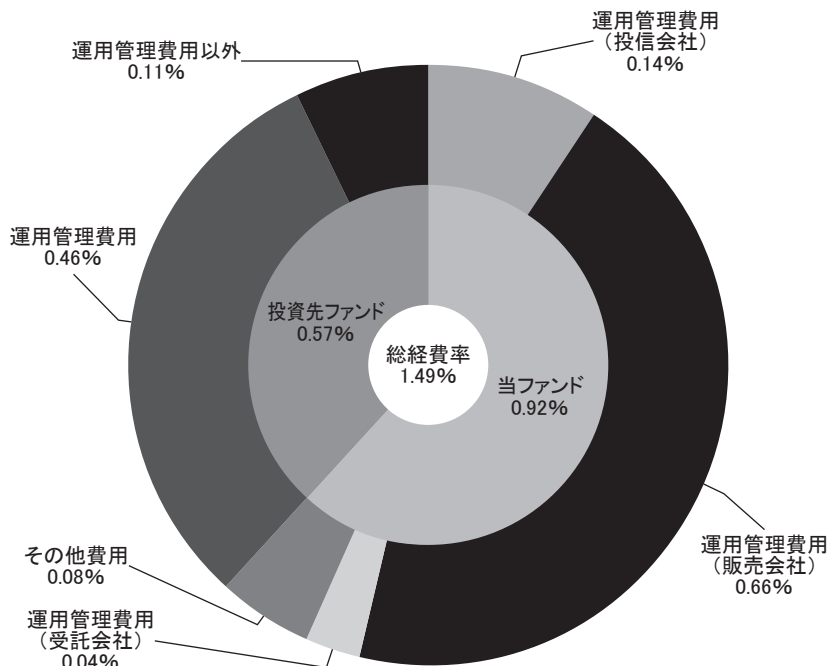
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.49%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 1.49% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.92% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.46% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.11% |

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

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

(注3)その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4)各比率は、年率換算した値です。

(注5)投資先ファンドとは、当ファンドが実質的に組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注6)①の費用は、マザーファンド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7)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■ 売買及び取引の状況 (2022年10月21日から2023年4月20日まで)

● 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
| | 単位数又は口数 | 金 額 | 単位数又は口数 | 金 額 |
| 国内 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式 ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用) | — (—) | — (—) | 4,101.459 (—) | 5,218 (—) |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ ファンド(適格機関投資家転売制限付き) | 479,529.05 (—) | 878,318 (—) | 18,003.023 (—) | 31,361 (—) |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用) | — (—) | — (—) | 20,082.264 (—) | 15,618 (—) |
| D L I B J 公社債オープン(中期コース) | — (—) | — (—) | 13,461.77 (—) | 13,014 (—) |
| 外国 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| FIDELITY FUNDS-JAPAN VALUE FUND A-ACC-JPY | — (—) | — (—) | 308.95821 (—) | 878,318 (—) |
| FID INVE FUNDS IX - FID SUSTAINABLE UK AGGREGATE BOND FD I-ACC | 千口 — (—) | 千イギリス・ポンド — (—) | 千口 22.12101 (—) | 千イギリス・ポンド 43 (—) |
| FF-EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND A | 千口 — (—) | 千ユーロ — (—) | 千口 1.01379 (—) | 千ユーロ 78 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年10月21日から2023年4月20日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|--------------|--------------|---------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 千口 19,258 | 千円 37,565 | 千口 — | 千円 — |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等（2022年10月21日から2023年4月20日まで）

〈フィデリティ・資産分散投信（成長型）〉

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|----------|------------|-------------------------|---------------|-----------|-------------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託受益証券 | 百万円 878 | 百万円 878 | % 100.0 | 百万円 65 | 百万円 65 | % 100.0 |
| 投資証券 | — | — | — | 896 | 896 | 100.0 |
| 為替 | 7 | — | — | 908 | 889 | 97.9 |

(2) 期中の利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 | | 期 |
|---------|----------|------------|--------------|
| | 買付額 | 売付額 | 期末保有額 |
| その他有価証券 | 百万円 — | 百万円 896 | 百万円 1,113 |

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 | 期 |
|-----------------|-----|---|
| 売買委託手数料総額(A) | 5千円 | |
| うち利害関係人への支払額(B) | — | |
| (B) / (A) | — | |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

〈フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド〉

● 期中の利害関係人との取引状況

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

※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あり、当ファンドに係る利害関係人とは、フィデリティ証券株式会社、FIL DISTRIBUTORS、FIL INVESTMENT SERVICES UK LIMITED、FIL LUXEMBOURG SAです。

■組入資産の明細（2023年4月20日現在）

(1) 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

| ファンド名 | 当 期 末 | | |
|--|--------------|-----------|------|
| | 単位数又は口数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千円 | % |
| フィデリティ・欧州中小型株・オープン（適格機関投資家専用） | 7,077.762 | 16,425 | 0.4 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式 ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用） | 253,914.991 | 323,056 | 8.0 |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ ファンド（適格機関投資家転売制限付き） | 676,201.69 | 1,298,915 | 32.2 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド（適格機関投資家専用） | 397,851.829 | 315,934 | 7.8 |
| D L I B J 公社債オープン（中期コース） | 393,698.818 | 382,596 | 9.5 |
| 合 計 | 1,728,745.09 | 2,336,927 | 57.9 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当 期 末 | | | |
|--|-------------|-----------|-----------|------|
| | 単位数又は口数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| ISHARES DIVERSIFIED COMMDY ETF | 185.102 | 1,280 | 172,819 | 4.3 |
| FF-SUSTAINABLE ASIA EQUITY FUND A | 4.43355 | 46 | 6,221 | 0.2 |
| FF-US DOLLAR BOND FUND (class1) A | 211.93546 | 1,517 | 204,706 | 5.1 |
| FF-EMERGING MARKET DEBT FUND A-ACC-USD | 131.35825 | 2,260 | 305,010 | 7.6 |
| | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| FID INVE FUNDS IX - FID SUSTAINABLE UK AGGREGATE BOND FD I-ACC | 379.51 | 722 | 121,170 | 3.0 |
| | 千口 | 千ユーロ | 千円 | |
| FF-EURO BOND FUND A | 110.82089 | 1,316 | 194,612 | 4.8 |
| FF-EUROPEAN DYNAMIC GROWTH FUND A | 5.31554 | 419 | 62,050 | 1.5 |
| FF-EURO HIGH YIELD A | 162.23164 | 1,395 | 206,333 | 5.1 |
| FF-ASIA PACIFIC OPPORTUNITIES A-ACC-EURO | 3.18141 | 91 | 13,548 | 0.3 |
| 合 計 | 1,193.88874 | — | 1,286,473 | 31.9 |

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

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 千口 180,275 | 千口 199,533 | 千円 408,864 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成 (2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 2,509,747 | % 61.8 |
| 投 資 証 券 | 1,113,653 | 27.4 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド | 408,864 | 10.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 26,998 | 0.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 4,059,263 | 100.0 |

(注1) 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。

なお、4月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.92円、1シンガポール・ドル=101.10円、1イギリス・ポンド=167.69円、1ユーロ=147.82円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(1,288,058千円)の投資信託財産総額(4,059,263千円)に対する比率は、31.7%です。

(注3) フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(4,663,712千円)の投資信託財産総額(4,851,332千円)に対する比率は、96.1%です。

(注4) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 4,060,504,917 |
| コール・ローン等 | 21,503,995 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 2,509,747,695 |
| 投 資 証 券(評価額) | 1,113,653,543 |
| フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド(評価額) | 408,864,057 |
| 未 収 入 金 | 6,459,587 |
| そ の 他 未 収 収 益 | 276,040 |
| (B) 負 債 | 22,492,029 |
| 未 払 金 | 1,241,778 |
| 未 払 解 約 金 | 3,215,956 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 16,585,120 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,449,175 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 4,038,012,888 |
| 元 本 | 2,396,235,505 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,641,777,383 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 2,396,235,505口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 16,851円 |

(注1) 当期における期首元本額2,425,000,450円、期中追加設定元本額7,780,656円、期中一部解約元本額36,545,601円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年10月21日 至2023年4月20日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 16,613,424 |
| 受 取 配 当 金 | 13,911,167 |
| 受 取 利 息 | 4,076 |
| そ の 他 収 益 金 | 2,698,181 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 88,806,718 |
| 売 買 益 | 189,617,641 |
| 売 買 損 | △100,810,923 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △18,053,972 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 87,366,170 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,513,837,279 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 40,573,934 |
| (配 当 等 相 当 額) | (82,553,580) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△41,979,646) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 1,641,777,383 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 1,641,777,383 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 40,573,934 |
| (配 当 等 相 当 額) | (82,554,458) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△41,980,524) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,751,121,111 |
| 繰 越 損 益 金 | △149,917,662 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 19,556,085円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 82,554,458円 |
| (d) 分配準備積立金 | 1,731,565,026円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 1,833,675,569円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 可 能 額 | 7,652.32円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 金 額(税引前) | 0円 |

フィデリティ・グローバル・リート・マザーファンド 運用報告書

《第17期》

決算日 2022年11月10日

(計算期間：2022年5月11日から2022年11月10日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">●日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(リート)(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)を主要な投資対象とし、配当等収益の確保と、投資信託財産の成長を図ることを目的に運用を行います。●リートへの投資は、原則として高位を維持します。●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。●FILインベストメンツ・インターナショナルに、運用の指図に関する権限を委託します。●資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。 |
| 主要運用対象 | 日本を含む世界各国の取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(リート)(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)を主要な投資対象とします。 |
| 組入制限 | <ul style="list-style-type: none">●リート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。●株式への直接投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 投資 受組 | 資 益 入 | 信 証 比 | 託 券 率 | 投 組 資 入 | 証 比 | 券 率 | 純 資 産 | 資 産 額 |
|-------------------|-------------|-------------|----------|-------------|-------------|-------------|------------------|--------|-----------|-------------|--------------|
| | 期 騰 | 落 中 率 | | | | | | | | | |
| 13期 (2020年11月10日) | 円 15,052 | % 8.0 | | | | % — | | | % 95.6 | | 百万円 5,326 |
| 14期 (2021年5月10日) | 18,698 | 24.2 | | | | — | | 98.5 | | 5,541 | |
| 15期 (2021年11月10日) | 21,686 | 16.0 | | | | — | | 98.6 | | 5,487 | |
| 16期 (2022年5月10日) | 22,360 | 3.1 | | | | — | | 96.8 | | 5,058 | |
| 17期 (2022年11月10日) | 20,652 | △7.6 | | | | — | | 95.6 | | 4,753 | |

(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ないためベンチマークは設定しておりません。

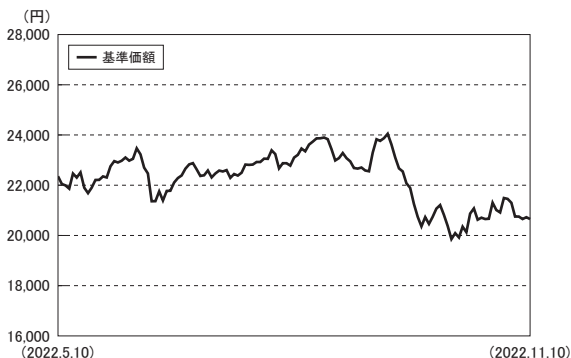
■当期中の基準価額等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 投資 受組 | 資 益 入 | 信 証 比 | 託 券 率 | 投 組 資 入 | 証 比 | 券 率 |
|---------------------|-------------|--------|----------|-------------|-------------|-------------|------------------|--------|-----------|
| | 騰 | 落 率 | | | | | | | |
| (期首) 2022年5月10日 | 円 22,360 | % — | | | | % — | | | % 96.8 |
| 5月末 | 22,959 | 2.7 | | | | — | | 96.4 | |
| 6月末 | 22,637 | 1.2 | | | | — | | 95.2 | |
| 7月末 | 23,389 | 4.6 | | | | — | | 95.3 | |
| 8月末 | 22,684 | 1.4 | | | | — | | 95.9 | |
| 9月末 | 20,460 | △8.5 | | | | — | | 94.0 | |
| 10月末 | 21,490 | △3.9 | | | | — | | 96.2 | |
| (期末) 2022年11月10日 | 20,652 | △7.6 | | | | — | | 95.6 | |

(注) 騰落率は期首比です。

■運用経過の説明

●基準価額の推移



●運用経過

当期のファンドの騰落率は、-7.6%でした。

当ファンドは、従来どおり、ボトム・アップ・アプローチによる個別リートのファンダメンタルズ分析やバリュエーション分析を行い、国別、業種別の分散も考慮した運用を行いました。

●投資環境

当期の世界リート相場は米ドルベースで下落しました。

期初は、新型コロナウイルス感染拡大に伴うロックダウンが続く中国経済の減速が懸念されたことや、ロシアによるウクライナ侵攻を巡る先行き不透明感から下落しました。その後6月は、米連邦準備制度理事会(FRB)が1994年以来となる0.75%幅の利上げを実施したことが更なる相場の重石となりました。7月に入ると、世界経済の減速懸念や金融引き締めが継続する状況であったものの、良好なバランスシートなどを背景にリートは上昇しました。8月から9月にかけては、FRBの3回連続となる0.75%幅の利上げ実施などを受けて、リートは再び下落に転じました。その後10月に入ると、FRBがハト派に転じるのではないかと観測が浮上したことを受けて、一旦、リートは上昇したものの、11月から期末にかけては、FRBのタカ派的な姿勢が継続されたことやウクライナ侵攻に伴うエネルギーや食品価格の上昇を背景に、リートは下落して期を終えました。

円ベースでは、米ドル、ユーロ、英ポンド、豪ドルに対して円安となったことがプラスに働きました。

■今後の運用方針

トップ・ダウン・アプローチによる国別・業種別配分を考慮したうえで、ボトム・アップ・アプローチによる個別リートのファンダメンタルズ分析を重視した運用を行います。

今後につきましても、調査分析ネットワークを活用し、個別リートの財務内容の精査に基づいた運用を行い、ファンドの付加価値を高める努力をしまる所存です。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

（2022年5月11日～2022年11月10日）

| 項目 | 金額 |
|-----------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料 （投資証券） | 0円 (0) |
| (b) 有価証券取引税 （投資証券） | 1 (1) |
| (c) その他費用 （保管費用） | 2 (2) |
| 合計 | 4 (4) |

（注）費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1万口（元本10,000円）当たりの費用明細」をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況（2022年5月11日から2022年11月10日まで）

投資信託受益証券、投資証券

| | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|--------------------------------|--------------|-------------|---------|------------|---------|------------|---------|------------|
| | 単位数又は口数 | 金額 | 単位数又は口数 | 金額 | 単位数又は口数 | 金額 | 単位数又は口数 | 金額 |
| 国内 | | | | | | | | |
| GLP投資法人 | 千口 0.018 | 千円 2,898 | | | 千口 — | | 千円 — | |
| 外国 | | | | | | | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル |
| PUBLIC STORAGE INC | 0.116 | 33 | — | — | — | — | — | — |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES TR | 0.309 | 7 | — | — | — | — | — | — |
| HEALTHPEAK PPTYS INC | 1.137 | 25 | — | — | — | — | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST - REIT | 0.232 | 27 | — | — | — | — | — | — |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 0.328 | 32 | — | — | — | — | — | — |
| AMERICAN TOWER CORP | 0.062 | 13 | 0.596 | 155 | — | — | — | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT CL A | 0.975 | 32 | — | — | — | — | — | — |
| WELLTOWER INC | 0.304 | 19 | 1.165 | 91 | — | — | — | — |
| DIGITAL CORE REIT | 489.9 | 386 | — | — | — | — | — | — |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 0.993 | 20 | — | — | — | — | — | — |
| PROLOGIS INC | 0.375 | 38 | — | — | — | — | — | — |
| INVITATION HOMES INC | 1.039 | 35 | — | — | — | — | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 0.103 | 18 | — | — | — | — | — | — |
| EQUITY RESIDENTIAL | 0.447 | 29 | — | — | — | — | — | — |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 0.482 | 30 | — | — | — | — | — | — |
| SIMON PPTY GROUP INC - REIT | 1.789 | 192 | — | — | — | — | — | — |
| (シンガポール) | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル |
| Capitaland Ascendas REIT | 7.8 (—) | 20 (△8) | — | — | — | — | — | — |
| (イギリス) | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 2.697 | 9 | — | — | — | — | — | — |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 3.273 | 14 | — | — | — | — | — | — |
| SEGRO PLC | 26.78 | 212 | — | — | — | — | — | — |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 2.28 | 11 | — | — | — | — | — | — |
| (ユーロ(オランダ)) | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| NSI NV | 0.531 | 12 | — | — | — | — | — | — |
| (ユーロ(フランス)) | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| ICADE | 0.131 (—) | 5 (△7) | — | — | — | — | — | — |

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）買付（ ）内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

（注3）金額の単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年5月11日から2022年11月10日まで)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

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

■ 組入資産の明細 (2022年11月10日現在)

(1) 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 | 期首(前期末) | 当 期 | | 末 |
|------------|-------------|---------|---------|---------|-----|
| | | 単位数又は口数 | 単位数又は口数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| G L P 投資法人 | | 1.157 | 1.175 | 178,365 | 3.8 |
| 合 計 | 口 数 、 金 額 | 1.157 | 1.175 | 178,365 | — |
| | 銘 柄 数 、 比 率 | 1 | 1 | — | 3.8 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 | | | 末 |
|--------------------------------|-------------|---------------|---------------|---------------------|---------------|------|
| | | 単位数又は口数 | 単位数又は口数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| (シンガポール) | | | | | | |
| DIGITAL CORE REIT | | — | 489.9 | 292 | 42,820 | 0.9 |
| (アメリカ) | | | | | | |
| PUBLIC STORAGE INC | | 7.657 | 7.773 | 2,213 | 324,012 | 6.8 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES TR | | 20.454 | 20.763 | 543 | 79,615 | 1.7 |
| HEALTHPEAK PPTYS INC | | 75.186 | 76.323 | 1,824 | 267,069 | 5.6 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST - REIT | | 15.313 | 15.545 | 1,700 | 248,919 | 5.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 21.677 | 22.005 | 2,136 | 312,799 | 6.6 |
| AMERICAN TOWER CORP | | 4.675 | 4.141 | 832 | 121,887 | 2.6 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT CL A | | 64.493 | 65.468 | 1,953 | 286,021 | 6.0 |
| WELLTOWER INC | | 21.246 | 20.385 | 1,355 | 198,473 | 4.2 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | — | 66.645 | 1,280 | 187,539 | 3.9 |
| PROLOGIS INC | | 24.772 | 25.147 | 2,735 | 400,540 | 8.4 |
| INVITATION HOMES INC | | 68.713 | 69.752 | 2,079 | 304,431 | 6.4 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 6.793 | 6.896 | 1,096 | 160,513 | 3.4 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 29.523 | 29.97 | 1,788 | 261,870 | 5.5 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | 65.652 | — | — | — | — |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 31.876 | 32.358 | 1,999 | 292,732 | 6.2 |
| SIMON PPTY GROUP INC - REIT | | 1.746 | 3.535 | 399 | 58,442 | 1.2 |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 459.776 | 956.606 | 24,231 | 3,547,689 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 15 | 16 | — | — | 74.6 |
| (シンガポール) | | | | | | |
| Capitaland Ascendas REIT | | 千口 512.493 | 千口 520.293 | 千シンガポール・ドル 1,347 | 千円 140,765 | 3.0 |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 512.493 | 520.293 | 1,347 | 140,765 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1 | 1 | — | — | 3.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-----------|------|
| | 単位数又は口数 | 単位数又は口数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 178.32 | 181.017 | 691 | 115,111 | 2.4 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 216.393 | 219.666 | 1,156 | 192,529 | 4.1 | |
| SEGRO PLC | — | 26.78 | 211 | 35,263 | 0.7 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 150.772 | 153.052 | 915 | 152,361 | 3.2 | |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 545.485 | 580.515 | 2,975 | 495,266 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 3 | 4 | — | — | 10.4 |
| (ユーロ (オランダ)) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | |
| NSI NV | 35.134 | 35.665 | 898 | 131,811 | 2.8 | |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 35.134 | 35.665 | 898 | 131,811 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1 | 1 | — | — | 2.8 |
| (ユーロ (フランス)) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ICADE | 8.629 | 8.76 | 337 | 49,436 | 1.0 | |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 8.629 | 8.76 | 337 | 49,436 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 1 | 1 | — | — | 1.0 |
| ユーロ計 | 口 数 、 金 額 | 43.763 | 44.425 | 1,235 | 181,248 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 2 | 2 | — | — | 3.8 |
| 合 計 | 口 数 、 金 額 | 1,561.517 | 2,101.839 | — | 4,364,970 | — |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 21 | 23 | — | — | 91.8 |

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

(注2) 比率欄は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の割合。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 4,543,335 | % 95.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 210,401 | 4.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 4,753,736 | 100.0 |

(注1) 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。

なお、11月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.41円、1シンガポール・ドル=104.46円、1イギリス・ポンド=166.47円、1ユーロ=146.66円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(4,571,368千円)の投資信託財産総額(4,753,736千円)に対する比率は、96.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年11月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 4,754,132,794 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 196,045,808 |
| 投 資 証 券(評価額) | 4,543,335,058 |
| 未 収 入 金 | 399,547 |
| 未 収 配 当 金 | 14,352,381 |
| (B) 負 債 | 397,099 |
| 未 払 金 | 396,558 |
| 未 払 解 約 金 | 11 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 530 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 4,753,735,695 |
| 元 本 | 2,301,783,454 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,451,952,241 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 2,301,783,454口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 20,652円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 2,262,468,092円 |
| 期中追加設定元本額 | 54,200,494円 |
| 期中一部解約元本額 | 14,885,132円 |

(注2) 当ファンドの当期末元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|------------------------------|----------------|
| フィデリティ・ワールド好配当株・ファンド | —円 |
| フィデリティ・世界インカム株式・ファンド(毎月決算型) | 54,355,440円 |
| フィデリティ・世界インカム株式・ファンド(資産成長型) | 17,639,374円 |
| フィデリティ・世界3資産・ファンド(毎月決算型) | 1,200,121,135円 |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(債券重視型) | 453,351,774円 |
| フィデリティ・世界分散・ファンド(株式重視型) | 310,724,885円 |
| フィデリティ・資産分散投信(安定型) | 25,005,114円 |
| フィデリティ・資産分散投信(成長型) | 180,275,278円 |
| フィデリティ・世界リート・ファンド(ファンドラップ専用) | 60,310,454円 |

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年5月11日 至2022年11月10日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 93,265,160 |
| 受 取 配 当 金 | 92,167,633 |
| 受 取 利 息 | 1,097,527 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △480,760,873 |
| 売 買 益 | 557,707,902 |
| 売 買 損 | △1,038,468,775 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △515,839 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △388,011,552 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 2,796,522,117 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △18,177,831 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 61,619,507 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 2,451,952,241 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 2,451,952,241 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示していません。

(注3) (F)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。

(注4) (G)追加信託差損益金とあるのは、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。

ご参考として以下に、フィデリティ・資産分散投信(安定型)、フィデリティ・資産分散投信(成長型)が組入れている各投資信託証券の直前の作成期における運用内容を掲載いたします。

<補足情報>

フィデリティ・欧州中小型株・オープン (適格機関投資家専用)の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|--|
| 設 定 形 態 | 国内証券投資信託 |
| 運 用 方 針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として英国および欧州大陸の取引所に上場されている株式に投資を行い、投資信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 |
| 主 な 投 資 対 象 | フィデリティ・欧州中小型株・オープン・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> ●株式への実質投資割合には制限を設けません。 ●新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ●同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ●同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ●同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ●投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 |
| 決 算 日 | 5月30日および11月30日 |
| 分 配 方 針 | <ul style="list-style-type: none"> ●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

■損益の状況

当期 自2022年5月31日 至2022年11月30日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|--------------|
| (A) 有価証券売買損益 | △488,660 |
| 売 | △488,660 |
| 買 | △488,660 |
| (B) 信託報酬等 | △80,572 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △569,232 |
| (D) 前期繰越損益金 | 7,898,084 |
| (E) 追加信託差損益金 | 2,403,587 |
| (配当等相当額) | (4,628,985) |
| (売買損益相当額) | (△2,225,398) |
| (F) 合計(C+D+E) | 9,732,439 |
| 次期繰越損益金(F) | 9,732,439 |
| 追加信託差損益金 | 2,403,587 |
| (配当等相当額) | (4,628,985) |
| (売買損益相当額) | (△2,225,398) |
| 分配準備積立金 | 9,373,010 |
| 繰越損益金 | △2,044,158 |

- (注1) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (E)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4) 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する費用として、純資産総額に対して年0.32%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|-------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 4,628,985円 |
| (d) 分配準備積立金 | 9,373,010円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 14,001,995円 |
| 1万円当たり分配可能額 | 16,837.17円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1万円当たり分配金額(税引前) | 0円 |

■組入資産の明細 (2022年11月30日現在)

●親投資信託残高

| 項 目 | 期 首 (前 期 末) | | 当 期 末 | |
|----------------------------|---------------|-------------|-------------|--------------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・欧州中小型株・オープン・マザーファンド | 千口 1,011 | 千口 1,007 | 千口 1,007 | 千円 18,047 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

<フィデリティ・欧州中小型株・オープン・マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・欧州中小型株・オープン(適格機関投資家専用)の主たる投資対象であるフィデリティ・欧州中小型株・オープン・マザーファンドの情報を掲載いたします。

■組入資産の明細 (2022年11月30日現在)

(1) 外国株式

上場、登録株式

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所) AUTOLIV INC | | 百株 203.15 | 百株 123.95 | 千アメリカ・ドル 1,068 | 千円 148,341 | 自動車・自動車部品 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 203.15 | 123.95 | 1,068 | 148,341 | |
| | 銘柄数 <比率> | 1銘柄 | 1銘柄 | — | <1.2%> | |
| (カナダ・・・トロント) ENDEAVOUR MINING PLC | | 百株 440.15 | 百株 393.1 | 千カナダ・ドル 1,098 | 千円 112,244 | 素材 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 440.15 | 393.1 | 1,098 | 112,244 | |
| | 銘柄数 <比率> | 1銘柄 | 1銘柄 | — | <0.9%> | |
| (イギリス・・・ロンドン) BALFOUR BEATTY PLC | | 百株 5,576.52 | 百株 3,974.83 | 千イギリス・ポンド 1,300 | 千円 216,192 | 資本財 |
| DCC PLC | | 147.91 | 155.09 | 694 | 115,368 | 資本財 |
| RS GROUP PLC | | — | 636.55 | 586 | 97,507 | 資本財 |
| INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC | | 507.08 | 669.89 | 803 | 133,571 | 各種金融 |
| KENMARE RESOURCES PLC (UK) | | 1,908.61 | 1,691.63 | 740 | 123,024 | 素材 |
| APTITUDE SOFTWARE GROUP PLC | | 1,555.37 | 1,444.34 | 526 | 87,513 | ソフトウェア・サービス |
| MORGAN ADVANCED MATERIALS PLC | | 2,800.17 | 2,361.21 | 720 | 119,713 | 資本財 |
| OXFORD INSTRUMENTS GROUP PLC | | 220.44 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| CENTRICA PLC | | 10,229.68 | 6,324.78 | 599 | 99,669 | 公益事業 |
| HEADLAM GROUP PLC | | 1,765.88 | 1,677.79 | 513 | 85,343 | 小売 |
| SYNTHOMER PLC | | 2,022.12 | 5,176.49 | 729 | 121,242 | 素材 |
| VISTRY GROUP PLC | | 1,449.13 | 1,345.68 | 844 | 140,366 | 耐久消費財・アパレル |
| 4IMPRINT GROUP PLC | | 307.13 | 193.08 | 791 | 131,592 | メディア・娯楽 |
| JOHN WOOD GROUP PLC | | 5,276.47 | 5,617.65 | 752 | 125,132 | エネルギー |
| CRANSWICK PLC | | 313.08 | 290.73 | 903 | 150,203 | 食品・飲料・タバコ |
| JD SPORTS FASHION PLC | | — | 6,302.69 | 784 | 130,333 | 小売 |
| RWS HOLDINGS PLC | | 2,572.31 | 2,686.22 | 888 | 147,622 | 商業・専門サービス |
| PREMIER FOODS PLC | | 12,416.44 | 9,923.82 | 1,057 | 175,851 | 食品・飲料・タバコ |
| FUTURE PLC | | 566.93 | 651.3 | 965 | 160,557 | メディア・娯楽 |
| IG GROUP HOLDINGS PLC | | 1,144.94 | 1,063.21 | 869 | 144,571 | 各種金融 |
| ESSENTRA PLC | | 2,803.18 | 2,507.5 | 611 | 101,704 | 素材 |
| BRITVIC PLC | | 1,911.3 | 1,431.09 | 1,165 | 193,761 | 食品・飲料・タバコ |
| ANGLE PLC | | 3,820.87 | 5,023.69 | 276 | 45,929 | ヘルスケア機器・サービス |
| CRANWARE PLC | | 574.19 | 516.1 | 1,078 | 179,303 | ヘルスケア機器・サービス |
| ACCESSO TECHNOLOGY GROUP PLC | | 781.41 | 742.43 | 593 | 98,731 | ソフトウェア・サービス |
| COATS GROUP PLC | | 17,146.18 | 16,204.46 | 1,085 | 180,475 | 耐久消費財・アパレル |
| BOOHOO GROUP PLC | | 6,956.98 | — | — | — | 小売 |
| ACCSYS TECHNOLOGIES PLC | | 4,484.58 | 2,899.34 | 182 | 30,363 | 素材 |

| 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 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | |
| CAIRN HOMES PLC | 6,920.74 | 5,369.07 | 417 | 69,347 | 耐久消費財・アパレル | |
| WIZZ AIR HOLDINGS PLC | 234.32 | 325.02 | 698 | 116,160 | 運輸 | |
| THE GYM GROUP PLC | 3,392.95 | 2,085.47 | 208 | 34,736 | 消費者サービス | |
| SMART METERING SYSTEMS PLC | 961.42 | 892.79 | 714 | 118,726 | 商業・専門サービス | |
| CONVATEC PLC | 4,416.37 | 3,138.15 | 718 | 119,354 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ALPHA FINANCIAL MARKETS CONSUL | 2,350.43 | 1,842.42 | 893 | 148,538 | 商業・専門サービス | |
| RHI MAGNESITA NV | 261.7 | 245.02 | 536 | 89,116 | 素材 | |
| JTC PLC | 1,190.78 | 1,105.77 | 864 | 143,741 | 各種金融 | |
| FINTEL PLC | 4,420.84 | 3,560.56 | 628 | 104,465 | 商業・専門サービス | |
| TEAM17 GROUP LTD | 1,630.46 | 1,430.4 | 657 | 109,376 | メディア・娯楽 | |
| GLOBALDATA PLC | 474.21 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| CREO MEDICAL GROUP PLC | 3,030.38 | 2,760.32 | 106 | 17,757 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AJ BELL PLC | 1,937.36 | — | — | — | 各種金融 | |
| TRITAX EUROBOX PLC | 10,598.24 | 8,853.42 | 564 | 93,894 | 不動産 | |
| MOLTEN VENTURES PLC | 883.15 | 1,407.05 | 531 | 88,365 | 各種金融 | |
| WATCHES OF SWITZERLAND GRP LTD | 658.71 | 603.78 | 601 | 99,914 | 小売 | |
| REABOLD RESOURCES PLC | 622,656.42 | 622,656.42 | 158 | 26,393 | エネルギー | |
| ALPHA FX GROUP PLC | 385.81 | 358.27 | 770 | 128,043 | 各種金融 | |
| INSPIRED PLC | 61,216.73 | 52,061.04 | 385 | 64,040 | 商業・専門サービス | |
| LONGBOAT ENERGY PLC | 5,888.9 | 5,595.83 | 127 | 21,115 | エネルギー | |
| THE PEBBLE GROUP | 6,773.17 | 6,030 | 518 | 86,203 | メディア・娯楽 | |
| SCS GROUP PLC | 2,422.12 | 2,301.3 | 345 | 57,381 | 小売 | |
| ADRIATIC METALS PLC | 3,983.11 | 2,744.2 | 454 | 75,495 | 素材 | |
| HEIQ PLC | 3,331.53 | 3,165.34 | 238 | 39,726 | 素材 | |
| BYTES TECHNOLOGY GROUP PLC | 1,506.16 | 1,398.64 | 572 | 95,137 | ソフトウェア・サービス | |
| DR. MARTENS LTD | 2,094.62 | 1,921.32 | 366 | 61,001 | 耐久消費財・アパレル | |
| TRUSTPILOT AS | 2,662.4 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| KISTOS PLC | — | 320.67 | 144 | 23,987 | エネルギー | |
| JADESTONE ENERGY PLC | 9,800.5 | 8,350.82 | 587 | 97,726 | エネルギー | |
| POD POINT GROUP HOLDINGS PLC | — | 1,613.45 | 110 | 18,398 | 資本財 | |
| LBG MEDIA PLC | 2,366.32 | 2,268.63 | 128 | 21,306 | メディア・娯楽 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 857,708.75 | 825,916.76 | 33,117 | 5,505,103 | |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 55銘柄 | 54銘柄 | — | <44.6%> | |
| (スイス・・・SIX Swiss Exchange) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | | |
| AMS-OSRAM AG | 1,211.67 | 1,109 | 840 | 122,388 | 半導体・半導体製造装置 | |
| FORBO HOLDING AS (REG) | — | 5.85 | 654 | 95,272 | 資本財 | |
| DKSH HOLDING AG | 36.69 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| ALUFLEXPACK AG | 405.17 | 428.81 | 801 | 116,809 | 素材 | |
| SIG GROUP AG | 761.84 | 442.67 | 887 | 129,354 | 素材 | |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| (スイス・・・SWX Europe) VZ HOLDING AG | | 百株 275.08 | 百株 245.93 | 千スイス・フラン 1,810 | 千円 263,669 | 各種金融 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 2,690.45 | 2,232.26 | 4,994 | 727,494 | |
| | 銘柄数 <比率> | 5銘柄 | 5銘柄 | — | <5.9%> | |
| (トルコ・・・イスタンブール) KOYTAS TEKSTIL SANAYI VE TIC | | 百株 176.95 | 百株 176.95 | 千トルコ・リラ 0 | 千円 0 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 176.95 | 176.95 | 0 | 0 | |
| | 銘柄数 <比率> | 1銘柄 | 1銘柄 | — | <0.0%> | |
| (ノルウェー・・・オスロ) ATEA ASA TGS ASA SPAREBANKEN VEST AS | | 百株 500.56 590.98 1,032.04 | 百株 655.56 432.98 497.64 | 千ノルウェー・クローネ 7,735 5,814 4,369 | 千円 107,524 80,827 60,732 | ソフトウェア・サービス エネルギー 銀行 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 2,123.58 | 1,586.18 | 17,919 | 249,085 | |
| | 銘柄数 <比率> | 3銘柄 | 3銘柄 | — | <2.0%> | |
| (スウェーデン・・・ストックホルム) TELE2 AB B SHS AAK AB HEXPOL AB B BOOZT AB KARNOV GROUP AB DESENIO HOLDING AB | | 百株 794.03 544.17 1,199.59 585.7 1,466.79 227.64 | 百株 737.35 568.59 1,036.63 302.86 1,362.08 — | 千スウェーデン・クローナ 6,876 9,919 11,817 3,452 7,831 — | 千円 90,357 130,336 155,283 45,367 102,911 — | 電気通信サービス 食品・飲料・タバコ 素材 小売 メディア・娯楽 小売 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 4,817.92 | 4,007.51 | 39,897 | 524,256 | |
| | 銘柄数 <比率> | 6銘柄 | 5銘柄 | — | <4.2%> | |
| ユーロ (アイルランド・・・EURONEXT ダブリン) UNIPHAR PLC | | 百株 2,862.12 | 百株 3,227.44 | 千ユーロ 1,123 | 千円 161,261 | ヘルスケア機器・サービス |
| ユーロ (アイルランド・・・アイルランド) IRISH CONTL GRP PLC UNITS (IR) DALATA HOTEL GROUP LTD GLENVEAGH PROPERTIES PLC 144U | | 3,661.77 3,223.77 7,807.98 | 3,278.57 2,890.89 7,250.59 | 1,429 994 669 | 205,241 142,785 96,192 | 運輸 消費者サービス 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 17,555.64 | 16,647.49 | 4,217 | 605,480 | |
| | 銘柄数 <比率> | 4銘柄 | 4銘柄 | — | <4.9%> | |
| ユーロ (オランダ・・・アムステルダム) KENDRION NV AALBERTS NV ASR NEDERLAND NV VAN LANSCHOT KEMPEN NV JUST EAT TAKEAWAY.COM NV BE SEMICOND INDUS NV (NETH) | | 百株 441.38 279.04 244.53 312.18 210.51 155.26 | 百株 351.61 242.43 220.44 — — 108.28 | 千ユーロ 566 918 952 — — 656 | 千円 81,279 131,887 136,731 — — 94,276 | 自動車・自動車部品 資本財 保険 各種金融 小売 半導体・半導体製造装置 |
| ユーロ (オランダ・・・EURONEXT アムステルダム) CTP BV | | 646.16 | 524.6 | 551 | 79,238 | 不動産 |

| 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 | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ (オランダ・・・EURONEXT パリ) EURONEXT NV | 百株 175.26 | 百株 171.35 | 千ユーロ 1,229 | 千円 176,596 | 各種金融 | |
| ユーロ (オランダ・・・XETRA) SHOP APOTHEKE EUROPE NV | 63.1 | 59.95 | 251 | 36,152 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 2,527.42 | 1,678.66 | 5,127 | 736,161 | |
| | 銘柄数 <比率> | 9銘柄 | 7銘柄 | — | <6.0%> | |
| ユーロ (ベルギー・・・ブリュッセル) D' IETEREN GROUP | 百株 63.25 | 百株 46.56 | 千ユーロ 828 | 千円 118,994 | 小売 | |
| ユーロ (ベルギー・・・EURONEXT ブリュッセル) KBC ANCORA | 342.89 | 306.05 | 1,202 | 172,694 | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 406.14 | 352.61 | 2,031 | 291,689 | |
| | 銘柄数 <比率> | 2銘柄 | 2銘柄 | — | <2.4%> | |
| ユーロ (ルクセンブルグ・・・アムステルダム) MAJOREL GROUP LUXEMBOURG SA | 百株 325.72 | 百株 302.47 | 千ユーロ 597 | 千円 85,814 | ソフトウェア・サービス | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 325.72 | 302.47 | 597 | 85,814 | |
| | 銘柄数 <比率> | 1銘柄 | 1銘柄 | — | <0.7%> | |
| ユーロ (フランス・・・EURONEXT パリ) LISI | 百株 419.16 | 百株 — | 千ユーロ — | 千円 — | 資本財 | |
| SCOR SE | 408.15 | 379.01 | 697 | 100,102 | 保険 | |
| REXEL SA | 784.25 | 700.2 | 1,300 | 186,793 | 資本財 | |
| ANTIN INFRASTRUCTURE PARTNERS | 465.92 | 369.03 | 797 | 114,448 | 各種金融 | |
| ALTEN | 71.82 | 64.45 | 775 | 111,322 | ソフトウェア・サービス | |
| SOPRA STERIA GROUP | 57.26 | 50.9 | 735 | 105,603 | ソフトウェア・サービス | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 2,206.56 | 1,563.59 | 4,306 | 618,270 | |
| | 銘柄数 <比率> | 6銘柄 | 5銘柄 | — | <5.0%> | |
| ユーロ (ドイツ・・・XETRA) FUCHS PETROLU SE (GERW) PFD | 百株 — | 百株 257.03 | 千ユーロ 863 | 千円 123,924 | 素材 | |
| AIXTRON SE | 293.37 | 232.41 | 695 | 99,807 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SOFTWARE AG BEARER | 316.42 | 281.9 | 674 | 96,816 | ソフトウェア・サービス | |
| NABALTEC AG | 241.48 | 219.96 | 536 | 77,059 | 素材 | |
| FLATEX AG | 484.09 | — | — | — | 各種金融 | |
| SYNLAB AG | — | 554.76 | 757 | 108,805 | ヘルスケア機器・サービス | |
| VITESCO TECHNOLOGIES GROUP AG | 301.43 | 242.27 | 1,223 | 175,664 | 自動車・自動車部品 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 1,636.79 | 1,788.33 | 4,750 | 682,079 | |
| | 銘柄数 <比率> | 5銘柄 | 6銘柄 | — | <5.5%> | |
| ユーロ (スペイン・・・マドリード) LINEA DIRECTA ASEGURADORA SA C | 百株 8,182.1 | 百株 4,946.9 | 千ユーロ 506 | 千円 72,661 | 保険 | |
| ユーロ (スペイン・・・SIBE) VIDRALA SA | 129.11 | 115.58 | 916 | 131,598 | 素材 | |
| GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA | 266.48 | 220.42 | 664 | 95,418 | 保険 | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|--|------------------------------------|-----------------------------|-------------------------|------------------------------|--------------------------------|-------|
| | | 株数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| APPLUS SERVICES SA BANKINTER SA | 百株 1,535.83 — | 百株 1,392.36 806.17 | 千ユーロ 873 513 | 千円 125,446 73,709 | 商業・専門サービス 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 10,113.52 | 株 数 7,481.43 | 評 価 額 3,474 | 評 価 額 498,834 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 4銘柄 | 銘 柄 数 5銘柄 | — | <4.0%> | | |
| ユーロ (イタリア・・・ミラノ) BANCA GENERALI SPA INWIT SPA TECHNOGYM SPA | 百株 225.57 793.78 1,089.12 | 百株 313.37 715.75 — | 千ユーロ 997 671 — | 千円 143,169 96,457 — | 各種金融 電気通信サービス 耐久消費財・アパレル | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 2,108.47 | 株 数 1,029.12 | 評 価 額 1,668 | 評 価 額 239,627 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 3銘柄 | 銘 柄 数 2銘柄 | — | <1.9%> | | |
| ユーロ (フィンランド・・・ヘルシンキ) HUHTAMAKI OYJ UPONOR OYJ | 百株 347.59 — | 百株 272.68 539.63 | 千ユーロ 983 797 | 千円 141,140 114,515 | 素材 資本財 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 347.59 | 株 数 812.31 | 評 価 額 1,780 | 評 価 額 255,656 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 1銘柄 | 銘 柄 数 2銘柄 | — | <2.1%> | | |
| ユーロ (オーストリア・・・ウィーン) WIENERBERGER AG VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN | 百株 463.52 485.04 | 百株 415.47 285.49 | 千ユーロ 1,057 643 | 千円 151,877 92,433 | 素材 保険 | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 948.56 | 株 数 700.96 | 評 価 額 1,701 | 評 価 額 244,310 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 2銘柄 | 銘 柄 数 2銘柄 | — | <2.0%> | | |
| ユーロ (ギリシャ・・・アテネ) HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION S.A.(OTE S.A) | 百株 447.45 | 百株 415.51 | 千ユーロ 614 | 千円 88,175 | 電気通信サービス | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 447.45 | 株 数 415.51 | 評 価 額 614 | 評 価 額 88,175 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 1銘柄 | 銘 柄 数 1銘柄 | — | <0.7%> | | |
| ユーロ計 | 株 数 、 金 額 38,623.86 | 株 数 32,772.48 | 評 価 額 30,269 | 評 価 額 4,346,100 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 38銘柄 | 銘 柄 数 37銘柄 | — | <35.2%> | | |
| 合 計 | 株 数 、 金 額 906,784.81 | 株 数 867,209.19 | 評 価 額 — | 評 価 額 11,612,625 | | |
| | 銘 柄 数 <比 率> 110銘柄 | 銘 柄 数 107銘柄 | — | <94.1%> | | |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|--------------------------------|--------------------|---------|-----------|---------|
| | | 単位数又は口数 | 単位数又は口数 | 評 価 額 |
| | | | | 外貨建金額 |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 |
| OAKLEY CAPITAL INVESTMENTS LTD | 432.024 | 376.636 | 1,598 | 265,771 |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 659.562 | 521.971 | 728 | 121,040 |
| 小 計 | 口数、金額 1,091.586 | 898.607 | 2,326 | 386,812 |
| | 銘柄数〈比率〉 2 | 2 | — | 〈3.1%〉 |
| ユーロ (ルクセンブルグ) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 |
| DB X-TRACKRS DJ EUR STX 50 ETF | 25.756 | 21.297 | 1,336 | 191,878 |
| 小 計 | 口数、金額 25.756 | 21.297 | 1,336 | 191,878 |
| | 銘柄数〈比率〉 1 | 1 | — | 〈1.6%〉 |
| 合 計 | 口数、金額 1,117.342 | 919.904 | — | 578,690 |
| | 銘柄数〈比率〉 3 | 3 | — | 〈4.7%〉 |

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

(注2) 〈 〉内は、純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ダイナミック・グロース・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|---|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て |
| 投 資 目 的 | 主として、欧州に本社があるか、事業活動の中心がそれらの地域にある企業の株式に投資し、アクティブなポートフォリオ運用を通じて長期的な元本の成長を目指します。 |
| 決 算 日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | ユーロ |
|--------------------------|------------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 57,879,165 |
| スワップ取引に係る受取利息 | — |
| デリバティブ収益 | — |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 57,879,165 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 51,523,577 |
| 管理費 | 8,443,959 |
| 国税 | 1,556,590 |
| 保管費用 | 387,394 |
| 販売手数料 | 1,483,753 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 637,908 |
| 費用合計 | 64,033,181 |
| スワップ取引に係る支払利息 | — |
| デリバティブ費用 | 24,851 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 64,058,032 |
| 純投資収益(損失) | (6,178,867) |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | 403,380,962 |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | (448,661) |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | 27,111,056 |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | (955,446) |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | — |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (498,454,096) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 33,884 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 16,012,501 |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 26,360 |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 運用実績 | (59,472,307) |
| 受益者への分配金 | (303,001) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 563,805,631 |
| 当期解約額 | (2,177,079,637) |
| 調整勘定 | 1,193,607 |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | (1,612,080,399) |
| 純増加(減少) | (1,671,855,707) |
| 純資産額 | |
| 期首 | 5,188,012,760 |
| 期末 | 3,516,157,053 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または額面価値 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|------------|--------------------|--------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | |
| 素材 | | | | | |
| Air Liquide | FR | EUR | 550,243 | 90,977,201 | 2.59 |
| Koninklijke DSM (NV) | NL | EUR | 280,373 | 45,027,931 | 1.28 |
| Sika | CH | CHF | 130,792 | 38,428,630 | 1.09 |
| | | | | 174,433,762 | 4.96 |
| 資本財・サービス | | | | | |
| RELX | GB | GBP | 4,941,272 | 141,012,687 | 4.01 |
| Experian | IE | GBP | 2,910,130 | 96,895,699 | 2.76 |
| Rentokil Initial | GB | GBP | 14,606,072 | 95,801,624 | 2.72 |
| Bunzl | GB | GBP | 1,939,492 | 71,770,604 | 2.04 |
| Elis | FR | EUR | 4,884,619 | 67,163,506 | 1.91 |
| Assa Abloy (B) | SE | SEK | 2,659,594 | 64,592,162 | 1.84 |
| HomeServe | GB | GBP | 5,185,124 | 60,784,017 | 1.73 |
| Brematig | DE | EUR | 737,595 | 54,537,762 | 1.55 |
| Teleperformance | FR | EUR | 158,748 | 54,402,881 | 1.55 |
| IMCD | NL | EUR | 330,157 | 50,414,997 | 1.43 |
| Sandvik | SE | SEK | 2,693,583 | 49,063,237 | 1.40 |
| Fanguson | GB | GBP | 374,989 | 45,345,374 | 1.29 |
| IE | IE | GBP | 540,519 | 39,178,546 | 1.11 |
| Airbus | FR | EUR | 331,521 | 34,967,595 | 0.99 |
| Wizz Air Holdings | CH | GBP | 852,046 | 32,261,407 | 0.92 |
| | | | | 958,192,098 | 27.25 |
| 情報技術 | | | | | |
| Infinion Technologies | DE | EUR | 4,708,060 | 129,234,256 | 3.68 |
| SAP | DE | EUR | 1,273,420 | 124,234,861 | 3.53 |
| Edenred | FR | EUR | 1,631,095 | 78,527,792 | 2.23 |
| Sage Group | GB | GBP | 8,549,203 | 75,180,551 | 2.14 |
| Worldline (France) | FR | EUR | 1,975,406 | 74,769,130 | 2.13 |
| Alten | FR | EUR | 429,664 | 55,555,557 | 1.58 |
| Novi | DE | EUR | 1,607,790 | 49,937,950 | 1.42 |
| Scout24 | IT | EUR | 4,573,243 | 43,089,093 | 1.23 |
| Tomson | DE | EUR | 651,657 | 39,490,429 | 1.12 |
| Auto Trader Group | GB | GBP | 4,561,938 | 34,535,283 | 0.98 |
| Aveva Group | GB | GBP | 1,281,386 | 33,236,554 | 0.95 |
| WAG Payment Solutions | CZ | GBP | 23,517,015 | 26,082,060 | 0.74 |
| | | | | 803,067,143 | 22.84 |
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| Prosus | NL | EUR | 1,197,483 | 55,790,715 | 1.59 |
| LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton | FR | EUR | 79,844 | 49,465,089 | 1.41 |
| Burberry Group | GB | GBP | 2,296,051 | 43,564,074 | 1.24 |
| Kering | FR | EUR | 78,164 | 40,106,188 | 1.14 |
| Entain | GB | GBP | 2,015,242 | 36,457,552 | 1.04 |
| Infarma | GB | GBP | 4,952,833 | 33,938,764 | 0.97 |
| Just Eat Takeaway.com | NL | EUR | 768,069 | 20,200,207 | 0.57 |
| | | | | 279,520,589 | 7.95 |
| 生活必需品 | | | | | |
| Swedish Match | SE | SEK | 10,570,192 | 80,429,839 | 2.29 |
| British American Tobacco (UK) | GB | GBP | 1,793,603 | 71,697,993 | 2.04 |
| Beiersdorf | DE | EUR | 408,410 | 39,133,884 | 1.11 |
| AAK | SE | SEK | 2,077,579 | 34,445,504 | 0.98 |
| | | | | 225,707,220 | 6.42 |
| ヘルスケア | | | | | |
| Novo Nordisk | DK | DKK | 1,650,358 | 180,220,688 | 5.13 |
| Merck | DE | EUR | 852,783 | 150,899,865 | 4.29 |
| Sonova Holding (B) | CH | CHF | 299,551 | 103,860,387 | 2.95 |
| Qiagen (DE) | NL | EUR | 1,289,193 | 56,776,038 | 1.61 |
| ICON | IE | USD | 172,453 | 37,798,025 | 1.07 |
| Tecan Group | CH | CHF | 113,536 | 32,760,146 | 0.93 |
| Gerrhesheimer | DE | EUR | 475,725 | 31,635,723 | 0.90 |
| Synlab | DE | EUR | 2,149,606 | 30,502,908 | 0.87 |
| Strumann Holdings | CH | CHF | 235,441 | 26,358,104 | 0.76 |
| | | | | 651,011,884 | 18.51 |
| 金融 | | | | | |
| Deutsche Boerse | DE | EUR | 513,664 | 85,370,924 | 2.43 |
| Prudential | GB | GBP | 3,891,304 | 46,869,814 | 1.33 |
| Partners Group Holding | CH | CHF | 31,070 | 31,768,408 | 0.90 |
| Alliunds Group | GB | EUR | 3,783,398 | 30,336,032 | 0.88 |
| | | | | 194,995,178 | 5.55 |
| オープンエンド型ファンド | | | | | |
| Fidelity IIF - The Euro Fund - A-ACC-EUR | IE | EUR | 4,407 | 60,130,562 | 1.71 |
| | | | | 60,130,562 | 1.71 |

その他の市場で取引される証券

| | | | | | |
|----------------------------|----|-----|-----------|-------------------|-------------|
| 情報技術 | | | | | |
| Amadeus IT Group | ES | EUR | 1,132,379 | 68,395,671 | 1.95 |
| | | | | 68,395,671 | 1.95 |
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| Industria de Diseno Textil | ES | EUR | 1,641,861 | 33,001,414 | 0.94 |
| | | | | 33,001,414 | 0.94 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額面価値 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|------------|----------------------|---------------|
| 金融 | | | | | |
| Banco Espirito Santo* | PT | EUR | 5,557,406 | 56 | 0.00 |
| | | | | 56 | 0.00 |
| その他 | | | | | |
| | | | | | (2) (0.00) |
| | | | | 174,433,762 | 4.96 |
| Total Investments (Cost EUR 3,080,622,842) | | | | | |
| | | | | 3,448,455,575 | 98.07 |
| 外国為替先物取引 | | | | | |
| A-ACC Shares (HUF) (hedged) | | | | | |
| Bought EUR Sold GBP at 1.0220270 20/05/2022 | | | 5,316,457 | 47,350 | 0.00 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | | | 1,564,371 | 7,466 | 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002661 20/05/2022 | | | 426,471 | 4,451 | 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002679 20/05/2022 | | | 225,600 | 3,902 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | | | 1,255,598 | 3,854 | 0.00 |
| Bought GBP Sold EUR at 0.842630 20/05/2022 | | | 173,878 | 726 | 0.00 |
| Bought SEK Sold EUR at 10.400158 20/05/2022 | | | 66,586 | 399 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097251 20/05/2022 | | | 69,170 | 374 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.068382 20/05/2022 | | | 24,242 | 318 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440320 20/05/2022 | | | 85,951 | 18 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134433 20/05/2022 | | | 1,183,732 | 16 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.441641 20/05/2022 | | | 13,989 | 5 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | | | 196,623 | (4) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.975166 20/05/2022 | | | 41,977 | (45) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022454 20/05/2022 | | | 46,556 | (88) | (0.00) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | | | 74,955 | (164) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | | | 118,787 | (275) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.967733 20/05/2022 | | | 46,565 | (404) | (0.00) |
| Bought HUF Sold EUR at 378.808864 20/05/2022 | | | 334,075 | (777) | (0.00) |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002623 20/05/2022 | | | 295,973 | (1,229) | (0.00) |
| Bought HUF Sold EUR at 372.193204 20/05/2022 | | | 392,726 | (7,756) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.915502 20/05/2022 | | | 225,977 | (7,813) | (0.00) |
| Bought HUF Sold EUR at 378.202100 20/05/2022 | | | 19,283,822 | (75,675) | (0.00) |
| | | | | (25,362) | (0.00) |
| A-ACC Shares (PLN) (hedged) | | | | | |
| Bought EUR Sold GBP at 1.0220270 20/05/2022 | | | 8,450,395 | 75,261 | 0.00 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | | | 2,486,495 | 11,867 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | | | 1,996,285 | 6,126 | 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.014331 20/05/2022 | | | 452,697 | 2,221 | 0.00 |
| Bought GBP Sold EUR at 0.842629 20/05/2022 | | | 297,996 | 1,229 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.068382 20/05/2022 | | | 42,026 | 552 | 0.00 |
| Bought SEK Sold EUR at 10.425391 20/05/2022 | | | 39,797 | 335 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440320 20/05/2022 | | | 164,354 | 34 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.056290 20/05/2022 | | | 17,514 | 29 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134433 20/05/2022 | | | 1,881,523 | 25 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.441643 20/05/2022 | | | 26,526 | 10 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | | | 173,386 | (3) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.975166 20/05/2022 | | | 80,244 | (86) | (0.00) |
| Bought PLN Sold EUR at 4.687343 20/05/2022 | | | 458,021 | (120) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022434 20/05/2022 | | | 89,884 | (170) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | | | 141,487 | (328) | (0.00) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | | | 171,003 | (373) | (0.00) |
| Bought EUR Sold PLN at 0.211961 20/05/2022 | | | 498,041 | (3,090) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.915502 20/05/2022 | | | 359,117 | (12,417) | (0.00) |
| Bought PLN Sold EUR at 4.661673 20/05/2022 | | | 30,540,581 | (175,197) | (0.00) |
| | | | | (94,095) | (0.00) |
| A-ACC Shares (SGD) (hedged) | | | | | |
| Bought SGD Sold EUR at 1.478970 20/05/2022 | | | 5,927,504 | 88,082 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.0220270 20/05/2022 | | | 1,632,451 | 14,539 | 0.00 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | | | 480,293 | 2,292 | 0.00 |
| Bought SGD Sold EUR at 1.479690 20/05/2022 | | | 90,424 | 1,388 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | | | 385,636 | 1,183 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.068382 20/05/2022 | | | 6,926 | 91 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440321 20/05/2022 | | | 29,649 | 6 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134433 20/05/2022 | | | 365,461 | 5 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | | | 45,972 | (1) | (0.00) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | | | 25,382 | (55) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | | | 27,887 | (65) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.967733 20/05/2022 | | | 9,567 | (83) | (0.00) |
| Bought EUR Sold SGD at 0.680532 20/05/2022 | | | 143,826 | (1,187) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.915502 20/05/2022 | | | 69,415 | (2,400) | (0.00) |
| | | | | 103,795 | 0.00 |
| A-ACC Shares (USD) (hedged) | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.0292270 20/05/2022 | | | 86,825,720 | 3,109,618 | 0.09 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.023040 20/05/2022 | | | 24,335,298 | 218,165 | 0.01 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | | | 7,160,648 | 34,176 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | | | 5,748,873 | 17,643 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440320 20/05/2022 | | | 481,600 | 102 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134433 20/05/2022 | | | 5,476,776 | 73 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | | | 425,971 | (8) | (0.00) |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134483 20/05/2022 | | | 169,773 | (61) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.975166 20/05/2022 | | | 189,579 | (202) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | | | 316,830 | (734) | (0.00) |

| | 契約額等 EUR | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets |
|---|------------------|----------------------------------|-----------------|
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | 820,694 | (1,791) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.935995 20/05/2022 | 2,185,532 | (28,311) | (0.00) |
| | 3,348,670 | 0.10 | |
| I-ACC Shares (USD) (hedged) | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.092297 20/05/2022 | 49,022,002 | 1,755,698 | 0.05 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.202340 20/05/2022 | 13,739,802 | 123,177 | 0.00 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | 4,042,958 | 19,296 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.083454 20/05/2022 | 532,458 | 14,600 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | 3,245,829 | 9,961 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.057101 20/05/2022 | 540,913 | 1,519 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097251 20/05/2022 | 126,772 | 685 | 0.00 |
| Bought SEK Sold EUR at 10.400157 20/05/2022 | 81,412 | 488 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440320 20/05/2022 | 265,190 | 56 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134453 20/05/2022 | 3,059,233 | 41 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | 291,956 | (6) | (0.00) |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134371 20/05/2022 | 164,826 | (73) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.975166 20/05/2022 | 101,428 | (108) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | 139,726 | (324) | (0.00) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | 534,339 | (1,166) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.935995 20/05/2022 | 1,376,348 | (17,845) | (0.00) |
| | 1,905,799 | 0.05 | |
| Y-ACC Shares (USD) (hedged) | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.092297 20/05/2022 | 179,409,031 | 6,425,442 | 0.18 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.202315 20/05/2022 | 50,284,338 | 449,674 | 0.01 |
| Bought EUR Sold CHF at 0.980865 20/05/2022 | 14,796,163 | 70,618 | 0.00 |
| Bought EUR Sold SEK at 0.097025 20/05/2022 | 11,878,971 | 36,455 | 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.057101 20/05/2022 | 1,945,509 | 4,744 | 0.00 |
| Bought DKK Sold EUR at 7.440320 20/05/2022 | 1,023,733 | 215 | 0.00 |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134453 20/05/2022 | 11,196,073 | 151 | 0.00 |
| Bought EUR Sold GBP at 1.191634 20/05/2022 | 801,151 | (15) | (0.00) |
| Bought EUR Sold DKK at 0.134371 20/05/2022 | 597,747 | (265) | (0.00) |
| Bought EUR Sold CHF at 0.975166 20/05/2022 | 367,639 | (392) | (0.00) |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022000 20/05/2022 | 587,084 | (1,560) | (0.00) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.189056 20/05/2022 | 1,934,655 | (4,222) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.935995 20/05/2022 | 4,098,414 | (53,139) | (0.00) |
| | 6,927,906 | 0.20 | |
| | 契約額等 | Unrealised | % Net |
| 通貨 | EUR | gain/(loss) | Assets |
| | | EUR | |
| 先物取引 | | | |
| Euro Stoxx 50 Index Future 17/06/2022 | EUR | 42,210,015 | 45,657 0.00 |
| FTSE 100 Index Future 17/06/2022 | GBP | 18,216,185 | (19,297) (0.00) |
| | | 26,360 | 0.00 |
| その他資産 (負債控除後) | | | |
| | | 55,508,405 | 1.59 |
| Net Assets | | 3,516,157,053 | 100.00 |

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーヨーロピアン・ハイ・イールド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|---|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て |
| 投 資 目 的 | 主として、本店所在地が西ヨーロッパ、中央ヨーロッパ、東ヨーロッパ(ロシアを含む)にあるか、活動の大半がそれらの地域で営まれている発行体の高利回り事業債(ハイ・イールド債券)に投資を行い、高水準のインカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 決 算 日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | ユーロ |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 131,776,249 |
| スワップ取引に係る受取利息 | 13,136,693 |
| デリバティブ収益 | — |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 144,912,942 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 23,820,629 |
| 管理費 | 5,874,137 |
| 国税 | 1,066,068 |
| 保管費用 | 292,697 |
| 販売手数料 | 643,753 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 394,255 |
| 費用合計 | 32,091,539 |
| スワップ取引に係る支払利息 | 8,827,234 |
| デリバティブ費用 | 91,075 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 還付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用還付 | — |
| 総費用 | 41,009,848 |
| 純投資収益(損失) | 103,903,094 |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | (12,058,419) |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | 349,911 |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | (34,658,839) |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | (2,658,755) |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | 31,641,731 |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (209,259,487) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 88,556 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (20,444,822) |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 1,005,453 |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (16,111,135) |
| 運用実績 | (158,202,712) |
| 受益者への分配金 | (38,809,719) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 1,426,175,476 |
| 当期解約額 | (1,604,333,880) |
| 調整勘定 | (9,417,013) |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | (187,575,417) |
| 純増加(減少) | (384,587,848) |
| 純資産額 | |
| 期首 | 2,832,952,601 |
| 期末 | 2,448,364,753 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--------------------------------------|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | |
| エネルギー | | | | | |
| Harbour Energy 5.50% 15/10/2026 144A | GB | USD | 19,720,575 | 18,210,957 | 0.74 |
| Koamos Energy 7.50% 01/03/2028 Reg S | US | USD | 18,024,362 | 16,484,230 | 0.67 |
| Tullow Oil 10.25% 15/05/2026 144A | GB | USD | 16,125,251 | 15,210,690 | 0.62 |
| Vollucose | FR | EUR | 615,252 | 6,932,808 | 0.28 |
| DTKE Finance 7.50% 31/12/2027 | GB | USD | 30,453,099 | 6,951,582 | 0.28 |
| | | | | 63,770,067 | 2.60 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|--------------------|-----------------|
| 公益事業 | | | | | |
| EDF 3.375% VRN (Perpetual) | FR | EUR | 41,652,585 | 35,299,566 | 1.44 |
| ContourGlobal Pwr. Hggs 4.125% 01/08/2025 Reg S | LU | EUR | 26,753,840 | 26,319,090 | 1.07 |
| EDF 4.00% VRN (Perpetual) EMTN | FR | GBP | 14,720,592 | 17,307,698 | 0.71 |
| Electricite de France SA 2.625% VRN (Perpetual) | FR | EUR | 17,229,784 | 14,598,520 | 0.60 |
| Teollisuuden Voima 1.125% 09/03/2026 EMTN | FI | EUR | 14,897,072 | 14,011,292 | 0.57 |
| Cullinan 4.625% 15/10/2026 Reg S | LU | EUR | 15,814,774 | 12,635,542 | 0.52 |
| Teollisuuden Voima 1.375% 23/06/2026 EMTN | FI | EUR | 10,870,656 | 9,756,109 | 0.40 |
| Cullinan 4.750% FRN 15/10/2026 Reg S | LU | EUR | 9,528,238 | 8,970,798 | 0.37 |
| SSE 4.00% VRN (Perpetual) | GB | EUR | 8,218,440 | 8,117,567 | 0.33 |
| Electricite de France 5.00% VRN (Perpetual) EMTN | FR | EUR | 4,516,545 | 4,436,169 | 0.18 |
| EDF 5.875% VRN (Perpetual) EMTN | FR | GBP | 2,509,127 | 2,835,268 | 0.12 |
| TXU Europe Funding 7.00% 30/11/2005 (Defaulted)* | GB | EUR | 627,298 | 6 | 0.00 |
| | | | | 154,283,625 | 6.30 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 素材 | | | | | |
| Schoeller Packaging 6.375% 01/11/2024 Reg S | NL | EUR | 22,775,955 | 22,319,755 | 0.91 |
| Ashland Services 2.00% 30/01/2026 Reg S | LU | EUR | 7,360,297 | 6,690,207 | 0.27 |
| INEOS Syraluron Group 2.25% 16/01/2027 Reg S | DE | EUR | 4,948,126 | 4,372,758 | 0.18 |
| Solvay Finance 5.869% VRN (Perpetual) | FR | EUR | 2,927,591 | 3,002,841 | 0.12 |
| ArcelorMittal 6.750% 01/03/2041 | LU | USD | 2,694,036 | 2,752,312 | 0.11 |
| | | | | 39,137,866 | 1.60 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 資本財・サービス | | | | | |
| Air France KLM 3.875% 01/07/2026 | FR | EUR | 22,499,087 | 20,151,307 | 0.82 |
| IAG 6.625% 17/11/2022 | ES | EUR | 18,484,380 | 18,302,494 | 0.75 |
| Autostrade Italia 6.25% 09/06/2022 EMTN | IT | GBP | 14,446,254 | 17,312,303 | 0.71 |
| Deutsche Lufthansa 2.875% 16/05/2027 EMTN | DE | EUR | 17,397,064 | 15,461,640 | 0.63 |
| Papric Holdings 3.50% 01/07/2026 Reg S | FR | EUR | 15,024,379 | 12,127,090 | 0.50 |
| Intrum 3.50% 15/07/2026 Reg S | SE | EUR | 11,488,755 | 10,728,048 | 0.44 |
| Trovis Perkins 3.75% 17/02/2026 | GB | GBP | 2,237,363 | 2,617,473 | 0.11 |
| | | | | 96,700,355 | 3.95 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 情報技術 | | | | | |
| Orano 3.375% 23/04/2026 EMTN | FR | EUR | 33,957,730 | 34,080,929 | 1.39 |
| Orano 3.75% 08/03/2028 EMTN | FR | EUR | 18,066,181 | 17,039,558 | 0.70 |
| IHS Netherlands 8.00% 18/09/2027 Reg S | NL | USD | 13,561,447 | 12,818,113 | 0.52 |
| Hurricane Finance 8.00% 15/10/2025 Reg S | GB | GBP | 10,194,847 | 12,282,183 | 0.50 |
| ams 2.125% 03/11/2027 | AT | EUR | 11,795,202 | 9,929,994 | 0.41 |
| ams 6.00% 31/07/2025 Reg S | AT | EUR | 7,469,864 | 7,496,590 | 0.30 |
| Ennergizer 3.50% 30/06/2029 Reg S | NL | EUR | 3,152,381 | 2,639,192 | 0.11 |
| | | | | 96,286,914 | 3.93 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|--------------------|-----------------|
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| Alice France Holding 8.00% 15/05/2027 Reg S | LU | EUR | 39,227,033 | 39,816,540 | 1.63 |
| LHMFC Finco 7.25% 02/10/2026 Reg S | LU | EUR | 27,135,208 | 25,978,465 | 1.06 |
| CEMS Education Doloware 7.125% 31/07/2026 Reg S | SU | USD | 24,025,512 | 22,773,906 | 0.93 |
| Albion Financing 8.75% 15/04/2027 144A | LU | USD | 22,080,888 | 19,924,767 | 0.81 |
| JLR Automotive 6.875% 15/11/2026 Reg S | GB | EUR | 19,375,980 | 19,020,043 | 0.78 |
| Ariqva Broadcast Finance 6.75% 30/09/2023 | GB | GBP | 15,877,350 | 18,889,073 | 0.77 |
| Verisure Holding 3.25% 15/02/2027 Reg S | SE | EUR | 20,815,419 | 18,805,482 | 0.77 |
| Verisure Holdings 3.875% 15/07/2026 Reg S | SE | EUR | 19,066,513 | 17,996,824 | 0.74 |
| Rakuten Group 4.25% VRN (Perpetual) Reg S | JP | EUR | 19,648,645 | 16,887,893 | 0.69 |
| Volkswagen 4.375% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 18,149,821 | 16,729,144 | 0.68 |
| Alice Finance 5.75% 15/08/2029 144A | LU | USD | 19,996,586 | 16,015,961 | 0.65 |
| Stonegate Financing 8.00% 13/07/2025 | GB | GBP | 9,522,383 | 11,441,091 | 0.47 |
| VZ Secured Financing 3.50% 15/01/2032 Reg S | NL | EUR | 12,944,084 | 11,082,855 | 0.45 |
| JLR Automotive 5.875% 15/01/2028 144A | GB | USD | 12,514,176 | 10,438,040 | 0.43 |
| Albion Finance 5.25% 15/10/2026 Reg S | LU | EUR | 10,870,020 | 10,354,596 | 0.42 |
| Deuce Finco 5.80% 15/06/2027 Reg S | GB | GBP | 8,931,050 | 9,744,393 | 0.40 |
| Ford Motor 6.625% 22/04/2030 | US | USD | 8,258,587 | 9,591,482 | 0.39 |
| Virgin Media 5.25% 15/05/2029 Reg S | GB | GBP | 7,527,576 | 8,382,556 | 0.34 |
| Unilever Group 5.25% 01/02/2030 Reg S | DE | EUR | 9,246,372 | 8,114,154 | 0.33 |
| CE Investment 5.50% 15/04/2026 Reg S | DE | EUR | 8,318,476 | 6,856,351 | 0.28 |
| Renault 2.50% 02/06/2027 EMTN | FR | EUR | 7,560,296 | 6,425,987 | 0.26 |
| Stonegate Financing 8.25% 31/07/2025 Reg S | GB | GBP | 3,588,144 | 4,344,654 | 0.18 |
| Sommer BC (B) 5.75% 31/10/2026 Reg S | LU | EUR | 4,181,986 | 4,141,413 | 0.17 |
| Circa Finance International 4.50% 15/05/2027 Reg S | LU | EUR | 4,028,080 | 3,640,265 | 0.15 |
| Ozon Holdings 1.875% 24/02/2026 | CY | USD | 13,215,077 | 5,586,070 | 0.14 |
| Schoeffler 3.375% 12/10/2028 EMTN | DE | EUR | 3,596,508 | 3,295,481 | 0.13 |
| ZF Finance 3.75% 21/09/2028 EMTN | DE | EUR | 3,596,508 | 3,205,928 | 0.13 |
| ZF Europe Finance 3.00% 23/10/2029 | NL | EUR | 2,174,633 | 1,829,062 | 0.07 |
| SES | LU | EUR | 203,055 | 1,733,275 | 0.07 |
| Waterford 9.875% 01/12/2010 Reg S (Defaulted)* | IE | EUR | 1,940,442 | 19 | 0.00 |
| | | | | 350,785,570 | 14.33 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 生活必需品 | | | | | |
| Bellis Acquisition Co 3.25% 16/02/2026 Reg S | GB | GBP | 34,058,860 | 35,719,536 | 1.46 |
| Iceland Bondco 4.375% 15/05/2028 Reg S | GB | GBP | 5,925,875 | 5,630,380 | 0.23 |
| | | | | 41,339,916 | 1.69 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|--------------|------------|-----------------|
| ヘルスケア | | | | | |
| Organon Finance 2.875% 30/04/2028 Reg S | US | EUR | 30,911,571 | 27,944,060 | 1.14 |
| Boyer 3.375% VRN 25/03/2082 | DE | EUR | 17,982,542 | 17,999,697 | 0.74 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| Chrome Bidco 3.50% 31/05/2028 Reg S | FR | EUR | 11,237,834 | 10,157,541 | 0.41 |
| Nidda Healthcare Holding 3.50% 30/09/2024 Reg S | DE | EUR | 10,112,880 | 9,396,395 | 0.38 |
| Nidda Healthcare Holding 3.50% 30/09/2024 Reg S | DE | EUR | 9,826,486 | 9,132,895 | 0.37 |
| Chrome Holdco 5.00% 31/05/2029 Reg S | DE | EUR | 5,505,655 | 6,315,072 | 0.26 |
| Boyer 3.125% VRN 12/11/2079 | FR | EUR | 5,596,508 | 3,524,278 | 0.14 |
| Boyer 3.75% VRN 03/07/2074 | FR | EUR | 3,136,490 | 3,138,221 | 0.13 |
| Teva Pharmaceutical III 5.125% 09/05/2029 | NL | USD | 3,293,733 | 2,857,569 | 0.12 |
| | | | | 92,267,728 | 3.77 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|--------------------|-----------------|
| 金融 | | | | | |
| Lincoln Financing 3.625% 01/04/2024 Reg S | LU | EUR | 29,676,212 | 29,525,220 | 1.21 |
| Newday Bondco 3.75% 01/02/2024 Reg S | GB | GBP | 22,494,905 | 26,648,584 | 1.09 |
| Co-Operative Bank 6.00% VRN 06/04/2027 | GB | GBP | 17,456,448 | 20,721,121 | 0.85 |
| Gartunkelux Holdco 3.75% 01/11/2025 Reg S | LU | GBP | 15,781,318 | 16,089,241 | 0.66 |
| Gartunkelux Holdco 3.625% 01/11/2025 Reg S | LU | EUR | 16,140,795 | 15,817,414 | 0.65 |
| Commerzbank 6.125% VRN (Perpetual) | DE | EUR | 15,716,916 | 13,429,011 | 0.55 |
| Co-Operative Bank Finance 9.00% VRN 27/11/2025 | GB | GBP | 9,852,760 | 12,787,466 | 0.52 |
| Intertrust Group 3.375% 15/11/2025 Reg S | NL | EUR | 12,420,500 | 12,502,194 | 0.50 |
| Intesa Sanpaolo 5.875% VRN (Perpetual) EMTN | IT | EUR | 12,704,875 | 11,665,921 | 0.48 |
| International Personal Finance 9.75% 12/11/2025 | GB | EUR | 9,936,400 | 9,704,077 | 0.40 |
| UniCredit 9.25% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 4,990,600 | 9,555,278 | 0.39 |
| Intesa Sanpaolo 6.375% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 7,971,703 | 7,615,199 | 0.31 |
| Pinowis Financial 5.50% VRN 19/02/2030 EMTN | GR | EUR | 7,527,576 | 6,785,018 | 0.28 |
| UniCredit 7.50% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 6,886,629 | 6,759,528 | 0.28 |
| Banco BPM 7.00% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 6,782,546 | 6,747,796 | 0.28 |
| Deutsche Bank 4.00% VRN 24/06/2032 EMTN | DE | EUR | 6,691,178 | 6,403,739 | 0.26 |
| Istanbul Metropolitan 10.75% 12/04/2027 Reg S | TR | USD | 4,704,755 | 4,488,547 | 0.18 |
| Pinowis Financial Holdings 8.75% VRN (Perpetual) | GR | EUR | 5,057,694 | 4,329,283 | 0.18 |
| FCE Bank 2.727% 03/06/2022 EMTN | GR | GBP | 3,484,431 | 4,157,475 | 0.17 |
| Gartunkelux 6.250% FRN 01/05/2026 Reg S | LU | EUR | 3,972,887 | 3,955,502 | 0.16 |
| Vmed O2 UK Financing 4.50% 15/07/2031 Reg S | GB | GBP | 3,642,510 | 3,765,318 | 0.15 |
| Pinowis Financial 5.50% VRN (Perpetual) | GR | GBP | 2,668,944 | 2,649,732 | 0.11 |
| Lincoln Financing 3.875% FRN 01/04/2024 Reg S | LU | EUR | 2,535,557 | 2,529,617 | 0.10 |
| Eurobank Ergasias | GR | EUR | 2,032,172 | 2,031,765 | 0.08 |
| Banca Monte 10.50% 23/07/2029 EMTN | IT | EUR | 2,418,025 | 1,777,248 | 0.07 |
| | | | | 242,237,085 | 9.89 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 不動産 | | | | | |
| Adler Group 3.25% 05/08/2025 | LU | EUR | 9,618,569 | 7,180,743 | 0.29 |
| Corestate Capital Holding 3.50% 15/04/2023 | LU | EUR | 6,105,700 | 3,115,587 | 0.13 |
| | | | | 10,294,330 | 0.42 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|-------------------------|------|-----|--------------|-------------------|-----------------|
| 国債 | | | | | |
| Turkey 8.60% 24/09/2027 | TR | USD | 20,763,563 | 19,966,360 | 0.82 |
| | | | | 19,966,360 | 0.82 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|--------------------|-----------------|
| オープンエンド型ファンド | | | | | |
| Fidelity IIF - The Euro Fund - A-ACCUR | IE | EUR | 17,044 | 232,559,296 | 9.50 |
| | | | | 232,559,296 | 9.50 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 EUR | % Net Assets |
|-------------------------------------|------|-----|--------------|------------|-----------------|
| コミュニケーション・サービス | | | | | |
| Vodafone Group 6.25% VRN 03/10/2078 | GB | USD | 21,014,482 | 20,215,383 | 0.83 |
| Celtnet Telecom 0.75% 20/11/2031 | ES | EUR | 25,919,124 | 19,775,225 | 0.81 |
| Alice France 5.50% 15/10/2029 144A | FR | EUR | 20,652,332 | 16,879,537 | 0.6 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面価値 | 時価 EUR | % Net Assets |
|--|------|-----|---------------|--------------------|-----------------|
| 資本財・サービス | | | | | |
| AA Bond 6.50% 31/01/2026 Reg S | GB | GBP | 21,662,690 | 25,193,920 | 1.03 |
| Autostrade per l'Italia 2.00% 15/01/2030 | IT | EUR | 26,296,351 | 23,533,622 | 0.97 |
| Autostrade per l'Italia 1.875% 26/09/2029 EMTN | IT | EUR | 21,074,702 | 19,028,897 | 0.78 |
| Suez Environment 2.75% 15/07/2029 | FR | EUR | 15,060,170 | 14,648,804 | 0.55 |
| Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028 | IT | EUR | 10,747,705 | 9,926,935 | 0.41 |
| Apcoa Parking 4.625% 15/01/2027 Reg S | DE | EUR | 9,774,975 | 9,071,793 | 0.37 |
| Autostrade per l'Italia 1.625% 12/06/2023 MTN | IT | EUR | 6,965,517 | 6,976,104 | 0.28 |
| IAG 3.75% 25/03/2029 | ES | EUR | 5,687,500 | 4,916,020 | 0.20 |
| Autostrade per l'Italia 1.75% 24/06/2026 EMTN | IT | EUR | 5,088,641 | 4,861,759 | 0.20 |
| XPO Logistics 6.25% 01/05/2025 144A | US | USD | 4,237,189 | 4,121,744 | 0.17 |
| Ukraine Railways 7.875% 15/07/2026 | GB | USD | 15,014,168 | 3,775,805 | 0.15 |
| Intl Consolidated Airlines 1.50% 04/07/2027 | ES | EUR | 5,765,788 | 5,067,039 | 0.15 |
| | | | | 128,142,422 | 5.23 |

| 情報技術 | | | | | |
|------------------------------|----|-----|-----------|------------------|-------------|
| Nokia 3.125% 15/05/2028 EMTN | FI | EUR | 6,088,972 | 6,030,518 | 0.25 |
| | | | | 6,030,518 | 0.25 |

| 一般消費財・サービス | | | | | |
|---|----|-----|------------|--------------------|-------------|
| Fuercia 2.75% 15/02/2027 | FR | EUR | 46,795,592 | 41,043,451 | 1.68 |
| Caixa Finance 1.25% 30/06/2026 Reg S | GB | GBP | 21,980,521 | 25,235,456 | 1.01 |
| Crisa Finance Intl 6.25% 20/12/2023 Reg S | LU | EUR | 15,941,423 | 15,915,916 | 0.65 |
| Ziggo Bond 3.375% 28/02/2030 Reg S | NL | EUR | 18,201,678 | 15,251,857 | 0.62 |
| JLR Automotive 7.75% 15/10/2025 144A | GB | USD | 15,369,637 | 14,615,981 | 0.60 |
| Unicredit 8.00% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 12,535,925 | 12,715,510 | 0.50 |
| UPC Broadband Finance BV 4.875% 15/07/2031 144A | NL | USD | 10,822,981 | 9,051,989 | 0.37 |
| CPUK Finance 4.875% 28/08/2023 Reg S | GB | GBP | 5,127,115 | 5,888,633 | 0.24 |
| Coira Mezz | CY | EUR | 169,348 | 24,725 | 0.00 |
| Johnston Press 8.625% 01/06/2019 Reg S (Defaulted)* | GB | GBP | 3,416,367 | 41 | 0.00 |
| | | | | 159,201,595 | 5.69 |

| ヘルスケア | | | | | |
|---|----|-----|------------|-------------------|-------------|
| Grifols Escrow Issuer 3.875% 15/10/2028 Reg S | ES | EUR | 14,304,066 | 12,874,203 | 0.53 |
| | | | | 12,874,203 | 0.53 |

| 金融 | | | | | |
|--|----|-----|------------|--------------------|-------------|
| BCC 5.25% VRN 27/11/2031 EMTN | ES | EUR | 26,848,353 | 25,652,527 | 1.05 |
| Vivion Investments 5.00% 08/08/2024 | LU | EUR | 26,179,235 | 24,066,571 | 0.98 |
| Unicredit 8.00% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 20,366,274 | 19,532,506 | 0.80 |
| Castor 6.00% 15/02/2029 Reg S | IT | EUR | 19,039,748 | 18,614,590 | 0.76 |
| Banco Com Portugues 4.00% VRN 17/05/2032 DMTN | PT | EUR | 19,237,138 | 16,975,735 | 0.69 |
| Jerrid Finco 4.875% 15/01/2026 Reg S | GB | GBP | 14,455,454 | 16,437,251 | 0.67 |
| Jancoo Finco 5.25% 15/01/2027 Reg S | GB | GBP | 12,908,956 | 14,692,203 | 0.60 |
| doValue 3.375% 31/07/2026 Reg S | IT | EUR | 12,469,847 | 11,750,025 | 0.48 |
| Hoist Finance 3.375% 27/11/2024 EMTN | SE | EUR | 9,651,188 | 9,769,415 | 0.40 |
| Banco de Sabadell SA 5.75% VRN (Perpetual) | ES | EUR | 10,371,326 | 9,608,266 | 0.39 |
| Banco de Sabadell 5.00% VRN (Perpetual) | ES | EUR | 9,534,929 | 8,196,797 | 0.33 |
| Banca Monte 5.375% VRN 18/01/2028 EMTN | IT | EUR | 12,688,147 | 8,125,537 | 0.33 |
| Yapi ve Kredi Bankasi 8.25% 15/10/2024 Reg S | TR | USD | 7,987,594 | 7,791,518 | 0.32 |
| TBC Bank 10.775% VRN (Perpetual) Reg S | GE | USD | 7,569,395 | 7,003,711 | 0.29 |
| TBC Bank 8.894% VRN (Perpetual) Reg S | GE | USD | 6,691,178 | 6,191,126 | 0.25 |
| Banca Monte 8.00% VRN 22/01/2030 | IT | EUR | 8,542,962 | 5,745,296 | 0.24 |
| Banco Commercial Portugues 9.25% VRN (Perpetual) | PT | EUR | 5,520,222 | 5,391,949 | 0.22 |
| Banco Commercial 1.75% VRN 07/04/2028 EMTN | PT | EUR | 6,272,980 | 5,372,619 | 0.22 |
| Banco de Sabadell 5.625% 06/05/2026 EMTN | ES | EUR | 5,018,384 | 5,295,657 | 0.22 |
| TBC Bank 5.75% 19/06/2024 Reg S | GE | USD | 5,290,213 | 5,061,033 | 0.21 |
| Deutsche Bank 6.75% VRN (Perpetual) | DE | EUR | 4,851,104 | 4,745,153 | 0.19 |
| Cooperative Rabobank UA 4.875% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 4,014,707 | 3,774,768 | 0.15 |
| Stoneyard Cop. 10.00% 01/03/2027 Reg S (Defaulted) | CA | USD | 12,702,992 | 3,545,272 | 0.14 |
| Sovcombank 7.60% VRN (Perpetual) Reg S | IE | USD | 9,265,100 | 7,911,154 | 0.33 |
| Tinkoff Credit 6.00% VRN (Perpetual) Reg S | IE | USD | 5,708,411 | 568,810 | 0.02 |
| Hel Telc.Fin. 8.011% 15/07/2015 Reg S (Defaulted)* | LU | EUR | 8,084,767 | 81 | 0.00 |
| | | | | 244,513,450 | 9.99 |

| 不動産 | | | | | |
|--|----|-----|------------|-------------------|-------------|
| Adler Real Estate 2.125% 06/02/2024 | DE | EUR | 14,632,771 | 12,107,886 | 0.49 |
| Adler Real Estate 1.875% 04/04/2025 | DE | EUR | 10,875,167 | 9,502,407 | 0.39 |
| Heimstaedt Bostad AB 3.625% VRN (Perpetual) EMTN | SE | EUR | 3,974,754 | 3,536,118 | 0.14 |
| | | | | 24,946,411 | 1.02 |

| コミュニケーション・サービス | | | | | |
|--|----|-----|------------|-------------------|-------------|
| Infrastructure Wireless 1.625% 21/10/2028 GMTN | IT | EUR | 17,760,960 | 16,077,809 | 0.66 |
| Telecom Italia 5.30% 30/05/2024 | IT | EUR | 16,217,743 | 15,014,517 | 0.62 |
| Iliad Holdco 6.50% 15/10/2026 144A | FR | EUR | 13,553,818 | 12,378,061 | 0.51 |
| Silknit 8.375% 31/01/2027 Reg S | GE | USD | 11,207,724 | 10,396,726 | 0.42 |
| Telecom Italia Capital 7.721% 04/06/2038 | LU | USD | 10,789,525 | 9,640,759 | 0.39 |
| Telecom Italia Capital 7.20% 18/07/2036 | LU | USD | 9,639,479 | 8,502,511 | 0.34 |
| Telefonica Europe BV 2.374% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 9,965,128 | 8,208,872 | 0.34 |
| Telecom Italia 5.00% 30/09/2025 EMTN | IT | EUR | 5,853,108 | 5,594,752 | 0.23 |
| Telecom Italia 5.25% 17/03/2025 EMTN | IT | EUR | 4,600,185 | 4,222,717 | 0.17 |
| Vodafone Group 7.00% VRN 04/04/2019 | GB | USD | 3,119,762 | 3,146,082 | 0.13 |
| | | | | 93,092,606 | 3.80 |

| 非上場 | | | | | |
|----------------|----|-----|---------|----------|-------------|
| エネルギー | | | | | |
| Fara Holdings* | GB | GBP | 737,744 | 9 | 0.00 |
| | | | | 9 | 0.00 |

| 一般消費財・サービス | | | | | |
|---|----|-----|------------|------------|------|
| Virgin Media Secured Fin. 4.125% 15/08/2030 Reg S | GB | GBP | 27,805,026 | 28,350,151 | 1.16 |
| JPMedia FRN 35.24% 17/11/2025 | GB | GBP | 1,568,473 | 818,356 | 0.03 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面価値 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|---------------|----------------------|-----------------|
| JPMedia | | | | | |
| | GB | GBP | 159,752 | 2 | 0.00 |
| | | | | 29,148,469 | 1.19 |
| 生活必需品 | | | | | |
| Market Bidco Finco 5.50% 04/11/2027 Reg S | GB | GBP | 16,686,126 | 17,809,647 | 0.73 |
| | | | | 17,809,647 | 0.73 |
| その他 | | | | | |
| | | | | (2) | (0.00) |
| Total Investments (Cost EUR 2,591,782,528) | | | | 2,406,163,847 | 98.28 |

| 契約額等 | | | | | |
|-------------|--|--|--|------------------------------|--------------|
| | | | | Unrealised % Net gain/(loss) | % Net Assets |
| | | | | EUR | EUR |

| クレジット・デフォルト・スワップ | | | | | |
|---|-----|-----|------------|------------------|---------------|
| Bought protection on Rolls-Royce Pl 0.875% 20/12/2026 | EA | EUR | 14,804,232 | 1,218,422 | 0.05 |
| Bought protection on Deutsche Luftha 0.25% 20/12/2026 | EUR | EUR | 7,381,206 | 708,857 | 0.03 |
| Bought protection on Auchan Holding 2.875% 20/12/2026 | EUR | EUR | 14,804,232 | 665,976 | 0.05 |
| Bought protection on Allice 6.25% 20/12/2024 | EUR | EUR | 11,575,003 | 629,011 | 0.03 |
| Sold protection on Intrum Just 5.125% 20/04/2024 | EUR | EUR | 10,036,567 | 459,546 | 0.02 |
| Sold protection on Vertical H 6.625% 20/06/2026 | EUR | EUR | 8,365,973 | 437,840 | 0.02 |
| Bought protection on Alstom 0.25% 20/12/2026 | EUR | EUR | 14,887,872 | 304,620 | 0.01 |
| Bought protection on Continental 0.375% 20/12/2026 | EUR | EUR | 7,402,116 | 118,795 | 0.00 |
| Bought protection on Carrefour 1.25% 20/04/2026 | EUR | EUR | 11,048,808 | 96,015 | 0.00 |
| Bought protection on Compagnie De 0.875% 20/12/2026 | EUR | EUR | 7,381,206 | (84,110) | (0.00) |
| Bought protection on Michelin Comp 1.125% 20/12/2026 | EUR | EUR | 7,402,116 | (146,402) | (0.01) |
| Sold protection on Air France 1.875% 20/12/2026 | EUR | EUR | 3,742,878 | (152,325) | (0.01) |
| Bought protection on CNX NA HV 5.8% 5 Year 20/06/2027 | USD | USD | 13,022,688 | (224,680) | (0.01) |
| Bought protection on Goodyear Tire 5% 20/12/2026 | USD | USD | 7,381,206 | (233,638) | (0.01) |
| Bought protection on Carlsberg Brew 2.625% 20/12/2026 | EUR | EUR | 22,227,258 | (474,419) | (0.02) |
| Sold protection on Rolls-Royce 2.125% 20/06/2025 | EUR | EUR | 11,876,841 | (490,752) | (0.02) |
| Bought protection on Itron Xaver 5.37 20/06/2027 | EUR | EUR | 42,884,481 | (1,315,825) | (0.05) |
| Sold protection on Adler Real Est 1.5% 20/06/2026 | EUR | EUR | 14,703,864 | (2,129,649) | (0.09) |
| | | | | (614,718) | (0.03) |

| 外国為替先物取引 | | | | | |
|---|--|--|-------------|---------------------|---------------|
| Bought RUB Sold USD at 118.00000 18/05/2022 | | | 6,118,466 | 3,820,279 | 0.16 |
| Bought USD Sold EUR at 1.120441 18/05/2022 | | | 16,385,202 | 1,025,513 | 0.04 |
| Bought USD Sold EUR at 1.138309 18/05/2022 | | | 11,549,877 | 918,688 | 0.04 |
| Bought USD Sold EUR at 1.143287 18/05/2022 | | | 6,195,806 | 690,594 | 0.03 |
| Bought USD Sold EUR at 1.122724 18/05/2022 | | | 9,897,887 | 640,983 | 0.05 |
| Bought USD Sold EUR at 1.135170 18/05/2022 | | | 8,263,074 | 616,981 | 0.05 |
| Bought USD Sold EUR at 1.137823 18/05/2022 | | | 7,497,873 | 592,932 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.120682 18/05/2022 | | | 8,239,470 | 517,636 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.111651 18/05/2022 | | | 9,485,404 | 514,672 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.011920 18/05/2022 | | | 9,357,400 | 421,369 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.094618 18/05/2022 | | | 9,337,298 | 355,803 | 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.105770 18/05/2022 | | | 7,172,124 | 349,152 | 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.111942 18/05/2022 | | | 6,067,205 | 330,876 | 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.086016 18/05/2022 | | | 10,295,456 | 253,546 | 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.087446 18/05/2022 | | | 7,219,911 | 224,009 | 0.01 |
| Bought GBP Sold EUR at 0.837580 18/05/2022 | | | 7,122,928 | (12,851) | (0.00) |
| Bought GBP Sold EUR at 0.836022 18/05/2022 | | | 7,108,186 | (26,019) | (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.935084 18/05/2022 | | | 7,145,291 | (100,121) | (0.01) |
| Bought GBP Sold EUR at 0.830805 18/05/2022 | | | 18,237,942 | (180,161) | (0.01) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.180613 18/05/2022 | | | 19,887,881 | (186,053) | (0.01) |
| Bought EUR Sold USD at 0.901323 18/05/2022 | | | 8,002,079 | (400,958) | (0.02) |
| Bought EUR Sold USD at 0.904573 18/05/2022 | | | 22,001,456 | (1,020,760) | (0.04) |
| Bought EUR Sold GBP at 1.182571 18/05/2022 | | | 385,638,135 | (2,938,504) | (1.12) |
| Bought USD Sold RUB at 0.021145 18/05/2022 | | | 32,236,081 | (3,796,421) | (1.16) |
| Bought EUR Sold USD at 0.872412 18/05/2022 | | | 547,148,601 | (45,824,010) | (1.79) |
| | | | | (41,230,825) | (1.68) |

| A-ACC Shares (CZK) (hedged) | | | | | |
|---|--|--|-----------|-----------------|---------------|
| Bought EUR Sold CZK at 0.040739 06/05/2022 | | | 7,861,815 | 14,071.00 | 0.00 |
| Bought CZK Sold EUR at 24.557940 06/05/2022 | | | 8,782,252 | (10,438) | (0.00) |
| Bought CZK Sold EUR at 24.672610 07/06/2022 | | | 7,761,919 | (15,391) | (0.00) |
| | | | | (11,758) | (0.00) |

| | 契約額等 EUR | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets | | 契約額等 EUR | Unrealised gain/(loss) EUR | % Net Assets |
|---|------------|----------------------------|----------------------|---------------|----------|----------------------------|--------------|
| Bought EUR Sold SEK at 0.095895 06/05/2022 | 44,702,494 | (397,401) | (0.02) | | | | |
| | | 30,267 | 0.00 | | | | |
| A-ACC Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 27,779,646 | 1,610,397 | 0.07 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 28,494,153 | 207,674 | 0.01 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.936561 06/05/2022 | 645,989 | (8,378) | (0.00) | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 28,744,054 | (210,270) | (0.01) | | | | |
| | | 1,599,423 | 0.07 | | | | |
| A-HMDIST (G) Shares (AUD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought AUD Sold EUR at 1.494082 06/05/2022 | 2,697,576 | 17,651 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold AUD at 0.674765 06/05/2022 | 2,715,228 | 4,346 | 0.00 | | | | |
| Bought AUD Sold EUR at 1.485448 07/06/2022 | 2,666,760 | (3,555) | (0.00) | | | | |
| | | 18,042 | 0.00 | | | | |
| A-MDIST Shares (SGD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought SGD Sold EUR at 1.509307 06/05/2022 | 587,886 | 21,366 | 0.00 | | | | |
| Bought SGD Sold EUR at 1.464817 07/06/2022 | 540,614 | 2,302 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold SGD at 0.673900 06/05/2022 | 49,355 | (1,119) | (0.00) | | | | |
| Bought EUR Sold SGD at 0.683706 06/05/2022 | 548,896 | (2,342) | (0.00) | | | | |
| | | 20,207 | 0.00 | | | | |
| A-MDIST Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 32,967,265 | 1,911,125 | 0.08 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 34,278,862 | 249,835 | 0.01 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 54,878,590 | (251,144) | (0.01) | | | | |
| | | 1,909,816 | 0.08 | | | | |
| A-MINCOME (G) Shares (HKD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought HKD Sold EUR at 8.758478 06/05/2022 | 1,486,884 | 84,446 | 0.00 | | | | |
| Bought HKD Sold EUR at 8.331675 07/06/2022 | 1,547,048 | 10,611 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold HKD at 0.120121 06/05/2022 | 1,571,330 | (10,566) | (0.00) | | | | |
| | | 84,471 | 0.00 | | | | |
| A-MINCOME (G) Shares (SGD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought SGD Sold EUR at 1.509307 06/05/2022 | 207,314 | 7,534 | 0.00 | | | | |
| Bought SGD Sold EUR at 1.464817 07/06/2022 | 211,835 | 902 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold SGD at 0.683706 06/05/2022 | 214,848 | (917) | (0.00) | | | | |
| | | 7,519 | 0.00 | | | | |
| A-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 1,670,790 | 96,856 | 0.00 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 1,706,846 | 12,440 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.921769 06/05/2022 | 40,422 | (1,544) | (0.00) | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 1,727,224 | (12,435) | (0.00) | | | | |
| | | 95,507 | 0.00 | | | | |
| RY-ACC Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 33,812,301 | 1,960,112 | 0.08 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.100270 06/05/2022 | 17,736,192 | 780,585 | 0.03 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 33,122,364 | 387,172 | 0.02 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.948999 07/06/2022 | 2,725,882 | 4,388 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 54,289,189 | (397,139) | (0.02) | | | | |
| | | 2,735,118 | 0.11 | | | | |
| Y-ACC Shares (CHF) (hedged) | | | | | | | |
| Bought CHF Sold EUR at 1.031098 06/05/2022 | 2,889,347 | 18,775 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold CHF at 0.977539 06/05/2022 | 2,908,122 | 4,163 | 0.00 | | | | |
| Bought CHF Sold EUR at 1.022840 07/06/2022 | 2,858,609 | (4,045) | (0.00) | | | | |
| | | 18,893 | 0.00 | | | | |
| Y-ACC Shares (CZK) (hedged) | | | | | | | |
| Bought EUR Sold CZK at 0.040739 06/05/2022 | 484,788 | 868 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold CZK at 0.040766 06/05/2022 | 14,502 | 36 | 0.00 | | | | |
| Bought CZK Sold EUR at 24.557940 06/05/2022 | 499,952 | (643) | (0.00) | | | | |
| Bought CZK Sold EUR at 24.672610 07/06/2022 | 480,071 | (952) | (0.00) | | | | |
| | | (711) | (0.00) | | | | |
| Y-ACC Shares (SEK) (hedged) | | | | | | | |
| Bought SEK Sold EUR at 10.433524 07/06/2022 | 422,542 | 3,744 | 0.00 | | | | |
| Bought SEK Sold EUR at 10.344842 06/05/2022 | 428,155 | 385 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold SEK at 0.095895 06/05/2022 | 428,540 | (5,810) | (0.00) | | | | |
| | | 319 | 0.00 | | | | |
| Y-ACC Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 47,043,728 | 2,727,143 | 0.11 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 49,776,678 | 362,788 | 0.01 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.111640 06/05/2022 | 1,130,132 | 61,931 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.948999 07/06/2022 | 1,528,749 | 2,461 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 50,962,933 | (372,807) | (0.02) | | | | |
| | | 2,781,516 | 0.11 | | | | |
| Y-MDIST Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 1,380,830 | 80,047 | 0.00 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 1,391,457 | 10,141 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.923614 06/05/2022 | 51,998 | (1,384) | (0.00) | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 1,408,879 | (10,306) | (0.00) | | | | |
| | | 78,498 | 0.00 | | | | |
| Y-MINCOME (G) Shares (USD) (hedged) | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 06/05/2022 | 43,588 | 2,527 | 0.00 | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.063130 07/06/2022 | 46,338 | 330 | 0.00 | | | | |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 06/05/2022 | 46,115 | (337) | (0.00) | | | | |
| | | 2,520 | 0.00 | | | | |
| 通貨 | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | |
| Euro-Bund Bond Future 08/06/2022 | EUR | (85,427,402) | 6,871,903 | 0.28 | | | |
| Long Gilt Future 28/04/2022 | GBP | (5,943,774) | 261,530 | 0.01 | | | |
| US Ultra Bond Future 21/06/2022 | USD | 3,218,666 | (450,940) | (0.02) | | | |
| US Treasury 20 Year Bond Future 21/06/2022 | USD | 6,814,286 | (633,355) | (0.03) | | | |
| US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2022 | USD | 12,816,207 | (1,050,805) | (0.04) | | | |
| Euro-Solci Bond Future 08/06/2022 | EUR | 28,933,458 | (1,226,229) | (0.05) | | | |
| US Treasury Note 5 Year Bond Future 30/06/2022 | USD | 68,642,665 | (2,870,411) | (0.12) | | | |
| | | | 901,693 | 0.04 | | | |
| 通貨 | | | | | | | |
| 翌日物金利スワップ | | | | | | | |
| Receive fixed 1.93% pay float. (1d SOFR) 21/03/2027 | USD | 139,678,347 | (4,622,174) | (0.19) | | | |
| | | | (4,622,174) | (0.19) | | | |
| その他資産 (負債控除後) | | | | | | | |
| | | | 78,485,571 | 3.24 | | | |
| Net Assets | | | | | | | |
| | | | 2,448,364,753 | 100.00 | | | |

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーエマージング・マーケット・デット・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|------|---|
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て |
| 投資目的 | 主としてエマージング債券に投資し、インカムの確保と値上り益の追求を目指します。 |
| 決算日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | 米ドル |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 136,962,682 |
| スワップ取引に係る受取利息 | 7,736,792 |
| デリバティブ収益 | 10 |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 144,699,484 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 22,683,748 |
| 管理費 | 5,529,858 |
| 国税 | 1,050,446 |
| 保管費用 | 573,635 |
| 販売手数料 | 628,252 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 327,040 |
| 費用合計 | 30,792,979 |
| スワップ取引に係る支払利息 | 12,534,466 |
| デリバティブ費用 | 46,316 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 43,373,761 |
| 純投資収益(損失) | 101,325,723 |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | (10,869,277) |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | (826,854) |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | (28,085,216) |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | 2,950,846 |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | 13,976,087 |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (527,073,894) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 720,211 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (7,308,978) |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (29,440,405) |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 9,632,845 |
| 運用実績 | (474,998,912) |
| 受益者への分配金 | (35,692,571) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 855,565,754 |
| 当期解約額 | (1,266,669,763) |
| 調整勘定 | (12,325,864) |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | (423,429,873) |
| 純増加(減少) | (934,121,356) |
| 純資産額 | |
| 期首 | 2,624,527,025 |
| 期末 | 1,690,405,669 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | | 国コード | 通貨 | 株数または額 面額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets |
|--|------|-----|--------------|--------------------|-----------------|---|------|-----|--------------|-----------|-----------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | | | | | | | |
| エネルギー | | | | | | | | | | | |
| Ecopetrol 6.875% 29/04/2030 | CO | USD | 28,318,615 | 28,119,110 | 1.66 | Iranbar Metropolitan 10.75% 12/04/2027 Reg S | TR | USD | 6,206,820 | 6,239,896 | 0.37 |
| Ecopetrol 4.625% 02/11/2031 | CO | USD | 25,275,574 | 19,490,267 | 1.15 | Banorte 8.375% VRN (Perpetual) Reg S | MX | USD | 5,345,296 | 5,502,446 | 0.33 |
| Uzbekneftegaz 4.75% 16/11/2028 Reg S | UZ | USD | 21,141,780 | 17,596,995 | 1.03 | Huorong Finance 2019 3.75% 29/05/2024 EMTN | VG | USD | 5,665,723 | 5,437,174 | 0.32 |
| Petróleo Mexicano 7.00% 23/01/2050 | MX | USD | 13,994,051 | 11,038,018 | 0.65 | Uzbek Industrial Bank 5.75% 02/12/2024 | UZ | USD | 5,271,912 | 5,221,244 | 0.31 |
| Ecopetrol 5.875% 28/05/2045 | CO | USD | 10,241,253 | 8,071,182 | 0.48 | Banco Mercantil 5.75% VRN (Perpetual) Reg S | MX | USD | 5,217,608 | 5,002,512 | 0.30 |
| Petróleo Mexicano 6.75% 21/09/2047 | MX | USD | 10,830,125 | 7,914,872 | 0.47 | Vanada Res. Fin. II 13.875% 21/01/2024 Reg S | GB | USD | 4,267,189 | 4,435,550 | 0.26 |
| Ennergaz 6.50% 30/04/2027 Reg S | GB | USD | 7,021,465 | 6,647,207 | 0.39 | Banco do Brasil 6.25% VRN (Perpetual) Reg S | BR | USD | 3,879,262 | 3,607,714 | 0.21 |
| Frontiera Energy 6.375% 24/10/2048 Reg S | KZ | USD | 6,652,935 | 6,370,099 | 0.38 | Abau Group 6.375% VRN (Perpetual) | UZ | USD | 3,415,751 | 3,293,662 | 0.19 |
| Ecopetrol 3.75% 18/09/2043 | CO | USD | 6,278,405 | 5,779,767 | 0.34 | Dev. Bank of Mongolia 7.25% 23/10/2023 Reg S | MN | USD | 2,715,848 | 2,698,229 | 0.16 |
| KazMunyoGas 5.75% 19/04/2047 Reg S | KZ | USD | 5,818,893 | 5,292,062 | 0.31 | Vanada Res. Fin. II 8.95% 11/03/2025 Reg S | GB | USD | 2,445,332 | 2,344,673 | 0.14 |
| Abou Dhabi National Oil Co 0.70% 04/06/2046 | AE | USD | 5,430,967 | 5,145,841 | 0.30 | Operadora de Servicios 8.25% 11/10/2025 Reg S | MX | USD | 3,200,391 | 2,022,503 | 0.12 |
| Frontiera Energy 7.875% 21/06/2028 Reg S | CA | USD | 4,984,852 | 4,542,920 | 0.27 | Tanjim State-OCI, 8 Management... 1.60% 17/12/2039* | CN | USD | 4,998,817 | 1,074,746 | 0.06 |
| Ennergaz Israel Financ 5.375% 30/03/2028 | IL | USD | 4,625,632 | 4,270,037 | 0.25 | Gilk Europe Capital 4.34% 27/02/2029 | IS | USD | 6,641,297 | 1,029,401 | 0.05 |
| Petróleo Mexicano 6.95% 28/01/2040 | MX | USD | 5,314,589 | 3,863,574 | 0.23 | Tuspark Forward 6.95% 13/05/2024 | GB | USD | 2,469,150 | 938,277 | 0.06 |
| Ennergaz Israel Financ 5.875% 30/03/2031 | IL | USD | 3,584,268 | 3,055,148 | 0.18 | Vanada Resources Fin. II 9.25% 23/04/2026 Reg S | VG | USD | 775,852 | 645,114 | 0.04 |
| Petróleo Mexicano 2.75% 21/04/2027 EMTN | MX | EUR | 3,122,806 | 2,815,420 | 0.17 | Credvalores-Credinvestico 8.875% 01/02/2025 Reg S | CO | USD | 1,316,949 | 641,583 | 0.04 |
| PDVSA 5.50% 12/04/2037 (Defaulted) | VE | USD | 41,120,181 | 2,672,812 | 0.16 | Dev. Bank of Kazakhstan 8.95% 04/05/2023 Reg S | KZ | KZT | 91,162,664 | 171,327 | 0.01 |
| KazMunyoGas 3.50% 14/04/2033 Reg S | KZ | USD | 2,994,791 | 2,487,832 | 0.15 | Yihua Overseas Invest 5.80% 23/10/2020 (Defaulted) | VG | USD | 1,183,175 | 154,381 | 0.01 |
| Al Candelaria (Spain) 7.50% 15/12/2028 Reg S | ES | USD | 1,971,441 | 1,915,417 | 0.11 | Pearl Holding III 9.00% 21/02/2025 Reg S | KY | USD | 383,271 | 139,894 | 0.01 |
| Petrobras Global Finance 6.85% 05/06/215 | NL | USD | 1,939,651 | 1,714,324 | 0.10 | Bulgaria Steel Fin. 12.00% 04/05/2013 (Defaulted) | NL | EUR | 232,756 | 2 | 0.00 |
| Tunisian Republic 5.75% 30/01/2023 Reg S | TN | USD | 2,327,557 | 1,604,583 | 0.09 | | | | | | |
| Mongolian Mining 9.25% 15/04/2024 Reg S | SU | USD | 1,165,779 | 838,293 | 0.05 | | | | | | |
| PDVSA 9.00% 17/11/2021 Reg S (Defaulted) | VE | USD | 1,551,705 | 114,438 | 0.01 | | | | | | |
| PDVSA 12.75% 17/02/2022 Reg S (Defaulted) | VE | USD | 1,551,705 | 114,438 | 0.01 | | | | | | |
| PDVSA 6.00% 16/05/2024 Reg S (Defaulted) | VE | USD | 1,551,705 | 105,904 | 0.01 | | | | | | |
| Lebanon 7.00% 22/04/2031 (Defaulted) | LB | USD | 271,548 | 32,347 | 0.00 | | | | | | |
| | | | | 151,410,961 | 8.96 | | | | | | |
| 公益事業 | | | | | | | | | | | |
| Comision Federal de Electric 5.00% 30/07/2049 EMTN | MX | USD | 45,203,751 | 43,847,638 | 2.59 | China South City Holdings 11.50% 12/02/2022 | HK | USD | 4,596,926 | 4,367,080 | 0.26 |
| Elkorn Holdings 7.125% 11/02/2025 Reg S | ZA | USD | 15,674,400 | 13,096,656 | 0.77 | Theta Capital 6.75% 31/10/2026 | SG | USD | 4,131,414 | 3,901,088 | 0.23 |
| Pakistan Wat. & Pow. Dev. Auth 7.50% 04/04/2031 | PK | USD | 8,980,497 | 5,787,927 | 0.33 | Radiance Capital 8.80% 17/09/2025 | VG | USD | 4,158,569 | 3,887,223 | 0.23 |
| Mong Dzung Fin. Holdings 5.125% 07/05/2029 Reg S | NL | USD | 5,896,479 | 5,292,090 | 0.31 | Country Garden Holdings 4.80% 06/08/2030 | KY | USD | 3,518,893 | 3,622,261 | 0.21 |
| Investment Energy Res. 6.25% 26/04/2029 Reg S | BM | USD | 4,034,433 | 3,987,008 | 0.24 | Uzbek Land Treasury II 7.00% 13/01/2025 | UZ | USD | 3,305,891 | 3,487,845 | 0.20 |
| GCL New Energy Holdings 10.00% 30/01/2024 | BM | USD | 5,962,384 | 3,744,642 | 0.22 | Sino-Ocean Land Treasury II 5.95% 04/02/2027 | VG | USD | 3,452,543 | 2,848,347 | 0.17 |
| Comision Federal de Electric 4.875% 15/05/2023 Reg S | MX | USD | 3,549,525 | 3,444,079 | 0.20 | Radiance Holdings 7.80% 20/03/2024 | KY | USD | 3,946,761 | 2,762,733 | 0.16 |
| Comision Federal 6.24% 15/02/2025 Reg S | MX | USD | 2,967,656 | 2,659,476 | 0.16 | Powerlong Real Estate Holdings 5.95% 30/04/2025 | KY | USD | 6,687,848 | 2,641,700 | 0.16 |
| Generacion Mediterraneo 9.625% 01/12/2027 Reg S | AR | USD | 3,064,167 | 2,457,830 | 0.15 | Powerlong Real Estate Holdings 6.25% 10/08/2024 | KY | USD | 3,649,782 | 2,618,590 | 0.16 |
| NPC Ukrenrgo 6.875% 09/11/2026 Reg S | UA | USD | 7,331,806 | 2,309,519 | 0.14 | Seazen Group 4.45% 13/07/2025 | VG | USD | 2,699,882 | 2,449,580 | 0.14 |
| | | | | 86,256,865 | 5.12 | China SCE Group Holdings 7.25% 19/04/2023 | KY | USD | 2,567,296 | 2,028,164 | 0.12 |
| | | | | | | Kaisa Group Holdings 9.375% 30/06/2024 (Defaulted) | KY | USD | 8,019,987 | 1,666,152 | 0.10 |
| | | | | | | New Metro Global 4.50% 02/05/2026 | VG | USD | 1,715,484 | 1,633,730 | 0.10 |
| | | | | | | Ronshine China Holdings 8.75% 25/10/2022 | KY | USD | 3,879,262 | 1,512,912 | 0.09 |
| | | | | | | Tina Fin. Holdings 5.55% 04/06/2024 | KY | USD | 2,715,484 | 1,439,206 | 0.09 |
| | | | | | | Shimao Group Holdings 5.20% 16/01/2027 | KY | USD | 5,818,935 | 1,367,440 | 0.08 |
| | | | | | | Sunac China Holdings 5.95% 26/04/2024 | KY | USD | 5,500,352 | 1,516,544 | 0.08 |
| | | | | | | SGC Ventures 3.00% 30/08/2026 (Defaulted) | VG | USD | 91,501,985 | 1,288,522 | 0.08 |
| | | | | | | China SCE Group Holdings 6.00% 04/02/2026 | KY | USD | 1,935,572 | 1,146,933 | 0.07 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 8.50% 23/01/2022 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 962,057 | 0.06 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 925,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 6.35% 08/02/2024 (Defaulted) | KY | USD | 3,879,262 | 863,156 | 0.05 |
| | | | | | | China Aoyuan Group 5.9% 18/08/2025 (Defaulted) | KY | USD | 4,205,120 | 825,126 | 0.05 |
| | | | | | | China Evergrande Grp 6.50% 28/06/2025 (Defaulted) | KY | USD | 1,758,525 | 892,233 | 0.05 |
| | | | | | | | | | | | |

| 国コード | 通貨 | 株数または額 面価値 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | 国コード | 通貨 | 株数または額 面価値 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | | |
|--|----|---------------|-------------|-----------------|------|---|---------------|----------|-------------------|-------------|------|
| Egypt 7.053% 15/01/2032 Reg S | EG | USD | 7,758,525 | 5,997,122 | 0.35 | 公益事業 | | | | | |
| Serbia 1.00% 23/09/2028 Reg S | RS | EUR | 7,428,787 | 5,988,485 | 0.35 | ESK Holding 8.45% 10/08/2028 Reg S | ZA | USD | 14,372,667 | 13,861,647 | 0.82 |
| Ecuador 5.00% 11/07/2032 Reg S | EC | USD | 7,345,945 | 5,955,260 | 0.35 | EnfraqGenEnergy Sur ES 5.375% 30/12/2030 Reg S | ES | USD | 15,245,501 | 10,972,035 | 0.65 |
| Zambia 13.00% 25/01/2031 | ZM | ZMW | 157,581,672 | 5,469,511 | 0.32 | Latin America Power 6.125% 15/06/2033 Reg S | CL | USD | 8,517,128 | 6,666,314 | 0.59 |
| Romania 2.75% 14/04/2041 Reg S | RO | EUR | 7,370,598 | 5,218,157 | 0.31 | Infraest. Energetica Nova 4.75% 15/01/2031 Reg S | MD | USD | 5,045,041 | 4,162,123 | 0.25 |
| Ghana 7.875% 26/03/2027 Reg S | GH | USD | 7,370,598 | 5,187,059 | 0.31 | EGE Haina 5.625% 08/11/2028 Reg S | DO | USD | 3,607,714 | 3,215,700 | 0.19 |
| Kenya 11.75% 02/10/2035 | KE | KES | 617,578,561 | 5,181,081 | 0.31 | AES Genera 7.125% VRN 26/03/2079 Reg S | CL | USD | 2,075,405 | 2,032,725 | 0.12 |
| Argentina 0.125% 09/10/2030 | AR | USD | 15,635,599 | 5,113,444 | 0.30 | Empresa Electrica Guacacola 4.56% 30/04/2025 Reg S | CL | USD | 6,634,869 | 1,240,126 | 0.07 |
| El Salvador 8.625% 28/02/2029 Reg S | SV | USD | 12,491,225 | 5,105,223 | 0.30 | Empresa Distribuidora 9.75% 25/10/2022 Reg S | AR | USD | 543,097 | 531,678 | 0.03 |
| Nigeria 8.747% 21/01/2031 Reg S | NG | USD | 5,251,745 | 4,773,364 | 0.28 | | | | 42,682,348 | 2.52 | |
| Ghana 8.627% 16/06/2049 Reg S | GH | USD | 7,758,525 | 4,514,220 | 0.27 | 素材 | | | | | |
| Ghana 8.75% 26/03/2027 Reg S | GH | USD | 7,758,525 | 4,508,479 | 0.27 | Newcastle Coal Infrastr. 4.70% 12/05/2031 Reg S | AU | USD | 5,566,741 | 4,760,232 | 0.28 |
| Kenya 7.25% 28/02/2028 Reg S | KE | USD | 4,887,871 | 4,307,680 | 0.25 | Endeavour Mining PLC 5.00% 14/10/2026 Reg S | GB | USD | 4,810,285 | 4,423,250 | 0.26 |
| Honduras 6.25% 19/01/2027 Reg S | HN | USD | 4,887,871 | 4,275,828 | 0.25 | Braskem 6.99% 20/02/2032 Reg S | MX | USD | 1,609,894 | 1,465,901 | 0.09 |
| Kenya 8.00% 22/05/2032 Reg S | KE | USD | 4,771,493 | 4,117,798 | 0.24 | Sino-Forest 6.25% 21/10/2017 144A (Defaulted) | CA | USD | 5,593,896 | | |
| Uzbekistan 5.70% 25/11/2030 Reg S | UZ | USD | 4,674,511 | 3,833,099 | 0.23 | | | | 10,647,439 | 0.63 | |
| Pakistan 6.00% 08/04/2026 Reg S | PK | USD | 4,577,530 | 3,755,405 | 0.22 | 資本財・サービス | | | | | |
| Nigeria 7.625% 28/11/2047 Reg S | NG | USD | 5,172,608 | 3,701,777 | 0.22 | Accu Petrolux Luxembourg 7.50% 15/01/2032 Reg S | LU | USD | 11,909,335 | 10,814,212 | 0.64 |
| Turkey 8.60% 24/09/2027 | TR | USD | 3,180,995 | 3,223,277 | 0.19 | EFE 5.83% 14/09/2061 Reg S | CL | USD | 11,135,483 | 8,566,714 | 0.51 |
| Lebanon 6.85% 25/05/2026 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 26,977,942 | 3,203,651 | 0.19 | Hydrovis Int'l Fin. 4.95% 08/02/2031 Reg S | LU | USD | 8,776,445 | 7,143,059 | 0.42 |
| Pakistan 8.25% 30/09/2023 Reg S | PK | USD | 3,324,698 | 3,009,281 | 0.18 | Prumo Investimentos 7.50% 31/12/2031 Reg S | BR | USD | 4,896,879 | 4,828,458 | 0.29 |
| El Salvador 9.50% 15/07/2052 Reg S | SV | USD | 7,336,461 | 2,989,681 | 0.18 | Ukraine Railways 7.875% 15/07/2026 | GB | USD | 16,601,691 | 4,399,448 | 0.26 |
| Sri Lanka 6.85% 14/03/2024 Reg S (Defaulted) | LK | USD | 6,641,297 | 2,872,561 | 0.17 | Empresa de Transporte 3.693% 13/09/2061 Reg S | CL | USD | 5,547,345 | 4,078,713 | 0.24 |
| Nigeria 5.00% 28/11/2027 Reg S | NG | USD | 5,142,202 | 2,797,346 | 0.17 | Rumo Luxembourg Sarl 4.20% 18/01/2032 Reg S | LU | USD | 4,325,377 | 3,617,724 | 0.21 |
| Zambian 3.75% 07/02/2034 Reg S | RO | EUR | 2,928,845 | 2,624,378 | 0.17 | Simpor Europe 5.20% 26/01/2031 Reg S | LU | USD | 4,344,774 | 3,600,796 | 0.21 |
| Nigeria 7.875% 16/10/2032 Reg S | NG | USD | 3,103,410 | 2,614,512 | 0.16 | Alfa Desarrolla 4.55% 27/09/2051 Reg S | CL | USD | 2,746,195 | 2,189,651 | 0.13 |
| Georgia 2.75% 22/04/2026 Reg S | GE | USD | 2,991,687 | 2,577,379 | 0.15 | Empresa Trans. Pasajero 4.70% 07/05/2050 Reg S | CL | USD | 2,036,613 | 1,866,729 | 0.11 |
| Lebanon 6.65% 26/02/2030 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 20,285,439 | 2,454,253 | 0.14 | | | | 51,103,484 | 3.02 | |
| Ghana 7.75% 07/04/2029 Reg S | GH | USD | 3,801,671 | 2,424,544 | 0.14 | 情報技術 | | | | | |
| Belarus 5.37% 24/02/2031 Reg S | BY | USD | 5,517,049 | 2,405,143 | 0.14 | StoneCo 3.95% 16/06/2028 Reg S | KY | USD | 13,693,796 | 11,279,991 | 0.67 |
| Sri Lanka 6.85% 03/11/2025 Reg S (Defaulted) | LK | USD | 5,450,364 | 2,388,203 | 0.14 | | | | 11,279,991 | 0.67 | |
| Nigeria 8.375% 24/03/2029 Reg S | NG | USD | 2,465,332 | 2,304,274 | 0.14 | 一般消費財・サービス | | | | | |
| Pakistan 7.375% 08/04/2031 Reg S | PK | USD | 2,831,861 | 2,177,301 | 0.13 | Moved Visa 5.25% 08/02/2031 Reg S | LU | USD | 12,045,109 | 10,012,196 | 0.59 |
| Lebanon 8.20% 17/05/2033 (Defaulted) | LB | USD | 20,172,164 | 2,143,292 | 0.13 | Mercadolibre 3.125% 14/01/2031 | IE | USD | 1,221,948 | 995,720 | 0.06 |
| Romania 2.625% 02/12/2040 Reg S | RO | EUR | 2,987,032 | 2,101,687 | 0.12 | LCPR Senior Secured Fin. 6.75% 15/10/2027 144A | US | USD | 676,545 | 679,683 | 0.04 |
| Argentina 2.50% 09/07/2041 | AR | USD | 5,818,893 | 1,960,967 | 0.12 | | | | 11,687,599 | 0.69 | |
| Sri Lanka 5.75% 18/04/2023 Reg S (Defaulted) | LK | USD | 4,390,549 | 1,923,331 | 0.12 | 生活必需品 | | | | | |
| Romania 4.625% 03/04/2049 Reg S | RO | EUR | 1,900,839 | 1,673,543 | 0.11 | Ulker Biskui Sanayi AS 4.95% 30/10/2025 Reg S | TR | USD | 2,987,032 | 2,573,238 | 0.15 |
| Sri Lanka 6.75% 18/04/2028 Reg S (Defaulted) | LK | USD | 3,879,262 | 1,648,083 | 0.10 | | | | 2,573,238 | 0.15 | |
| Nigeria 7.143% 23/02/2030 Reg S | NG | USD | 1,939,631 | 1,665,079 | 0.10 | 金融 | | | | | |
| Lebanon 6.75% 29/11/2027 (Defaulted) | LB | USD | 13,330,697 | 1,626,345 | 0.10 | Yapi ve Kredi Bank 13.875% VRN (Perpetual) Reg S | TR | USD | 12,762,773 | 13,774,223 | 0.81 |
| Zambia 14.00% 05/12/2031 | ZM | ZMW | 39,199,944 | 1,418,495 | 0.08 | Banco Nacional de Panama 7.50% 11/08/2030 Reg S | PA | USD | 15,055,718 | 11,114,327 | 0.66 |
| Kenya 8.25% 28/02/2048 Reg S | KE | USD | 1,648,686 | 1,269,010 | 0.08 | TBC Bank 10.75% VRN (Perpetual) Reg S | BR | USD | 6,788,709 | 6,618,991 | 0.39 |
| Lebanon 6.20% 26/02/2025 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 9,853,326 | 1,178,950 | 0.07 | TBC Bank 5.75% 19/04/2024 Reg S | GE | USD | 5,555,953 | 6,609,057 | 0.39 |
| El Salvador 7.625% 01/02/2041 Reg S | SV | USD | 2,841,172 | 1,097,262 | 0.06 | JSC Georgia Capital 6.125% 09/03/2024 Reg S | GE | USD | 6,749,916 | 6,564,294 | 0.39 |
| Ghana 7.875% 24/03/2029 Reg S | GH | USD | 7,506,321 | 1,088,424 | 0.06 | Rau Unibanc Hldg 4.625% VRN (Perpetual) Reg S | BR | USD | 6,982,672 | 6,042,246 | 0.36 |
| El Salvador 7.65% 15/06/2035 Reg S | SV | USD | 2,715,484 | 1,066,686 | 0.06 | Banco GNB Sudameris 7.50% VRN 16/04/2031 Reg S | CO | USD | 6,284,405 | 5,805,188 | 0.34 |
| El Salvador 7.125% 20/01/2050 Reg S | SV | USD | 2,715,484 | 997,967 | 0.06 | Stoneybank Cap. 10.00% 01/03/2027 Reg S (Defaulted) | CA | USD | 18,205,605 | 5,052,055 | 0.30 |
| Lebanon 6.85% 23/03/2027 (Defaulted) | LB | USD | 8,088,262 | 954,415 | 0.06 | Banco Merc. d Norte 6.625% VRN (Perpetual) Reg S | MX | USD | 3,413,571 | 3,060,428 | 0.18 |
| Lebanon 7.05% 02/11/2035 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 7,758,525 | 945,376 | 0.06 | Inversiones Atlantida 7.50% 19/05/2026 Reg S | HN | USD | 3,035,583 | 2,977,022 | 0.18 |
| Romania 3.375% 08/02/2037 Reg S | RO | EUR | 1,144,382 | 925,417 | 0.06 | Banco Do Brasil 9.00% VRN (Perpetual) Reg S | BR | USD | 2,327,357 | 2,376,948 | 0.14 |
| Lebanon 8.25% 17/05/2034 (Defaulted) | LB | USD | 7,758,525 | 908,446 | 0.05 | Sovcombank 7.60% VRN (Perpetual) Reg S | IE | USD | 13,715,192 | 1,234,187 | 0.07 |
| Venezuela 7.00% 31/03/2038 (Defaulted) | VE | USD | 9,310,230 | 796,025 | 0.05 | Alfa Bank 5.00% VRN 26/10/2031 Reg S | IE | USD | 6,691,727 | 535,338 | 0.03 |
| Lebanon 7.25% 23/03/2037 (Defaulted) | LB | USD | 6,381,387 | 770,552 | 0.05 | Tinkoff Bank 9.25% VRN (Perpetual) | IE | USD | 2,599,106 | 337,884 | 0.02 |
| Lebanon 7.15% 20/11/2031 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 5,818,893 | 705,541 | 0.04 | Tirekredit Cof. 0.00% VRN (Perpetual) Reg S | IE | USD | 2,056,009 | 215,881 | 0.01 |
| Lebanon 6.375% 09/05/2020 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 5,857,686 | 702,922 | 0.04 | | | | 72,318,669 | 4.28 | |
| Hungary 3.125% 21/09/2051 Reg S | HU | USD | 989,212 | 687,527 | 0.04 | 不動産 | | | | | |
| Lebanon 6.25% 12/06/2025 (Defaulted) | LB | USD | 5,178,115 | 634,405 | 0.04 | China SCE Group Holdings 5.95% 29/09/2024 | KY | USD | 785,163 | 488,842 | 0.03 |
| Lebanon 6.40% 26/05/2023 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 5,239,184 | 384,633 | 0.02 | | | | 488,842 | 0.03 | |
| Lebanon 6.65% 22/04/2024 (Defaulted) | LB | USD | 2,696,087 | 333,722 | 0.02 | 国債 | | | | | |
| Lebanon 6.15% 19/04/2020 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 2,715,484 | 332,647 | 0.02 | Ghana 19.25% 18/01/2027 | GH | GHS | 171,366,413 | 21,272,445 | 1.26 |
| Venezuela 9.00% 07/05/2023 (Defaulted) | VE | USD | 3,879,262 | 331,677 | 0.02 | Ethiopia 4.625% 11/12/2024 Reg S | ET | USD | 22,522,997 | 15,645,375 | 0.93 |
| Lebanon 6.10% 04/10/2022 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 2,211,180 | 270,770 | 0.02 | Philippine 3.229% 29/03/2027 | PH | USD | 11,540,805 | 11,231,022 | 0.66 |
| Lebanon 6.25% 14/11/2024 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 1,881,442 | 229,959 | 0.01 | Philippine 3.556% 29/09/2032 | PH | USD | 10,706,764 | 10,166,045 | 0.60 |
| Lebanon 8.25% 12/04/2021 Reg S (Defaulted) | LB | USD | 1,784,461 | 220,827 | 0.01 | Ukraine 8.994% 01/02/2024 Reg S | UA | USD | 22,848,855 | 8,370,221 | 0.50 |
| Lebanon 6.00% 27/01/2023 (Defaulted) | LB | USD | 1,668,083 | 204,340 | 0.01 | Armenia 5.60% 02/02/2031 Reg S | AM | USD | 11,114,087 | 8,313,726 | 0.49 |
| Argentina 0.500% 09/07/2029 | AR | EUR | 616,467 | 204,200 | 0.01 | Dominican Republic 4.00% 29/02/2033 Reg S | DO | USD | 1,652,233 | 4,981,193 | 0.25 |
| Lebanon 6.65% 03/11/2028 GMTN (Defaulted) | LB | USD | 1,221,968 | 146,375 | 0.01 | Colombia 5.00% 15/06/2045 | CO | USD | 9,310,230 | 6,971,127 | 0.41 |
| | | | | | | Dominican Republic 5.50% 22/02/2029 Reg S | DO | USD | 7,380,684 | 6,936,072 | 0.41 |
| | | | | | | Ukraine 7.375% 29/09/2032 Reg S | UA | USD | 19,047,178 | 6,155,286 | 0.36 |
| | | | | | | Philippine 4.20% 29/03/2047 | PH | USD | 6,536,557 | 6,050,024 | 0.34 |
| | | | | | | Ivory Coast 8.875% 17/10/2040 Reg S | CI | EUR | 5,663,723 | 5,053,888 | 0.30 |
| | | | | | | Romanian 3.625% 27/03/2032 Reg S | RO | EUR | 5,350,106 | 4,615,664 | 0.27 |
| | | | | | | Ghana 17.60% 20/02/2023 | GH | GHS | 32,370,116 | 4,271,683 | 0.25 |
| | | | | | | Ukraine 0.00% VRN 5/15/2040 Reg S | UA | USD | 1,489,045 | 4,255,867 | 0.25 |
| | | | | | | Armenia 3.95% 26/09/2029 Reg S | AM | USD | 4,385,566 | 3,528,771 | 0.21 |
| | | | | | | Iraq 6.752% 09/03/2023 Reg S | IQ | USD | 3,084,014 | 3,089,873 | 0.18 |
| | | | | | | Guatemala 3.70% 07/10/2033 Reg S | GT | USD | 3,122,806 | 2,700,834 | 0.16 |
| | | | | | | Ukraine 6.00% VRN 5/15/2040 Reg S | UA | USD | 5,818,893 | 2,596,394 | 0.14 |
| | | | | | | Pakistan 6.875% 05/12/2027 Reg S | PK | USD | 2,599,106 | 2,134,335 | 0.13 |
| | | | | | | Belarus 6.20% 28/02/2 | | | | | |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額面価値 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | 契約額等USD | 未実現 (損益) (米ドル) | % Net Assets |
|--|------|-----|---------------|----------------------|---------------|------------|----------------|--------------|
| Russia 6.90% 23/07/2031* | RU | RUB | 3,103,409,853 | 439 | 0.00 | | | |
| | | | | 146,987,525 | 8.70 | | | |
| 非上場 | | | | | | | | |
| 素材 | | | | | | | | |
| Pearl Holding II 6.00% (Perpetual) Reg S | KY | USD | 481,250 | 21,656 | 0.00 | | | |
| Sino Forest 0.00% 28/07/2014 (Defaulted) | CA | USD | 512,063 | 5 | 0.00 | | | |
| | | | | 21,661 | 0.00 | | | |
| その他 | | | | | (5) | (0.00) | | |
| 投資資産合計 (取得価額 USD 2,299,884,537) | | | | 1,627,347,307 | 96.27 | | | |
| | | | 契約額等 | 未実現 (損益) (米ドル) | % Net Assets | | | |
| | | 通貨 | | | | | | |
| クレジット+デフォルト+スワップ | | | | | | | | |
| Bought protection on CDX EM CDSI 537 5 Year 20/06/2027 | USD | | 107,945,905 | 8,437,226 | 0.50 | | | |
| Bought protection on CDX NA HY S38 5 Year 20/06/2027 | USD | | 178,252,103 | (3,239,429) | (0.19) | | | |
| Sold protection on Turkey 11.875% 20/12/2026 | USD | | 33,749,582 | (6,326,552) | (0.37) | | | |
| | | | | (1,128,955) | (0.07) | | | |
| | | | 契約額等USD | 未実現 (損益) (米ドル) | % Net Assets | | | |
| 外国為替先物取引 | | | | | | | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.146658 18/05/2022 | | | 132,090,239 | 11,549,645 | 0.68 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 90.100000 18/05/2022 | | | 51,527,941 | 7,528,571 | 0.41 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 118.700000 18/05/2022 | | | 10,980,894 | 6,962,128 | 0.41 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 109.500000 18/05/2022 | | | 11,265,803 | 5,715,986 | 0.34 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 108.500000 18/05/2022 | | | 7,579,757 | 3,742,456 | 0.22 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.003201 18/05/2022 | | | 19,517,462 | 2,942,707 | 0.17 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.056035 18/05/2022 | | | 47,669,042 | 2,847,757 | 0.17 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 118.000000 18/05/2022 | | | 3,682,012 | 2,298,996 | 0.14 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 117.000000 18/05/2022 | | | 3,713,482 | 2,267,525 | 0.15 | | | |
| Bought RUB Sold TWD at 0.065480 18/05/2022 | | | 29,973,061 | 1,038,128 | 0.06 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.003109 11/05/2022 | | | 10,795,134 | 1,272,862 | 0.08 | | | |
| Bought USD Sold PLN at 0.250065 11/05/2022 | | | 10,915,813 | 1,205,378 | 0.07 | | | |
| Bought USD Sold ILS at 0.312280 18/05/2022 | | | 26,847,633 | 1,042,109 | 0.06 | | | |
| Bought USD Sold CNY at 0.154780 18/05/2022 | | | 29,973,061 | 1,038,128 | 0.06 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.056389 11/05/2022 | | | 11,068,652 | 789,044 | 0.05 | | | |
| Bought BRL Sold USD at 0.186800 18/05/2022 | | | 12,133,951 | 564,563 | 0.03 | | | |
| Bought USD Sold PLN at 0.248327 11/05/2022 | | | 5,254,008 | 539,622 | 0.03 | | | |
| Bought USD Sold ZAR at 0.065480 18/05/2022 | | | 17,159,371 | 496,388 | 0.03 | | | |
| Bought BRL Sold USD at 0.422300 11/05/2022 | | | 4,908,405 | 474,182 | 0.03 | | | |
| Bought USD Sold CLP at 0.001276 11/05/2022 | | | 5,269,838 | 456,755 | 0.03 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.002869 18/05/2022 | | | 12,533,834 | 490,191 | 0.02 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 108.000000 11/05/2022 | | | 733,023 | 370,587 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold MYR at 0.238749 11/05/2022 | | | 9,172,547 | 340,163 | 0.02 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 0.772800 11/05/2022 | | | 4,615,542 | 355,912 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold ILS at 0.310834 18/05/2022 | | | 9,680,467 | 329,179 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.035705 11/05/2022 | | | 6,409,605 | 327,813 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold KRW at 0.020835 11/05/2022 | | | 6,236,422 | 323,531 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold KRW at 0.000834 11/05/2022 | | | 6,442,833 | 319,953 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold PLN at 0.243654 11/05/2022 | | | 3,783,214 | 310,060 | 0.02 | | | |
| Bought RUB Sold USD at 0.786500 11/05/2022 | | | 3,116,165 | 299,813 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold KRW at 0.020835 11/05/2022 | | | 5,901,134 | 292,644 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold PHP at 0.019973 18/05/2022 | | | 18,451,326 | 275,370 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold KRW at 0.000283 11/05/2022 | | | 7,785,708 | 275,020 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold CLP at 0.001277 11/05/2022 | | | 5,727,955 | 261,439 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold ILS at 0.310145 11/05/2022 | | | 8,111,771 | 240,584 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold MXN at 0.050146 11/05/2022 | | | 11,233,529 | 258,109 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold COP at 0.000263 11/05/2022 | | | 5,652,410 | 256,255 | 0.02 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.036117 11/05/2022 | | | 3,702,308 | 234,258 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.002948 18/05/2022 | | | 9,051,715 | 217,819 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold EUR at 0.126448 18/05/2022 | | | 3,348,437 | 216,978 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.002899 18/05/2022 | | | 4,878,149 | 212,159 | 0.01 | | | |
| Bought BRL Sold USD at 0.531600 11/05/2022 | | | 2,814,144 | 211,365 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold THB at 0.027995 11/05/2022 | | | 9,478,419 | 193,072 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold EUR at 0.105658 18/05/2022 | | | 3,786,115 | 187,145 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold HUF at 0.002952 11/05/2022 | | | 2,779,692 | 171,281 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.035836 18/05/2022 | | | 3,168,694 | 170,812 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold INR at 0.013164 18/05/2022 | | | 18,566,629 | 159,740 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold ZAR at 0.068548 11/05/2022 | | | 1,898,706 | 156,085 | 0.01 | | | |
| Bought BRL Sold USD at 0.239107 18/05/2022 | | | 2,685,292 | 153,280 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold THB at 0.030374 11/05/2022 | | | 3,785,402 | 152,123 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold TWD at 0.036173 11/05/2022 | | | 2,247,554 | 145,928 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold ZAR at 0.064502 11/05/2022 | | | 7,596,691 | 139,164 | 0.01 | | | |
| Bought TRY Sold USD at 0.1542350 11/05/2022 | | | 3,223,539 | 133,871 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold EUR at 0.110720 18/05/2022 | | | 2,664,515 | 132,871 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold ZAR at 0.065448 11/05/2022 | | | 3,971,478 | 132,096 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold THB at 0.027980 11/05/2022 | | | 6,059,216 | 126,281 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold CNY at 0.151446 18/05/2022 | | | 17,479,471 | 120,265 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold INR at 0.013122 18/05/2022 | | | 18,680,536 | 101,259 | 0.01 | | | |
| Bought USD Sold IDR at 0.000069 11/05/2022 | | | | | | 18,720,082 | 99,834 | 0.01 |
| Bought USD Sold BRL at 0.208860 11/05/2022 | | | | | | 3,008,876 | 98,488 | 0.01 |
| Bought USD Sold INR at 0.013187 11/05/2022 | | | | | | 15,931,982 | 95,092 | 0.01 |
| Bought MXN Sold USD at 0.20.763200 11/05/2022 | | | | | | 5,114,494 | 93,908 | 0.01 |
| Bought USD Sold ILS at 0.309248 18/05/2022 | | | | | | 3,185,463 | 91,513 | 0.01 |
| Bought USD Sold PLN at 0.250044 11/05/2022 | | | | | | 808,605 | 89,215 | 0.01 |
| Bought USD Sold TRY at 0.069622 11/05/2022 | | | | | | 2,162,048 | 87,035 | 0.01 |
| Bought MXN Sold USD at 0.20.976699 18/05/2022 | | | | | | 7,818,848 | 77,055 | 0.01 |
| Bought USD Sold MXN at 0.050166 11/05/2022 | | | | | | 3,243,164 | 74,000 | 0.00 |
| Bought USD Sold HUF at 0.002961 11/05/2022 | | | | | | 1,068,639 | 69,086 | 0.01 |
| Bought USD Sold COP at 0.000253 18/05/2022 | | | | | | 22,427,588 | 68,239 | 0.00 |
| Bought MXN Sold USD at 0.20.969070 11/05/2022 | | | | | | 2,362,265 | 67,230 | 0.00 |
| Bought USD Sold PHP at 0.019322 11/05/2022 | | | | | | 6,189,211 | 65,489 | 0.01 |
| Bought COP Sold USD at 4006.250001 11/05/2022 | | | | | | 6,694,739 | 65,443 | 0.00 |
| Bought USD Sold MYR at 0.237671 11/05/2022 | | | | | | 1,847,588 | 65,877 | 0.00 |
| Bought USD Sold INR at 0.013187 11/05/2022 | | | | | | 5,760,123 | 62,600 | 0.00 |
| Bought MXN Sold USD at 0.20.857121 18/05/2022 | | | | | | 3,024,642 | 62,205 | 0.00 |
| Bought USD Sold PHP at 0.019224 11/05/2022 | | | | | | 10,955,688 | 59,947 | 0.00 |
| Bought USD Sold IDR at 0.000070 11/05/2022 | | | | | | 5,180,850 | 59,826 | 0.00 |
| Bought USD Sold INR at 0.013187 11/05/2022 | | | | | | 6,003,991 | 55,987 | 0.00 |
| Bought USD Sold PLN at 0.266461 11/05/2022 | | | | | | 2,283,352 | 55,421 | 0.00 |
| Bought USD Sold CLP at 0.001192 11/05/2022 | | | | | | 3,461,582 | 54,471 | 0.00 |
| Bought MXN Sold USD at 0.20.677200 11/05/2022 | | | | | | 3,775,070 | 52,530 | 0.00 |
| Bought COP Sold USD at 4016.999999 11/05/2022 | | | | | | 3,865,003 | 48,254 | 0.00 |
| Bought USD Sold ZAR at 0.063715 11/05/2022 | | | | | | 8,100,116 | 47,744 | 0.00 |
| Bought USD Sold THB at 0.030103 11/05/2022 | | | | | | 1,497,462 | 46,326 | 0.00 |
| Bought PHP Sold USD at 52.737000 11/05/2022 | | | | | | 5,422,810 | 45,618 | 0.00 |
| Bought ZAR Sold USD at 15.962600 18/05/2022 | | | | | | 4,240,879 | 45,465 | 0.00 |
| Bought USD Sold CLP at 0.001282 11/05/2022 | | | | | | 417,390 | 39,303 | 0.00 |
| Bought USD Sold KRW at 0.000797 11/05/2022 | | | | | | 11,422,875 | 31,747 | 0.00 |
| Bought USD Sold MYR at 0.239120 11/05/2022 | | | | | | 717,041 | 29,314 | 0.00 |
| Bought RUB Sold USD at 76.963606 11/05/2022 | | | | | | 239,600 | 17,421 | 0.00 |
| Bought USD Sold COP at 0.000269 11/05/2022 | | | | | | 405,748 | 17,395 | 0.00 |
| Bought USD Sold HUF at 0.002099 11/05/2022 | | | | | | 370,975 | 17,041 | 0.00 |
| Bought USD Sold ZAR at 0.067295 11/05/2022 | | | | | | 194,313 | 14,061 | 0.00 |
| Bought USD Sold MYR at 0.238186 11/05/2022 | | | | | | 381,424 | 14,042 | 0.00 |
| Bought USD Sold TWD at 0.034350 11/05/2022 | | | | | | 1,164,204 | 12,419 | 0.00 |
| Bought COP Sold USD at 3988.800004 18/05/2022 | | | | | | 2,958,012 | 12,024 | 0.00 |
| Bought USD Sold INR at 0.015090 11/05/2022 | | | | | | 6,324,369 | 11,765 | 0.00 |
| Bought USD Sold COP at 0.000260 11/05/2022 | | | | | | 380,499 | 11,742 | 0.00 |
| Bought USD Sold COP at 0.000261 11/05/2022 | | | | | | 279,758 | 10,302 | 0.00 |
| Bought RUB Sold USD at 77.495265 11/05/2022 | | | | | | 128,008 | 10,256 | 0.00 |
| Bought CLP Sold USD at 853.160000 11/05/2022 | | | | | | 4,902,493 | 7,265 | 0.00 |
| Bought USD Sold COP at 0.000253 11/05/2022 | | | | | | 2,101,504 | 6,891 | 0.00 |
| Bought INR Sold USD at 76.700000 11/05/2022 | | | | | | 3,146,805 | 6,697 | 0.00 |
| Bought USD Sold ILS at 0.313205 11/05/2022 | | | | | | 123,330 | 4,843 | 0.00 |
| Bought USD Sold PEN at 0.263904 11/05/2022 | | | | | | 315,065 | 4,551 | 0.00 |
| Bought USD Sold PEN at 0.261131 11/05/2022 | | | | | | 1,117,966 | 4,230 | 0.00 |
| Bought USD Sold COP at 0.000254 11/05/2022 | | | | | | | | |

| | 契約額等USD | 未実現(損 % Net)益(米下 Assets ル) |
|---|-------------------|-----------------------------------|
| Bought USD Solid MGN at 0.047694 11/05/2022 | 2,304,706 | (63,541) (0.00) |
| Bought HUF Solid USD at 312.426098 11/05/2022 | 525,246 | (68,888) (0.00) |
| Bought USD Solid INR at 0.015621 11/05/2022 | 5,272,481 | (57,238) (0.00) |
| Bought IDR Solid USD at 14328.500005 11/05/2022 | 5,816,712 | (76,675) (0.00) |
| Bought TRY Solid USD at 14.333500 11/05/2022 | 2,253,807 | (91,759) (0.01) |
| Bought KRW Solid USD at 1231.420001 11/05/2022 | 4,566,409 | (94,759) (0.01) |
| Bought IDR Solid USD at 14378.400002 11/05/2022 | 9,899,924 | (96,477) (0.01) |
| Bought INR Solid USD at 0.016300 11/05/2022 | 13,295,857 | (83,729) (0.01) |
| Bought PHP Solid USD at 51.564000 11/05/2022 | 7,656,661 | (108,129) (0.01) |
| Bought CLP Solid USD at 820.100000 11/05/2022 | 2,930,656 | (109,389) (0.01) |
| Bought USD Solid TRY at 0.064645 11/05/2022 | 3,357,410 | (114,418) (0.01) |
| Bought THB Solid USD at 32.650000 11/05/2022 | 2,497,240 | (115,334) (0.01) |
| Bought CLP Solid USD at 809.299999 11/05/2022 | 2,589,033 | (129,460) (0.01) |
| Bought PEN Solid USD at 3.740900 11/05/2022 | 4,856,415 | (130,240) (0.01) |
| Bought USD Solid BRL at 0.179656 11/05/2022 | 1,207,097 | (134,797) (0.01) |
| Bought MYR Solid USD at 4.202500 11/05/2022 | 3,908,524 | (135,104) (0.01) |
| Bought INR Solid USD at 75.600000 11/05/2022 | 11,427,086 | (139,912) (0.01) |
| Bought ZAR Solid USD at 15.386179 11/05/2022 | 5,624,184 | (142,971) (0.01) |
| Bought COP Solid USD at 3752.999997 18/05/2022 | 2,729,791 | (150,738) (0.01) |
| Bought USD Solid BRL at 0.193502 11/05/2022 | 3,545,602 | (152,826) (0.01) |
| Bought IDR Solid USD at 14372.516996 11/05/2022 | 15,300,971 | (155,311) (0.01) |
| Bought TWD Solid USD at 28.051000 18/05/2022 | 3,397,394 | (156,865) (0.01) |
| Bought TWD Solid USD at 27.993932 18/05/2022 | 3,665,964 | (176,444) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.921324 18/05/2022 | 6,221,482 | (177,443) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897989 18/05/2022 | 3,080,857 | (179,914) (0.01) |
| Bought KRW Solid USD at 1194.020000 11/05/2022 | 3,610,573 | (182,307) (0.01) |
| Bought BRL Solid USD at 4.655400 11/05/2022 | 3,214,803 | (188,039) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.895081 18/05/2022 | 3,227,357 | (188,157) (0.01) |
| Bought ZAR Solid USD at 14.603377 18/05/2022 | 2,695,783 | (204,272) (0.01) |
| Bought ILS Solid USD at 3.174480 11/05/2022 | 4,586,222 | (211,401) (0.01) |
| Bought THB Solid USD at 32.298000 11/05/2022 | 3,815,869 | (217,126) (0.01) |
| Bought COP Solid USD at 3780.286998 11/05/2022 | 4,740,527 | (223,652) (0.01) |
| Bought USD Solid EUR at 0.927000 11/05/2022 | 5,137,001 | (224,424) (0.01) |
| Bought PLN Solid USD at 4.255600 11/05/2022 | 5,749,250 | (229,451) (0.01) |
| Bought KRW Solid USD at 1204.430000 11/05/2022 | 5,850,452 | (246,973) (0.01) |
| Bought USD Solid BRL at 0.189914 11/05/2022 | 4,012,933 | (262,427) (0.02) |
| Bought ILS Solid USD at 3.216600 11/05/2022 | 8,924,016 | (298,403) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897330 18/05/2022 | 5,091,336 | (299,790) (0.02) |
| Bought HUF Solid USD at 319.003500 11/05/2022 | 2,673,991 | (301,791) (0.02) |
| Bought ZAR Solid USD at 14.611050 11/05/2022 | 4,412,058 | (328,779) (0.02) |
| Bought ZAR Solid USD at 14.968000 11/05/2022 | 6,761,289 | (350,970) (0.02) |
| Bought CLP Solid USD at 820.7500 18/05/2022 | 7,125,496 | (457,165) (0.03) |
| Bought TWD Solid USD at 27.717000 11/05/2022 | 7,985,539 | (467,339) (0.03) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012171 11/05/2022 | 3,895,609 | (493,475) (0.03) |
| Bought MYR Solid USD at 4.187000 11/05/2022 | 13,796,536 | (526,023) (0.03) |
| Bought USD Solid RUB at 0.013566 18/05/2022 | 10,712,807 | (545,792) (0.03) |
| Bought KRW Solid USD at 1198.780000 11/05/2022 | 12,223,716 | (570,938) (0.03) |
| Bought TWD Solid USD at 28.569500 11/05/2022 | 20,563,437 | (607,976) (0.04) |
| Bought USD Solid MGN at 0.048090 11/05/2022 | 33,876,274 | (680,293) (0.04) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012303 18/05/2022 | 5,990,518 | (701,195) (0.04) |
| Bought USD Solid RUB at 0.011223 18/05/2022 | 4,540,460 | (801,702) (0.05) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012964 18/05/2022 | 20,347,590 | (1,189,838) (0.07) |
| Bought HUF Solid USD at 311.773000 11/05/2022 | 10,420,875 | (1,385,659) (0.08) |
| Bought ILS Solid USD at 3.211923 18/05/2022 | 41,150,834 | (1,417,271) (0.08) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012822 18/05/2022 | 21,028,848 | (1,441,505) (0.09) |
| Bought PLN Solid USD at 4.095920 11/05/2022 | 18,817,063 | (1,460,367) (0.09) |
| Bought TWD Solid USD at 28.420000 18/05/2022 | 45,729,569 | (1,527,621) (0.09) |
| Bought HUF Solid USD at 331.650000 18/05/2022 | 20,966,030 | (1,648,370) (0.10) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012497 18/05/2022 | 47,646,697 | (1,671,750) (0.10) |
| Bought USD Solid RUB at 0.013076 18/05/2022 | 36,639,160 | (1,837,123) (0.11) |
| Bought USD Solid RUB at 0.012145 18/05/2022 | 21,648,342 | (2,549,519) (0.15) |
| Bought USD Solid BRL at 0.187917 18/05/2022 | 38,633,888 | (2,652,063) (0.16) |
| Bought USD Solid RUB at 0.010838 18/05/2022 | 20,703,780 | (4,483,922) (0.26) |
| | 29,974,603 | 1.17 |

A Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.060524 06/05/2022 | 12,130,564 | 76,386 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.106680 06/05/2022 | 524,309 | 26,264 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.111464 06/05/2022 | 4,452,329 | 24,798 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.097828 06/05/2022 | 671,116 | 24,797 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.101160 06/05/2022 | 476,673 | 21,581 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.091152 06/05/2022 | 593,866 | 20,998 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.089585 06/05/2022 | 602,613 | 20,412 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.087501 06/05/2022 | 629,593 | 20,014 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.084860 06/05/2022 | 665,425 | 19,556 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.091190 06/05/2022 | 462,446 | 16,368 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.087480 06/05/2022 | 444,741 | 14,176 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.082752 06/05/2022 | 300,674 | 8,229 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.073800 06/05/2022 | 311,740 | 5,890 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.068451 06/05/2022 | 316,061 | 4,367 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.058058 07/06/2022 | 249,717 | 620 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.055785 07/06/2022 | 610,149 | (956) (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.9142 07/06/2022 | 12,224,042 | (75,628) (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897719 06/05/2022 | 19,640,888 | (1,058,740) (0.06) |
| | (831,068) | (0.05) |

A-ACC Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|--------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.060573 06/05/2022 | 52,325,419 | 331,925 (0.02) |
| Bought USD Solid EUR at 1.087389 06/05/2022 | 1,250,859 | 39,763 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.084860 06/05/2022 | 1,222,721 | 35,954 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.914573 07/06/2022 | 52,257,100 | (325,410) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897831 06/05/2022 | 57,914,040 | (3,115,942) (0.18) |
| | (3,052,830) | (0.18) |

A-ACC Shares (HUF) (hedged)

| | | |
|---|-----------|--------------|
| Bought USD Solid HUF at 0.002788 04/05/2022 | 2,192,355 | 3,899 (0.00) |
|---|-----------|--------------|

| | 契約額等USD | 未実現(損 % Net)益(米下 Assets ル) |
|---|------------------|-----------------------------------|
| Bought USD Solid HUF at 0.002891 06/05/2022 | 44,900 | 1,746 (0.00) |
| Bought HUF Solid USD at 360.273101 07/06/2022 | 2,180,613 | (4,536) (0.00) |
| Bought USD Solid HUF at 331.151400 06/05/2022 | 2,403,994 | (18,063) (0.00) |
| Bought HUF Solid USD at 331.691600 06/05/2022 | 2,183,613 | (167,889) (0.01) |
| | (185,463) | (0.01) |

A-ACC Shares (SEK) (hedged)

| | | |
|---|------------------|------------------|
| Bought SEK Solid USD at 0.829947 07/06/2022 | 2,110,550 | 6,740 (0.00) |
| Bought USD Solid SEK at 0.576758 06/05/2022 | 80,299 | 2,965 (0.00) |
| Bought USD Solid SEK at 0.108970 06/05/2022 | 53,584 | 2,086 (0.00) |
| Bought USD Solid SEK at 0.101640 06/05/2022 | 2,142,139 | (6,885) (0.00) |
| Bought SEK Solid USD at 0.927949 06/05/2022 | 2,405,429 | (129,407) (0.01) |
| | (124,481) | (0.01) |

A-HMDIST (G) Shares (PLN) (hedged)

| | | |
|---|------------------|------------------|
| Bought USD Solid PLN at 0.234423 04/05/2022 | 231,462 | 9,314 (0.00) |
| Bought PLN Solid USD at 4.459992 07/06/2022 | 7,961,265 | 4,090 (0.00) |
| Bought PLN Solid USD at 4.331820 04/05/2022 | 167,158 | (3,979) (0.00) |
| Bought USD Solid PLN at 0.225116 06/05/2022 | 8,042,880 | (8,515) (0.00) |
| Bought PLN Solid USD at 4.193137 04/05/2022 | 8,585,765 | (472,603) (0.03) |
| | (471,693) | (0.03) |

A-MDIST Shares (AUD) (hedged)

| | | |
|---|------------------|------------------|
| Bought USD Solid AUD at 0.715436 06/05/2022 | 2,602,824 | 19,965 (0.00) |
| Bought USD Solid AUD at 0.743860 06/05/2022 | 89,530 | 2,271 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.914617 07/06/2022 | 1,923,233 | (19,323) (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.838765 06/05/2022 | 2,834,891 | (142,536) (0.01) |
| | (137,623) | (0.01) |

E-ACC Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|-----------------|-----------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.060524 06/05/2022 | 468,453 | 2,950 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.087389 06/05/2022 | 10,750 | 342 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.914617 07/06/2022 | 466,647 | (2,887) (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.898041 06/05/2022 | 506,325 | (27,122) (0.00) |
| | (26,717) | (0.00) |

E-MDIST Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|--------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.061464 06/05/2022 | 35,634,894 | 255,168 (0.02) |
| Bought USD Solid EUR at 1.087389 06/05/2022 | 1,070,328 | 54,024 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.910350 06/05/2022 | 831,329 | (33,747) (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.940809 07/06/2022 | 35,639,334 | (250,692) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897751 06/05/2022 | 37,952,158 | (2,046,518) (0.12) |
| | (2,039,765) | (0.12) |

I-ACC Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|--------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.060563 06/05/2022 | 90,681,556 | 574,375 (0.03) |
| Bought USD Solid EUR at 1.088152 06/05/2022 | 17,275,854 | 361,678 (0.03) |
| Bought USD Solid EUR at 1.088545 06/05/2022 | 7,146,518 | 216,706 (0.01) |
| Bought USD Solid EUR at 1.082409 06/05/2022 | 6,282,088 | 61,760 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.068451 06/05/2022 | 2,027,727 | 27,951 (0.00) |
| Bought USD Solid EUR at 1.056380 07/06/2022 | 5,317,510 | 4,743 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.919557 06/05/2022 | 4,115,611 | (127,070) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.916451 06/05/2022 | 4,147,941 | (141,797) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.908848 06/05/2022 | 5,848,375 | (246,341) (0.01) |
| Bought EUR Solid USD at 0.915628 06/05/2022 | 7,529,473 | (265,760) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.914771 06/05/2022 | 8,465,618 | (304,206) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.904781 06/05/2022 | 7,665,282 | (356,149) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.914375 07/06/2022 | 97,384,052 | (549,057) (0.03) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897847 06/05/2022 | 87,798,907 | (4,720,940) (0.28) |
| | (5,282,307) | (0.31) |

X-ACC Shares (GBP) (GBP/USD hedged)

| | | |
|---|------------------|------------------|
| Bought USD Solid GBP at 1.301620 06/05/2022 | 180,706 | 6,467 (0.00) |
| Bought GBP Solid USD at 0.779610 07/06/2022 | 9,263,807 | 3,906 (0.00) |
| Bought USD Solid GBP at 1.256116 06/05/2022 | 9,194,264 | (3,892) (0.00) |
| Bought GBP Solid USD at 0.761146 06/05/2022 | 9,801,403 | (426,433) (0.03) |
| | (419,952) | (0.02) |

Y-ACC Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|--------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.061024 06/05/2022 | 66,248,329 | 471,864 (0.03) |
| Bought USD Solid EUR at 1.091190 04/05/2022 | 3,327,754 | 46,818 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.940844 07/06/2022 | 65,841,824 | (460,681) (0.02) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897791 06/05/2022 | 71,415,312 | (3,844,248) (0.23) |
| | (3,786,245) | (0.22) |

Y-QDIST Shares (EUR) (hedged)

| | | |
|---|--------------------|--------------------|
| Bought USD Solid EUR at 1.061724 04/05/2022 | 112,030,159 | 832,971 (0.05) |
| Bought EUR Solid USD at 1.087389 06/05/2022 | 2,315,918 | 75,619 (0.00) |
| Bought EUR Solid USD at 0.940551 07/06/2022 | 111,389,858 | (813,889) (0.05) |
| Bought EUR Solid USD at 0.897817 06/05/2022 | 120,840,672 | (6,494,595) (0.38) |
| | (6,401,894) | (0.38) |

| 通貨 | 契約額等 | 未実現(損 % Net)益(米下 Assets ル) |
|-----|-------------|-----------------------------------|
| EUR | 100,335,397 | 7,905,904 (0.47) |
| USD | 100,502,542 | 1,449,433 (0.09) |

先物取引

| | | | |
|---|-----|-------------|------------------|
| Euro-Bund Bond Future 09/06/2022 | EUR | 100,335,397 | 7,905,904 (0.47) |
| US 10 Year Ultra Bond Future 07/06/2022 | USD | 100,502,542 | 1,449,433 (0.09) |

| | 契約額等 | 未実現(損 % Net) 益 (米ドル) | % Assets |
|--|-----------------|-----------------------------|----------------------|
| 通貨 | | | |
| US Treasury 20 Year Bond Future 21/06/2022 | USD (8,827,625) | 710,033 | 0.04 |
| Euro-Robl Bond Future 08/06/2022 | EUR (2,861,515) | 127,792 | 0.01 |
| US Treasury Note 2 Year Bond Future 30/06/2022 | USD 40,547,696 | (572,249) | (0.03) |
| Euro-Buxl 30Y Bond Future 08/06/2022 | EUR 4,775,589 | (875,895) | (0.05) |
| US Treasury 10 Year Bond Future 21/06/2022 | USD 60,835,135 | (1,103,071) | (0.07) |
| US Treasury Note 5 Year Bond Future 30/06/2022 | USD 69,176,457 | (2,444,636) | (0.14) |
| US Ultra Bond Future 21/06/2022 | USD 244,452,079 | (34,368,602) | (2.03) |
| | | <u>(29,171,291)</u> | <u>(1.73)</u> |
| その他資産 (負債控除後) | | 86,124,043 | 5.12 |
| Net Assets | | <u><u>1,690,405,669</u></u> | <u><u>100.00</u></u> |

フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド (適格機関投資家専用)の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|--|
| 設 定 形 態 | 国内証券投資信託 |
| 運 用 方 針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り社債(ハイ・イールド債券)を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的に積極的な運用を行うことを基本とします。 |
| 主 な 投 資 対 象 | フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> ●公社債の実質投資割合には、制限を設けません。 ●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ●新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ●同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ●同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ●同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ●マザーファンド受益証券以外への投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 |
| 決 算 日 | 毎月22日 |
| 分 配 方 針 | <ul style="list-style-type: none"> ●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ●収益分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

■ 損益の状況

第194期 自2022年5月24日 至2022年6月22日 第197期 自2022年8月23日 至2022年9月22日
 第195期 自2022年6月23日 至2022年7月22日 第198期 自2022年9月23日 至2022年10月24日
 第196期 自2022年7月23日 至2022年8月22日 第199期 自2022年10月25日 至2022年11月22日

| 項 目 | 第194期 | 第195期 | 第196期 | 第197期 | 第198期 | 第199期 |
|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| (A) 有価証券売買損益 | 681,254,625円 | 368,090,371円 | 439,592,583円 | 407,268,512円 | 99,017,248円 | △224,298,361円 |
| 売 買 益 | 681,342,664 | 368,528,540 | 439,604,455 | 407,443,127 | 100,770,893 | 36,895 |
| 売 買 損 | △88,039 | △438,169 | △11,872 | △174,615 | △1,753,645 | △224,335,256 |
| (B) 信託報酬等 | △10,959,549 | △10,942,425 | △11,598,082 | △11,783,547 | △12,136,325 | △13,526,801 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 670,295,076 | 357,147,946 | 427,994,501 | 395,484,965 | 86,880,923 | △237,825,162 |
| (D) 前期繰越損益金 | △71,305,201 | 517,986,830 | 796,006,847 | 1,127,711,300 | 1,441,364,548 | 1,450,322,751 |
| (E) 追加信託差損益金 | △4,571,557,441 | △4,571,557,441 | △4,571,250,049 | △4,502,493,728 | △4,496,091,451 | △4,495,615,000 |
| (配当等相当額) | (4,003,714) | (4,003,714) | (4,003,445) | (3,943,230) | (3,937,623) | (3,937,206) |
| (売買損益相当額) | (△4,575,561,155) | (△4,575,561,155) | (△4,575,253,494) | (△4,506,436,958) | (△4,500,029,074) | (△4,499,552,206) |
| (F) 合 計(C+D+E) | △3,972,567,566 | △3,696,422,665 | △3,347,248,701 | △2,979,297,463 | △2,967,845,980 | △3,283,117,411 |
| (G) 収益分配金 | △81,003,045 | △79,074,402 | △79,069,084 | △79,779,264 | △77,769,013 | △77,760,771 |
| 次期繰越損益金(F+G) | △4,053,570,611 | △3,775,497,067 | △3,426,317,785 | △3,059,076,727 | △3,045,614,993 | △3,360,878,182 |
| 追加信託差損益金 | △4,571,557,441 | △4,571,557,441 | △4,571,250,049 | △4,502,493,728 | △4,496,091,451 | △4,495,615,000 |
| (配当等相当額) | (4,003,714) | (4,003,714) | (4,003,445) | (3,943,230) | (3,937,623) | (3,937,206) |
| (売買損益相当額) | (△4,575,561,155) | (△4,575,561,155) | (△4,575,253,494) | (△4,506,436,958) | (△4,500,029,074) | (△4,499,552,206) |
| 分配準備積立金 | 715,660,236 | 796,060,374 | 1,144,932,264 | 1,443,417,001 | 1,450,476,458 | 1,459,476,427 |
| 繰越損益金 | △197,673,406 | — | — | — | — | △324,739,609 |

(注1) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E) 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4) 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する費用として、純資産総額に対して年0.33%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 第194期 | 第195期 | 第196期 | 第197期 | 第198期 | 第199期 |
|------------------------------|--------------|--------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 79,597,821円 | 73,436,627円 | 76,583,542円 | 78,796,217円 | 73,574,747円 | 86,914,447円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 | 86,037,913円 | 351,410,959円 | 316,688,748円 | 13,306,176円 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 4,003,714円 | 4,003,714円 | 4,003,445円 | 3,943,230円 | 3,937,623円 | 3,937,206円 |
| (d) 分配準備積立金 | 717,065,460円 | 715,660,236円 | 796,006,847円 | 1,127,711,300円 | 1,441,364,548円 | 1,450,322,751円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 800,666,995円 | 879,138,490円 | 1,228,004,793円 | 1,527,139,495円 | 1,532,183,094円 | 1,541,174,404円 |
| 1万円当たり分配可能額 | 415.15円 | 455.83円 | 636.76円 | 803.97円 | 807.77円 | 812.60円 |
| (f) 分配金額 | 81,003,045円 | 79,074,402円 | 79,069,084円 | 79,779,264円 | 77,769,013円 | 77,760,771円 |
| 1万円当たり分配金額(税引前) | 42円 | 41円 | 41円 | 42円 | 41円 | 41円 |

■ 組入資産の明細 (2022年11月22日現在)

● 親投資信託残高

| | 第 193 期 末 | 第 199 期 末 | |
|--------------------------|-----------------|-----------------|------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド | 千口 3,449,808 | 千口 3,274,930 | 千円 15,596,531 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

<フィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・USハイ・イールド・ファンド(適格機関投資家専用)の主たる投資対象であるフィデリティ・USハイ・イールド・マザーファンドの情報を掲載いたします。

■組入資産の明細 (2022年11月22日現在)

(1) 外国株式

上場、登録株式

| 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 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ・・・NASDAQ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC A | 111.85 | 111.85 | 4,127 | 586,484 | メディア・娯楽 | |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 3,039.45 | 2,013.32 | 19,746 | 2,805,997 | エネルギー | |
| FRONTIER COMMS PARENT INC | 1,629.41 | 1,629.41 | 3,957 | 562,408 | 電気通信サービス | |
| NORTHEAST GROCERY INC PP | 15,955.32 | 15,955.32 | 1,771 | 251,664 | 食品・生活必需品小売り | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 2,069.98 | 2,069.98 | 10,053 | 1,428,658 | 消費者サービス | |
| (アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所) | | | | | | |
| NRG ENERGY INC | 942 | — | — | — | 公益事業 | |
| SFL CORP LTD | 742.6 | 742.6 | 733 | 104,257 | エネルギー | |
| VISTRA CORP | 9,470.3 | 4,869.3 | 11,140 | 1,583,130 | 公益事業 | |
| DENBURY INC | 2,024.68 | 2,024.68 | 18,199 | 2,586,198 | エネルギー | |
| CALIFORNIA RES CORP | 4,812.29 | 4,812.29 | 21,385 | 3,038,924 | エネルギー | |
| VALARIS LTD | 846.83 | 846.83 | 5,383 | 764,966 | エネルギー | |
| NOBLE CORPORATION | 179.08 | — | — | — | エネルギー | |
| SOUTHEASTERN GROCERS INC | 10,482.76 | 10,482.76 | 22,674 | 3,222,005 | 小売 | |
| PG&E CORP 5.5% PC 08/16/23 | 1,416 | 1,416 | 18,938 | 2,691,191 | エネルギー | |
| NOBLE CORPORATION 144A | 35.88 | — | — | — | エネルギー | |
| NOBLE CORP PLC | — | 214.96 | 794 | 112,958 | エネルギー | |
| (アメリカ・・・OTC) | | | | | | |
| MESQUITE ENERGY INC | 1,867.42 | 1,867.42 | 10,351 | 1,470,892 | エネルギー | |
| EP ENERGY CORP | 5,665.55 | 5,665.55 | 4,742 | 673,847 | エネルギー | |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP PIPE | 70.13 | 70.13 | 687 | 97,741 | エネルギー | |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC A | 906.42 | 906.42 | 7,504 | 1,066,354 | エネルギー | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG | 1,961.59 | 1,961.59 | 9,423 | 1,339,076 | 電気通信サービス | |
| NEW COTAI LLC / CAP P/P | 49,669.43 | 49,669.43 | 0 | 0 | 各種金融 | |
| JONAH EGY LLC / JONAH EGY FIN | 3,365.6 | 3,365.6 | 21,405 | 3,041,681 | エネルギー | |
| PURE WEST ENERGY | 77.89 | 77.89 | 0 | 0 | エネルギー | |
| INTELSAT JACKSON CVR SER A RT | 205.42 | 205.42 | 178 | 25,424 | 電気通信サービス | |
| INTELSAT JACKSON CVR SER B RT | 205.42 | 205.42 | 659 | 93,729 | 電気通信サービス | |
| PURE WEST ENERGY CVR | 46.94 | 46.94 | 0 | 0 | エネルギー | |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 | 117,800.24 | 111,231.11 | 193,860 | 27,547,593 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 26銘柄 | 24銘柄 | — | <4.6%> | |
| 合 計 | 株 数 、 金 額 | 117,800.24 | 111,231.11 | — | 27,547,593 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 26銘柄 | 24銘柄 | — | <4.6%> | |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国新株予約権証券

| 銘 柄 | 期 首 (前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------|-------------|---------|-----------|-------------|-----------|
| | 証 券 数 | 証 券 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ) | 証 券 | 証 券 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| NOBLE CORP PLC TR 1 WT 2/04/28 | — | 72,804 | 1,397 | 198,632 | |
| NOBLE CORP PLC TR2 WT 2/04/28 | — | 72,804 | 1,317 | 187,252 | |
| NOBLE CORPORATION TRANCHE 1 WT | 72,804 | — | — | — | |
| NOBLE CORPORATION TRANCHE 2 WT | 72,804 | — | — | — | |
| DENBURY INC WT 09/18/25 | 315,827 | 313,027 | 19,094 | 2,713,349 | |
| CALIFORNIA RES CRP WT 10/27/24 | 46,818 | 46,818 | 564 | 80,166 | |
| 小 計 | 証 券 数 、 金 額 | 508,253 | 505,453 | 22,374 | 3,179,401 |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 4 | 4 | — | <0.5%> |
| 合 計 | 証 券 数 、 金 額 | 508,253 | 505,453 | — | 3,179,401 |
| | 銘 柄 数 <比 率> | 4 | 4 | — | <0.5%> |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 4,012,813 | 千アメリカ・ドル 3,459,039 | 千円 491,529,560 | % 81.5 | % 71.3 | % 49.9 | % 27.7 | % 3.9 |
| 合 計 | — | — | 491,529,560 | 81.5 | 71.3 | 49.9 | 27.7 | 3.9 |

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価については証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|--------------------------------------|----------|---------|----------|-----------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP | 新株予約権付社債 | 15.0000 | 1,469 | 8,710 | 1,237,769 | 2023/07/31 |
| MESQUITE 15% PIK CONV 7/23 PP | 新株予約権付社債 | 15.0000 | 2,536 | 15,034 | 2,136,432 | 2023/07/15 |
| DISH NETWK CV 2.375% 3/15/24 | 新株予約権付社債 | 2.3750 | 41,113 | 36,426 | 5,176,151 | 2024/03/15 |
| DISH NETWORK CO CV 0% 12/15/25 | 新株予約権付社債 | 0.0000 | 7,197 | 4,737 | 673,239 | 2025/12/15 |
| DISH NETWK CV 3.375% 8/26 144A | 新株予約権付社債 | 3.3750 | 51,366 | 32,694 | 4,645,882 | 2026/08/15 |
| NEW COTAI LLC CONV 5% 2/24/27 | 新株予約権付社債 | 5.0000 | 5,802 | 5,628 | 799,829 | 2027/02/24 |
| ALPHA NAT RES I 9.75% 4/15/18 Escrow | 社債券 | 0.0000 | 6,605 | 0 | 0 | 2023/04/15 |
| WP ROCKET MRGR 10.125 7/19 144 | 社債券 | 0.0000 | 6,530 | 0 | 0 | 2023/07/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|-------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| RURAL/METRO C 10.125 7/19 144A | 社債券 | 0.0000 | 4,985 | 0 | 0 | 2023/07/15 |
| WALTER ENERGY 9.5% 10/19 144A | 社債券 | 0.0000 | 13,820 | 0 | 0 | 2049/12/31 |
| CSC HLDGS LLC 4.625% 12/01/30 144A | 社債券 | 4.6250 | 12,335 | 7,878 | 1,119,498 | 2030/12/01 |
| TOPS MARKETS CORP ESCROW | 社債券 | 0.0000 | 20,640 | 0 | 0 | 2049/12/31 |
| HERTZ CORP 6.25% 10/15/22 | 社債券 | 0.0000 | 5,980 | 7 | 1,062 | 2049/12/31 |
| TRANSOCEAN 5.375% 5/15/23 144A | 社債券 | 5.3750 | 4,829 | 4,768 | 677,649 | 2023/05/15 |
| INTERGEN NV 7.0% 06/30/23 144A | 社債券 | 7.0000 | 65,967 | 64,580 | 9,176,871 | 2023/06/30 |
| INTELSAT J H SA 5.5% 08/01/23 | 社債券 | 0.0000 | 17,015 | 0 | 0 | 2023/08/01 |
| AVOLON HLDGS 3.95% 7/24 144A | 社債券 | 3.9500 | 25 | 23 | 3,360 | 2024/07/01 |
| CITGO HLDG INC 9.25% 08/01/24 144A | 社債券 | 9.2500 | 6,335 | 6,350 | 902,454 | 2024/08/01 |
| OCCIDENTAL PETE 6.95% 07/01/24 | 社債券 | 6.9500 | 5,975 | 6,154 | 874,535 | 2024/07/01 |
| NEXTERA ENERGY 4.25% 9/24 144A | 社債券 | 4.2500 | 601 | 567 | 80,598 | 2024/09/15 |
| INFRABUILD AUST 12% 10/24 144A | 社債券 | 12.0000 | 13,890 | 13,542 | 1,924,424 | 2024/10/01 |
| INTELSAT JACKS 8.5% 10/24 144A | 社債券 | 0.0000 | 3,835 | 0 | 0 | 2024/10/15 |
| HERTZ 5.5% 10/15/24 144A | 社債券 | 0.0000 | 6,520 | 146 | 20,846 | 2024/10/15 |
| CARLYLE AVIAT 7% 10/15/24 144A | 社債券 | 7.0000 | 9,835 | 7,517 | 1,068,247 | 2024/10/15 |
| WOLVERINE 8.5% 11/24 144A | 社債券 | 8.5000 | 3,807 | 1,903 | 270,481 | 2024/11/15 |
| NABORS IND 5.75% 02/01/25 | 社債券 | 5.7500 | 8,875 | 8,451 | 1,200,918 | 2025/02/01 |
| EG GLOBAL FINANCE PLC 6.75% 02 | 社債券 | 6.7500 | 20,670 | 18,885 | 2,683,637 | 2025/02/07 |
| CVR ENERGY 5.25% 2/15/25 144A | 社債券 | 5.2500 | 11,525 | 10,975 | 1,559,649 | 2025/02/15 |
| SPRINGLEAF FIN 6.875% 3/15/25 | 社債券 | 6.8750 | 6,965 | 6,741 | 957,976 | 2025/03/15 |
| SYMANTEC CORP 5% 04/25 144A | 社債券 | 5.0000 | 6,265 | 6,091 | 865,623 | 2025/04/15 |
| CHOBANI 7.5% 04/15/25 144A | 社債券 | 7.5000 | 2,345 | 2,258 | 320,898 | 2025/04/15 |
| CRESTWOOD MID P/F 5.75% 4/1/25 | 社債券 | 5.7500 | 8,145 | 7,920 | 1,125,494 | 2025/04/01 |
| WYNN RESORTS LTD 7.75% 04/15/2 | 社債券 | 7.7500 | 11,430 | 11,235 | 1,596,591 | 2025/04/15 |
| SABRE GLBL 9.25% 04/15/25 144A | 社債券 | 9.2500 | 4,215 | 4,113 | 584,582 | 2025/04/15 |
| ARCONIC ROLLED 6% 5/15/25 144A | 社債券 | 6.0000 | 3,335 | 3,282 | 466,501 | 2025/05/15 |
| USIS MERGER 6.875% 05/25 144A | 社債券 | 6.8750 | 11,205 | 11,023 | 1,566,372 | 2025/05/01 |
| SUGARHOUSE 5.875% 5/15/25 144A | 社債券 | 5.8750 | 5,585 | 5,235 | 744,026 | 2025/05/15 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.75 | 社債券 | 6.7500 | 7,465 | 7,487 | 1,063,948 | 2025/05/01 |
| VIKING CRUIS 13% 05/15/25 144A | 社債券 | 13.0000 | 4,665 | 4,952 | 703,803 | 2025/05/15 |
| UBER TECH 7.5% 05/15/25 144A | 社債券 | 7.5000 | 10,860 | 10,977 | 1,559,918 | 2025/05/15 |
| ROYAL CARI 11.5% 06/01/25 144A | 社債券 | 11.5000 | 2,795 | 3,001 | 426,460 | 2025/06/01 |
| PBF HLDG / FIN 7.25% 06/15/25 | 社債券 | 7.2500 | 29,085 | 28,555 | 4,057,758 | 2025/06/15 |
| CITGO PETE COR 7% 6/15/25 144A | 社債券 | 7.0000 | 12,675 | 12,516 | 1,778,603 | 2025/06/15 |
| FORD MTR CR 5.125% 6/16/25 | 社債券 | 5.1250 | 16,150 | 15,621 | 2,219,871 | 2025/06/16 |
| VICI PPTY LP 4.625% 06/25 RGS | 社債券 | 4.6250 | 10,630 | 10,182 | 1,446,975 | 2025/06/15 |
| BRAND ENERGY 8.5% 7/25 144A | 社債券 | 8.5000 | 27,100 | 20,191 | 2,869,274 | 2025/07/15 |
| SP FINCO LLC 6.75% 7/1/25 144A | 社債券 | 6.7500 | 2,735 | 2,623 | 372,837 | 2025/07/01 |
| NAVIOS LOG/FI 10.75% 7/25 144A | 社債券 | 10.7500 | 10,515 | 9,785 | 1,390,515 | 2025/07/01 |
| DPL INC 4.125% 07/01/25 | 社債券 | 4.1250 | 17,145 | 16,116 | 2,290,126 | 2025/07/01 |
| WESTERN LO 10.375% 8/25 144A | 社債券 | 10.3750 | 5,625 | 4,643 | 659,808 | 2025/08/15 |
| SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A | 社債券 | 8.0000 | 3,763 | 3,809 | 541,267 | 2025/09/20 |
| OCCIDENTAL PETE 5.875% 9/01/25 | 社債券 | 5.8750 | 3,520 | 3,520 | 500,192 | 2025/09/01 |
| NEW FORTRESS EN 6.75% 09/15/25 | 社債券 | 6.7500 | 14,790 | 14,331 | 2,036,549 | 2025/09/15 |
| SABRE GLBL INC 7.375% 09/01/25 144A | 社債券 | 7.3750 | 5,275 | 4,903 | 696,814 | 2025/09/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|-------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| SPIRIT LOYALT 8% 09/20/25 144A | 社債券 | 8.0000 | 18,260 | 18,407 | 2,615,763 | 2025/09/20 |
| EG GLOBAL 8.5% 10/30/25 144A | 社債券 | 8.5000 | 3,435 | 3,216 | 457,123 | 2025/10/30 |
| NEW HOME CO 7.25% 10/15/25 144A | 社債券 | 7.2500 | 3,440 | 2,736 | 388,864 | 2025/10/15 |
| CANPACK SA 3.125% 11/01/25 144A | 社債券 | 3.1250 | 3,435 | 2,979 | 423,438 | 2025/11/01 |
| ACRISURE LLC 7% 11/15/25 144A | 社債券 | 7.0000 | 25,675 | 24,006 | 3,411,270 | 2025/11/15 |
| KLX ENERGY 11.5% 11/1/25 144A | 社債券 | 11.5000 | 7,250 | 6,525 | 927,202 | 2025/11/01 |
| ICAHN LP/FN COR 6.375% 12/15/2 | 社債券 | 6.3750 | 13,815 | 13,473 | 1,914,642 | 2025/12/15 |
| RP ESCROW ISS 5.25% 12/15/25 144A | 社債券 | 5.2500 | 4,700 | 3,936 | 559,341 | 2025/12/15 |
| ENVIVA PT LP 6.5% 1/15/26 144A | 社債券 | 6.5000 | 14,850 | 14,083 | 2,001,215 | 2026/01/15 |
| LEGENDS HOSPITAL 5% 02/01/26 144A | 社債券 | 5.0000 | 2,985 | 2,596 | 368,946 | 2026/02/01 |
| NGL ENERGY OP 7.5% 02/01/26 144A | 社債券 | 7.5000 | 17,125 | 15,459 | 2,196,832 | 2026/02/01 |
| CALIFORNIA 7.125% 02/01/26 144A | 社債券 | 7.1250 | 8,730 | 8,424 | 1,197,114 | 2026/02/01 |
| FIRST QUANTUM 6.875% 3/26 144A | 社債券 | 6.8750 | 8,650 | 8,265 | 1,174,491 | 2026/03/01 |
| SPRINGLEAF FIN CRP 7.125% 3/26 | 社債券 | 7.1250 | 9,765 | 9,278 | 1,318,420 | 2026/03/15 |
| CHS/CMNTY HEALTH 8% 3/26 144A | 社債券 | 8.0000 | 29,005 | 26,753 | 3,801,608 | 2026/03/15 |
| OCCIDENTAL PETE 5.55% 03/15/26 | 社債券 | 5.5500 | 6,554 | 6,577 | 934,694 | 2026/03/15 |
| NCL CORP LTD 5.875 03/15/26 144A | 社債券 | 5.8750 | 1,680 | 1,371 | 194,861 | 2026/03/15 |
| MATTEL INC 3.375% 04/01/26 144A | 社債券 | 3.3750 | 1,685 | 1,535 | 218,188 | 2026/04/01 |
| FERRELLGAS/FG 5.375% 04/01/26 144A | 社債券 | 5.3750 | 3,980 | 3,641 | 517,485 | 2026/04/01 |
| USA COMPRESSIO 6.875% 04/01/26 | 社債券 | 6.8750 | 2,960 | 2,816 | 400,275 | 2026/04/01 |
| CORECIVIC INC 0% 04/30/26 | 社債券 | 8.2500 | 8,245 | 8,387 | 1,191,895 | 2026/04/15 |
| WASH MULT 5.75% 4/15/26 144A | 社債券 | 5.7500 | 3,610 | 3,384 | 480,919 | 2026/04/15 |
| CEC ENT CO LLC 6.75% 5/26 144A | 社債券 | 6.7500 | 4,950 | 4,580 | 650,921 | 2026/05/01 |
| SEASPAN CORPORA 6.5% 4/26 144A | 社債券 | 6.5000 | 4,600 | 4,519 | 642,220 | 2026/04/29 |
| TULLOW OI 10.25% 05/15/26 144A | 社債券 | 10.2500 | 12,297 | 10,759 | 1,528,978 | 2026/05/15 |
| HUB INTEL LTD 7% 5/01/26 144A | 社債券 | 7.0000 | 7,640 | 7,506 | 1,066,645 | 2026/05/01 |
| AVOLON HLD 4.375% 5/01/26 144A | 社債券 | 4.3750 | 18 | 16 | 2,297 | 2026/05/01 |
| ICAHN LP/FN COR 6.25% 05/15/26 | 社債券 | 6.2500 | 9,980 | 9,521 | 1,352,965 | 2026/05/15 |
| EQT CORP 3.125% 05/15/26 144A | 社債券 | 3.1250 | 3,875 | 3,575 | 508,133 | 2026/05/15 |
| BLOCK INC 2.75% 06/01/26 | 社債券 | 2.7500 | 5,755 | 5,162 | 733,643 | 2026/06/01 |
| CITGO PETROL 6.375% 06/26 144A | 社債券 | 6.3750 | 6,045 | 5,939 | 843,962 | 2026/06/15 |
| BOBOMBARDIER 7.125% 06/26 144A | 社債券 | 7.1250 | 7,380 | 7,191 | 1,021,977 | 2026/06/15 |
| ROYAL CARIBBEAN 4.25% 07/01/26 144A | 社債券 | 4.2500 | 9,705 | 7,944 | 1,128,970 | 2026/07/01 |
| BERRY GBL ES 4.875% 7/26 144A | 社債券 | 4.8750 | 3,655 | 3,479 | 494,461 | 2026/07/15 |
| GEMS MENAS 7.125% 7/31/26 144A | 社債券 | 7.1250 | 21,875 | 20,696 | 2,940,954 | 2026/07/31 |
| ATR CANADA 3.875% 08/15/26 144A | 社債券 | 3.8750 | 4,620 | 4,159 | 591,114 | 2026/08/15 |
| TRIVIUM PACKING 5.5% 8/26 144A | 社債券 | 5.5000 | 3,670 | 3,425 | 486,800 | 2026/08/15 |
| HERTZ CORP 7.125% 08/01/2026 1 | 社債券 | 0.0000 | 8,230 | 329 | 46,779 | 2026/08/01 |
| ACRISURE 10.125% 08/01/26 144A | 社債券 | 10.1250 | 5,055 | 4,966 | 705,744 | 2026/08/01 |
| ROYAL CARIBBEAN 5.5% 08/31/26 | 社債券 | 5.5000 | 9,590 | 8,165 | 1,160,317 | 2026/08/31 |
| DIAMOND SPORT 5.375% 08/15/26 | 社債券 | 5.3750 | 6,430 | 1,077 | 153,045 | 2026/08/15 |
| SM ENERGY CO 6.75% 09/15/26 | 社債券 | 6.7500 | 3,640 | 3,549 | 504,312 | 2026/09/15 |
| RADIATE HOLDC 4.5% 9/15/26 144A | 社債券 | 4.5000 | 14,100 | 11,717 | 1,665,039 | 2026/09/15 |
| SBP LLC/C 6.375% 09/30/26 144A | 社債券 | 6.3750 | 2,480 | 2,021 | 287,318 | 2026/09/30 |
| IMS HEALTH 5% 10/15/26 144A | 社債券 | 5.0000 | 5,060 | 4,870 | 692,062 | 2026/10/15 |
| KEHE DISTRS LLC / KEHE FIN COR | 社債券 | 8.6250 | 4,048 | 3,984 | 566,155 | 2026/10/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| GANNETT HOLDING 6% 11/01/26 144A | 社債券 | 6.0000 | 2,870 | 2,267 | 322,183 | 2026/11/01 |
| RIVIAN 6ML+600 10/15/26 144A | 社債券 | 10.1635 | 20,480 | 19,660 | 2,793,799 | 2026/10/15 |
| CAMELOT FIN SA 4.5% 11/26 144A | 社債券 | 4.5000 | 5,440 | 5,045 | 716,979 | 2026/11/01 |
| KOBE US MID PIK VAR 11/26 144A | 社債券 | 9.2500 | 12,375 | 8,662 | 1,230,941 | 2026/11/01 |
| HERTZ 4.625% 12/01/26 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,580 | 3,050 | 433,519 | 2026/12/01 |
| KRONOS ACQ K 5% 12/31/26 144A | 社債券 | 5.0000 | 1,170 | 1,063 | 151,155 | 2026/12/31 |
| ZIGGO BOND 6% 1/15/27 144A | 社債券 | 6.0000 | 5,985 | 5,416 | 769,673 | 2027/01/15 |
| SM ENERGY CO 6.625% 1/15/27 | 社債券 | 6.6250 | 5,695 | 5,509 | 782,958 | 2027/01/15 |
| ALBERTSONS 4.625% 1/15/27 144A | 社債券 | 4.6250 | 10,543 | 9,735 | 1,383,431 | 2027/01/15 |
| VISTRA OP CO 5.625% 02/27 144A | 社債券 | 5.6250 | 5,626 | 5,411 | 769,003 | 2027/02/15 |
| TENET HEALTHCA 6.25% 2/27 144A | 社債券 | 6.2500 | 13,060 | 12,482 | 1,773,724 | 2027/02/01 |
| CENTURYLINK INC 4% 02/27 144A | 社債券 | 4.0000 | 9,745 | 8,295 | 1,178,822 | 2027/02/15 |
| VICI PROPERT 3.75% 02/27 144A | 社債券 | 3.7500 | 4,530 | 4,073 | 578,865 | 2027/02/15 |
| SBA COMMUNICATI 3.875% 02/27 | 社債券 | 3.8750 | 10,425 | 9,455 | 1,343,682 | 2027/02/15 |
| LINDBLAD E 6.75% 02/15/27 144A | 社債券 | 6.7500 | 4,725 | 4,347 | 617,708 | 2027/02/15 |
| STUDIO CITY CO 7% 02/27 144A | 社債券 | 7.0000 | 5,135 | 4,377 | 622,055 | 2027/02/15 |
| NCL CORP 5.875% 02/15/27 144A | 社債券 | 5.8750 | 6,415 | 5,633 | 800,450 | 2027/02/15 |
| VICI PPTY LP 5.75% 02/01/27 RE | 社債券 | 5.7500 | 6,005 | 5,799 | 824,041 | 2027/02/01 |
| TRANSDIGM INC 7.5% 03/15/27 | 社債券 | 7.5000 | 16,800 | 16,737 | 2,378,327 | 2027/03/15 |
| FRONT RANGE BID 4% 3/1/27 144A | 社債券 | 4.0000 | 9,450 | 6,884 | 978,329 | 2027/03/01 |
| CHS/CMNTY HLT 5.625% 03/15/27 144A | 社債券 | 5.6250 | 5,130 | 4,302 | 611,426 | 2027/03/15 |
| CARNIVAL COR 5.75% 3/1/27 144A | 社債券 | 5.7500 | 11,865 | 8,661 | 1,230,792 | 2027/03/01 |
| BOMBARDIER 7.875% 04/27 144A | 社債券 | 7.8750 | 13,585 | 13,182 | 1,873,249 | 2027/04/15 |
| SURGERY CTR 10% 04/15/27 144A | 社債券 | 10.0000 | 5,555 | 5,516 | 783,839 | 2027/04/15 |
| SUNOCO LP /CORP 6% 04/15/27 | 社債券 | 6.0000 | 9,955 | 9,729 | 1,382,550 | 2027/04/15 |
| NORTHWEST FIN 4.75% 04/30/27 144A | 社債券 | 4.7500 | 3,525 | 3,066 | 435,750 | 2027/04/30 |
| CCO HLDGS/CAP 5.125% 5/27 144 | 社債券 | 5.1250 | 19,140 | 17,776 | 2,526,008 | 2027/05/01 |
| CHEMOURS CO 5.375% 05/15/2027 | 社債券 | 5.3750 | 15,235 | 14,034 | 1,994,364 | 2027/05/15 |
| ALTICE FR 10.5% 5/15/27 144A | 社債券 | 10.5000 | 12,170 | 9,488 | 1,348,310 | 2027/05/15 |
| ICAHN LP/FN COR 5.25% 05/15/27 | 社債券 | 5.2500 | 13,520 | 12,269 | 1,743,481 | 2027/05/15 |
| FORD MTR CR LLC 4.95% 05/28/27 | 社債券 | 4.9500 | 11,750 | 10,956 | 1,556,971 | 2027/05/28 |
| KFC CO/PIZZA 4.75% 6/1/27 144A | 社債券 | 4.7500 | 7,630 | 7,350 | 1,044,562 | 2027/06/01 |
| ARD FIN SA 6.5% 06/30/27 144A | 社債券 | 7.2500 | 5,830 | 4,244 | 603,073 | 2027/06/30 |
| UNIVISION 6.625% 06/01/27 144A | 社債券 | 6.6250 | 10,585 | 10,342 | 1,469,638 | 2027/06/01 |
| WR GRACE 4.875% 06/15/27 144A | 社債券 | 4.8750 | 6,725 | 5,934 | 843,336 | 2027/06/15 |
| BERRY GBL ES 5.625% 7/27 144A | 社債券 | 5.6250 | 3,000 | 2,931 | 416,631 | 2027/07/15 |
| NEXSTAR 5.625% 7/15/27 144A | 社債券 | 5.6250 | 6,745 | 6,366 | 904,742 | 2027/07/15 |
| SCRIPPS ESCRO 5.875% 7/27 144A | 社債券 | 5.8750 | 5,375 | 4,703 | 668,314 | 2027/07/15 |
| CAESARS E 8.125% 07/01/27 | 社債券 | 8.1250 | 12,020 | 11,930 | 1,695,334 | 2027/07/01 |
| ROYAL CARI 5.375% 7/15/27 144A | 社債券 | 5.3750 | 4,325 | 3,561 | 506,133 | 2027/07/15 |
| SIRIUS XM RADIO 5% 8/1/27 144A | 社債券 | 5.0000 | 8,735 | 8,125 | 1,154,641 | 2027/08/01 |
| CARNIVAL CORP 9.875% 08/01/27 144A | 社債券 | 9.8750 | 19,185 | 18,465 | 2,623,956 | 2027/08/01 |
| ALLEGiant T 7.25% 8/15/27 144A | 社債券 | 7.2500 | 3,405 | 3,246 | 461,341 | 2027/08/15 |
| ROYAL CARIBBEAN 11.625% 08/15/27 144A | 社債券 | 11.6250 | 17,750 | 17,832 | 2,534,028 | 2027/08/15 |
| OLYMPUS WATER 7.125% 10/01/27 144A | 社債券 | 7.1250 | 3,440 | 3,240 | 460,423 | 2027/10/01 |
| C&W SR FIN 6.875% 9/15/27 144A | 社債券 | 6.8750 | 20,380 | 17,985 | 2,555,718 | 2027/09/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| ADVANCED DRAIN 5% 9/30/27 144A | 社債券 | 5.0000 | 1,210 | 1,113 | 158,185 | 2027/09/30 |
| CABLEVS LT LLC 3.875% 9/15/27 144A | 社債券 | 3.8750 | 2,645 | 2,237 | 317,961 | 2027/09/15 |
| FRONTIER COM 5.875% 10/15/27 144A | 社債券 | 5.8750 | 5,005 | 4,673 | 664,092 | 2027/10/15 |
| UBER TECH I 7.5% 09/15/27 144A | 社債券 | 7.5000 | 5,815 | 5,880 | 835,607 | 2027/09/15 |
| MPT OPER PARTNER 5% 10/15/27 | 社債券 | 5.0000 | 11,630 | 9,769 | 1,388,203 | 2027/10/15 |
| PERFORMANCE 5.5% 10/15/27 144A | 社債券 | 5.5000 | 13,405 | 12,966 | 1,842,523 | 2027/10/15 |
| LIVE NATIN 4.75% 10/15/27 144A | 社債券 | 4.7500 | 7,085 | 6,304 | 895,922 | 2027/10/15 |
| ALLIANT HLDG 6.75% 10/27 144A | 社債券 | 6.7500 | 22,620 | 20,460 | 2,907,368 | 2027/10/15 |
| LCPR SR 6.75% 10/15/27 144A | 社債券 | 6.7500 | 5,264 | 4,915 | 698,458 | 2027/10/15 |
| FIRST QUANT 6.875% 10/27 144A | 社債券 | 6.8750 | 6,590 | 6,256 | 889,027 | 2027/10/15 |
| MINERAL RES LT 8% 11/1/27 144A | 社債券 | 8.0000 | 6,125 | 6,147 | 873,495 | 2027/11/01 |
| TRANSDIGM INC 5.5% 11/15/27 | 社債券 | 5.5000 | 27,775 | 25,796 | 3,665,616 | 2027/11/15 |
| AVOLON HLDGS 2.528% 11/27 144A | 社債券 | 2.5280 | 9,509 | 7,541 | 1,071,605 | 2027/11/18 |
| FORD MTR CR LLC 7.35% 11/04/27 | 社債券 | 7.3500 | 30,000 | 30,816 | 4,379,038 | 2027/11/04 |
| DISH NETWORK CO 11.75% 11/27 144A | 社債券 | 11.7500 | 10,000 | 10,212 | 1,451,196 | 2027/11/15 |
| MATCH GROUP INC 5% 12/27 144A | 社債券 | 5.0000 | 7,545 | 6,969 | 990,393 | 2027/12/15 |
| GO DADDY OP 5.25% 12/1/27 144A | 社債券 | 5.2500 | 5,050 | 4,784 | 679,930 | 2027/12/01 |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.8 | 社債券 | 5.8750 | 5,860 | 5,396 | 766,797 | 2027/12/01 |
| MOOG INC 4.25% 12/15/2027 144A | 社債券 | 4.2500 | 1,720 | 1,548 | 219,970 | 2027/12/15 |
| TERRIER M 8.875% 12/15/27 144A | 社債券 | 8.8750 | 7,700 | 6,044 | 858,923 | 2027/12/15 |
| AFFINTY GME 6.875% 12/15/27 144A | 社債券 | 6.8750 | 1,930 | 1,625 | 230,992 | 2027/12/15 |
| KRONOS ACQ 7% 12/31/27 144A | 社債券 | 7.0000 | 1,485 | 1,236 | 175,672 | 2027/12/31 |
| OPEN TEXT CO 6.9% 12/1/27 144A | 社債券 | 6.9000 | 3,970 | 3,989 | 566,957 | 2027/12/01 |
| 1375209 BC LTD 9% 1/30/28 144A | 社債券 | 9.0000 | 2,267 | 2,227 | 316,503 | 2028/01/30 |
| POST HLDGS 5.625% 01/28 144A | 社債券 | 5.6250 | 13,375 | 12,639 | 1,796,055 | 2028/01/15 |
| ENDEAVOR ENERGY 5.75 1/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 11,850 | 11,553 | 1,641,787 | 2028/01/30 |
| ANTERO MIDS 5.75% 1/15/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 5,390 | 5,053 | 718,049 | 2028/01/15 |
| TAYLOR MORRISON CMNTY/ MONARCH | 社債券 | 5.7500 | 7,155 | 6,599 | 937,817 | 2028/01/15 |
| ALTICE FRANCE SA 5.5% 01/15/20 | 社債券 | 5.5000 | 11,490 | 9,373 | 1,332,012 | 2028/01/15 |
| HERTZ CORP 6% 01/15/2028 144A | 社債券 | 0.0000 | 8,095 | 475 | 67,580 | 2028/01/15 |
| ALTICE FING 5% 01/15/28 144A | 社債券 | 5.0000 | 5,480 | 4,411 | 626,859 | 2028/01/15 |
| ALLEN MEDIA 10.5% 02/28 144A | 社債券 | 10.5000 | 16,865 | 6,746 | 958,606 | 2028/02/15 |
| STUDIO CITY 6.5% 1/15/28 144A | 社債券 | 6.5000 | 10,530 | 6,229 | 885,173 | 2028/01/15 |
| UBER TECH INC 6.25% 01/15/28 144A | 社債券 | 6.2500 | 4,435 | 4,290 | 609,731 | 2028/01/15 |
| ASHTON WO 6.625% 01/15/28 144A | 社債券 | 6.6250 | 85 | 73 | 10,486 | 2028/01/15 |
| UNISYS 6.875% 11/01/27 144A | 社債券 | 6.8750 | 2,905 | 2,059 | 292,605 | 2027/11/01 |
| ENLINK MID 5.625% 01/15/28 144A | 社債券 | 5.6250 | 2,255 | 2,170 | 308,419 | 2028/01/15 |
| CSC HLDGS LLC 5.375% 2/28 144A | 社債券 | 5.3750 | 2,325 | 2,063 | 293,214 | 2028/02/01 |
| CVR ENERGY 5.75% 02/15/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 8,810 | 7,973 | 1,132,970 | 2028/02/15 |
| ALTICE FR HLDS 6% 2/15/28 144A | 社債券 | 6.0000 | 6,000 | 3,862 | 548,861 | 2028/02/15 |
| RADIOLOGY PAR 0% 01/31/28 144A | 社債券 | 9.2500 | 9,925 | 6,026 | 856,331 | 2028/02/01 |
| PBF HLD LLC/FIN 6% 02/15/28 | 社債券 | 6.0000 | 20,275 | 18,334 | 2,605,271 | 2028/02/15 |
| CLEAR CHAN 7.75% 04/15/28 144A | 社債券 | 7.7500 | 3,180 | 2,400 | 341,167 | 2028/04/15 |
| NTH OIL & GAS 8.125% 03/01/28 144A | 社債券 | 8.1250 | 7,995 | 7,772 | 1,104,483 | 2028/03/01 |
| NORTHWEST FIN 6% 02/15/28 144A | 社債券 | 6.0000 | 1,825 | 1,442 | 205,041 | 2028/02/15 |
| FORD MTR CR LLC 2.9% 02/16/28 | 社債券 | 2.9000 | 4,625 | 3,852 | 547,418 | 2028/02/16 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| ADTALEM GLOBA 5.5% 03/01/28 144A | 社債券 | 5.5000 | 10,160 | 9,451 | 1,343,107 | 2028/03/01 |
| BOMBARDIER INC 6% 02/28 144A | 社債券 | 6.0000 | 7,710 | 7,016 | 996,987 | 2028/02/15 |
| CLEARWY ENR 4.75% 3/15/28 144A | 社債券 | 4.7500 | 3,445 | 3,169 | 450,445 | 2028/03/15 |
| FRONT RANGE BIDCO INC 6.125% 0 | 社債券 | 6.1250 | 5,210 | 2,942 | 418,070 | 2028/03/01 |
| ASBURY AUTOMOTI 4.5% 03/01/28 | 社債券 | 4.5000 | 1,668 | 1,492 | 212,135 | 2028/03/01 |
| NCL FINANCE LTD 6.125% 03/15/28 144A | 社債券 | 6.1250 | 2,075 | 1,635 | 232,365 | 2028/03/15 |
| SPA HOLDINGS 4.875% 2/28 144A | 社債券 | 4.8750 | 3,985 | 3,185 | 452,726 | 2028/02/04 |
| CSC HOLDINGS 7.5% 4/1/28 144A | 社債券 | 7.5000 | 20,300 | 15,771 | 2,241,069 | 2028/04/01 |
| CDW LLC / CDW F 4.25% 04/01/28 | 社債券 | 4.2500 | 7,050 | 6,367 | 904,760 | 2028/04/01 |
| ARCHROCK PR 6.25% 4/1/28 144A | 社債券 | 6.2500 | 5,800 | 5,394 | 766,487 | 2028/04/01 |
| UNITI/FIN 4.75% 04/15/28 144A | 社債券 | 4.7500 | 4,490 | 3,833 | 544,755 | 2028/04/15 |
| MAGIC MERG 5.25% 05/1/28 144A | 社債券 | 5.2500 | 5,220 | 3,719 | 528,505 | 2028/05/01 |
| ORGANON F 4.125% 04/30/28 144A | 社債券 | 4.1250 | 6,615 | 5,866 | 833,678 | 2028/04/30 |
| SCIH SALT 4.875% 05/01/28 144A | 社債券 | 4.8750 | 5,850 | 5,148 | 731,530 | 2028/05/01 |
| ATLAS LUX 4.625% 06/01/28 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,000 | 2,460 | 349,566 | 2028/06/01 |
| VALARIS 12%/VAR 04/30/28 144A | 社債券 | 8.2500 | 1,233 | 1,223 | 173,900 | 2028/04/30 |
| CHARLES RIV 4.25% 5/1/28 144A | 社債券 | 4.2500 | 1,765 | 1,621 | 230,418 | 2028/05/01 |
| ASGN INC 4.625% 05/15/28 144A | 社債券 | 4.6250 | 13,835 | 12,279 | 1,744,862 | 2028/05/15 |
| NORTHWEST FIN 10.75% 06/01/28 144A | 社債券 | 10.7500 | 2,995 | 2,822 | 401,130 | 2028/06/01 |
| MOLINA HEA 4.375% 6/15/28 144A | 社債券 | 4.3750 | 3,800 | 3,433 | 487,855 | 2028/06/15 |
| FRONTIER COMM 5% 05/01/28 144A | 社債券 | 5.0000 | 5,150 | 4,557 | 647,568 | 2028/05/01 |
| ARCHES BUYER 4.25% 06/01/28 144A | 社債券 | 4.2500 | 1,655 | 1,366 | 194,250 | 2028/06/01 |
| ATLANTICA SUS 4.125% 6/28 144A | 社債券 | 4.1250 | 2,790 | 2,400 | 341,125 | 2028/06/15 |
| SRS DISTRIBUTIO 4.625% 07/01/28 144A | 社債券 | 4.6250 | 4,110 | 3,629 | 515,769 | 2028/07/01 |
| DELEK LOGISTIC 7.125% 06/01/28 144A | 社債券 | 7.1250 | 3,425 | 3,108 | 441,673 | 2028/06/01 |
| CARNIVAL 10.375% 05/28 144A | 社債券 | 10.3750 | 11,435 | 11,736 | 1,667,713 | 2028/05/01 |
| HESS MIDST 5.125% 6/15/28 144A | 社債券 | 5.1250 | 6,815 | 6,243 | 887,161 | 2028/06/15 |
| TRI POINTE GROUP 5.7% 06/15/28 | 社債券 | 5.7000 | 1,630 | 1,437 | 204,208 | 2028/06/15 |
| DANA INC 5.625% 6/15/28 | 社債券 | 5.6250 | 5,070 | 4,648 | 660,606 | 2028/06/15 |
| CVR PART LP/FIN 6.125% 06/15/28 144A | 社債券 | 6.1250 | 6,680 | 5,967 | 847,935 | 2028/06/15 |
| MICROSTRATEGY 6.125% 06/15/28 | 社債券 | 6.1250 | 24,345 | 17,540 | 2,492,515 | 2028/06/15 |
| SM ENERGY CO 6.5% 07/15/28 | 社債券 | 6.5000 | 2,040 | 1,948 | 276,839 | 2028/07/15 |
| MADISON IAQ 4.125% 06/28 144A | 社債券 | 4.1250 | 3,975 | 3,334 | 473,827 | 2028/06/30 |
| GEO GRP INC/THE 10.5% 06/30/28 | 社債券 | 10.5000 | 5,706 | 5,737 | 815,282 | 2028/06/30 |
| LEVEL 3 FINANCI 4.25% 07/01/28 | 社債券 | 4.2500 | 7,065 | 5,488 | 779,908 | 2028/07/01 |
| PG&E CORP 5% 07/01/28 | 社債券 | 5.0000 | 7,060 | 6,499 | 923,640 | 2028/07/01 |
| WINNEBAGO IND 6.25% 7/28 144A | 社債券 | 6.2500 | 4,355 | 4,048 | 575,247 | 2028/07/15 |
| AVANTOR FUNDING 4.625% 07/15/28 144A | 社債券 | 4.6250 | 7,015 | 6,369 | 905,152 | 2028/07/15 |
| GPC MERGER SU 7.125% 8/15/28 144A | 社債券 | 7.1250 | 3,040 | 2,546 | 361,786 | 2028/08/15 |
| CARNIVAL CORP 4% 08/01/28 144A | 社債券 | 4.0000 | 10,645 | 8,713 | 1,238,228 | 2028/08/01 |
| EMERGENT BIO 3.875% 08/15/30 144A | 社債券 | 3.8750 | 3,395 | 1,631 | 231,797 | 2028/08/15 |
| WINDSTREA 7.75% 08/15/28 144A | 社債券 | 7.7500 | 22,330 | 19,585 | 2,783,119 | 2028/08/15 |
| ON SEMICONDUCT 3.875% 09/01/28 144A | 社債券 | 3.8750 | 6,575 | 5,804 | 824,750 | 2028/09/01 |
| PIKE CORP 5.5% 9/01/28 144A | 社債券 | 5.5000 | 18,495 | 16,359 | 2,324,668 | 2028/09/01 |
| TREEHOUSE FOODS 4% 09/01/28 | 社債券 | 4.0000 | 1,800 | 1,505 | 213,896 | 2028/09/01 |
| HCA INC 5.625% 09/01/28 | 社債券 | 5.6250 | 8,770 | 8,675 | 1,232,745 | 2028/09/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| HARVEST MIDSTRE 7.5% 9/28 144A | 社債券 | 7.5000 | 12,085 | 11,600 | 1,648,415 | 2028/09/01 |
| BOOZ ALLEN 3.875% 9/01/28 144A | 社債券 | 3.8750 | 5,080 | 4,519 | 642,267 | 2028/09/01 |
| OCCIDENTAL PETR 6.375% 9/01/28 | 社債券 | 6.3750 | 5,280 | 5,338 | 758,661 | 2028/09/01 |
| BLACK KNIGHT 3.625% 09/28 144A | 社債券 | 3.6250 | 5,650 | 4,950 | 703,510 | 2028/09/01 |
| SOUTHWESTERN EN 8.375% 9/15/28 | 社債券 | 8.3750 | 5,280 | 5,448 | 774,222 | 2028/09/15 |
| TENET HEALTH 6.125% 10/01/28 144A | 社債券 | 6.1250 | 15,635 | 13,876 | 1,971,788 | 2028/10/01 |
| WEEKLEY HOMES L 4.875% 09/15/28 | 社債券 | 4.8750 | 2,460 | 1,980 | 281,498 | 2028/09/15 |
| RADIATE HOLDC 6.5% 9/15/28 144A | 社債券 | 6.5000 | 10,430 | 5,971 | 848,503 | 2028/09/15 |
| ALTICE FRANCE 5.125% 01/15/29 144A | 社債券 | 5.1250 | 4,690 | 3,602 | 511,919 | 2029/01/15 |
| CABLEVS LHT 5.625% 09/15/28 144A | 社債券 | 5.6250 | 2,090 | 1,587 | 225,619 | 2028/09/15 |
| COINBASE GLOBAL 3.375% 10/01/28 144A | 社債券 | 3.3750 | 20,330 | 11,040 | 1,568,871 | 2028/10/01 |
| GRIFOLS ES 4.75% 10/15/28 144A | 社債券 | 4.7500 | 2,255 | 1,852 | 263,208 | 2028/10/15 |
| BAUSCH HEALTH 11% 9/30/28 144A | 社債券 | 11.0000 | 4,029 | 3,102 | 440,841 | 2028/09/30 |
| SEG HLD LLC 5.625% 10/15/28 144A | 社債券 | 5.6250 | 5,080 | 4,774 | 678,418 | 2028/10/15 |
| UNITED NATURA 6.75% 10/15/28 144A | 社債券 | 6.7500 | 3,695 | 3,593 | 510,620 | 2028/10/15 |
| CONSLIDATED COM 5% 10/28 144A | 社債券 | 5.0000 | 2,990 | 2,226 | 316,390 | 2028/10/01 |
| CHENIERE ENER 4.625% 10/15/28 | 社債券 | 4.6250 | 6,660 | 6,172 | 877,120 | 2028/10/15 |
| VERTIV GROUP 4.125% 11/15/28 144A | 社債券 | 4.1250 | 6,290 | 5,418 | 769,927 | 2028/11/15 |
| LSB INDUS 6.25% 10/15/28 144A | 社債券 | 6.2500 | 580 | 517 | 73,558 | 2028/10/15 |
| CHOBANI LLC/FIN 4.625% 11/15/28 | 社債券 | 4.6250 | 2,990 | 2,601 | 369,687 | 2028/11/15 |
| CHEMOURS CO 5.75% 11/15/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 7,290 | 6,460 | 918,001 | 2028/11/15 |
| C AND S GRP 5% 12/15/28 144A | 社債券 | 5.0000 | 3,920 | 2,920 | 414,983 | 2028/12/15 |
| DISH DBS 5.75% 12/01/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 3,105 | 2,487 | 353,470 | 2028/12/01 |
| GEO GRP IN 9.5% 12/31/28 144A | 社債券 | 9.5000 | 13,485 | 12,654 | 1,798,179 | 2028/12/31 |
| HOLOGIC INC 3.25% 02/15/29 144A | 社債券 | 3.2500 | 5,215 | 4,478 | 636,377 | 2029/02/15 |
| RACKSPACE INC 5.375% 12/01/28 144A | 社債券 | 5.3750 | 2,980 | 1,348 | 191,614 | 2028/12/01 |
| H&E EQUIPMENT S 3.875% 12/15/28 | 社債券 | 3.8750 | 8,460 | 7,161 | 1,017,633 | 2028/12/15 |
| BIG RIV STL LLC 6.625% 01/31/2 | 社債券 | 6.6250 | 12,541 | 11,836 | 1,681,923 | 2029/01/31 |
| LAMAR MEDIA CRP 4.875% 01/15/2 | 社債券 | 4.8750 | 4,330 | 3,948 | 561,141 | 2029/01/15 |
| EQT CORP 5% 01/15/29 | 社債券 | 5.0000 | 5,130 | 4,874 | 692,626 | 2029/01/15 |
| STERICYCL 3.875% 01/15/29 144A | 社債券 | 3.8750 | 3,440 | 3,014 | 428,395 | 2029/01/15 |
| CNX RESOURCES C 6% 01/15/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 2,465 | 2,320 | 329,795 | 2029/01/15 |
| ASSUREDPARTNE 5.625% 01/15/29 144A | 社債券 | 5.6250 | 2,965 | 2,497 | 354,824 | 2029/01/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 6% 01/15/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 7,465 | 6,132 | 871,459 | 2029/01/15 |
| SCRIPPS ESC I 3.875% 01/15/29 144A | 社債券 | 3.8750 | 4,720 | 3,823 | 543,276 | 2029/01/15 |
| REALOGY GROUP 5.75% 01/15/29 144A | 社債券 | 5.7500 | 2,725 | 2,016 | 286,544 | 2029/01/15 |
| CROWDSTRIKE HOL 3% 02/15/29 | 社債券 | 3.0000 | 6,125 | 5,200 | 738,981 | 2029/02/15 |
| CHS/CMNTY HEA 6.875% 04/15/29 144A | 社債券 | 6.8750 | 6,570 | 3,456 | 491,146 | 2029/04/15 |
| UNITI/FIN/CSL 6.5% 02/15/29 144A | 社債券 | 6.5000 | 7,695 | 5,575 | 792,298 | 2029/02/15 |
| REAL HERO 6.25% 02/01/29 144A | 社債券 | 6.2500 | 1,595 | 1,163 | 165,358 | 2029/02/01 |
| US FOODS INC 4.75% 02/15/29 144A | 社債券 | 4.7500 | 7,250 | 6,450 | 916,560 | 2029/02/15 |
| JAZZ SECU DAC 4.375% 01/15/29 | 社債券 | 4.3750 | 4,460 | 3,982 | 565,972 | 2029/01/15 |
| TRANSDIGM INC 4.625% 01/15/29 | 社債券 | 4.6250 | 8,355 | 7,310 | 1,038,839 | 2029/01/15 |
| FERTITTA ENTERT 4.625% 01/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 6,405 | 5,624 | 799,248 | 2029/01/15 |
| MATCH GRP 5.625% 02/15/29 144A | 社債券 | 5.6250 | 5,645 | 5,155 | 732,543 | 2029/02/15 |
| CRESTWOOD M P/F 6% 02/01/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 17,165 | 16,060 | 2,282,211 | 2029/02/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| MEG ENERGY CRP 5.875% 02/01/29 144A | 社債券 | 5.8750 | 7,390 | 6,909 | 981,861 | 2029/02/01 |
| CLEVELAND-CLIF 4.625% 3/1/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,385 | 2,961 | 420,882 | 2029/03/01 |
| AVIS BUDGET 5.375% 03/01/29 144A | 社債券 | 5.3750 | 3,385 | 2,967 | 421,738 | 2029/03/01 |
| COMSTOCK RESO 6.75% 03/29 144A | 社債券 | 6.7500 | 7,995 | 7,630 | 1,084,283 | 2029/03/01 |
| ICAHN LP/FN CO 4.375% 02/01/29 | 社債券 | 4.3750 | 5,925 | 5,011 | 712,123 | 2029/02/01 |
| MERCER INTL 5.125% 02/01/29 | 社債券 | 5.1250 | 5,195 | 4,340 | 616,833 | 2029/02/01 |
| SOUTHWESTERN EN 5.375% 02/29 | 社債券 | 5.3750 | 10,290 | 9,492 | 1,348,887 | 2029/02/01 |
| JACOBS ENT 6.75% 02/15/29 144A | 社債券 | 6.7500 | 2,750 | 2,459 | 349,540 | 2029/02/15 |
| NCL CORP 7.75% 02/15/29 144A | 社債券 | 7.7500 | 5,710 | 4,581 | 651,035 | 2029/02/15 |
| HUDBAY MINERAL 6.125% 4/01/29 144A | 社債券 | 6.1250 | 9,850 | 8,819 | 1,253,263 | 2029/04/01 |
| ALBERTSONS 3.5% 03/15/29 144A | 社債券 | 3.5000 | 3,395 | 2,829 | 402,114 | 2029/03/15 |
| KENNEDY-WILSON 4.75% 03/01/29 | 社債券 | 4.7500 | 5,095 | 4,028 | 572,386 | 2029/03/01 |
| TTM TECH INC 4% 03/01/29 144A | 社債券 | 4.0000 | 5,085 | 4,327 | 614,993 | 2029/03/01 |
| TRONOX INC 4.625% 03/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 5,040 | 4,075 | 579,156 | 2029/03/15 |
| CHARLES RIVER L 3.75% 03/15/29 144A | 社債券 | 3.7500 | 1,680 | 1,475 | 209,720 | 2029/03/15 |
| ALCOA NEDERLAND 4.125% 03/31/29 144A | 社債券 | 4.1250 | 6,035 | 5,235 | 743,945 | 2029/03/31 |
| CROCS INC 4.25% 03/15/29 144A | 社債券 | 4.2500 | 8,285 | 6,876 | 977,157 | 2029/03/15 |
| MATTEL INC 3.75% 04/01/29 144A | 社債券 | 3.7500 | 1,685 | 1,459 | 207,413 | 2029/04/01 |
| TRITON WAT 6.25% 04/01/29 144A | 社債券 | 6.2500 | 2,425 | 1,839 | 261,376 | 2029/04/01 |
| NESCO HOLDING 5.5% 04/15/29 144A | 社債券 | 5.5000 | 3,975 | 3,468 | 492,829 | 2029/04/15 |
| ARCOSA INC 0% 03/31/29 144A | 社債券 | 4.3750 | 3,160 | 2,711 | 385,308 | 2029/04/15 |
| MOZART DEBT 3.875% 04/01/29 144A | 社債券 | 3.8750 | 9,715 | 8,220 | 1,168,180 | 2029/04/01 |
| CLYDESDALE ACQU 6.625% 3/29 144A | 社債券 | 6.6250 | 2,320 | 2,244 | 318,918 | 2029/04/15 |
| DPL INC 4.35% 04/15/29 | 社債券 | 4.3500 | 22,705 | 20,135 | 2,861,186 | 2029/04/15 |
| TEMPUR SEALY 4% 04/15/29 144A | 社債券 | 4.0000 | 5,280 | 4,441 | 631,097 | 2029/04/15 |
| SENSATA TECHNOL 4% 04/15/29 14 | 社債券 | 4.0000 | 5,575 | 4,769 | 677,757 | 2029/04/15 |
| MAGIC MERG 7.875% 05/1/29 144A | 社債券 | 7.8750 | 7,910 | 4,610 | 655,219 | 2029/05/01 |
| CROWNROCK LP / 5% 05/1/29 144A | 社債券 | 5.0000 | 1,855 | 1,678 | 238,553 | 2029/05/01 |
| UNITED AIRLIN 4.625% 04/30/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,645 | 3,201 | 454,955 | 2029/04/15 |
| SCIH SALT 6.625% 05/01/29 144A | 社債券 | 6.6250 | 3,900 | 3,238 | 460,127 | 2029/05/01 |
| HIGHTOWER 6.75% 04/15/29 144A | 社債券 | 6.7500 | 2,160 | 1,783 | 253,433 | 2029/04/15 |
| LCM INVESTMENTS 4.875% 05/01/29 144A | 社債券 | 4.8750 | 5,860 | 4,935 | 701,313 | 2029/05/01 |
| NOVA CHEM CORP 4.25% 05/15/29 144A | 社債券 | 4.2500 | 6,005 | 4,913 | 698,204 | 2029/05/15 |
| TKC HOLDIN 10.5% 05/15/29 144A | 社債券 | 10.5000 | 4,280 | 2,486 | 353,393 | 2029/05/15 |
| ALLIED UNV 6% 06/01/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 2,375 | 1,710 | 242,991 | 2029/06/01 |
| VICTORS MERGER 6.375% 05/15/29 144A | 社債券 | 6.3750 | 7,820 | 4,829 | 686,212 | 2029/05/15 |
| DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29 | 社債券 | 5.1250 | 9,305 | 9,029 | 1,283,115 | 2029/05/15 |
| HILTON DOMESTIC 3.75% 05/01/29 | 社債券 | 3.7500 | 3,440 | 2,962 | 420,989 | 2029/05/01 |
| FRONTIER COMM 6.75% 05/01/29 144A | 社債券 | 6.7500 | 5,810 | 4,837 | 687,428 | 2029/05/01 |
| GREAT LAKE 5.25% 06/01/29 144A | 社債券 | 5.2500 | 3,140 | 2,457 | 349,173 | 2029/06/01 |
| CLEAR CHANNEL 7.5% 06/01/29 144A | 社債券 | 7.5000 | 5,830 | 4,299 | 610,976 | 2029/06/01 |
| SRS DISTRIBUTIO 6.125% 07/01/29 144A | 社債券 | 6.1250 | 2,260 | 1,891 | 268,844 | 2029/07/01 |
| DT MIDSTREAM 4.125% 06/15/29 144A | 社債券 | 4.1250 | 5,735 | 5,013 | 712,350 | 2029/06/15 |
| SUNOCO LP /CORP 4.5% 05/15/29 | 社債券 | 4.5000 | 4,765 | 4,104 | 583,232 | 2029/05/15 |
| NRG ENERGY 5.25% 06/15/29 144A | 社債券 | 5.2500 | 5,385 | 4,931 | 700,701 | 2029/06/15 |
| SERVICE CO INTL 5.125% 6/1/29 | 社債券 | 5.1250 | 3,060 | 2,860 | 406,444 | 2029/06/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|--------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| SYNAPTICS INC 4% 06/15/29 144A | 社債券 | 4.0000 | 2,730 | 2,252 | 320,044 | 2029/06/15 |
| TENET HEALTH 4.25% 06/01/29 144A | 社債券 | 4.2500 | 14,290 | 12,289 | 1,746,323 | 2029/06/01 |
| MADISON IAQ 5.875% 6/29 144A | 社債券 | 5.8750 | 6,155 | 4,585 | 651,595 | 2029/06/30 |
| AHP HEALTH PAR 5.75% 7/29 144A | 社債券 | 5.7500 | 5,900 | 4,616 | 656,040 | 2029/07/15 |
| ELASTIC 4.125% 07/15/29 144A | 社債券 | 4.1250 | 2,790 | 2,254 | 320,394 | 2029/07/15 |
| VICTORIA'S 4.625% 07/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,640 | 2,961 | 420,829 | 2029/07/15 |
| CENTRAL PARENT 7.25% 06/15/29 | 社債券 | 7.2500 | 9,310 | 8,920 | 1,267,611 | 2029/06/15 |
| LEVEL 3 FIN 3.75% 07/15/29 144A | 社債券 | 3.7500 | 8,720 | 6,300 | 895,258 | 2029/07/15 |
| LCPR SENIOR 5.125% 7/29 144A | 社債券 | 5.1250 | 5,635 | 4,625 | 657,274 | 2029/07/15 |
| ALTICE FRANCE 5.125% 7/29 144A | 社債券 | 5.1250 | 9,920 | 7,612 | 1,081,779 | 2029/07/15 |
| COLGATE ENERGY 5.875% 07/01/29 | 社債券 | 5.8750 | 5,640 | 5,217 | 741,335 | 2029/07/01 |
| SEASPAN CORPORA 5.5% 08/01/29 144A | 社債券 | 5.5000 | 8,005 | 6,004 | 853,303 | 2029/08/01 |
| PERFORMANCE FO 4.25% 08/01/29 144A | 社債券 | 4.2500 | 2,925 | 2,539 | 360,856 | 2029/08/01 |
| AMWINS GROUP 4.875% 06/30/29 144A | 社債券 | 4.8750 | 3,035 | 2,596 | 368,915 | 2029/06/30 |
| VENTURE GLOBAL 3.875% 08/15/29 144 | 社債券 | 3.8750 | 4,765 | 4,133 | 587,389 | 2029/08/15 |
| MPT OPER PARTNERSHIP LP/CORP 4 | 社債券 | 4.6250 | 8,370 | 6,633 | 942,581 | 2029/08/01 |
| ASHTON WOODS US 4.625% 08/01/2 | 社債券 | 4.6250 | 2,985 | 2,324 | 330,253 | 2029/08/01 |
| ALTICE FING SA 5.75% 8/29 144A | 社債券 | 5.7500 | 15,990 | 12,931 | 1,837,624 | 2029/08/15 |
| UBER TECH INC 4.5% 08/15/29 144A | 社債券 | 4.5000 | 27,145 | 23,698 | 3,367,503 | 2029/08/15 |
| WR GRACE HLG 5.625% 08/29 144A | 社債券 | 5.6250 | 5,070 | 4,101 | 582,877 | 2029/08/15 |
| CCO HLDGS/CAP 6.375% 9/29 144A | 社債券 | 6.3750 | 4,755 | 4,458 | 633,488 | 2029/09/01 |
| TEGNA INC 5% 09/15/29 | 社債券 | 5.0000 | 13,405 | 12,596 | 1,789,988 | 2029/09/15 |
| PAPA JOHNS IN 3.875% 09/15/29 144A | 社債券 | 3.8750 | 1,830 | 1,535 | 218,235 | 2029/09/15 |
| ALLEGHENY TECH 4.875% 10/01/29 | 社債券 | 4.8750 | 2,540 | 2,155 | 306,342 | 2029/10/01 |
| CAESARS ENTERTA 4.625% 10/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 6,000 | 4,956 | 704,273 | 2029/10/15 |
| ROLLER BEARING 4.375% 10/15/29 144A | 社債券 | 4.3750 | 1,440 | 1,256 | 178,526 | 2029/10/15 |
| HEALTH EQUITY INC 4.5% 10/01/29 144A | 社債券 | 4.5000 | 2,085 | 1,793 | 254,799 | 2029/10/01 |
| QORVO INC 4.375% 10/15/29 | 社債券 | 4.3750 | 3,915 | 3,423 | 486,425 | 2029/10/15 |
| THOR INDUSTRIES 4% 10/15/29 144A | 社債券 | 4.0000 | 6,650 | 5,270 | 748,884 | 2029/10/15 |
| ALLIANT HLDG 5.875% 11/01/29 144A | 社債券 | 5.8750 | 6,220 | 5,159 | 733,110 | 2029/11/01 |
| OPTION CARE HEA 4.375% 10/31/29 | 社債券 | 4.3750 | 2,165 | 1,851 | 263,037 | 2029/10/31 |
| MSCI INC 4% 11/15/29 144A | 社債券 | 4.0000 | 13,690 | 12,037 | 1,710,467 | 2029/11/15 |
| FRONTIER 5.875% 11/01/29 144A | 社債券 | 5.8750 | 1,284 | 1,014 | 144,230 | 2029/11/01 |
| CHEMOURS 4.625% 11/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 4,800 | 3,857 | 548,105 | 2029/11/15 |
| AVANTOR FUNDING 3.875% 11/01/29 | 社債券 | 3.8750 | 4,710 | 4,009 | 569,733 | 2029/11/01 |
| ASBURY AUTOMO 4.625% 11/15/29 144A | 社債券 | 4.6250 | 3,075 | 2,633 | 374,223 | 2029/11/15 |
| PECF USS INTERM 8% 11/29 144A | 社債券 | 8.0000 | 1,765 | 1,037 | 147,496 | 2029/11/15 |
| SRS DISTRIBUTIO 6% 12/01/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 3,575 | 2,920 | 415,021 | 2029/12/01 |
| OPEN TEXT CORP 3.875% 12/01/29 144A | 社債券 | 3.8750 | 4,655 | 3,682 | 523,280 | 2029/12/01 |
| HERTZ 5% 12/01/29 144A | 社債券 | 5.0000 | 4,675 | 3,646 | 518,167 | 2029/12/01 |
| SPIRIT AE 9.375% 11/30/29 144A | 社債券 | 9.3750 | 12,000 | 12,480 | 1,773,408 | 2029/11/30 |
| TRANSALTA 7.75% 11/15/29 144A | 社債券 | 7.7500 | 4,735 | 4,830 | 686,381 | 2029/11/15 |
| UNITED RENTAL 6% 12/29 144A | 社債券 | 6.0000 | 13,860 | 13,902 | 1,975,512 | 2029/12/15 |
| CENTENE CORP 4.625% 12/15/29 | 社債券 | 4.6250 | 9,050 | 8,371 | 1,189,554 | 2029/12/15 |
| COMSTOCK 5.875% 01/15/30 144A | 社債券 | 5.8750 | 3,545 | 3,214 | 456,780 | 2030/01/15 |
| UNITI GRP/UNI 6% 01/15/30 144A | 社債券 | 6.0000 | 14,240 | 9,869 | 1,402,389 | 2030/01/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|--------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| HUB INTE 5.625% 12/01/29 144A | 社債券 | 5.6250 | 4,185 | 3,703 | 526,311 | 2029/12/01 |
| II-VI INC 5% 12/15/29 144A | 社債券 | 5.0000 | 3,060 | 2,669 | 379,385 | 2029/12/15 |
| COVERT M 4.875% 12/01/29 144A | 社債券 | 4.8750 | 2,965 | 2,511 | 356,821 | 2029/12/01 |
| CSC HOLDINGS 5.75% 01/30 144A | 社債券 | 5.7500 | 8,985 | 6,109 | 868,202 | 2030/01/15 |
| JBS USA/LUX/FI 5.5% 01/30 144A | 社債券 | 5.5000 | 10,595 | 10,002 | 1,421,329 | 2030/01/15 |
| ZIGGO BV 4.875% 01/15/2030 144 | 社債券 | 4.8750 | 4,150 | 3,550 | 504,501 | 2030/01/15 |
| ZIGGO BOND CO 5.125% 02/28/30 144A | 社債券 | 5.1250 | 2,840 | 2,272 | 322,851 | 2030/02/28 |
| FRONTIER COMM 6% 01/31/30 144A | 社債券 | 6.0000 | 6,275 | 4,983 | 708,170 | 2030/01/15 |
| LAMB WESTON 4.125% 01/30 144A | 社債券 | 4.1250 | 4,710 | 4,138 | 588,139 | 2030/01/31 |
| TENET HEALTH 4.375% 01/15/30 144A | 社債券 | 4.3750 | 14,020 | 11,987 | 1,703,366 | 2030/01/15 |
| FERTITTA ENTERT 6.75% 07/15/30 144A | 社債券 | 6.7500 | 11,205 | 9,277 | 1,318,366 | 2030/07/15 |
| MIWD HOLDCO II 5.5% 02/01/30 144A | 社債券 | 5.5000 | 1,300 | 1,046 | 148,705 | 2030/02/01 |
| VISTAJET MAL/XO 6.375% 02/01/30 144A | 社債券 | 6.3750 | 9,445 | 7,738 | 1,099,570 | 2030/02/01 |
| ERO COPPER 6.5% 2/15/30 144A | 社債券 | 6.5000 | 20,070 | 15,466 | 2,197,767 | 2030/02/15 |
| MINERVA MERGE 6.5% 02/15/30 144A | 社債券 | 6.5000 | 18,835 | 13,884 | 1,973,027 | 2030/02/15 |
| INTELSAT JACKSN 6.5% 1/30 144A | 社債券 | 6.5000 | 23,650 | 21,575 | 3,065,833 | 2030/03/15 |
| ALBERTSONS 4.875% 2/15/30 144A | 社債券 | 4.8750 | 15,497 | 13,666 | 1,941,942 | 2030/02/15 |
| OPEN TEXT 4.125% 2/15/30 144A | 社債券 | 4.1250 | 7,655 | 6,200 | 881,098 | 2030/02/15 |
| CENTENE CORP 3.375% 2/15/30 WI | 社債券 | 3.3750 | 4,895 | 4,160 | 591,242 | 2030/02/15 |
| HESS INFRA/FI 4.25% 02/30 144A | 社債券 | 4.2500 | 3,345 | 2,834 | 402,837 | 2030/02/15 |
| GRAPHIC PACK 3.75% 02/30 144A | 社債券 | 3.7500 | 2,510 | 2,120 | 301,308 | 2030/02/01 |
| CCO HLDGS 4.75% 03/01/30 144A | 社債券 | 4.7500 | 12,395 | 10,566 | 1,501,533 | 2030/03/01 |
| ASBURY AUTOMOTI 4.75% 03/01/30 | 社債券 | 4.7500 | 1,662 | 1,415 | 201,098 | 2030/03/01 |
| MACYS RTL HLDG 5.875% 03/15/30 | 社債券 | 5.8750 | 2,010 | 1,763 | 250,632 | 2030/03/15 |
| OWENS MINOR INC 6.625% 04/30 144A | 社債券 | 6.6250 | 8,620 | 7,521 | 1,068,873 | 2030/04/01 |
| CLYDESDALE ACQUI 8.75% 03/30 144A | 社債券 | 8.7500 | 13,965 | 12,782 | 1,816,385 | 2030/04/15 |
| CDI ESCROW ISSU 5.75% 04/01/30 144A | 社債券 | 5.7500 | 9,515 | 8,689 | 1,234,842 | 2030/04/01 |
| POST HLDGS IN 4.625% 4/30 144A | 社債券 | 4.6250 | 1,416 | 1,226 | 174,250 | 2030/04/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 6.125% 04/01/30 144A | 社債券 | 6.1250 | 12,790 | 6,187 | 879,250 | 2030/04/01 |
| REALOGY GR 5.25% 04/15/30 144A | 社債券 | 5.2500 | 7,925 | 5,563 | 790,585 | 2030/04/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 5.25% 05/15/30 144A | 社債券 | 5.2500 | 10,895 | 8,280 | 1,176,616 | 2030/05/15 |
| MINERAL RES 8.5% 5/1/30 144A | 社債券 | 8.5000 | 1,465 | 1,477 | 209,950 | 2030/05/01 |
| DAVITA INC 0% 05/31/30 144A | 社債券 | 4.6250 | 14,645 | 11,458 | 1,628,300 | 2030/06/01 |
| ROBLOX CO 3.875% 05/01/30 144A | 社債券 | 3.8750 | 22,315 | 17,801 | 2,529,571 | 2030/05/01 |
| US FOODS INC 4.625% 06/01/30 144A | 社債券 | 4.6250 | 2,370 | 2,067 | 293,848 | 2030/06/01 |
| FRONTIER COMM 8.75% 05/15/30 144A | 社債券 | 8.7500 | 4,885 | 4,956 | 704,286 | 2030/05/15 |
| DARLING INGRED 6% 6/15/30 144A | 社債券 | 6.0000 | 4,950 | 4,807 | 683,130 | 2030/06/15 |
| SIRIUS XM R 4.125% 7/1/30 144A | 社債券 | 4.1250 | 4,755 | 3,992 | 567,373 | 2030/07/01 |
| TENET HEALTH 6.125% 06/15/30 144A | 社債券 | 6.1250 | 8,165 | 7,684 | 1,091,919 | 2030/06/15 |
| ADVANCED DRAIN 6.375% 06/15/30 144A | 社債券 | 6.3750 | 8,020 | 7,674 | 1,090,512 | 2030/06/15 |
| UNIVISION COM 7.375% 06/30/30 144A | 社債券 | 7.3750 | 7,630 | 7,458 | 1,059,827 | 2030/06/30 |
| PG&E CORP 5.25% 07/01/30 | 社債券 | 5.2500 | 19,645 | 17,606 | 2,501,819 | 2030/07/01 |
| OCCIDENTL PETE 8.875% 07/15/30 | 社債券 | 8.8750 | 14,070 | 16,049 | 2,280,695 | 2030/07/15 |
| PG&E 4.55% 07/01/30 | 社債券 | 4.5500 | 36,411 | 32,999 | 4,689,211 | 2030/07/01 |
| DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30 | 社債券 | 8.1250 | 425 | 469 | 66,783 | 2030/08/16 |
| VICI PROPE 4.125% 8/15/30 144A | 社債券 | 4.1250 | 5,935 | 5,091 | 723,487 | 2030/08/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|---------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 08/30 144A | 社債券 | 4.5000 | 12,200 | 10,105 | 1,435,940 | 2030/08/15 |
| MATCH GROUP INC 4.125% 08/01/2 | 社債券 | 4.1250 | 5,750 | 4,743 | 674,086 | 2030/08/01 |
| FMG RES AG 5.875% 4/15/30 144A | 社債券 | 5.8750 | 9,275 | 8,553 | 1,215,504 | 2030/04/15 |
| ENLINK MIDSTR 6.5% 9/1/30 144A | 社債券 | 6.5000 | 4,735 | 4,735 | 672,843 | 2030/09/01 |
| OCCIDENTAL PETE 6.625% 9/1/30 | 社債券 | 6.6250 | 17,605 | 18,318 | 2,602,988 | 2030/09/01 |
| L BRANDS INC 6.625% 10/01/30 144A | 社債券 | 6.6250 | 10,425 | 9,669 | 1,373,991 | 2030/10/01 |
| 1011778 BC ULC 4% 10/15/30 144A | 社債券 | 4.0000 | 10,310 | 8,557 | 1,215,992 | 2030/10/15 |
| DANA INC 4.25% 09/01/30 | 社債券 | 4.2500 | 3,175 | 2,563 | 364,317 | 2030/09/01 |
| CENTRAL GARDEN 4.125% 10/15/30 | 社債券 | 4.1250 | 3,435 | 2,872 | 408,184 | 2030/10/15 |
| HESS MIDSTREAM 5.5% 10/30 144A | 社債券 | 5.5000 | 1,990 | 1,801 | 256,053 | 2030/10/15 |
| BAUSCH HEALTH 14% 10/30 144A | 社債券 | 14.0000 | 797 | 470 | 66,819 | 2030/10/15 |
| MOLINA HEALTHCA 3.875% 11/15/30 144A | 社債券 | 3.8750 | 4,985 | 4,248 | 603,735 | 2030/11/15 |
| FORD MTR CR LLC 4% 11/13/30 | 社債券 | 4.0000 | 3,440 | 2,880 | 409,292 | 2030/11/13 |
| CSC HLDGS LLC 4.125% 12/01/30 144A | 社債券 | 4.1250 | 5,315 | 4,023 | 571,702 | 2030/12/01 |
| SPRINGLEAF CORP 4% 09/15/30 | 社債券 | 4.0000 | 6,100 | 4,556 | 647,437 | 2030/09/15 |
| TALLGRASS LP 6% 12/31/30 144A | 社債券 | 6.0000 | 5,145 | 4,630 | 657,994 | 2030/12/31 |
| CNX RESOURCES 7.375% 01/15/31 144A | 社債券 | 7.3750 | 3,710 | 3,645 | 517,965 | 2031/01/15 |
| OCCIDENTAL PETRO 6.125% 01/01/31 | 社債券 | 6.1250 | 12,810 | 12,954 | 1,840,870 | 2031/01/01 |
| SCRIPPS ESC II 5.375% 01/15/31 144A | 社債券 | 5.3750 | 2,450 | 1,874 | 266,330 | 2031/01/15 |
| MURPHY OIL USA 3.75% 02/15/31 144A | 社債券 | 3.7500 | 2,245 | 1,850 | 262,950 | 2031/02/15 |
| CHS/CMNTY HEALT 4.75% 02/15/31 144A | 社債券 | 4.7500 | 26,430 | 19,169 | 2,724,011 | 2031/02/15 |
| CSC HLDGS LLC 3.375% 02/15/31 144A | 社債券 | 3.3750 | 7,020 | 4,951 | 703,646 | 2031/02/15 |
| DAVITA INC 3.75% 02/15/31 144A | 社債券 | 3.7500 | 5,275 | 3,798 | 539,695 | 2031/02/15 |
| COMMERCIAL META 3.875% 02/15/31 | 社債券 | 3.8750 | 2,620 | 2,124 | 301,843 | 2031/02/15 |
| CLEVELAND-CLIF 4.875% 3/1/31 144A | 社債券 | 4.8750 | 3,385 | 2,922 | 415,331 | 2031/03/01 |
| KENNEDY-WILSON 5% 03/01/31 | 社債券 | 5.0000 | 5,095 | 3,973 | 564,611 | 2031/03/01 |
| CHARLES RIVER L 4% 03/15/31 144A | 社債券 | 4.0000 | 4,710 | 4,084 | 580,395 | 2031/03/15 |
| FMG RES AUG LTD 4.375% 04/01/31 144A | 社債券 | 4.3750 | 3,615 | 3,005 | 427,134 | 2031/04/01 |
| ORGANON FINAN 5.125% 04/30/31 144A | 社債券 | 5.1250 | 6,600 | 5,688 | 808,388 | 2031/04/30 |
| SCOTTS MIRACLE 4% 04/01/31 | 社債券 | 4.0000 | 3,370 | 2,586 | 367,538 | 2031/04/01 |
| OCCIDENTAL PETE 7.5% 05/01/31 | 社債券 | 7.5000 | 22,290 | 23,906 | 3,397,046 | 2031/05/01 |
| EQT CORP 3.625% 05/15/31 144A | 社債券 | 3.6250 | 3,875 | 3,335 | 473,994 | 2031/05/15 |
| BLOCK INC 3.5% 06/01/31 | 社債券 | 3.5000 | 5,755 | 4,668 | 663,363 | 2031/06/01 |
| DT MIDSTREAM 4.375% 06/15/31 144A | 社債券 | 4.3750 | 5,735 | 4,906 | 697,167 | 2031/06/15 |
| CQP HOLDCO 5.5% 06/15/31 144A | 社債券 | 5.5000 | 16,265 | 14,577 | 2,071,463 | 2031/06/15 |
| FORD MTR CR LLC 3.625% 6/17/31 | 社債券 | 3.6250 | 5,490 | 4,377 | 622,098 | 2031/06/17 |
| MC BRAZIL DWNST 7.25% 06/31 144A | 社債券 | 7.2500 | 16,050 | 13,368 | 1,899,713 | 2031/06/30 |
| VENTURE GLOBAL 4.125% 08/15/31 144A | 社債券 | 4.1250 | 4,765 | 4,127 | 586,523 | 2031/08/15 |
| CROCS INC 4.125% 08/15/31 144A | 社債券 | 4.1250 | 8,120 | 6,475 | 920,196 | 2031/08/15 |
| ALLEGHENY TECH 5.125% 10/01/31 | 社債券 | 5.1250 | 1,780 | 1,485 | 211,064 | 2031/10/01 |
| COINBASE GLOBAL 3.625% 10/01/31 | 社債券 | 3.6250 | 12,770 | 6,547 | 930,426 | 2031/10/01 |
| ALLY 8% GLOBAL | 社債券 | 8.0000 | 34,804 | 37,103 | 5,272,357 | 2031/11/01 |
| ALLY FINANCIAL 8% 11/01/31 | 社債券 | 8.0000 | 18,070 | 19,143 | 2,720,296 | 2031/11/01 |
| TENET HEALTH 6.875% 11/15/31 | 社債券 | 6.8750 | 725 | 631 | 89,758 | 2031/11/15 |
| CSC HLDGS LLC 4.5% 11/15/31 144A | 社債券 | 4.5000 | 4,930 | 3,722 | 528,896 | 2031/11/15 |
| CSC HLDGS LLC 5% 11/15/31 144A | 社債券 | 5.0000 | 5,185 | 3,280 | 466,202 | 2031/11/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|--------------------------------------|-----|--------|-----------|-----------|-------------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| SOUTHWESTERN EN 4.75% 02/01/32 | 社債券 | 4.7500 | 4,720 | 4,070 | 578,361 | 2032/02/01 |
| HILTON DOMEST 3.625% 02/15/32 144A | 社債券 | 3.6250 | 3,430 | 2,761 | 392,476 | 2032/02/15 |
| YUM BRANDS INC 4.625% 01/31/32 | 社債券 | 4.6250 | 5,800 | 5,096 | 724,248 | 2032/01/31 |
| VZ SECURED FINA 5% 01/15/32 14 | 社債券 | 5.0000 | 15,310 | 12,669 | 1,800,268 | 2032/01/15 |
| NRG ENERGY INC 3.875% 02/15/32 144A | 社債券 | 3.8750 | 2,945 | 2,361 | 335,503 | 2032/02/15 |
| ASBURY AUTOMO 5% 02/15/32 144A | 社債券 | 5.0000 | 3,075 | 2,560 | 363,802 | 2032/02/15 |
| FORD MOTOR 3.25% 02/12/32 | 社債券 | 3.2500 | 9,450 | 7,366 | 1,046,801 | 2032/02/12 |
| BUILDERS F 4.25% 02/01/32 144A | 社債券 | 4.2500 | 12,090 | 9,867 | 1,402,188 | 2032/02/01 |
| BELLRING BRANDS 7% 3/30 144A | 社債券 | 7.0000 | 1,860 | 1,778 | 252,742 | 2030/03/15 |
| SPRINT CAP CORP 8.75% 3/15/32 | 社債券 | 8.7500 | 44,955 | 53,046 | 7,537,964 | 2032/03/15 |
| MACYS RTL HLDG 6.125% 03/15/32 | 社債券 | 6.1250 | 2,345 | 1,976 | 280,898 | 2032/03/15 |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 05/01/32 | 社債券 | 4.5000 | 4,545 | 3,650 | 518,793 | 2032/05/01 |
| MOLINA HEALTHCA 3.875% 05/15/32 144A | 社債券 | 3.8750 | 6,725 | 5,615 | 797,944 | 2032/05/15 |
| FORD MOTOR 6.1% 08/19/32 | 社債券 | 6.1000 | 9,770 | 9,328 | 1,325,551 | 2032/08/19 |
| CCO HLDGS/CAP 4.5% 04/33 144A | 社債券 | 4.5000 | 9,955 | 7,762 | 1,103,052 | 2033/06/01 |
| CCO HLDGS/ 4.25% 01/15/34 144A | 社債券 | 4.2500 | 8,000 | 6,012 | 854,396 | 2034/01/15 |
| CF INDUSTRI INC 5.15% 03/15/34 | 社債券 | 5.1500 | 5,115 | 4,823 | 685,476 | 2034/03/15 |
| OCCIDENTAL PETE 6.45% 09/15/36 | 社債券 | 6.4500 | 4,200 | 4,193 | 595,859 | 2036/09/15 |
| ALCOA INC GLB 5.95 2/1/37 | 社債券 | 5.9500 | 3,730 | 3,518 | 499,943 | 2037/02/01 |
| OCCIDENTAL PETRO 4.3% 08/15/39 | 社債券 | 4.3000 | 2,145 | 1,738 | 246,980 | 2039/08/15 |
| OCCIDENTAL PETE 6.2% 03/15/40 | 社債券 | 6.2000 | 2,405 | 2,326 | 330,650 | 2040/03/15 |
| PACIFIC GAS & ELE 3.75% 8/15/42 | 社債券 | 3.7500 | 855 | 567 | 80,643 | 2042/08/15 |
| DCP MIDSTR 5.85% 5/21/43 144A | 社債券 | 5.8500 | 5,575 | 5,461 | 776,093 | 2043/05/21 |
| CF INDUS INC 5.375% 03/15/44 | 社債券 | 5.3750 | 5,780 | 5,186 | 736,978 | 2044/03/15 |
| OCCIDENTAL PETE 4.5% 07/15/44 | 社債券 | 4.5000 | 1,985 | 1,602 | 227,770 | 2044/07/15 |
| OCCIDENTAL PETE 6.6% 03/15/46 | 社債券 | 6.6000 | 5,365 | 5,378 | 764,272 | 2046/03/15 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM 4.4% 4/46 | 社債券 | 4.4000 | 4,275 | 3,398 | 482,944 | 2046/04/15 |
| KRAFT HEINZ CO 4.375% 6/1/46 | 社債券 | 4.3750 | 1,500 | 1,245 | 177,025 | 2046/06/01 |
| PACIFIC GAS & ELEC 3.95% 12/47 | 社債券 | 3.9500 | 5,170 | 3,549 | 504,334 | 2047/12/01 |
| KRAFT HEINZ FD 4.875% 10/01/49 | 社債券 | 4.8750 | 7,485 | 6,630 | 942,174 | 2049/10/01 |
| ALLIANT HLDG PREF A 9.75% PERP | 社債券 | 9.7500 | 3,000 | 2,482 | 352,763 | 2049/12/31 |
| JPMORGAN CHASE 5.15% PERP | 社債券 | 5.1500 | 35,000 | 34,346 | 4,880,595 | 2049/12/31 |
| CITIGROUP 5.35% PERP | 社債券 | 5.3500 | 25,370 | 24,727 | 3,513,832 | 2049/12/31 |
| BANK OF AMERICA 6.1% VAR PERP | 社債券 | 6.1000 | 12,630 | 12,309 | 1,749,137 | 2049/12/31 |
| KRAFT HEINZ FD 5.5% 06/01/50 | 社債券 | 5.5000 | 1,990 | 1,936 | 275,169 | 2050/06/01 |
| PG&E 4.95% 07/01/50 | 社債券 | 4.9500 | 40,141 | 31,493 | 4,475,271 | 2050/07/01 |
| CITIGROUP INC 5%/VAR PERP | 社債券 | 5.0000 | 5,310 | 4,797 | 681,782 | 2049/12/31 |
| BK OF AMERCA CORP 4.3%/VAR PRP | 社債券 | 4.3000 | 6,295 | 5,416 | 769,734 | 2049/12/31 |
| CA MAGNUM HLD 5.375% 10/31/26 144A | 社債券 | 5.3750 | 1,565 | 1,369 | 194,588 | 2026/10/31 |
| OPEN TEXT HOLDI 4.125% 12/01/31 144A | 社債券 | 4.1250 | 4,655 | 3,613 | 513,510 | 2031/12/01 |
| STATION CAS LLC 4.625% 12/01/31 144A | 社債券 | 4.6250 | 7,800 | 6,385 | 907,319 | 2031/12/01 |
| 小計 | | — | 4,012,813 | 3,459,039 | 491,529,560 | — |
| 合計 | | — | — | — | 491,529,560 | — |

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(4) 金銭債権

(A) 金銭債権

| 区 分 | 当 期 末 | | |
|---------|---------------------|------------------|------------|
| | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 187,556 | 千円 26,651,836 | % <4.4> |
| 合 計 | — | 26,651,836 | <4.4> |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)金銭債権

| 銘 柄 | 種 類 | 利 率 | 当 期 末 | | | 償 還 年 月 日 |
|------------------------------------|------|----------|----------|-----------|-------------|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C1 | 金銭債権 | 0.00000 | 1,814 | 0 | 0 | 2049/12/31 |
| SANCHEZ TERM 1LN DIP 05/11/20 C2 | 金銭債権 | 0.00000 | 1,638 | 0 | 0 | 2049/12/31 |
| SANCHEZ DIP ROLL UP TL 5/11/20 C1 | 金銭債権 | 0.00000 | 1,489 | 0 | 0 | 2049/12/31 |
| USI TERM B INCR 05/16/24 | 金銭債権 | 6.42414 | 2,422 | 2,415 | 343,269 | 2024/05/16 |
| CITGO TERM LOAN B 1LN 03/28/24 C1 | 金銭債権 | 10.00386 | 12,544 | 12,541 | 1,782,150 | 2024/03/28 |
| INTERNET TM 1LN 09/15/2024 C1 | 金銭債権 | 7.50386 | 1,049 | 1,023 | 145,399 | 2024/09/15 |
| SOFTBANK SVF II TERM 1LN 12/24 C1 | 金銭債権 | 5.00000 | 22,933 | 22,933 | 3,258,888 | 2024/12/31 |
| KINDERCARE TERM 2LN 08/22/2025 C1 | 金銭債権 | 12.00386 | 13,635 | 13,094 | 1,860,729 | 2025/08/22 |
| ALLIANT INSURAN TRM B EXT 5/25 C1 | 金銭債権 | 7.00386 | 355 | 348 | 49,473 | 2025/05/10 |
| AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C1 | 金銭債権 | 7.16471 | 644 | 630 | 89,664 | 2025/10/01 |
| ALLIANT TERM B-2 1LN 05/10/25 C1 | 金銭債権 | 7.00386 | 5,422 | 5,304 | 753,732 | 2025/05/10 |
| MISYS LIMITED TERM 2LN 06/25 C1 | 金銭債権 | 10.62071 | 3,431 | 2,624 | 372,972 | 2025/06/13 |
| CONSOLIDATE TM INCR B 1LN 5/25 C1 | 金銭債権 | 7.35814 | 12,664 | 12,031 | 1,709,669 | 2025/05/07 |
| ANASTASIA BEV TERM B 08/25 C1 | 金銭債権 | 7.42414 | 7,712 | 5,701 | 810,146 | 2025/08/10 |
| AKZONOBEL TERM B 10/01/25 C2 | 金銭債権 | 7.16471 | 2,481 | 2,430 | 345,424 | 2025/10/01 |
| NUMERICABLE TERM B-12 01/01/26 C1 | 金銭債権 | 7.76664 | 15,472 | 14,276 | 2,028,698 | 2026/01/31 |
| ULTIMATE SOFTWARE TERM 1LN 5/26 C1 | 金銭債権 | 7.50386 | 1,901 | 1,853 | 263,368 | 2026/05/04 |
| TRAVELPORT TERM 1LN 05/29/2026 C1 | 金銭債権 | 10.42414 | 3,395 | 2,284 | 324,646 | 2026/05/29 |
| THE GOLUB CORPOR TM 2LN 05/26 C1 | 金銭債権 | 18.06000 | 10,302 | 10,302 | 1,464,050 | 2026/05/08 |
| UKG TERM 1LN 5/3/26 C1 | 金銭債権 | 6.99829 | 8,361 | 8,067 | 1,146,435 | 2026/05/03 |
| SINCLAIR BROAD TM 1LN 05/26 C1 | 金銭債権 | 11.89387 | 936 | 885 | 125,892 | 2026/05/25 |
| ANGUS CHEMICAL TM B 1LN 11/27 | 金銭債権 | 7.57643 | 2,000 | 1,931 | 274,488 | 2027/11/24 |
| FRST EAGLE TERM B 1LN 2/1/27 C1 | 金銭債権 | 6.17414 | 2,461 | 2,398 | 340,851 | 2027/02/01 |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C1 | 金銭債権 | 7.67414 | 515 | 507 | 72,147 | 2027/01/23 |
| VEEAM SOFTWARE TERM B 1LN 2/27 C1 | 金銭債権 | 6.75386 | 1,082 | 1,060 | 150,711 | 2027/02/19 |
| ACRISURE TERM B 1LN 02/15/27 C1 | 金銭債権 | 8.00386 | 456 | 436 | 61,956 | 2027/02/15 |
| UKG TERM 2LN 05/03/2027 C1 | 金銭債権 | 8.99829 | 15,315 | 14,057 | 1,997,633 | 2027/05/03 |
| ANGUS CHEMICAL TM 1LN 11/04/27 C1 | 金銭債権 | 8.54387 | 580 | 545 | 77,472 | 2027/11/04 |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C2 | 金銭債権 | 7.67414 | 259 | 255 | 36,322 | 2027/01/23 |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C3 | 金銭債権 | 8.16986 | 86 | 84 | 12,053 | 2027/01/23 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | | | |
|-----------------------------------|-------|----------|----------|-----------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| AECOM TERM B 1LN 01/23/27 C4 | 金銭債権 | 8.16986 | 170 | 168 | 23,941 | 2027/01/23 |
| EPICOR SOFTWARE TL 2LN 07/28 C1 | 金銭債権 | 11.50386 | 4,075 | 4,022 | 571,576 | 2028/07/30 |
| CSC SERVICEWORKS TM B 1LN 2/28 C1 | 金銭債権 | 7.14414 | 3,384 | 3,040 | 432,043 | 2028/03/01 |
| PAREXEL TERM B 1LN 08/11/28 C1 | 金銭債権 | 7.00386 | 2,412 | 2,324 | 330,296 | 2028/08/11 |
| ALTERRA MOUNT TM B-1 1LN 07/28 C1 | 金銭債権 | 7.25386 | 277 | 273 | 38,844 | 2028/07/21 |
| EXAMWORKS TERM B 1LN 11/01/28 C1 | 金銭債権 | 6.75386 | 597 | 579 | 82,303 | 2028/11/01 |
| ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C1 | 金銭債権 | 10.75386 | 1,134 | 1,129 | 160,450 | 2028/10/25 |
| GREAT OUTDOOR TM B1 1LN 3/5/28 C1 | 金銭債権 | 7.50386 | 6,185 | 5,902 | 838,793 | 2028/03/05 |
| ASURION TM B10 1LN 8/17/28 C1 | 金銭債権 | 7.13409 | 9,480 | 8,427 | 1,197,484 | 2028/08/17 |
| ECHO GLOBAL LOGIS TM 2LN 10/28 C2 | 金銭債権 | 11.41471 | 780 | 776 | 110,309 | 2028/10/25 |
| USI INC TERM 1LN 11/16/29 | 金銭債権 | 0.00000 | 560 | 550 | 78,183 | 2029/11/16 |
| ASCEND LEARNING TM 2LN 11/29 C1 | 金銭債権 | 9.50386 | 650 | 551 | 78,394 | 2029/11/18 |
| AUTHENTIC BR TM B 2LN 12/20/29 C1 | 金銭債権 | 9.82872 | 370 | 340 | 48,370 | 2029/12/20 |
| ATHENAHEALTH TM B 1LN 02/15/29 C1 | 金銭債権 | 7.41060 | 6,021 | 5,457 | 775,465 | 2029/02/15 |
| SCIENTIFIC GAME TM B 1LN 02/29 C1 | 金銭債権 | 7.09736 | 1,005 | 964 | 137,009 | 2029/02/04 |
| HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C1 | 金銭債権 | 6.33990 | 2,498 | 2,162 | 307,345 | 2029/02/25 |
| DEL MONTE FOODS TM B 1LN 05/29 C1 | 金銭債権 | 7.82647 | 4,135 | 3,995 | 567,752 | 2029/05/16 |
| BAYER ENVIR SCI TERM 1LN 10/29 C1 | 金銭債権 | 7.96829 | 6,265 | 5,727 | 813,917 | 2029/10/04 |
| HUB INTERNAT TM B 1LN 11/10/29 C1 | 金銭債権 | 8.22019 | 345 | 339 | 48,246 | 2029/11/10 |
| HUNTER DOUGLAS TERM B 1LN 2/29 C2 | 金銭債権 | 6.33990 | 917 | 794 | 112,853 | 2029/02/25 |
| 小 計 | | — | 204,631 | 187,556 | 26,651,836 | — |
| 合 計 | | — | — | — | 26,651,836 | — |

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 決算日時点で受渡しが完了していない新規買付銘柄に関しましては、クーポンレートが確定しておりません。

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーUSドル・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|-----------------------|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て |
| 投 資 目 的 | 主として米ドル建ての債券に投資を行います。 |
| 決 算 日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | 米ドル |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 36,903,444 |
| スワップ取引に係る受取利息 | 252,795 |
| デリバティブ収益 | — |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 37,156,239 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 10,117,399 |
| 管理費 | 3,061,689 |
| 国税 | 752,803 |
| 保管費用 | 115,759 |
| 販売手数料 | 6,046 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 261,670 |
| 費用合計 | 14,315,366 |
| スワップ取引に係る支払利息 | 2,179,096 |
| デリバティブ費用 | 47,162 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 16,541,624 |
| 純投資収益(損失) | 20,614,615 |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | (75,162,009) |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | (158,074) |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | 7,069,070 |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | (641,450) |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | (2,231,384) |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (152,178,801) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (129,186) |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (6,313,999) |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 378,786 |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 3,155,692 |
| 運用実績 | (205,596,740) |
| 受益者への分配金 | (3,961,456) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 1,223,723,102 |
| 当期解約額 | (761,130,724) |
| 調整勘定 | 5,102,145 |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | 467,694,523 |
| 純増加(減少) | 258,136,327 |
| 純資産額 | |
| 期首 | 1,849,318,247 |
| 期末 | 2,107,454,574 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または 通貨 | 時価 (米ドル) | % Net Assets |
|--|------|-----|-------------------|-------------|-----------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | |
| エネルギー | | | | | |
| Equinor 6.125% 06/04/2030 | NO | USD | 9,401,327 | 9,935,419 | 0.42 |
| Energy Transfer 6.25% 15/04/2049 | US | USD | 7,862,928 | 8,027,393 | 0.38 |
| DCP Midstream Operating 5.125% 15/05/2029 | US | USD | 7,884,232 | 6,977,013 | 0.35 |
| Equinor 3.70% 06/04/2050 | NO | USD | 5,697,714 | 5,150,993 | 0.24 |
| Energy Transfer 6.00% 15/06/2048 | US | USD | 4,672,175 | 4,608,092 | 0.22 |
| Targa Resources 4.95% 15/04/2052 | US | USD | 3,798,516 | 3,485,349 | 0.17 |
| Volero Energy 2.80% 01/12/2031 | US | USD | 3,798,516 | 3,287,248 | 0.16 |
| Volero Energy 4.00% 01/06/2052 | US | USD | 2,181,868 | 1,825,401 | 0.09 |
| Targa Resources 4.20% 01/02/2033 | US | USD | 1,803,535 | 1,705,818 | 0.08 |
| Enterprise Products Operating 4.90% 15/05/2046 | US | USD | 1,025,599 | 990,848 | 0.05 |
| | | | 44,987,574 | 2.13 | |
| 公益事業 | | | | | |
| NextEra Energy Capital 2.25% 01/04/2030 | US | USD | 5,191,052 | 4,442,848 | 0.21 |
| NextEra Energy 2.44% 15/01/2032 | US | USD | 4,729,152 | 4,016,857 | 0.19 |
| NextEra Energy 1.875% 15/01/2027 | US | USD | 3,526,542 | 3,230,750 | 0.15 |
| Terna 2.375% VRN (Perpetual) | IT | EUR | 3,131,497 | 3,034,529 | 0.14 |
| TXU Europe Funding 7.00% 30/11/2005 (Defaulted) | GB | EUR | 854,666 | 9 | 0.00 |
| | | | 14,724,993 | 0.70 | |
| 素材 | | | | | |
| Ashland 6.875% 15/05/2043 | US | USD | 8,828,511 | 9,857,783 | 0.47 |
| Arceormittal 7.00% 15/10/2039 | LU | USD | 5,663,587 | 6,234,418 | 0.30 |
| Boll 2.875% 15/08/2030 | US | USD | 1,386,458 | 1,165,887 | 0.06 |
| | | | 17,258,088 | 0.82 | |
| 資本財・サービス | | | | | |
| Air Lease 1.875% 15/08/2026 | US | USD | 7,474,999 | 6,666,956 | 0.32 |
| Air Lease 3.125% 01/12/2030 | US | USD | 4,350,308 | 3,744,187 | 0.18 |
| United Rentals North America 4.875% 15/01/2028 | US | USD | 2,482,710 | 2,423,398 | 0.11 |
| Union Pacific 3.50% 14/02/2053 | US | USD | 2,408,259 | 2,056,368 | 0.10 |
| | | | 14,890,909 | 0.71 | |
| 情報技術 | | | | | |
| HP 4.20% 15/04/2032 | US | USD | 6,993,068 | 6,424,574 | 0.30 |
| Oracle 3.65% 25/03/2041 | US | USD | 3,380,679 | 2,616,270 | 0.12 |
| | | | 9,404,844 | 0.43 | |
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| Lennar 5.875% 15/11/2042 | US | USD | 13,069,174 | 13,577,891 | 0.64 |
| Yum Brands 5.375% 01/04/2032 | US | USD | 8,736,587 | 8,449,983 | 0.40 |
| General Motors 6.80% 01/10/2027 | US | USD | 6,792,506 | 7,344,413 | 0.35 |
| Toll Brothers Finance 3.80% 01/11/2029 | US | USD | 7,182,994 | 6,532,124 | 0.31 |
| Volkswagen 4.375% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 6,609,418 | 6,419,514 | 0.30 |
| Lowes Cos 4.25% 01/01/2032 | US | USD | 4,273,333 | 3,849,191 | 0.18 |
| General Motors 6.125% 01/10/2025 | US | USD | 3,058,813 | 3,212,729 | 0.15 |
| VWIF 3.748% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 3,114,783 | 3,068,883 | 0.15 |
| Time Warner Cable 5.75% 02/06/2031 | US | GBP | 2,051,199 | 2,829,561 | 0.13 |
| Marrriott Vacations World - 2.00% 15/01/2026 | US | USD | 2,507,021 | 2,700,561 | 0.13 |
| Dick's Sporting Goods 3.150% 15/01/2032 | US | USD | 2,374,073 | 1,992,441 | 0.09 |
| Dick's Sporting Goods 4.10% 15/01/2052 | US | USD | 1,652,354 | 1,216,710 | 0.06 |
| McDonald's 4.875% 09/12/2045 MTN | US | USD | 1,025,599 | 1,039,144 | 0.05 |
| Toll Brothers Finance 4.375% 15/04/2023 | US | USD | 949,629 | 955,780 | 0.05 |
| | | | 65,188,275 | 3.00 | |
| 生活必需品 | | | | | |
| AB InBev Worldwide 5.80% 23/01/2059 | US | USD | 4,547,583 | 5,016,055 | 0.24 |
| | | | 5,016,055 | 0.24 | |
| ヘルスケア | | | | | |
| AbbVie 4.875% 14/11/2048 | US | USD | 7,771,764 | 7,810,540 | 0.37 |
| AbbVie 4.25% 14/11/2028 | US | USD | 5,241,952 | 5,251,931 | 0.25 |
| Centene 3.00% 15/10/2030 | US | USD | 5,610,408 | 4,889,583 | 0.23 |
| Boyer 4.50% VRN 25/03/2082 | DE | EUR | 3,950,457 | 4,109,244 | 0.19 |
| Boyer 5.375% VRN 25/03/2082 | DE | EUR | 3,798,516 | 4,006,505 | 0.19 |
| AbbVie 4.70% 14/03/2045 | US | USD | 3,114,783 | 3,051,296 | 0.14 |
| Aetna 4.75% 15/03/2044 | US | USD | 2,279,110 | 2,234,070 | 0.11 |
| Centene 2.50% 01/03/2031 | US | USD | 2,415,856 | 2,011,865 | 0.10 |
| CVS Health 5.05% 25/03/2048 | US | USD | 1,443,456 | 1,455,527 | 0.07 |
| | | | 34,780,533 | 1.65 | |
| 金融 | | | | | |
| KIW 2.125% 15/06/2022 | DE | USD | 27,862,115 | 27,895,882 | 1.32 |
| Nationwide Building 1.491% FRN 16/02/2028 144A | GB | USD | 10,901,741 | 10,737,357 | 0.51 |
| Ford Motor 4.95% 28/05/2027 | US | USD | 11,015,697 | 10,681,040 | 0.51 |
| HSBC 2.871% VRN 22/11/2030 | GB | USD | 10,220,287 | 8,520,156 | 0.40 |
| BNP Paribas 0.875% VRN 11/07/2030 EMTN | FR | EUR | 8,888,528 | 8,278,423 | 0.39 |
| AerCap Ireland Capital DAC 2.45% 29/10/2026 | IE | USD | 8,945,505 | 7,985,400 | 0.38 |
| Toyota 3.05% 22/05/2027 | US | USD | 7,562,284 | 7,160,608 | 0.34 |
| Standard Chartered 3.971% VRN 30/03/2026 144A | GB | EUR | 7,154,885 | 7,011,989 | 0.33 |
| Credit Suisse Group 2.125% VRN 15/10/2026 | CH | EUR | 6,650,442 | 6,819,012 | 0.32 |
| ING Groep 5.860% VRN 28/03/2026 | NL | USD | 5,854,521 | 5,772,667 | 0.27 |
| Credit Suisse Group A/C 2.875% VRN 02/04/2032 | CH | EUR | 5,142,431 | 5,079,374 | 0.24 |
| Citigroup 5.875% 30/01/2042 | US | USD | 3,760,531 | 4,215,821 | 0.20 |
| Nationwide Building Society 1.50% VRN 08/03/2026 | GB | EUR | 3,798,516 | 3,946,999 | 0.19 |
| AerCap Ireland Capital DAC 3.30% 30/01/2032 | IE | USD | 4,558,219 | 4,152,817 | 0.19 |
| ING Groep 1.025% VRN 29/11/2031 | NL | EUR | 3,494,635 | 3,524,891 | 0.17 |
| Barclays 1.00% VRN 10/12/2024 | GB | USD | 3,418,664 | 3,262,956 | 0.15 |
| Bank of America 2.824% VRN 27/04/2033 EMTN | US | EUR | 3,019,820 | 3,170,177 | 0.15 |
| ING Groep 4.017% VRN 28/03/2028 | NL | EUR | 3,245,452 | 3,156,882 | 0.15 |
| MTDWD 0.646% VRN 29/10/2027 | US | EUR | 3,247,731 | 3,148,950 | 0.15 |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets |
|---|------|-----|----------------------|-------------------|-----------------|
| Barclays 2.064% VRN 20/05/2027 | | | | | |
| Barclays 2.064% VRN 20/05/2027 | GB | AUD | 4,938,071 | 3,144,864 | 0.15 |
| Goldman Sachs Group 6.25% 01/02/2041 | US | USD | 2,620,976 | 3,072,732 | 0.15 |
| Berkshire Hathaway Finance Corp 2.00% 18/03/2054 | US | EUR | 3,066,922 | 3,032,097 | 0.14 |
| Deutsche Bank 4.00% VRN 24/06/2032 EMTN | DE | EUR | 2,658,961 | 2,681,517 | 0.13 |
| HSBC Holdings 4.762% VRN 29/03/2033 | GB | USD | 2,713,660 | 2,565,262 | 0.12 |
| Barclays 3.330% VRN 24/11/2042 | US | USD | 3,092,752 | 2,394,738 | 0.11 |
| Banco Santander 4.175% VRN 24/03/2028 | ES | USD | 2,431,050 | 2,362,709 | 0.11 |
| Aon 3.90% 28/08/2031 | US | USD | 2,674,155 | 2,315,672 | 0.11 |
| Barclays 3.582% VRN 20/05/2032 | GB | AUD | 3,798,516 | 2,204,550 | 0.10 |
| AerCap Ireland Capital DAC 3.85% 29/10/2041 | IE | USD | 2,563,998 | 1,999,195 | 0.09 |
| Aon 2.60% 02/12/2031 | US | USD | 1,823,288 | 1,578,009 | 0.07 |
| HSBC Holdings 1.488% FRN 18/05/2044 | GB | USD | 1,519,406 | 1,521,892 | 0.07 |
| Alliant 3.875% (Perpetual) | DE | USD | 1,671,347 | 1,392,451 | 0.07 |
| | | | 164,567,256 | 7.80 | |
| 不動産 | | | | | |
| Alexandria 3.55% 15/03/2052 | US | USD | 8,850,542 | 7,241,983 | 0.34 |
| Crown Castle International 5.20% 15/02/2049 | US | USD | 3,179,358 | 3,195,520 | 0.15 |
| | | | 10,437,503 | 0.50 | |
| 国債 | | | | | |
| US Treasury 1.875% 15/02/2032 | US | USD | 358,112,699 | 326,945,703 | 15.51 |
| US Treasury 1.125% 31/10/2026 | US | USD | 206,259,422 | 190,405,229 | 9.03 |
| US Treasury 1.875% 15/11/2051 | US | USD | 241,319,725 | 189,775,340 | 9.00 |
| US Treasury Bond 0.25% 15/06/2024 | US | USD | 192,318,868 | 182,402,427 | 8.66 |
| US Treasury Note/Bond 3.375% 31/03/2029 | US | USD | 104,747,879 | 100,985,037 | 4.77 |
| US Treasury 1.50% 31/01/2027 | US | USD | 86,978,421 | 81,416,559 | 3.86 |
| US Treasury 0.75% 15/11/2024 | US | USD | 60,312,838 | 57,207,670 | 2.71 |
| US Treasury 2.875% 31/10/2033** | US | USD | 46,535,392 | 46,764,434 | 2.22 |
| Mexico 2.50% 31/03/2025 | MX | USD | 45,992,452 | 42,945,637 | 2.04 |
| Mexico 5.75% 05/03/2026 | MX | MXN | 278,716,116 | 12,245,263 | 0.58 |
| Canadian Government Bond 2.25% 01/06/2025 | CA | CAD | 13,978,539 | 10,799,370 | 0.51 |
| New Zealand Government Bond 0.50% 15/05/2024 | NZ | NZD | 16,113,305 | 9,864,583 | 0.47 |
| Australia 1.75% 21/06/2051 | AU | AUD | 16,307,789 | 7,948,005 | 0.38 |
| US Treasury 1.125% 15/08/2040 | US | USD | 9,648,231 | 6,931,274 | 0.33 |
| UK Treasury 1.25% 31/07/2051 | GB | GBP | 4,596,204 | 4,782,379 | 0.23 |
| UK Treasury 0.625% 22/10/2050 | GB | GBP | 5,386,296 | 4,747,003 | 0.23 |
| Germany 1.08% 15/08/2052 | DE | EUR | 5,644,595 | 4,289,420 | 0.20 |
| Mexico 7.75% 29/03/2031 | MX | MXN | 74,260,989 | 3,350,454 | 0.16 |
| Germany 0.94% 15/02/2032 | DE | EUR | 3,167,962 | 3,046,428 | 0.14 |
| Mexico 7.50% 03/06/2027 | MX | MXN | 48,995,095 | 2,230,768 | 0.11 |
| Australia 5.00% 21/03/2047 | AU | AUD | 2,677,954 | 1,750,258 | 0.08 |
| Australia 1.50% 21/06/2051 | AU | AUD | 2,715,939 | 1,680,892 | 0.08 |
| Australia 1.25% 21/05/2032 | AU | AUD | 1,956,236 | 1,164,042 | 0.06 |
| US Treasury 2.50% 31/03/2027 | US | USD | 1,040,793 | 1,019,978 | 0.05 |
| | | | 1,294,692,620 | 61.45 | |
| オープンエンド型ファンド | | | | | |
| Fidelity IIF - The US Dollar Fund - A-ACC-USD | IE | USD | 590 | 10,728,893 | 0.51 |
| | | | | 10,728,893 | 0.51 |
| コミュニケーション・サービス | | | | | |
| Netflix 3.625% 15/06/2030 Reg S | US | EUR | 5,321,721 | 5,515,142 | 0.26 |
| AT&T 4.375% 14/09/2029 | US | GBP | 3,551,613 | 4,718,505 | 0.22 |
| Cellex Telecom 0.75% 20/11/2031 | ES | EUR | 4,862,101 | 4,326,257 | 0.21 |
| T-Mobile USA 4.375% 15/04/2040 | US | USD | 1,025,599 | 946,745 | 0.04 |
| T-Mobile USA 4.50% 15/04/2050 | US | USD | 1,025,599 | 939,386 | 0.04 |
| | | | 16,446,504 | 0.78 | |
| その他の市場で取引される証券 | | | | | |
| エネルギー | | | | | |
| Targa Resources Partners Finance 5.50% 01/03/2030 | US | USD | 3,798,516 | 3,767,729 | 0.18 |
| ConocoPhillips 2.40% 07/03/2025 | US | USD | 2,438,647 | 2,376,368 | 0.11 |
| | | | 6,144,697 | 0.29 | |
| 公益事業 | | | | | |
| TXU Eastern Funding 6.45% 15/05/2005 (Defaulted) | GB | USD | 664,740 | 7 | 0.00 |
| | | | | 7 | 0.00 |
| 素材 | | | | | |
| Crown Americas 5.25% 01/04/2030 144A | US | USD | 8,069,568 | 8,010,297 | 0.38 |
| Alcoa Nederland Hldg BV 4.125% 31/03/2029 144A | NL | USD | 2,506,945 | 4,961,913 | 0.24 |
| Alcoa Nederland 6.125% 15/05/2028 144A | NL | USD | 4,520,234 | 4,603,858 | 0.22 |
| Louisiana-Pacific 3.625% 15/03/2029 144A | US | USD | 4,223,950 | 3,638,447 | 0.17 |
| | | | 21,214,515 | 1.01 | |
| 資本財・サービス | | | | | |
| Daimler Trucks 1.282% FRN 05/04/2024 144A | US | USD | 6,352,638 | 6,361,850 | 0.30 |
| Avolon Holdings Funding 4.25% 15/04/2026 144A | KY | USD | 3,798,516 | 3,647,416 | 0.17 |
| Daimler Trucks Finance 2.375% 14/12/2028 | | | | | |

| | 国コード | 通貨 | 株数または額面価値 | 時価 (米ドル) | % Net Assets |
|---|------|-----|-------------------|-------------|--------------|
| Envestnet 1.75% 01/06/2023 | US | USD | 1,367,466 | 1,696,370 | 0.08 |
| Broadcom 3.187% 15/11/2036 144A | US | USD | 1,937,245 | 1,531,277 | 0.07 |
| Take-Two Interactive Software 3.55% 15/07/2025 | US | USD | 1,411,351 | 1,528,204 | 0.07 |
| Broadcom 3.187% 15/11/2036 Reg S | US | USD | 1,439,658 | 1,137,949 | 0.05 |
| | | | 35,849,698 | 1.70 | |
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| Charter Communications 6.834% 23/10/2055 | US | USD | 10,587,224 | 11,281,631 | 0.54 |
| Take-Two Interactive Software 3.50% 28/03/2024 | US | USD | 5,697,774 | 5,675,032 | 0.27 |
| Take-Two Interactive Software 3.55% 14/04/2025 | US | USD | 5,279,957 | 4,169,845 | 0.20 |
| Prosus 3.061% 15/07/2031 Reg S | NL | USD | 3,912,472 | 3,829,570 | 0.18 |
| Take-Two Interactive Software 3.70% 14/04/2027 | US | USD | 3,978,516 | 3,746,588 | 0.18 |
| Espeedia Group 5.80% 15/02/2028 | US | USD | 3,980,518 | 3,626,959 | 0.17 |
| Prosus 3.68% 21/01/2030 Reg S | NL | USD | 4,102,397 | 3,465,715 | 0.16 |
| Magallanes 5.05% 15/03/2042 144A | US | USD | 3,798,516 | 3,463,229 | 0.16 |
| Magallanes 5.391% 15/03/2062 144A | US | USD | 3,882,083 | 3,462,406 | 0.16 |
| Prosus 1.985% 15/07/2033 Reg S | NL | EUR | 4,026,427 | 3,232,586 | 0.15 |
| Hilton Domestic Operating 3.75% 01/05/2029 144A | US | USD | 3,513,627 | 3,184,629 | 0.15 |
| Ziggo 4.875% 15/01/2030 144A | NL | USD | 3,138,534 | 2,799,802 | 0.13 |
| Magallanes 4.054% 15/03/2029 144A | US | USD | 2,793,429 | 2,684,476 | 0.13 |
| Marriott International 4.625% 15/06/2030 | US | USD | 2,488,028 | 2,458,844 | 0.12 |
| Lennor 5.25% 01/06/2026 | US | USD | 1,405,451 | 1,452,789 | 0.07 |
| Lowe's 5.125% 15/04/2050 | US | USD | 1,025,599 | 1,057,545 | 0.05 |
| Magallanes 3.755% 15/03/2027 144A | US | USD | 853,906 | 825,393 | 0.04 |
| | | | 65,486,189 | 3.12 | |

ヘルスケア

| | | | | | |
|--|----|-----|-------------------|-------------|------|
| Teva Pharmaceutical II 4.375% 09/05/2030 | NL | EUR | 11,063,558 | 10,332,101 | 0.49 |
| GSK Consumer Healthcare 3.125% 24/03/2025 144A | GB | USD | 5,811,730 | 5,714,458 | 0.27 |
| Centene 4.625% 15/12/2029 | US | USD | 3,551,613 | 3,440,358 | 0.16 |
| CSL 4.75% 27/04/2052 144A | GB | USD | 2,017,727 | 1,988,030 | 0.09 |
| HCA 3.625% 15/03/2032 144A | US | USD | 1,675,146 | 1,502,550 | 0.07 |
| Tapco 4.80% 15/07/2044 | US | USD | 1,025,599 | 914,025 | 0.04 |
| HCA 3.125% 15/03/2027 144A | US | USD | 603,964 | 599,966 | 0.03 |
| HCA 4.375% 15/03/2042 144A | US | USD | 491,528 | 428,347 | 0.02 |
| GSK Consumer Healthcare 4.00% 24/03/2052 144A | US | USD | 450,752 | 388,251 | 0.02 |
| | | | 25,378,886 | 1.20 | |

金融

| | | | | | |
|--|----|-----|--------------------|-------------|------|
| Bank Of America 1.197% VRN 24/10/2026 MTN | US | USD | 11,129,652 | 10,049,191 | 0.48 |
| UBS Group 1.008% VRN 30/07/2024 144A | CH | USD | 10,261,511 | 9,965,332 | 0.47 |
| Societe Generale 2.226% VRN 21/01/2026 144A | FR | USD | 10,316,700 | 9,673,115 | 0.46 |
| Wells North America 3.875% 15/09/2049 | US | USD | 9,690,014 | 9,060,456 | 0.38 |
| JPMorgan Chase 1.402% FRN 24/02/2028 | US | USD | 7,559,047 | 7,476,927 | 0.35 |
| UBS Group 1.564% VRN 30/01/2027 144A | CH | USD | 7,976,884 | 7,165,573 | 0.34 |
| Wells North America 4.50% 15/09/2028 | US | USD | 7,004,464 | 7,017,505 | 0.33 |
| JPMorgan Chase 4.08% VRN 04/04/2028 144A | US | USD | 6,039,641 | 6,036,941 | 0.29 |
| Danske Bank 4.298% VRN 24/01/2028 144A | DK | USD | 5,925,685 | 5,759,481 | 0.27 |
| Bank of Ireland Group 2.029% VRN 30/09/2027 144A | IE | USD | 6,457,477 | 5,704,723 | 0.27 |
| Danske Bank 3.773% VRN 28/03/2035 100A | DK | USD | 5,583,819 | 5,525,397 | 0.26 |
| Deutsche Bank 1.42% FRN 16/11/2027 | DE | USD | 5,507,848 | 5,325,605 | 0.25 |
| Societe Generale 2.17% VRN 16/11/2028 144A | FR | USD | 5,880,103 | 5,317,907 | 0.25 |
| Swedbank 3.356% 04/04/2025 144A | SE | USD | 5,129,078 | 5,138,903 | 0.24 |
| Deutsche Bank 2.311% VRN 16/11/2027 | DE | USD | 5,750,194 | 5,102,290 | 0.24 |
| Societe Generale 3.337% VRN 21/01/2033 144A | FR | USD | 5,944,678 | 5,036,971 | 0.24 |
| JPMorgan Chase 4.586% VRN 26/04/2035 | US | USD | 4,799,805 | 4,833,088 | 0.23 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4.875% VRN (Perpetual) | NL | EUR | 4,710,160 | 4,666,698 | 0.22 |
| MSCI 3.625% 01/09/2030 144A | US | USD | 5,127,997 | 4,533,405 | 0.22 |
| AIB Group 2.25% VRN 04/04/2028 EMTN | IE | EUR | 4,179,127 | 4,296,757 | 0.20 |
| MSCI 3.875% 15/02/2031 144A | US | USD | 4,729,152 | 4,275,509 | 0.20 |
| Bank of Ireland Group 1.375% VRN 11/08/2031 EMTN | IE | EUR | 4,312,075 | 4,104,332 | 0.19 |
| Morgan Stanley 2.584% FRN 24/10/2023 MTN | US | USD | 3,798,516 | 3,812,524 | 0.18 |
| Wells Fargo 3.526% VRN 24/03/2028 MTN | US | USD | 3,893,479 | 3,745,752 | 0.18 |
| Bank of America 2.651% VRN 11/03/2032 | US | USD | 4,261,935 | 3,656,128 | 0.17 |
| AIB Group 4.263% VRN 10/04/2025 144A | IE | USD | 3,589,598 | 3,559,369 | 0.17 |
| AIB Group 2.875% VRN 30/05/2031 EMTN | IE | EUR | 3,424,742 | 3,456,479 | 0.16 |
| JPMorgan Chase 4.206% VRN 01/06/2029 | US | USD | 3,855,494 | 3,380,922 | 0.16 |
| Bank of America 5.559% VRN 23/04/2027 MTN | US | USD | 3,418,664 | 3,321,490 | 0.16 |
| Nasdaq 3.95% 07/05/2052 | US | USD | 3,804,593 | 3,297,174 | 0.15 |
| JPMorgan Chase 1.963% VRN 23/03/2030 EMTN | US | EUR | 3,091,992 | 3,164,199 | 0.15 |
| Corebridge Financial 3.50% 04/04/2025 144A | US | USD | 2,990,952 | 2,961,915 | 0.14 |
| JPMorgan Chase & Co 0.824% VRN 01/06/2025 | US | USD | 2,620,976 | 2,488,029 | 0.12 |
| Corebridge Financial 4.40% 05/04/2032 144A | US | USD | 2,595,146 | 2,359,859 | 0.11 |
| MSCI 4.00% 15/11/2030 144A | US | USD | 2,336,087 | 2,154,807 | 0.10 |
| Corebridge Financial 3.65% 05/04/2027 144A | US | USD | 1,994,221 | 1,936,517 | 0.09 |
| Corebridge Financial 3.90% 05/04/2032 144A | US | USD | 1,817,210 | 1,707,515 | 0.08 |
| MSCI 3.625% 01/11/2031 144A | US | USD | 1,575,624 | 1,384,958 | 0.07 |
| MSCI 3.15% 15/08/2035 144A | US | USD | 1,368,725 | 1,158,148 | 0.05 |
| Direct Line Insurance 4.00% 05/04/2032 | GB | GBP | 892,651 | 1,053,712 | 0.05 |
| | | | 185,655,383 | 8.71 | |

不動産

| | | | | | |
|--|----|-----|-------------------|-------------|------|
| Equinix 2.625% 18/11/2024 | US | USD | 3,822,827 | 3,724,090 | 0.18 |
| Yellowstone 3.85% 15/05/2032 | US | USD | 3,446,718 | 3,645,092 | 0.17 |
| Equinix 2.90% 18/11/2026 | US | USD | 3,540,217 | 3,259,262 | 0.15 |
| Digital Tech Finco BV 1.25% 05/01/2021 | NL | EUR | 3,540,217 | 3,097,820 | 0.15 |
| Equinix 2.50% 15/05/2031 | US | USD | 2,279,110 | 1,925,777 | 0.09 |
| | | | 15,670,041 | 0.74 | |

コミュニケーション・サービス

| | | | | | |
|---|----|-----|------------------|-------------|------|
| Cellnex Telecom 1.875% 24/04/2029 | ES | EUR | 5,014,041 | 4,567,271 | 0.22 |
| Rogers Communications 3.80% 15/03/2032 144A | CA | USD | 4,022,629 | 3,728,587 | 0.18 |
| | | | 8,295,858 | 0.39 | |

非市場

一般消費財・サービス

| | | | | | |
|---|----|-----|-----------|------------------|-------------|
| Virgin Media Secured Fin. 4.125% 15/08/2030 Reg S | GB | GBP | 8,394,720 | 9,178,037 | 0.44 |
| | | | | 9,178,037 | 0.44 |

金融

| | | | | | |
|---|----|-----|------------|-------------------|-------------|
| Ginnie Mae 2.50% 01/05/2052 (Perpetual) | US | USD | 11,395,548 | 10,589,847 | 0.50 |
| | | | | 10,589,847 | 0.50 |

その他

| | | | | | |
|---------------------------------|--|--|--|----------------------|--------------|
| 投資資産合計 (取得価額 USD 2,252,681,499) | | | | 2,096,215,364 | 99.47 |
|---------------------------------|--|--|--|----------------------|--------------|

| 契約額等 | 未実現 (損 % Net) | 益 (米ドル) | % Net Assets |
|------|---------------|---------|--------------|
| 通貨 | | | |

クレジット・デフォルト・スワップ

| | | | | |
|---|-----|------------|------------------|---------------|
| Bought protection on Colombia Gbs 10.375% 20/06/2027 | USD | 9,344,550 | 564,980 | 0.03 |
| Bought protection on Brazil 4.25% 20/04/2027 | USD | 5,488,856 | 313,295 | 0.01 |
| Bought protection on Viacomcbs 4.75% 20/06/2026 | USD | 7,597,032 | 54,728 | 0.00 |
| Bought protection on Conocophillips 5.9% 20/06/2022 | USD | 2,734,932 | (3,461) | (0.00) |
| Bought protection on Avnet 4.875% 20/06/2026 | USD | 6,609,418 | (11,867) | (0.00) |
| Bought protection on Lincoln National 3.5% 20/12/2025 | USD | 4,862,101 | (37,846) | (0.00) |
| Bought protection on Dow Chemical 7.375% 20/06/2026 | USD | 5,977,032 | (56,014) | (0.00) |
| Bought protection on Wells Fargo 3.069% 20/12/2025 | USD | 5,925,685 | (57,429) | (0.00) |
| Bought protection on AIG International 6.25% 20/12/2025 | USD | 4,862,101 | (69,892) | (0.00) |
| Bought protection on ITCor Xaver 537 20/06/2022 | USD | 19,562,358 | (633,085) | (0.03) |
| Bought protection on General Motors 4.875% 20/06/2026 | USD | 7,597,032 | (919,660) | (0.04) |
| | | | (856,251) | (0.04) |

| 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net) | 益 (米ドル) | % Net Assets |
|----------|---------------|---------|--------------|
| | | | |

外国為替先物取引

| | | | |
|---|--------------------|-------------|--------|
| Bought USD Sold EUR at 1.146548 18/05/2022 | 103,984,858 | 9,083,509 | 0.43 |
| Bought USD Sold JPY at 0.008648 18/05/2022 | 36,316,974 | 4,437,978 | 0.21 |
| Bought USD Sold GBP at 1.356058 18/05/2022 | 22,921,700 | 1,815,441 | 0.09 |
| Bought USD Sold EUR at 1.080358 18/05/2022 | 38,996,417 | 584,584 | 0.03 |
| Bought USD Sold EUR at 1.05658 18/05/2022 | 15,775,281 | 766,294 | 0.04 |
| Bought USD Sold AUD at 0.735969 18/05/2022 | 19,125,970 | 695,323 | 0.03 |
| Bought USD Sold EUR at 1.103547 18/05/2022 | 14,429,499 | 672,027 | 0.03 |
| Bought USD Sold EUR at 1.146511 18/05/2022 | 4,827,991 | 420,659 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.106558 18/05/2022 | 7,862,168 | 379,719 | 0.02 |
| Bought USD Sold EUR at 1.102285 18/05/2022 | 7,831,166 | 355,349 | 0.02 |
| Bought USD Sold GBP at 1.317091 18/05/2022 | 6,328,528 | 304,438 | 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.111220 18/05/2022 | 5,190,871 | 279,528 | 0.01 |
| Bought USD Sold NZD at 0.669382 18/05/2022 | 7,021,253 | 236,005 | 0.01 |
| Bought USD Sold CAD at 0.788909 18/05/2022 | 11,332,375 | 115,346 | 0.01 |
| Bought EUR Sold USD at 0.915380 18/05/2022 | 5,842,276 | (202,010) | (0.01) |
| Bought EUR Sold USD at 0.907805 18/05/2022 | 6,303,210 | (269,624) | (0.01) |
| Bought EUR Sold MXN at 0.048099 18/05/2022 | 16,679,841 | (299,508) | (0.01) |
| Bought EUR Sold USD at 0.930385 18/05/2022 | 6,675,172 | (318,759) | (0.02) |
| Bought EUR Sold USD at 0.885787 18/05/2022 | 7,477,070 | (493,426) | (0.02) |
| Bought EUR Sold USD at 0.916165 18/05/2022 | 20,437,698 | (681,147) | (0.03) |
| Bought KRW Sold USD at 1020.836500 18/05/2022 | 18,981,822 | (874,696) | (0.04) |
| Bought EUR Sold USD at 0.899017 18/05/2022 | 20,976,569 | (1,091,649) | (0.05) |
| Bought JPY Sold USD at 115.237660 18/05/2022 | 40,465,041 | (4,531,535) | (0.22) |
| | 117,585,846 | 5.56 | |

A-ACC Shares (PLN) (hedged)

| | | | |
|--|-------------|-------------|--------|
| Bought USD Sold PLN at 0.234221 04/05/2022 | 417,627 | 16,432 | 0.00 |
| Bought USD Sold PLN at 0.233975 04/05/2022 | 409,109 | 15,649 | 0.00 |
| Bought USD Sold PLN at 0.232324 04/05/2022 | 402,754 | 14,082 | 0.00 |
| Bought USD Sold PLN at 0.232588 04/05/2022 | 393,065 | 12,364 | 0.00 |
| Bought PLN Sold USD at 4.459392 07/06/2022 | 19,335,192 | 9,935,192 | 0.45 |
| Bought USD Sold PLN at 0.225116 04/05/2022 | 19,214,851 | (20,343) | (0.00) |
| Bought PLN Sold USD at 4.193137 04/05/2022 | 22,051,510 | (1,214,107) | (0.06) |
| | (1,1 | | |

| | 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net) 益 (米下 Assets ル) |
|--|------------------|---|
| Bought EUR Sold USD at 0.897775 06/05/2022 | 92,790,524 | (4,996,409) (0.24) (4,952,846) (0.24) |
| Y.ACC Shares (CHF) (hedged) | | |
| Bought USD Sold CHF at 1.037662 06/05/2022 | 5,691,526 | 49,339 0.00 |
| Bought USD Sold CHF at 1.072899 06/05/2022 | 114,705 | 4,923 0.00 |
| Bought CHF Sold USD at 0.962232 07/06/2022 | 5,712,240 | (48,590) (0.00) |
| Bought CHF Sold USD at 0.923567 06/05/2022 | 6,111,092 | (304,861) (0.01) |
| | | (299,189) (0.01) |
| Y.ACC Shares (EUR) (hedged) | | |
| Bought USD Sold EUR at 1.060524 06/05/2022 | 43,438,511 | 273,527 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.093170 06/05/2022 | 4,397,346 | 163,905 0.01 |
| Bought USD Sold EUR at 1.084282 06/05/2022 | 2,891,552 | 85,393 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.087389 06/05/2022 | 1,254,337 | 39,873 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.067809 07/06/2022 | 2,255,050 | 26,644 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.081020 06/05/2022 | 929,002 | 23,917 0.00 |
| Bought EUR Sold USD at 0.908133 06/05/2022 | 1,491,301 | (64,021) (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.895000 06/05/2022 | 3,444,383 | (195,552) (0.01) |
| Bought EUR Sold USD at 0.941612 07/06/2022 | 45,553,418 | (269,463) (0.01) |
| Bought EUR Sold USD at 0.897968 06/05/2022 | 50,968,528 | (2,734,090) (0.13) |
| | | (2,651,867) (0.13) |
| 通貨 | | |
| 先物取引 | | |
| Euro-Buxl 30Y Bond Future 08/06/2022 | EUR (21,952,095) | 4,009,774 0.19 |
| Euro-Bund Bond Future 08/06/2022 | EUR (23,219,880) | 1,484,142 0.07 |
| Long Gilt Future 28/06/2022 | GBP (17,905,870) | 827,489 0.04 |
| Euro-Bobl Bond Future 08/06/2022 | EUR (8,695,715) | 190,729 0.01 |
| US Treasury Note 5 Year Bond Future 30/06/2022 | USD 31,730,131 | (1,398,168) (0.07) |
| US Treasury 10 Year Bond Future 21/06/2022 | USD 34,891,624 | (2,103,121) (0.10) |
| US 10 Year Ultra Bond Future 21/06/2022 | USD 25,042,856 | (2,165,636) (0.10) |
| | | 847,209 0.04 |
| 通貨 | | |
| インフレーション スワップ | | |
| Receive fixed 2.91% pay float. (US CPI) 22/02/2027 | USD 6,837,329 | (346,365) (0.02) |
| Receive fixed 2.059% pay float. (Euro HICP) 15/01/2027 | EUR 6,077,626 | (630,365) (0.03) |
| Receive fixed 2.076% pay float. (Euro HICP) 15/11/2026 | EUR 11,395,548 | (1,273,598) (0.06) |
| | | (2,250,326) (0.11) |
| その他資産 (負債控除後) | | 10,828,047 0.50 |
| Net Assets | | 2,107,454,574 100.00 |

<補足情報>

フィデリティ・インスティテューショナル・ファンズーサステナブル・ UK・アグリゲート・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|--|
| 設 定 形 態 | 英国籍証券投資法人／英ポンド建て |
| 投 資 目 的 | 主として英ポンド建て（もしくは英ポンドヘッジ）投資適格債券に投資し、インカムの確保と元本の成長を目指します。当ファンドは純資産の70%以上を、各業種で優れたサステナビリティ特性を有する企業の株式に投資する「ベスト・イン・クラス」戦略を採用しています。サステナビリティ特性とは、効果的な企業統治と環境・社会問題への優れた取り組み（ESG）を含む企業の性質を指しています。 |
| 決 算 日 | 6月30日 |

※2022年7月14日付で「フィデリティ・インスティテューショナル・ファンズーサステナブル・UK・アグリゲート・ボンド・ファンド」から「フィデリティ・インベストメント・ファンズ・IXーフィデリティ・サステナブル・UK・アグリゲート・ボンド・ファンド」に名称変更致しました。

総利益計算書

期末 2022年6月30日

2022年6月30日

2021年6月30日

千英ポンド

千英ポンド

千英ポンド

千英ポンド

| 収益 | 千英ポンド | 千英ポンド | 千英ポンド | 千英ポンド |
|-----------------|---------|------------------|---------|-----------------|
| 売買損益 | | (220,499) | | (29,525) |
| 配当等収益 | 26,828 | | 22,855 | |
| 費用 | (5,003) | | (4,464) | |
| 支払利息および類似費用 | (2,266) | | (1,110) | |
| 税引前純利益／（損失） | 19,559 | | 17,281 | |
| 税額 | — | | — | |
| 税引後純利益／（損失） | | 19,559 | | 17,281 |
| 総利益 | | (200,940) | | (12,244) |
| 分配金 | | (19,599) | | (17,281) |
| 受益者に帰属する純資産の変動額 | | (220,539) | | (29,525) |

ポートフォリオ計算書

2022年6月30日現在

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現（損）益 （千英ポンド） | 純資産 比率（%） |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
| | 社債 - (46.48%) | | |
| 22,127,000 | The Wellcome Trust 1.5% 14/07/71 | 12,034 | 0.92 |
| 12,378,000 | DNB Bank 2.625% VRN 10/06/2026 Reg S | 11,982 | 0.92 |
| 15,275,000 | Manulife Financial 3.703% 16/03/2032 | 11,617 | 0.89 |
| 11,007,000 | Bank of Nova Scotia 2.875% 03/05/2027 Reg S | 10,365 | 0.79 |
| 12,512,000 | AXA 4.25% VRN 10/03/2043 EMTN | 10,089 | 0.77 |
| 12,100,000 | Allianz SE 4.252% VRN 05/07/2052 EMTN | 9,935 | 0.76 |
| 13,500,000 | UBS 1.25% 01/06/2026 144A | 9,891 | 0.76 |
| 11,000,000 | Munich RE Group 5.875% VRN 23/05/2042 | 9,130 | 0.70 |
| 12,775,000 | Zurich Finance (Ireland) Dac 3.50% VRN 02/05/2052 EMTN | 8,529 | 0.65 |
| 10,300,000 | First Abu Dhabi Bank 1.625% 07/04/2027 EMTN Reg S | 8,327 | 0.64 |
| 8,775,000 | First Abu Dhabi Bank 0.875% 09/12/2025 EMTN Reg S | 7,975 | 0.61 |
| 11,125,000 | HSBC Holdings 4.00% VRN (Perpetual) | 7,714 | 0.59 |
| 8,070,000 | Bank of America Corporation 3.584% VRN 27/04/2031 Reg S | 7,613 | 0.58 |
| 8,688,000 | BP Capital Markets 4.25% VRN (Perpetual) | 7,574 | 0.58 |
| 8,575,000 | Hyundai Capital America 6.375% 08/04/2030 Reg S | 7,528 | 0.58 |
| 10,600,000 | Verizon Communications 1.875% 03/11/2038 | 7,404 | 0.57 |
| 7,305,000 | Logicor 2019-1 UK 1.875% 17/11/2031 Reg S | 6,812 | 0.52 |
| 7,143,000 | Goldman Sachs Group 1.00% VRN 16/12/2025 EMTN Reg S | 6,578 | 0.50 |
| 7,538,000 | Bank of America Corporation 1.667% VRN 02/06/2029 EMTN Reg S | 6,548 | 0.50 |
| 7,291,000 | Metropolitan Life Global Funding I 1.625% 12/10/2028 GMTN Reg S | 6,485 | 0.50 |
| 8,663,000 | Goldman Sachs Group 1.25% 07/02/2029 Reg S | 6,381 | 0.49 |
| 8,660,000 | Berkshire Hathaway Finance 2.00% 18/03/2034 | 6,324 | 0.48 |
| 7,800,000 | NIKE 2.75% 27/03/2027 | 6,181 | 0.47 |

| 保有数量/ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価/ 未実現(損)益 (千英ポンド) | 純資産 比率(%) |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
| 6,339,000 | Bank of Nova Scotia 1.375% 05/12/2023 EMTN Reg S | 6,152 | 0.47 |
| 6,039,000 | DNB Bank 1.375% 12/06/2023 Reg S | 5,934 | 0.45 |
| 7,100,000 | ING Groep 1.125% VRN 07/12/2028 EMTN Reg S | 5,908 | 0.45 |
| 7,500,000 | CPI Property Group 2.75% 22/01/2028 EMTN Reg S | 5,759 | 0.44 |
| 6,000,000 | Pension Insurance 5.625% 20/09/2030 Reg S | 5,732 | 0.44 |
| 5,953,000 | Westfield Stratford City Finance No 2 1.642% 04/08/2031 Reg S | 5,579 | 0.43 |
| 6,200,000 | First Abu Dhabi Bank 1.125% 07/09/2026 EMTN Reg S | 5,525 | 0.42 |
| 5,700,000 | Volkswagen Finance Services 3.25% 13/04/2027 Reg S | 5,377 | 0.41 |
| 5,300,000 | Barclays Bank 2.375% VRN 06/10/2023 Reg S | 5,285 | 0.40 |
| 7,293,000 | UBS Group 0.25% VRN 05/11/2028 EMTN Reg S | 5,267 | 0.40 |
| 6,300,000 | BFCM Paris 3.875% VRN 16/06/2032 Reg S | 5,221 | 0.40 |
| 5,600,000 | CaixaBank 1.50% VRN 03/12/2026 EMTN Reg S | 5,029 | 0.39 |
| 5,411,000 | Aviva 6.875% VRN (Perpetual) Reg S | 4,938 | 0.38 |
| 5,540,000 | Scottish Hydro Electric Transmission 1.50% 24/03/2028 EMTN Reg S | 4,907 | 0.38 |
| 7,500,000 | EDF 1.00% 29/11/2033 EMTN Reg S | 4,827 | 0.37 |
| 6,325,000 | BNP Paribas 2.591% VRN 20/01/2028 144A | 4,698 | 0.36 |
| 5,422,000 | Athene Global Funding 1.75% 24/11/2027 Reg S | 4,683 | 0.36 |
| 5,975,000 | Goldman Sachs Group 3.615% VRN 15/03/2028 | 4,668 | 0.36 |
| 5,850,000 | Scentre Group Trust 2 3.625% 28/01/2026 144A | 4,665 | 0.36 |
| 5,900,000 | Nordea Bank Abp 1.125% 16/02/2027 EMTN Reg S | 4,651 | 0.36 |
| 4,727,000 | DNB Bank 1.625% 15/12/2023 EMTN Reg S | 4,600 | 0.35 |
| 5,653,000 | Morgan Stanley 2.95% VRN 07/05/2032 | 4,583 | 0.35 |
| 4,800,000 | Euroclear Bank KBC Group 1.25% 30/09/2024 EMTN Reg S | 4,542 | 0.35 |
| 4,260,000 | America Movil 4.948% 22/07/2033 | 4,483 | 0.34 |
| 4,300,000 | EDF 6.00% 23/01/2114 EMTN Reg S | 4,477 | 0.34 |
| 5,166,000 | Goldman Sachs Group 1.50% 07/12/2027 EMTN Reg S | 4,462 | 0.34 |
| 5,550,000 | Glencore Funding 4.875% 12/03/2029 144A | 4,440 | 0.34 |
| 7,419,000 | Totalenergies SE 3.25% VRN (Perpetual) Reg S | 4,437 | 0.34 |
| 4,400,000 | Volkswagen Finance Services 4.25% 09/10/2025 EMTN Reg S | 4,384 | 0.34 |
| 4,500,000 | Telereal Securitisation 3.5625% 10/12/2036 Reg S | 4,367 | 0.33 |
| 5,750,000 | HSBC Holdings 1.645% VRN 18/04/2026 | 4,358 | 0.33 |
| 5,453,000 | DWR Cymru Financing UK 1.375% 31/03/2033 EMTN Reg S | 4,338 | 0.33 |
| 5,032,000 | RCI Banque 4.75% 06/07/2027 EMTN Reg S | 4,318 | 0.33 |
| 5,082,000 | HSBC Holdings 4.95% 31/03/2030 | 4,133 | 0.32 |
| 4,588,000 | SSE 3.74% VRN (Perpetual) | 4,098 | 0.31 |
| 4,444,000 | Enel Finance International 2.875% 11/04/2029 EMTN Reg S | 4,055 | 0.31 |
| 5,200,000 | BNP Paribas 1.25% 13/07/2031 EMTN Reg S | 3,935 | 0.30 |
| 4,583,000 | London Stock Exchange Group 1.625% 06/04/2030 Reg S | 3,928 | 0.30 |
| 4,305,000 | Blackstone Property Partners EUR Holdings 2.00% 20/10/2025 EMTN Reg S | 3,875 | 0.30 |
| 5,011,000 | Bristol-Myers Squibb 2.95% 15/03/2032 | 3,784 | 0.29 |
| 4,023,000 | Lloyds Banking Group 1.875% VRN 15/01/2026 Reg S | 3,778 | 0.29 |
| 4,346,000 | General Motors 6.80% 01/10/2027 | 3,775 | 0.29 |
| 4,738,000 | National Grid 3.245% 30/03/2034 Reg S | 3,767 | 0.29 |

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現（損）益 （千英ポンド） | 純資産 比率（%） |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 4,625,000 | Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/01/2028 Reg S | 3,720 | 0.29 |
| 5,900,000 | BFCM Paris 1.125% 19/11/2031 EMTN Reg S | 3,687 | 0.28 |
| 4,222,000 | NatWest Group 2.057% VRN 09/11/2028 Reg S | 3,673 | 0.28 |
| 4,450,000 | Credit Agricole 6.875% VRN (Perpetual) 144A | 3,545 | 0.27 |
| 3,833,000 | Canary Wharf Group Investment Holdings PLC 3.375% 23/04/2028 REGS | 3,401 | 0.26 |
| 5,250,000 | Hammerson Ireland 1.75% 03/06/2027 Reg S | 3,390 | 0.26 |
| 4,700,000 | Deutsche Boerse 2.00% VRN 23/06/2048 Reg S | 3,389 | 0.26 |
| 3,340,000 | Rentokil Initial 5.00% 27/06/2032 EMTN Reg S | 3,357 | 0.26 |
| 5,023,000 | Annington Funding 2.924% 06/10/2051 EMTN Reg S | 3,306 | 0.25 |
| 4,585,000 | Berkshire Hathaway Finance 2.625% 19/06/2059 | 3,262 | 0.25 |
| 3,800,000 | Investec 2.625% VRN 04/01/2032 EMTN Reg S | 3,253 | 0.25 |
| 2,750,000 | Lloyds TSB Bank 6.00% 08/02/2029 Reg S | 3,245 | 0.25 |
| 4,450,000 | Dae Funding 3.375% 20/03/2028 Reg S | 3,222 | 0.25 |
| 3,099,000 | Anglian Water (Osprey) Financing 5.00% 30/04/2023 EMTN Reg S | 3,129 | 0.24 |
| 4,350,000 | International Business Machines 2.72% 09/02/2032 | 3,125 | 0.24 |
| 3,106,000 | BMW International Investment 1.25% 11/07/2022 EMTN Reg S | 3,105 | 0.24 |
| 4,631,000 | Faurecia 2.75% 15/02/2027 Reg S | 3,104 | 0.24 |
| 3,100,000 | Ladbrokes Group Finance 5.125% 08/09/2023 Reg S | 3,062 | 0.23 |
| 3,462,000 | Peabody Capital No 2 2.75% 02/03/2034 Reg S | 3,051 | 0.23 |
| 3,582,000 | Metropolitan Life Global Funding I 0.625% 08/12/2027 Reg S | 3,032 | 0.23 |
| 3,100,000 | Volkswagen Finance Services 1.125% 18/09/2023 EMTN Reg S | 2,993 | 0.23 |
| 3,010,000 | Society of Lloyds 4.75% 30/10/2024 Reg S | 2,985 | 0.23 |
| 2,961,000 | Rothsay Life 5.50% VRN 17/09/2029 Reg S | 2,967 | 0.23 |
| 3,295,000 | Motability Operations Group 1.75% 03/07/2029 EMTN Reg S | 2,964 | 0.23 |
| 3,556,000 | Credit Suisse Group 2.125% VRN 15/11/2029 Reg S | 2,928 | 0.22 |
| 2,680,000 | British Land 5.264% 24/09/2035 | 2,912 | 0.22 |
| 3,200,000 | BNP Paribas 2.00% VRN 24/05/2031 EMTN | 2,777 | 0.21 |
| 3,850,000 | Prosus 3.257% 19/01/2027 Reg S | 2,767 | 0.21 |
| 3,434,000 | Prologis International Funding II 3.125% 01/06/2031 Reg S | 2,758 | 0.21 |
| 2,704,000 | Royal London Finance Bonds 6.125% VRN 30/11/2043 Reg S | 2,752 | 0.21 |
| 3,145,000 | Anglian Water (Osprey) Financing 2.00% 31/07/2028 EMTN Reg S | 2,730 | 0.21 |
| 3,505,000 | Bellis Acquisition 3.25% 16/02/2026 Reg S | 2,726 | 0.21 |
| 3,260,000 | HSBC Holdings 2.50% 15/03/2027 EMTN Reg S | 2,690 | 0.21 |
| 2,900,000 | Hammerson 6.00% 23/02/2026 | 2,685 | 0.21 |
| 3,750,000 | Bristol-Myers Squibb 3.90% 15/03/2062 | 2,662 | 0.20 |
| 3,191,000 | Bunzl Finance 1.50% 30/10/2030 EMTN Reg S | 2,614 | 0.20 |
| 3,000,000 | Volkswagen International Finance 3.75% 28/09/2027 Reg S | 2,604 | 0.20 |
| 4,075,000 | Shell International Finance 3.125% 07/11/2049 | 2,586 | 0.20 |
| 3,018,000 | Blackstone Property Partners EUR Holdings 2.625% 20/10/2028 EMTN Reg S | 2,551 | 0.20 |
| 2,705,000 | McDonalds 3.75% 31/05/2038 Reg S | 2,512 | 0.19 |
| 2,800,000 | Shaftesbury Carnaby 2.487% 30/09/2031 Reg S | 2,458 | 0.19 |
| 2,450,000 | BHP Billiton Finance 6.50% VRN 22/10/2077 Reg S | 2,452 | 0.19 |
| 2,788,000 | Bank of America Corporation 3.648% VRN 31/03/2029 EMTN Reg S | 2,429 | 0.19 |

| 保有数量/ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価/ 未実現(損)益 (千英ポンド) | 純資産 比率(%) |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 2,657,000 | Barclays 1.70% VRN 03/11/2026 Reg S | 2,412 | 0.18 |
| 2,495,000 | Gsk Consumer Healthcare Capital UK 2.875% 29/10/2028 EMTN Reg S | 2,380 | 0.18 |
| 3,428,000 | easyJet Finco 1.875% 03/03/2028 EMTN Reg S | 2,367 | 0.18 |
| 2,731,000 | Associated British Foods 2.50% 16/06/2034 Reg S | 2,354 | 0.18 |
| 2,870,000 | Intercontinental Exchange 5.20% 15/06/2062 | 2,343 | 0.18 |
| 2,922,000 | Berkshire Hathaway Finance 2.375% 19/06/2039 | 2,335 | 0.18 |
| 2,636,000 | National Express Group 2.375% 20/11/2028 Reg S | 2,330 | 0.18 |
| 2,829,000 | Berkshire Hathaway 0.00% 12/03/2025 | 2,301 | 0.18 |
| 2,536,000 | National Express Group 4.25% VRN (Perpetual) | 2,289 | 0.18 |
| 2,330,000 | AA Bond 5.50% 31/07/2050 Reg S | 2,261 | 0.17 |
| 4,629,000 | CPI Property Group 4.875% VRN (Perpetual) Reg S | 2,259 | 0.17 |
| 3,000,000 | Vonovia SE 1.875% 28/06/2028 Reg S | 2,248 | 0.17 |
| 2,587,000 | Jigsaw Funding 3.375% 05/05/2052 Reg S | 2,210 | 0.17 |
| 2,500,000 | M&G 6.25% VRN 20/10/2068 Reg S | 2,203 | 0.17 |
| 2,200,000 | RAC Bond 4.565% 06/05/2046 EMTN Reg S | 2,198 | 0.17 |
| 2,708,000 | Motability Operations Group 2.375% 03/07/2039 EMTN Reg S | 2,196 | 0.17 |
| 1,715,000 | Lloyds Bank 6.50% 17/09/2040 EMTN Reg S | 2,189 | 0.17 |
| 2,427,000 | Heathrow Funding 2.75% 13/10/2031 EMTN Reg S | 2,189 | 0.17 |
| 2,900,000 | Goldman Sachs Group 2.64% VRN 24/02/2028 | 2,170 | 0.17 |
| 2,150,000 | First Abu Dhabi Bank 1.375% 19/02/2023 EMTN Reg S | 2,128 | 0.16 |
| 2,609,000 | Intercontinental Exchange 4.60% 15/03/2033 | 2,127 | 0.16 |
| 2,378,000 | MPT Operating Partnership 2.50% 24/03/2026 | 2,098 | 0.16 |
| 2,694,000 | Bristol-Myers Squibb 4.25% 26/10/2049 | 2,082 | 0.16 |
| 3,359,000 | Clarion Funding 1.875% 07/09/2051 EMTN Reg S | 2,056 | 0.16 |
| 2,800,000 | Rabobank 4.875% VRN (Perpetual) Reg S | 2,016 | 0.15 |
| 1,900,000 | Lloyds Bank 5.125% 07/03/2025 EMTN Reg S | 2,012 | 0.15 |
| 2,500,000 | Wintershall Dea Finance 0.84% 25/09/2025 Reg S | 1,959 | 0.15 |
| 2,194,000 | Jerrold Finco 4.875% 15/01/2026 Reg S | 1,929 | 0.15 |
| 2,730,000 | Paradigm Homes Charitable Housing Association 2.25% 20/05/2051 Reg S | 1,924 | 0.15 |
| 2,727,000 | University of Oxford 2.544% 08/12/2117 Reg S | 1,900 | 0.15 |
| 2,625,000 | Bristol-Myers Squibb 3.55% 15/03/2042 | 1,894 | 0.15 |
| 2,200,000 | Credit Agricole 1.874% VRN 09/12/2031 Reg S | 1,875 | 0.14 |
| 1,750,000 | Clydesdale Bank 4.625% 08/06/2026 EMTN | 1,873 | 0.14 |
| 2,275,000 | Glencore Funding 4.125% 12/03/2024 144A | 1,870 | 0.14 |
| 1,963,000 | Phoenix Group Holdings 5.625% 28/04/2031 EMTN Reg S | 1,842 | 0.14 |
| 2,474,000 | CK Hutchison Group Telecom Finance 2.625% 17/10/2034 Reg S | 1,834 | 0.14 |
| 2,490,000 | AbbVie 4.05% 21/11/2039 | 1,831 | 0.14 |
| 2,704,000 | Verizon Communications 3.40% 22/03/2041 | 1,818 | 0.14 |
| 2,029,000 | Gsk Consumer Healthcare Capital UK 3.375% 29/03/2038 EMTN Reg S | 1,801 | 0.14 |
| 1,700,000 | HSBC Holdings 7.00% 07/04/2038 EMTN Reg S | 1,779 | 0.14 |
| 2,583,000 | Societe Generale France 4.75% VRN (Perpetual) 144A | 1,731 | 0.13 |
| 1,850,000 | HSBC Holdings 3.00% VRN 22/07/2028 | 1,715 | 0.13 |
| 1,843,000 | InterContinental Hotels Group 3.375% 08/10/2028 EMTN Reg S | 1,669 | 0.13 |

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現(損)益 (千英ポンド) | 純資産 比率(%) |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
| 2,667,000 | ASTM 2.375% 25/11/2033 EMTN Reg S | 1,668 | 0.13 |
| 2,375,000 | UBS Group 4.875% VRN (Perpetual) | 1,642 | 0.13 |
| 1,928,000 | Unilever Finance Netherlands 1.25% 25/03/2025 EMTN Reg S | 1,623 | 0.12 |
| 2,571,000 | Simon International Finance SCA 1.125% 19/03/2033 Reg S | 1,607 | 0.12 |
| 2,000,000 | SEB 6.875% VRN (Perpetual) Reg S | 1,577 | 0.12 |
| 1,550,000 | Zurich Finance (UK) 6.625% VRN (Perpetual) EMTN | 1,551 | 0.12 |
| 2,200,000 | ING Groep 0.875% VRN 29/11/2030 EMTN Reg S | 1,538 | 0.12 |
| 1,875,000 | QBE Insurance Group 5.875% VRN (Perpetual) | 1,488 | 0.11 |
| 2,200,000 | Autostrade per Litalia 1.875% 26/09/2029 EMTN Reg S | 1,488 | 0.11 |
| 2,120,000 | S&P Global 3.70% 01/03/2052 144A | 1,481 | 0.11 |
| 1,612,000 | Yorkshire Building Society 3.511% VRN 11/10/2030 Reg S | 1,471 | 0.11 |
| 1,655,000 | Bazalgette Finance 2.75% 10/03/2034 EMTN Reg S | 1,450 | 0.11 |
| 1,705,000 | AA Bond Co Ltd. 3.25% 31/07/2050 REGS | 1,423 | 0.11 |
| 1,200,000 | Walmart Stores 5.625% 27/03/2034 | 1,412 | 0.11 |
| 1,600,000 | Severn Trent Water Utilities Finance 2.625% 22/02/2033 EMTN Reg S | 1,411 | 0.11 |
| 1,688,000 | Aroundtown 4.75% VRN (Perpetual) | 1,403 | 0.11 |
| 1,438,000 | Canary Wharf Group Investment Holdings 2.625% 23/04/2025 Reg S | 1,327 | 0.10 |
| 1,869,000 | National Grid Electric Transmission 2.00% 17/04/2040 EMTN Reg S | 1,293 | 0.10 |
| 1,500,000 | CaixaBank 3.75% VRN 15/02/2029 EMTN Reg S | 1,274 | 0.10 |
| 1,493,000 | NewRiver (REIT) 3.50% 07/03/2028 Reg S | 1,266 | 0.10 |
| 1,300,000 | Volkswagen International Finance 4.125% 17/11/2031 Reg S | 1,239 | 0.09 |
| 1,250,000 | Society of Lloyds 4.875% VRN 07/02/2047 Reg S | 1,211 | 0.09 |
| 1,400,000 | Phoenix Group Holdings 5.75% VRN (Perpetual) Reg S | 1,194 | 0.09 |
| 1,400,000 | Apple 4.65% 23/02/2046 | 1,184 | 0.09 |
| 2,000,000 | Allianz SE 2.60% VRN (Perpetual) | 1,177 | 0.09 |
| 1,750,000 | Union Pacific 3.85% 14/02/2072 | 1,173 | 0.09 |
| 1,175,000 | Yorkshire Building Society 3.00% VRN 18/04/2025 EMTN Reg S | 1,147 | 0.09 |
| 1,457,000 | International Business Machines 2.20% 09/02/2027 | 1,115 | 0.09 |
| 1,800,000 | Allianz SE 3.20% VRN (Perpetual) | 1,090 | 0.08 |
| 940,000 | Heathrow Funding 6.45% VRN 10/12/2031 Reg S | 1,081 | 0.08 |
| 1,320,000 | Goodman US Finance Five 4.625% 04/05/2032 144A | 1,065 | 0.08 |
| 1,212,000 | Travis Perkins 3.75% 17/02/2026 Reg S | 1,053 | 0.08 |
| 2,340,000 | Deutsche Bahn Finance 0.625% 08/12/2050 EMTN Reg S | 1,048 | 0.08 |
| 1,567,000 | Valero Energy 4.00% 01/06/2052 | 1,033 | 0.08 |
| 1,368,000 | Segro Capital SARL 1.875% 23/03/2030 EMTN Reg S | 1,027 | 0.08 |
| 1,150,000 | Home Group 3.125% 27/03/2043 Reg S | 979 | 0.08 |
| 981,000 | Nationwide Building Society 5.875% VRN (Perpetual) | 930 | 0.07 |
| 1,074,000 | Lloyds Banking Group 3.50% VRN 01/04/2026 EMTN Reg S | 929 | 0.07 |
| 850,000 | Lloyds Bank 4.875% 30/03/2027 EMTN | 926 | 0.07 |
| 1,096,000 | Nats (En Route) 1.75% 30/09/2033 Reg S | 905 | 0.07 |
| 1,100,000 | Volkswagen International Finance 2.625% 16/11/2027 Reg S | 903 | 0.07 |
| 982,000 | Whitbread Group 2.375% 31/05/2027 Reg S | 873 | 0.07 |
| 1,051,000 | Lloyds Banking Group 0.50% VRN 12/11/2025 EMTN Reg S | 855 | 0.07 |

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現（損）益 （千英ポンド） | 純資産 比率（%） |
|----------------|--|---------------------------|--------------|
| 900,000 | Aviva 5.125% VRN 04/06/2050 EMTN Reg S | 849 | 0.07 |
| 850,000 | CPUK Finance 3.588% 28/02/2042 EMTN Reg S | 838 | 0.06 |
| 887,000 | Optivo Finance 2.857% 07/10/2035 Reg S | 784 | 0.06 |
| 1,026,000 | Orbit Capital 2.00% 24/11/2038 Reg S | 770 | 0.06 |
| 1,075,000 | Via Outlets 1.75% 15/11/2028 Reg S | 768 | 0.06 |
| 1,005,000 | Phoenix Group Holdings 5.625% VRN (Perpetual) Reg S | 764 | 0.06 |
| 750,000 | Phoenix Group Holdings 4.125% 20/07/2022 EMTN Reg S | 750 | 0.06 |
| 809,000 | Whitbread Group 3.00% 31/05/2031 Reg S | 676 | 0.05 |
| 680,000 | Massachusetts Institute of Technology 5.60% 01/07/2111 | 670 | 0.05 |
| 1,007,000 | Guinness Partnership 2.00% 22/04/2055 Reg S | 648 | 0.05 |
| 867,000 | The Berkeley Group 2.50% 11/08/2031 Reg S | 633 | 0.05 |
| 550,000 | Santander UK 5.75% 02/03/2026 EMTN Reg S | 607 | 0.05 |
| 787,000 | Northern Electric Finance 2.75% 24/05/2049 Reg S | 600 | 0.05 |
| 600,000 | Virgin Money UK 9.25% VRN (Perpetual) | 592 | 0.05 |
| 550,000 | CPUK Finance 7.239% 28/02/2024 EMTN Reg S | 577 | 0.04 |
| 525,000 | UNITE (USAF) II 3.921% 30/06/2025 Reg S | 533 | 0.04 |
| 460,000 | Abrdn 5.25% VRN (Perpetual) Reg S | 399 | 0.03 |
| 340,000 | Peel Land & Property Investments 8.375% STEP 30/04/2040 | 352 | 0.03 |
| 375,000 | Digital Stout Holding 3.75% 17/10/2030 Reg S | 343 | 0.03 |
| 280,000 | London Merchant Securities 6.50% 16/03/2026 | 306 | 0.02 |
| 356,000 | Land Securities Capital Markets 2.625% 22/09/2039 EMTN Reg S | 305 | 0.02 |
| 300,000 | Phoenix Group Holdings 5.375% 06/07/2027 EMTN Reg S | 238 | 0.02 |
| 160,000 | Westpac Banking 3.35% 08/03/2027 | 128 | 0.01 |
| 150,000 | Autostrade per Litalia 1.625% 12/06/2023 | 128 | 0.01 |
| 68,000 | Microsoft 2.675% 01/06/2060 | 40 | 0.00 |
| | | 679,123 | 52.03 |
| | 英国国債 - (45.46%) | | |
| 73,000,000 | UK Gilt 2.00% 07/09/2025 Reg S | 72,951 | 5.59 |
| 54,260,000 | UK Gilt 4.25% 07/12/2027 | 60,179 | 4.61 |
| 43,300,000 | UK Gilt 4.50% 07/12/2042 | 55,217 | 4.23 |
| 67,870,000 | UK Gilt 1.50% 22/07/2047 Reg S | 52,914 | 4.05 |
| 27,580,000 | UK Gilt 4.00% 22/01/2060 Reg S | 37,125 | 2.84 |
| 35,050,000 | UK Gilt 2.75% 07/09/2024 Reg S | 35,575 | 2.73 |
| 26,580,000 | UK Gilt 4.25% 07/09/2039 Reg S | 32,149 | 2.46 |
| 23,795,000 | UK Gilt 3.75% 22/07/2052 Reg S | 29,088 | 2.23 |
| 21,100,000 | UK Gilt 5.00% 07/03/2025 | 22,715 | 1.74 |
| 24,000,000 | UK Gilt 0.875% 22/10/2029 Reg S | 21,955 | 1.68 |
| 16,850,000 | UK Gilt 4.25% 07/12/2049 | 21,815 | 1.67 |
| 15,860,000 | UK Gilt 4.75% 07/12/2038 | 20,204 | 1.55 |
| 14,190,000 | UK Gilt 4.25% 07/12/2055 | 19,275 | 1.48 |
| 11,070,000 | UK Gilt 4.25% 07/12/2040 Reg S | 13,509 | 1.04 |
| 9,100,000 | UK Gilt 3.50% 22/07/2068 | 11,539 | 0.88 |
| 6,140,000 | UK Gilt 4.50% 07/09/2034 Reg S | 7,387 | 0.57 |

| 保有数量/ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価/ 未実現(損)益 (千英ポンド) | 純資産 比率(%) |
|----------------|---|---------------------------|--------------|
| 4,930,000 | UK Gilt 1.75% 07/09/2037 Reg S | 4,351 | 0.33 |
| 3,630,000 | UK Gilt 4.25% 07/03/2036 Reg S | 4,288 | 0.33 |
| 5,454,000 | UK Gilt 1.50% 31/07/2053 Reg S | 4,137 | 0.32 |
| 5,000,000 | UK Gilt 1.75% 22/07/2057 Reg S | 4,028 | 0.31 |
| 2,810,000 | UK Gilt 3.25% 22/01/2044 Reg S | 3,037 | 0.23 |
| 1,700,000 | UK Gilt 3.50% 22/01/2045 Reg S | 1,913 | 0.15 |
| 1,320,000 | UK Gilt 0.625% 31/07/2035 Reg S | 1,025 | 0.08 |
| 1,000,000 | UK Gilt 2.50% 22/07/2065 Reg S | 999 | 0.08 |
| 550,000 | UK Gilt 1.75% 22/01/2049 Reg S | 452 | 0.03 |
| 100,000 | UK Gilt 6.00% 07/12/2028 | 123 | 0.01 |
| | | 537,950 | 41.22 |
| | モーゲージ証券 - (3.58%) | | |
| 4,620,000 | NewDay Partnership Funding 2017-1 0.8052% VRN 15/12/2027 Reg S | 4,611 | 0.35 |
| 3,829,828 | Together Asset Backed Securitisation 2021-Crel 2.5357% VRN 20/01/2055 Reg S | 3,818 | 0.29 |
| 2,900,000 | Sage AR Funding No 1 2.1084% VRN 17/11/2051 Reg S | 2,775 | 0.21 |
| 4,887,550 | Intu (SGS) Finance 4.625% 17/03/2028 Reg S | 2,638 | 0.20 |
| 2,501,000 | Income Contingent Student Loans 1 2002-2006 2.50% 24/07/2056 Reg S | 2,190 | 0.17 |
| 1,546,982 | Tesco Property Finance 2 6.0517% 13/10/2039 | 1,666 | 0.13 |
| 3,010,912 | Metrocentre Finance 8.75% VRN 06/12/2028 | 1,506 | 0.12 |
| 1,636,000 | NATS (En Route) 1.375% 31/03/2031 Reg S | 1,477 | 0.11 |
| 1,605,000 | Dignity Finance 4.6956% 31/12/2049 Reg S | 1,439 | 0.11 |
| 1,806,009 | British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust 4.25% 15/05/2034 144A | 1,430 | 0.11 |
| 1,200,000 | Broadgate Financing 4.999% 05/10/2033 Reg S | 1,260 | 0.10 |
| 1,427,250 | Income Contingent Student Loans 2 2007-2009 2.50% 24/07/2058 Reg S | 1,221 | 0.09 |
| 1,130,400 | Greene King Finance 3.593% 15/03/2035 Reg S | 1,058 | 0.08 |
| 1,127,715 | Marstons Issuer 5.158% VRN 15/10/2027 | 1,025 | 0.08 |
| 1,044,000 | Telereal Securitisation 1.9632% VRN 10/12/2033 Reg S | 962 | 0.07 |
| 1,593,889 | Intu (SGS) Finance 4.25% 17/09/2035 EMTN Reg S | 861 | 0.07 |
| 737,631 | Highbury Finance 7.017% 20/03/2023 | 756 | 0.06 |
| 821,864 | Taurus 2019-1 FR Srl 0.90% VRN 02/02/2031 Reg S | 695 | 0.05 |
| 642,073 | Tesco Property Finance 3 5.744% 13/04/2040 Reg S | 673 | 0.05 |
| 500,000 | RHP Finance 3.25% 05/02/2048 Reg S | 432 | 0.03 |
| 406,932 | Together Asset Backed Securitisation 2018-1 2.239% VRN 12/07/2050 Reg S | 407 | 0.03 |
| 318,585 | Equity Release Funding 3 5.05% 26/04/2033 | 352 | 0.03 |
| 314,767 | Juturna European Loan Conduit No 16 5.0636% 10/08/2033 EMTN Reg S | 347 | 0.03 |
| 328,804 | Premiertel 6.175% 08/05/2032 | 345 | 0.03 |
| 290,176 | Tesco Property Finance 5 5.6611% 13/10/2041 Reg S | 299 | 0.02 |
| 248,092 | Equity Release Funding 3 5.70% 26/02/2031 | 268 | 0.02 |
| 190,000 | Peel South East 10.00% 30/04/2026 | 196 | 0.02 |
| 176,626 | Longstone Finance 4.791% 19/04/2036 | 186 | 0.01 |
| 177,277 | Meadowhall Finance 4.986% 12/07/2037 Reg S | 185 | 0.01 |
| 117,720 | Dignity Finance 3.5456% 31/12/2034 Reg S | 117 | 0.01 |

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現（損）益 （千英ポンド） | 純資産 比率（%） |
|----------------|--|---------------------------|---------------|
| 14,286 | Equity Release Funding 2 5.88% 26/05/2032 | 16 | 0.00 |
| | | 35,211 | 2.70 |
| | 国債 - (1.64%) | | |
| 6,350,000 | Saudi Arabia 3.25% 26/10/2026 Reg S | 5,121 | 0.39 |
| 4,850,000 | Qatar 3.75% 16/04/2030 Reg S | 3,971 | 0.30 |
| 4,150,000 | Abu Dhabi 2.125% 30/09/2024 Reg S | 3,314 | 0.25 |
| 3,559,000 | Jersey 2.875% 06/05/2052 Reg S | 3,136 | 0.24 |
| 4,275,000 | Chile 4.34% 07/03/2042 | 3,108 | 0.24 |
| 2,700,000 | Abu Dhabi 3.875% 16/04/2050 Reg S | 1,979 | 0.15 |
| 1,750,000 | Mexico 5.625% 19/03/2114 EMTN | 1,362 | 0.10 |
| 1,250,000 | Chile 3.50% 31/01/2034 | 908 | 0.07 |
| 1,275,000 | Chile 4.00% 31/01/2052 | 860 | 0.07 |
| 200,000 | Qatar 3.25% 02/06/2026 Reg S | 163 | 0.01 |
| | | 23,922 | 1.83 |
| | 金融 - (1.86%) | | |
| 326 | Fidelity Institutional Liquidity Fund - Sterling A Accumulating Shares | 6,857 | 0.53 |
| | | 6,857 | 0.53 |
| | 地方債 - (0.21%) | | |
| 2,370,000 | University of California Revenues 4.858% 15/05/2112 | 1,848 | 0.14 |
| | | 1,848 | 0.14 |
| | 先物取引 - ((0.02)%) | | |
| (57,400,000) | Euro-Bund Commodity Future 08/09/2022 | 2,235 | 0.17 |
| (46,800,000) | US 10 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 21/09/2022 | 903 | 0.07 |
| (14,400,000) | US Ultra Bond Commodity Future 21/09/2022 | 796 | 0.06 |
| (30,800,000) | US 10 Year Ultra Future 21/09/2022 | 786 | 0.06 |
| (54,700,000) | Euro-Bobl Commodity Future 08/09/2022 | 525 | 0.04 |
| (5,700,000) | US 20 Year Long Bond (CBT) Commodity Future 21/09/2022 | 179 | 0.01 |
| (900,000) | Euro-Buxl 30 Year Commodity Future 08/09/2022 | 99 | 0.01 |
| (7,700,000) | US 5 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 30/09/2022 | 99 | 0.01 |
| (4,800,000) | Euro-Schatz Commodity Future 08/09/2022 | 16 | 0.00 |
| (2,400,000) | US 2 Year Treasury Note (CBT) Commodity Future 30/09/2022 | 15 | 0.00 |
| 189,400,000 | Long Gilt Commodity Future 28/09/2022 | (6,265) | (0.48) |
| | | (612) | (0.05) |
| | 外国為替先物取引 - (0.03%) | | |
| 8,286,000 | Bought USD sold GBP @ 0.794998 for settlement 18/08/2022 | 250 | 0.02 |
| 5,452,000 | Bought CHF sold GBP @ 0.828670 for settlement 18/08/2022 | 159 | 0.01 |
| 3,598,000 | Bought CHF sold GBP @ 0.828670 for settlement 18/08/2022 | 150 | 0.01 |
| 4,786,000 | Bought CAD sold GBP @ 0.622394 for settlement 18/08/2022 | 78 | 0.01 |
| 9,506,000 | Bought EUR sold GBP @ 0.857728 for settlement 18/08/2022 | 50 | 0.00 |
| (3,810,000) | Bought GBP sold EUR @ 1.156905 for settlement 18/08/2022 | 13 | 0.00 |
| (42,596,000) | Bought GBP sold SEK @ 12.442624 for settlement 18/08/2022 | 7 | 0.00 |
| 4,176,000 | Bought EUR sold GBP @ 0.857728 for settlement 18/08/2022 | (5) | 0.00 |

| 保有数量／ 保有相当量 | 組入投資資産 | 時価／ 未実現（損）益 （千英ポンド） | 純資産 比率（％） |
|------------------|--|---------------------------|---------------|
| (3, 870, 000) | Bought GBP sold EUR @ 1.165846 for settlement 18/08/2022 | (13) | 0.00 |
| (6, 354, 000) | Bought GBP sold EUR @ 1.165201 for settlement 18/08/2022 | (18) | 0.00 |
| (11, 498, 000) | Bought GBP sold EUR @ 1.171753 for settlement 18/08/2022 | (88) | (0.01) |
| (4, 195, 000) | Bought GBP sold USD @ 1.246355 for settlement 18/08/2022 | (95) | (0.01) |
| (17, 522, 000) | Bought GBP sold EUR @ 1.169120 for settlement 18/08/2022 | (100) | (0.01) |
| (4, 119, 000) | Bought GBP sold USD @ 1.257864 for settlement 18/08/2022 | (124) | (0.01) |
| (10, 044, 000) | Bought GBP sold USD @ 1.250085 for settlement 18/08/2022 | (253) | (0.02) |
| (134, 241, 000) | Bought GBP sold EUR @ 1.164223 for settlement 18/08/2022 | (282) | (0.02) |
| (210, 300, 000) | Bought GBP sold USD @ 1.229379 for settlement 18/08/2022 | (2, 461) | (0.19) |
| | | (2, 732) | (0.21) |
| | スワップ - ((0.13)%) | | |
| 26, 200, 000 | Pay fixed 1.41% receive float SONIA Overnight Deposit Rates Swap 17/02/2032 | 2, 336 | 0.18 |
| 36, 000, 000 | Pay fixed 1.4062% receive float 28/01/2027 | 1, 772 | 0.14 |
| 11, 000, 000 | Pay fixed 0.2982% receive float 6 Month EURIBOR 10/06/2029 | 1, 068 | 0.08 |
| 6, 900, 000 | Pay fixed -0.1578% receive float 6 Month EURIBOR 18/05/2030 | 980 | 0.08 |
| 269, 500, 000 | Pay fixed 2.305% receive float 3 Month STIBOR 03/05/2032 | 946 | 0.07 |
| 8, 200, 000 | Pay fixed 0.0317% receive float 6 Month EURIBOR 05/08/2029 | 941 | 0.07 |
| 377, 200, 000 | Pay fixed 2.48% receive float 3 Month STIBOR 31/05/2032 | 874 | 0.07 |
| 129, 800, 000 | Pay fixed 2.5392% receive float 3 Month STIBOR 09/05/2032 | 248 | 0.02 |
| 78, 300, 000 | Pay fixed 2.8877% receive float 3 Month STIBOR 29/06/2032 | (37) | 0.00 |
| 5, 278, 300, 000 | Receive fixed 0.4028% pay float Bank of Japan Final Result: Un 13/06/2032 | (128) | (0.01) |
| 12, 700, 000 | Receive fixed 3.2673% pay float 3 Month CDOR 28/04/2032 | (291) | (0.02) |
| 17, 800, 000 | Receive fixed 1.2073% pay float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 16/05/2032 | (722) | (0.06) |
| 25, 000, 000 | Sold Protection on ITRAXX XOver S37 20/06/2027 | (816) | (0.06) |
| 13, 300, 000 | Receive fixed 0.9078% pay float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 04/04/2032 | (840) | (0.06) |
| 23, 900, 000 | Receive fixed 1.223% pay float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 25/04/2032 | (926) | (0.07) |
| 15, 500, 000 | Receive fixed 2.2728% pay float 3 Month CDOR 21/01/2032 | (1, 146) | (0.09) |
| 15, 200, 000 | Receive fixed 0.6723% pay float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 21/03/2032 | (1, 235) | (0.09) |
| 6, 950, 000 | Receive fixed 0.2646% pay float Overnight GBP SONIA 16/10/2040 | (2, 168) | (0.17) |
| 27, 200, 000 | Receive fixed -0.09% pay float SARON Fixing 3 Month (Market Close) Index 24/09/2031 | (3, 592) | (0.28) |
| | | (2, 736) | (0.21) |
| | 組入投資資産 | 1, 278, 831 | 97.98 |
| | 現金その他純資産（負債控除後） | 26, 316 | 2.02 |
| | 純資産額 | 1, 305, 147 | 100.00 |

カッコ内の数字は2021年6月30日現在の割合を示す。当期中に有価証券の分類の変更があった場合、割合は修正されている。

純資産比率は端数処理されている。

特に記載のない限り、すべての保有資産は証券取引所に上場されているか、認可された集団投資スキームである。

保有数量／保有相当量がゼロの場合、単元未満株によるものである。

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーユーロ・ボンド・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|------|------------------------|
| 設定形態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て |
| 投資目的 | 主としてユーロ建ての債券に投資を行いません。 |
| 決算日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | ユーロ |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 2,109,426 |
| スワップ取引に係る受取利息 | 878,554 |
| デリバティブ収益 | — |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 2,987,980 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 8,162,260 |
| 管理費 | 2,326,061 |
| 国税 | 534,445 |
| 保管費用 | 128,392 |
| 販売手数料 | 461,403 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 182,277 |
| 費用合計 | 11,794,838 |
| スワップ取引に係る支払利息 | 260,503 |
| デリバティブ費用 | 57,761 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | (369,872) |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 11,743,230 |
| 純投資収益(損失) | (8,755,250) |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | (40,088,659) |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | 42,663 |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | 259,400 |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | 3,095,429 |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | 1,876,950 |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (40,947,198) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 20,276 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 1,162,603 |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 9,168,738 |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (31,671,954) |
| 運用実績 | (105,837,002) |
| 受益者への分配金 | (17) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 280,820,147 |
| 当期解約額 | (424,174,465) |
| 調整勘定 | 572,638 |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | (142,781,680) |
| 純増加(減少) | (248,618,699) |
| 純資産額 | |
| 期首 | 1,408,151,304 |
| 期末 | 1,159,532,605 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または額面価値 | 時価 EUR | % Net Assets |
|---|------|-----|-------------|----------------------|--------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | |
| 公益事業 | | | | | |
| | GB | EUR | 3,103,923 | 31 | 0.00 |
| | | | | 31 | 0.00 |
| 素材 | | | | | |
| | IE | EUR | 20,084,211 | 18,575,625 | 1.60 |
| | DE | EUR | 16,286,469 | 15,436,234 | 1.33 |
| | | | | 34,011,859 | 2.93 |
| 一般消費財・サービス | | | | | |
| | NL | EUR | 23,516,785 | 21,676,009 | 1.87 |
| | | | | 21,676,009 | 1.87 |
| 生活必需品 | | | | | |
| | LU | EUR | 16,252,143 | 15,398,636 | 1.33 |
| | | | | 15,398,636 | 1.33 |
| ヘルスケア | | | | | |
| | DE | EUR | 14,022,431 | 14,035,808 | 1.21 |
| | | | | 14,035,808 | 1.21 |
| 金融 | | | | | |
| | CH | EUR | 24,960,657 | 23,596,997 | 2.02 |
| | US | EUR | 21,296,567 | 21,216,534 | 1.83 |
| | DE | EUR | 20,230,278 | 19,361,225 | 1.67 |
| | US | EUR | 19,926,458 | 18,695,322 | 1.61 |
| | DE | EUR | 12,196,593 | 11,761,260 | 1.01 |
| | US | EUR | 3,264,597 | 2,980,319 | 0.26 |
| | | | | 97,411,657 | 8.40 |
| 不動産 | | | | | |
| | LU | EUR | 12,228,728 | 11,661,645 | 1.01 |
| | DE | EUR | 2,775,273 | 1,967,846 | 0.17 |
| | | | | 13,629,491 | 1.18 |
| 国債 | | | | | |
| | DE | EUR | 294,557,379 | 268,808,646 | 23.18 |
| | DE | EUR | 186,481,896 | 171,570,244 | 14.80 |
| | DE | EUR | 155,735,503 | 154,289,984 | 13.31 |
| | NL | EUR | 114,107,530 | 106,237,419 | 9.16 |
| | DE | EUR | 97,481,455 | 97,699,814 | 8.43 |
| | DE | EUR | 276,213 | 268,546 | 0.02 |
| | | | | 798,674,653 | 68.90 |
| オープンエンド型ファンド | | | | | |
| | IE | EUR | 263 | 3,592,728 | 0.31 |
| | | | | 3,592,728 | 0.31 |
| その他の市場で取引される証券 | | | | | |
| 素材 | | | | | |
| | IE | EUR | 13,146,029 | 12,462,488 | 1.07 |
| | | | | 12,462,488 | 1.07 |
| 生活必需品 | | | | | |
| | NL | EUR | 9,720,758 | 9,311,922 | 0.80 |
| | NL | EUR | 7,047,732 | 6,806,481 | 0.59 |
| | | | | 16,118,403 | 1.39 |
| ヘルスケア | | | | | |
| | NL | EUR | 13,846,420 | 12,685,758 | 1.09 |
| | | | | 12,685,758 | 1.09 |
| 不動産 | | | | | |
| | DE | EUR | 6,134,813 | 5,828,140 | 0.50 |
| | | | | 5,828,140 | 0.50 |
| 国債 | | | | | |
| | SU | EUR | 117,855,609 | 108,182,020 | 9.33 |
| | | | | 108,182,020 | 9.33 |
| その他 | | | | | |
| | | | | 2 | 0.00 |
| Total Investments (Cost EUR 1,212,043,363) | | | | 1,153,907,683 | 99.51 |

外国為替先物取引

| | 契約額等 EUR | Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR |
|--|-----------|---|
| A-ACC Shares (HUF) (hedged) | | |
| Bought HUF Sold EUR at 383.008802 07/04/2022 | 871,178 | 4,577 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002693 04/05/2022 | 25,336 | 500 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002671 04/05/2022 | 18,246 | 209 0.00 |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002627 04/05/2022 | 45,192 | (222) (0.00) |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002625 04/05/2022 | 55,548 | (322) (0.00) |
| Bought EUR Sold HUF at 0.002626 04/05/2022 | 872,298 | (4,835) (0.00) |
| Bought HUF Sold EUR at 370.649800 04/05/2022 | 1,036,424 | (22,003) (0.00) |
| | | (22,096) (0.00) |

A-ACC Shares (USD) (hedged)

| | | |
|--|------------|-----------------------|
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 04/05/2022 | 19,794,942 | 1,147,520 0.10 |
| Bought USD Sold EUR at 1.065130 07/04/2022 | 20,754,745 | 151,267 0.01 |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 04/05/2022 | 20,942,462 | (153,199) (0.01) |
| | | 1,145,588 0.10 |

Y-ACC Shares (USD) (hedged)

| | | |
|--|--------|-------------------|
| Bought USD Sold EUR at 1.114982 04/05/2022 | 46,458 | 2,693 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.065130 07/04/2022 | 47,877 | 549 0.00 |
| Bought EUR Sold USD at 0.923860 04/05/2022 | 949 | (25) (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.941927 04/05/2022 | 48,202 | (353) (0.00) |
| | | 2,664 0.00 |

契約額等

Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR

通貨

先物取引

| | | | |
|--------------------------------------|-----|---------------|-----------------------|
| Euro-Bund 30Y Bond Future 08/04/2022 | EUR | (106,266,639) | 7,574,000 0.65 |
| Euro-Schatz Future 08/04/2022 | EUR | (180,996,168) | 692,896 0.06 |
| | | | 8,266,896 0.71 |

契約額等

Unrealised % Net gain/(loss) Assets EUR

通貨

金利スワップ取引

| | | | |
|--|-----|-------------|----------------------------|
| Pay fixed 0.6% receive float. (6m EURIBOR) 09/03/2052 | EUR | 22,640,383 | 4,846,013 0.42 |
| Pay fixed 0.59% receive float. (6m EURIBOR) 09/02/2052 | EUR | 10,955,024 | 2,375,942 0.20 |
| Pay fixed 0.65% receive float. (6m EURIBOR) 04/03/2052 | EUR | 11,320,191 | 2,285,238 0.20 |
| Pay fixed 0.74% receive float. (6m EURIBOR) 15/02/2052 | EUR | 11,174,124 | 2,015,543 0.17 |
| Pay fixed 0.74% receive float. (6m EURIBOR) 14/02/2052 | EUR | 10,955,024 | 1,970,535 0.17 |
| Receive fixed 0.83% pay float. (6m EURIBOR) 15/02/2032 | EUR | 32,828,555 | (2,650,224) (0.23) |
| Receive fixed 0.81% pay float. (6m EURIBOR) 14/02/2032 | EUR | 32,865,072 | (2,732,515) (0.24) |
| Receive fixed 0.81% pay float. (6m EURIBOR) 22/02/2032 | EUR | 33,303,273 | (2,763,776) (0.24) |
| Receive fixed 0.74% pay float. (6m EURIBOR) 07/03/2032 | EUR | 32,865,072 | (2,947,937) (0.25) |
| Receive fixed 0.71% pay float. (6m EURIBOR) 08/03/2032 | EUR | 32,865,072 | (3,037,385) (0.26) |
| Receive fixed 0.68% pay float. (6m EURIBOR) 04/03/2032 | EUR | 32,865,072 | (3,116,771) (0.27) |
| Receive fixed 0.66% pay float. (6m EURIBOR) 09/02/2032 | EUR | 32,865,072 | (3,180,705) (0.27) |
| Receive fixed 0.64% pay float. (6m EURIBOR) 04/03/2032 | EUR | 32,865,072 | (3,231,466) (0.28) |
| Receive fixed 0.86% pay float. (6m EURIBOR) 18/02/2032 | EUR | 48,202,106 | (3,780,740) (0.33) |
| Receive fixed 0.75% pay float. (6m EURIBOR) 09/03/2032 | EUR | 200,111,772 | (17,723,906) (1.53) |
| | | | (31,671,954) (2.73) |

その他資産（負債控除後）

27,903,824 2.42

Net Assets

1,159,532,605 100.00

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーアジア・パシフィック・
オポチュニティーズ・ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|--|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／ユーロ建て |
| 投 資 目 的 | 主として、アジア太平洋地域(除く日本)に本社があるか、事業活動の中心がそれらの地域にある企業の株式に投資し、長期的な元本の成長を目指します。 |
| 決 算 日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | 米ドル |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 33,172,079 |
| スワップ取引に係る受取利息 | — |
| デリバティブ収益 | — |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 33,172,079 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 26,108,710 |
| 管理費 | 4,279,891 |
| 国税 | 870,231 |
| 保管費用 | 768,794 |
| 販売手数料 | 951,415 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 354,056 |
| 費用合計 | 33,333,097 |
| スワップ取引に係る支払利息 | — |
| デリバティブ費用 | — |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 33,333,097 |
| 純投資収益(損失) | (161,018) |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | 18,002,113 |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | (1,167,452) |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | — |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | 99,952 |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | — |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | — |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (467,295,731) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (164,470) |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (127,096) |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 運用実績 | (450,813,702) |
| 受益者への分配金 | (183,832) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 1,249,445,111 |
| 当期解約額 | (761,439,147) |
| 調整勘定 | 918,479 |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | 488,924,443 |
| 純増加(減少) | 37,926,909 |
| 純資産額 | |
| 期首 | 2,362,277,026 |
| 期末 | 2,400,203,935 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または 面額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | | 時価 % Net Assets |
|---|------|-----|-------------|--------------------|-----------------|----------------------|--------------------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | | | |
| エネルギー | | | | | | | |
| China Merchants Energy Shipping (A) | CN | CNY | 38,150,929 | 29,549,315 | 1.23 | | |
| | | | | 29,549,315 | 1.23 | | |
| 素材 | | | | | | | |
| Franco-Nevada | CA | USD | 958,020 | 146,634,581 | 6.11 | 契約額等 USD | 未実現 (損 % Net 益) (米ドル) |
| James Hardie Industries | IE | AUD | 2,830,073 | 62,868,849 | 3.45 | | |
| Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology (A) | CN | CNY | 6,542,321 | 44,599,149 | 1.87 | | |
| Skshu Paint (A) | CN | CNY | 559,069 | 6,285,173 | 0.26 | | |
| Skshu Paint (A) | CN | CNY | 232,606 | 2,615,000 | 0.11 | | |
| Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology (A) | CN | CNY | 324,989 | 2,333,337 | 0.09 | | |
| | | | | 285,596,089 | 11.90 | | |
| 資本財・サービス | | | | | | | |
| Technetric Industries | HK | HKD | 7,329,721 | 98,915,305 | 4.12 | | |
| BOC Aviation | SG | HKD | 5,451,799 | 42,995,661 | 1.79 | | |
| | | | | 141,910,966 | 5.91 | | |
| 情報技術 | | | | | | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing | TW | TWD | 10,925,170 | 199,806,898 | 8.32 | | |
| Tencent Holdings | CN | HKD | 2,665,925 | 126,056,759 | 5.25 | | |
| SK Hynix | KR | KRW | 1,214,341 | 107,766,845 | 4.49 | | |
| ASML Holding | NL | EUR | 153,751 | 88,784,497 | 3.70 | | |
| Hon Hai Precision Industry | TW | TWD | 24,867,521 | 85,791,933 | 3.57 | | |
| MediaTek | TW | TWD | 2,977,231 | 83,365,649 | 3.47 | | |
| Zhen Ding Technology Holding | TW | TWD | 11,520,417 | 41,177,512 | 1.72 | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing ADR | TW | USD | 141,626 | 13,468,606 | 0.56 | | |
| | | | | 746,218,719 | 31.09 | | |
| 一般消費財・サービス | | | | | | | |
| Focus Media Information Technology (A) | CN | CNY | 75,123,409 | 66,306,663 | 2.76 | | |
| Nine Entertainment Holdings | AU | AUD | 18,536,376 | 35,366,307 | 1.47 | | |
| Yum China Holdings | CN | HKD | 656,569 | 27,562,082 | 1.15 | | |
| Yum China Holdings | CN | USD | 452,900 | 19,085,193 | 0.80 | | |
| Restaurant Brands (New Zealand) | NZ | NZD | 1,846,293 | 13,340,308 | 0.64 | | |
| Batang Electric Suzhou | CN | CNY | 350,007 | 8,190,713 | 0.34 | | |
| Focus Media Information Technology | CN | CNY | 7,091,922 | 6,259,590 | 0.26 | | |
| Shangri-La Asia | HK | HKD | 2,446,903 | 1,857,174 | 0.08 | | |
| Batang Electric Suzhou | CN | CNY | 10,187 | 238,394 | 0.01 | | |
| | | | | 180,206,424 | 7.51 | | |
| 生活必需品 | | | | | | | |
| Kweichow Moutai (A) | CN | CNY | 370,364 | 102,727,350 | 4.28 | | |
| Hanjaya Mandala Sampoerna (Dematerialised) | ID | IDR | 4,539,254 | 304,144 | 0.01 | | |
| Unilever Indonesia | ID | IDR | 676,544 | 181,552 | 0.01 | | |
| | | | | 103,213,046 | 4.30 | | |
| ヘルスケア | | | | | | | |
| CSL | AU | AUD | 500,221 | 96,569,151 | 4.02 | | |
| | | | | 96,569,151 | 4.02 | | |
| 金融 | | | | | | | |
| HDFC Bank | IN | INR | 7,743,789 | 139,781,737 | 5.82 | | |
| AIA Group | HK | HKD | 8,819,635 | 87,138,890 | 3.63 | | |
| Maccaserie Group | AU | AUD | 520,484 | 76,298,367 | 3.18 | | |
| HDFC Bank ADR | IN | USD | 22,654 | 1,268,189 | 0.05 | | |
| | | | | 304,487,183 | 12.69 | | |
| 不動産 | | | | | | | |
| Sun Hung Kai Properties | HK | HKD | 5,600,910 | 64,676,193 | 2.69 | | |
| | | | | 64,676,193 | 2.69 | | |
| オープンエンド型ファンド | | | | | | | |
| Fidelity IIF - The US Dollar Fund - AACC-USD | IE | USD | 5,192 | 94,389,524 | 3.93 | | |
| | | | | 94,389,524 | 3.93 | | |
| エクイティ・リンク債 | | | | | | | |
| BNP (Focus Media Info (A)) ELN 10/07/2023 | CN | USD | 35,755,065 | 31,558,689 | 1.31 | | |
| UBS (Focus Media Info. (A)) ELN 24/02/2023 | CN | USD | 27,751,864 | 24,494,780 | 1.02 | | |
| BNP (Beijing Oriental Yuhong (A)) ELN 25/06/2023 | CN | USD | 1,687,351 | 11,395,407 | 0.48 | | |
| | | | | 67,648,876 | 2.82 | | |
| その他の市場で取引される証券 | | | | | | | |
| エクイティ・リンク債 | | | | | | | |
| JPM (Beijing Oriental Yuhong (A)) ELN 13/07/2022 | CN | USD | 7,042,308 | 48,395,028 | 2.02 | | |
| UBS (Beijing Oriental Yuhong (A)) ELN 16/06/2023 | CN | USD | 4,599,775 | 31,609,842 | 1.32 | | |
| CITI (Kweichow Moutai (A)) ELN 17/02/2023 | CN | USD | 108,877 | 30,199,062 | 1.26 | | |
| HSBC (Skshu Paint (A)) ELN 29/07/2022 | CN | USD | 2,645,412 | 29,740,240 | 1.24 | | |
| CITI (Focus Media Information (A)) ELN 17/02/2023 | CN | USD | 33,636,292 | 29,688,585 | 1.24 | | |
| BNP (Batang Electric Suzhou (A)) ELN 22/07/2024 | CN | USD | 726,885 | 17,010,229 | 0.71 | | |
| CSL (Kweichow Moutai (A)) ELN 14/09/2022 | CN | USD | 53,403 | 14,812,402 | 0.62 | | |
| UBS (China Merchants Energy (A)) ELN 25/01/2023 | CN | USD | 16,314,756 | 12,636,371 | 0.53 | | |
| UBS (Batang Electric Suzhoc (A)) ELN 22/02/2023 | CN | USD | 5,18,958 | 12,144,421 | 0.51 | | |
| UBS (Skshu Paint (A)) ELN 22/02/2024 | CN | USD | 458,347 | 5,152,824 | 0.21 | | |
| BNP (Skshu Paint (A)) ELN 17/10/2024 | CN | USD | 378,478 | 4,234,922 | 0.18 | | |
| MACQ (Batang Electric Suzhoc (A)) ELN 06/02/2023 | CN | USD | 61,245 | 1,433,239 | 0.06 | | |
| | | | | 237,077,165 | 9.88 | | |
| その他 | | | | | | (2) | (0.00) |
| 投資資産合計 (取得価額 USD 2,389,340,747) | | | | | | 2,351,542,649 | 97.97 |

<補足情報>

iシェアーズ・ディバーシファイド・コモディティ・
スワップ UCITS ETFの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|------|--|
| 設定形態 | アイルランド籍証券投資法人／米ドル建て |
| 投資目的 | トータル・リターン・スワップの活用を通じてコモディティ・インデックスのパフォーマンスに追随することを旨とします。 |
| 決算日 | 3月31日 |

■ 損益計算書 2022年3月31日に終了した年度

INCOME STATEMENT

For the financial year ended 31 March 2022

| | iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF 2022 USD'000 |
|--|--|
| Operating income | 1,952 |
| Net gains/(losses) on financial instruments | 849,815 |
| Total investment income/(loss) | 851,767 |
| Operating expenses | (3,934) |
| Negative yield on financial assets | - |
| Net operating income/(expenses) | 847,833 |
| Finance costs: | |
| Interest expense or similar charges | (5,646) |
| Distributions to redeemable shareholders | - |
| Total finance costs | (5,646) |
| Net profit/(loss) before taxation | 842,187 |
| Taxation | - |
| Net profit/(loss) after taxation | 842,187 |
| Increase/(decrease) in net assets attributable to redeemable shareholders | 842,187 |

■ 投資資産明細表 2022年3月31日現在
iSHARES DIVERSIFIED COMMODITY SWAP UCITS ETF
As at 31 March 2022

| 通貨 | 額面価額 | 銘柄名 | 時価 (1,000米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---|-------------|--|------------------|--------------|
| Transferable Securities Admitted to an Official Stock Exchange Listing or traded on a Regulated Market (31 March 2021: 97.06%) | | | | |
| Bonds (31 March 2021: 97.06%) | | | | |
| United States (31 March 2021: 97.06%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| USD | 464,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 21/04/2022 | 463,967 | 16.89 |
| USD | 453,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 19/05/2022 [^] | 452,852 | 16.49 |

| 通貨 | 額面価額 | 銘柄名 | 時価 (1,000米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---|-------------|--|------------------|--------------|
| United States (31 March 2021: 97.06%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| USD | 453,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 16/06/2022 [^] | 452,604 | 16.48 |
| USD | 452,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 14/07/2022 [^] | 451,203 | 16.43 |
| USD | 451,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 11/08/2022 [^] | 449,626 | 16.37 |
| USD | 452,000,000 | United States Treasury Bill 0.000% 01/09/2022 [^] | 450,244 | 16.39 |
| Total United States | | | 2,720,496 | 99.05 |
| Total bonds | | | 2,720,496 | 99.05 |

| Notional Amount | Currency | Counterparty | Description | Maturity date | Fair value USD 000 | % of net asset value |
|--|----------|-------------------------------------|--|---------------|--------------------|----------------------|
| Financial derivative instruments (31 March 2021: 9.14%) | | | | | | |
| Total return swaps (31 March 2021: 9.14%) | | | | | | |
| United States | | | | | | |
| 2,728,177 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/04/2022 | 1,165 | 0.04 |
| 5,521,610 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 22/04/2022 | 2,295 | 0.08 |
| 11,514,162 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 26/04/2022 | 4,509 | 0.16 |
| 1,262,072 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 28/04/2022 | 481 | 0.02 |
| 1,683,101 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/05/2022 | 633 | 0.02 |
| 1,025,235 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 04/05/2022 | 368 | 0.01 |
| 5,809,339 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 05/05/2022 | 2,036 | 0.07 |
| 12,703,008 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/05/2022 | 4,332 | 0.16 |
| 3,143,360 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/05/2022 | 1,033 | 0.04 |
| 4,417,563 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 11/05/2022 | 1,444 | 0.05 |
| 46,751,587 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 17/05/2022 | 15,688 | 0.57 |
| 1,503,726 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 24/05/2022 | 541 | 0.02 |
| 11,211,806 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 31/05/2022 | 3,831 | 0.14 |
| 2,958,921 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/05/2022 | 1,015 | 0.04 |
| 1,151,744 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 01/06/2022 | 372 | 0.01 |
| 1,778,827 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 02/06/2022 | 567 | 0.02 |
| 6,811,111 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/06/2022 | 2,284 | 0.08 |
| 24,063,883 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/06/2022 | 7,764 | 0.28 |
| 3,741,162 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/06/2022 | 1,173 | 0.04 |
| 1,888,210 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 10/06/2022 | 586 | 0.02 |
| 13,110,977 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 13/06/2022 | 4,078 | 0.15 |
| 4,422,619 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 15/06/2022 | 1,466 | 0.05 |
| 57,950,858 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 16/06/2022 | 19,481 | 0.71 |
| 7,863,444 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 20/06/2022 | 2,906 | 0.11 |
| 1,033,399 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 22/06/2022 | 373 | 0.01 |
| 2,096,250 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 28/06/2022 | 708 | 0.03 |

| Notional Amount | Currency | Counterparty | Description | Maturity date | Fair value USD '000 | % of net asset value |
|-----------------|----------|-------------------------------------|--|---------------|---------------------|----------------------|
| 1,781,833 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 01/07/2022 | 562 | 0.02 |
| 9,254,361 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 15/07/2022 | 2,989 | 0.11 |
| 6,190,805 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/07/2022 | 1,854 | 0.07 |
| 3,903,988 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 02/08/2022 | 1,174 | 0.04 |
| 13,458,437 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 05/08/2022 | 4,126 | 0.15 |
| 2,335,735 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/08/2022 | 788 | 0.03 |
| 7,102,567 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 10/08/2022 | 2,269 | 0.08 |
| 27,298,854 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 11/08/2022 | 8,500 | 0.31 |
| 315,830,872 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 18/08/2022 | 104,844 | 3.82 |
| 1,868,897 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 23/08/2022 | 630 | 0.02 |
| 5,622,546 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 24/08/2022 | 1,796 | 0.07 |
| 34,685,451 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 25/08/2022 | 10,895 | 0.40 |
| 6,607,230 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/09/2022 | 1,982 | 0.07 |
| 2,196,456 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 08/09/2022 | 632 | 0.02 |
| 3,853,745 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 15/09/2022 | 965 | 0.04 |
| 4,509,608 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 23/09/2022 | 1,207 | 0.04 |
| 7,082,896 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/09/2022 | 1,661 | 0.06 |
| 6,959,718 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 28/09/2022 | 1,628 | 0.06 |
| 1,455,247 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/10/2022 | 340 | 0.01 |
| 639,854 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 04/10/2022 | 141 | 0.01 |
| 3,809,796 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 05/10/2022 | 757 | 0.03 |
| 1,528,635 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/10/2022 | 345 | 0.01 |
| 2,447,776 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 14/10/2022 | 471 | 0.02 |
| 4,042,399 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/10/2022 | 836 | 0.03 |
| 17,103,532 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 24/10/2022 | 3,423 | 0.12 |
| 2,343,668 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 25/10/2022 | 414 | 0.01 |
| 82,952,741 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 26/10/2022 | 14,788 | 0.54 |
| 15,345,090 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/10/2022 | 2,839 | 0.10 |
| 89,583,981 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 31/10/2022 | 18,339 | 0.67 |
| 3,651,169 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 01/11/2022 | 735 | 0.03 |
| 2,807,702 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/11/2022 | 582 | 0.02 |
| 5,091,514 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 04/11/2022 | 1,089 | 0.04 |
| 4,103,247 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/11/2022 | 870 | 0.03 |
| 4,509,127 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 08/11/2022 | 954 | 0.03 |
| 801,098 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 10/11/2022 | 177 | 0.01 |

| Notional Amount | Currency | Counterparty | Description | Maturity date | Fair value USD '000 | % of net asset value |
|-----------------|----------|-------------------------------------|--|---------------|---------------------|----------------------|
| 6,001,393 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 14/11/2022 | 1,268 | 0.05 |
| 63,808,522 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 18/11/2022 | 13,667 | 0.50 |
| 1,923,437 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/11/2022 | 417 | 0.02 |
| 2,879,128 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 22/11/2022 | 632 | 0.02 |
| 135,799,389 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 23/11/2022 | 27,978 | 1.02 |
| 5,682,947 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 29/11/2022 | 1,485 | 0.05 |
| 52,965,691 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 30/11/2022 | 15,900 | 0.58 |
| 16,435,464 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 02/12/2022 | 5,079 | 0.18 |
| 2,248,545 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/12/2022 | 677 | 0.02 |
| 29,463,457 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/12/2022 | 8,476 | 0.31 |
| 12,369,241 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 08/12/2022 | 3,467 | 0.13 |
| 9,373,177 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/12/2022 | 2,714 | 0.10 |
| 11,789,779 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 13/12/2022 | 3,422 | 0.12 |
| 1,266,238 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 14/12/2022 | 376 | 0.01 |
| 2,075,290 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 16/12/2022 | 588 | 0.02 |
| 5,021,102 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/12/2022 | 1,414 | 0.05 |
| 26,923,707 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 29/12/2022 | 6,535 | 0.24 |
| 2,275,615 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/01/2023 | 581 | 0.02 |
| 10,091,668 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 04/01/2023 | 2,400 | 0.09 |
| 1,801,005 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 05/01/2023 | 416 | 0.02 |
| 3,931,220 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/01/2023 | 925 | 0.03 |
| 7,825,896 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/01/2023 | 1,794 | 0.07 |
| 4,108,615 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 11/01/2023 | 869 | 0.03 |
| 4,868,074 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 12/01/2023 | 936 | 0.03 |
| 6,201,606 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 13/01/2023 | 1,291 | 0.05 |
| 4,937,902 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 17/01/2023 | 999 | 0.04 |
| 29,860,956 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 18/01/2023 | 5,843 | 0.21 |
| 12,594,356 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 19/01/2023 | 2,276 | 0.08 |
| 27,204,696 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 24/01/2023 | 5,170 | 0.19 |
| 829,048 | USD | Morgan Stanley Capital Services Inc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 25/01/2023 | 148 | 0.01 |
| 7,912,139 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 26/01/2023 | 1,326 | 0.05 |
| 29,455,642 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/01/2023 | 5,077 | 0.18 |
| 37,230,300 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 01/02/2023 | 5,458 | 0.20 |
| 1,540,310 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/02/2023 | 213 | 0.01 |
| 82,249,151 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/02/2023 | 11,194 | 0.41 |
| 36,177,819 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/02/2023 | 4,990 | 0.18 |
| 2,693,425 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 08/02/2023 | 385 | 0.01 |
| 891,133 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 10/02/2023 | 122 | 0.00 |
| 4,423,145 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 13/02/2023 | 587 | 0.02 |
| 95,118,851 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 16/02/2023 | 10,903 | 0.40 |

| Notional Amount | Currency | Counterparty | Description | Maturity date | Fair value USD '000 | % of net asset value |
|--|----------|-----------------------------|--|---------------|---------------------|----------------------|
| 13,086,877 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 17/02/2023 | 1,518 | 0.06 |
| 20,846,790 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/02/2023 | 2,398 | 0.09 |
| 2,168,365 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 22/02/2023 | 209 | 0.01 |
| 87,534,546 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 23/02/2023 | 7,751 | 0.28 |
| 15,822,010 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 24/02/2023 | 1,263 | 0.05 |
| 62,753,760 | USD | Goldman Sachs International | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/02/2023 | 6,475 | 0.24 |
| 2,516,945 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 28/02/2023 | 210 | 0.01 |
| 15,054,681 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 01/03/2023 | 479 | 0.02 |
| 39,804,835 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 02/03/2023 | 478 | 0.02 |
| 7,183,619 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 03/03/2023 | 46 | 0.00 |
| 13,655,861 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 09/03/2023 | 205 | 0.01 |
| 91,978,774 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 10/03/2023 | 1,509 | 0.05 |
| 26,302,594 | USD | J.P. Morgan Securities Plc | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 14/03/2023 | 724 | 0.03 |
| 9,945,433 | USD | Macquarie Bank Ltd | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 20/03/2023 | 181 | 0.01 |
| Total unrealised gains on total return swaps | | | | | 458,175 | 16.68 |
| United Kingdom | | | | | | |
| 7,108,919 | USD | Macquarie Bank Ltd | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 28/03/2023 | (101) | 0.00 |
| United States | | | | | | |
| 8,289,660 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 06/03/2023 | (187) | (0.01) |
| 36,451,062 | USD | Societe Generale SA | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 07/03/2023 | (1,780) | (0.07) |
| 85,666,070 | USD | Citibank N.A. | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 08/03/2023 | (3,626) | (0.13) |
| 2,351,677 | USD | Macquarie Bank Ltd | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 21/03/2023 | (15) | 0.00 |
| 1,965,388 | USD | Macquarie Bank Ltd | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 22/03/2023 | (17) | 0.00 |
| 7,271,441 | USD | Macquarie Bank Ltd | Fund receives Bloomberg Commodity Index and pays 3 Months United States Treasury Bills | 27/03/2023 | (306) | (0.01) |
| Total unrealised losses on total return swaps | | | | | (6,032) | (0.22) |
| Net unrealised gains on total return swaps | | | | | 452,143 | 16.46 |
| Total financial derivative instruments | | | | | 452,143 | 16.46 |

| | Fair Value USD'000 | % of net asset value |
|---|-----------------------|----------------------------|
| Total value of investments | 3,172,639 | 115.51 |
| Bank overdraft† | (414,938) | (15.11) |
| Other net liabilities | (10,991) | (0.40) |
| Net asset value attributable to redeemable shareholders at the end of the financial year | 2,746,710 | 100.00 |

†Cash holdings of USD70,342,417 are held with State Street Bank and Trust Company. USD(124,930,000) is due as security for total return swaps to Citibank Plc. USD(109,130,000) is due as security for total return swaps to Goldman Sachs. USD(88,390,000) is due as security for total return swaps to JP Morgan Chase Bank. USD(115,430,000) is due as security for total return swaps to Morgan Stanley. USD(280,000) is due as security for total return swaps to Macquarie Bank Ltd. USD(47,120,000) is due as security for total return swaps to Societe Generale.

[^]These securities are partially or fully transferred as securities lent.

Fixed income securities are primarily classified by country/geographic region of issuer for government type fixed income securities.

Total return swaps are classified by the country/geographic region of incorporation of the underlying security held on the swap.

Underlying exposure has been calculated according to the guidelines issued by ESMA and represents the market value of an equivalent position in the assets underlying each financial derivative instrument.

| Analysis of total current assets gross of all liabilities | Fair value USD'000 | % of total current assets |
|--|-----------------------|---------------------------------|
| Transferable securities admitted to an official stock exchange listing | 2,720,496 | 83.69 |
| Over-the-counter financial derivative instruments | 458,175 | 14.09 |
| Other assets | 72,184 | 2.22 |
| Total current assets | 3,250,855 | 100.00 |

The following table details the value on a gross absolute basis of the underlying exposure obtained through financial derivative instruments as at 31 March 2022.

| Financial derivative instruments | Underlying Exposure USD'000 |
|----------------------------------|-----------------------------------|
| Total Return Swaps | 2,298,915 |

*ブラックロックが開示している資料に基づき作成しています。

<補足情報>

D L I B J 公社債オープン（中期コース）の運用状況

■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／国内／債券 |
| 信託期間 | 1999年12月14日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主として国内の公社債への投資を行うことにより、信託財産の成長をはかることを目的として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 国内外の国債、地方債、政府保証債、国内外企業の発行による普通社債、ユーロ円債、転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債、資産担保証券を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | 金利リスクおよび信用リスクを超過収益の源泉とし、両リスクの取り方を景気サイクルや市況動向に応じて変化させます。「NOMURA-BPI総合」を運用にあたってのベンチマークとし、これを上回る成果の実現をめざします。ポートフォリオのデュレーションは、原則として1年～ベンチマークのデュレーション+3年程度の範囲で調整します。ただし、基準価額の防衛等リスク管理の観点から、デュレーションがマイナスとなるような調整を行う場合があります。なお、デュレーションの水準によっては、信託財産の純資産総額に対する実質組入比率がマイナスになる場合があります。一般事業債等の組入れ時において、格付け機関 ^(*) による発行体格付け（長期優先債務格付け）がBBB-以上の債券を投資対象とします。 (*）格付投資情報センター（R&I）または日本格付研究所（JCR）による格付けを基準とします。 格付けがBBBの債券組入上限は、原則としてポートフォリオの50%程度とします。 外貨建資産への投資を行った場合は為替フルヘッジとし、原則として為替リスクはとりません。 |
| 組入制限 | 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 |
| 分配方針 | 決算日（原則として3月21日および9月21日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配する方針です。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わない場合があります。 |

■ 損益の状況

当期 自2022年9月22日 至2023年3月22日

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 103,140,119円 |
| 受 取 利 息 | 103,188,430 |
| そ の 他 収 益 | 157,069 |
| 支 払 利 息 | △205,380 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △136,230,915 |
| 売 買 益 | 206,464,215 |
| 売 買 損 | △342,695,130 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △131,007,597 |
| 取 引 益 | 23,194,926 |
| 取 引 損 | △154,202,523 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △99,156,741 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | △263,255,134 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | △1,665,212,638 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 891,581,276 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,656,103,885) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△764,522,609) |
| (H) 合 計 (E + F + G) | △1,036,886,496 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | △1,036,886,496 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 891,581,276 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,656,103,885) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△764,522,609) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 15,986,866 |
| 繰 越 損 益 金 | △1,944,454,638 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (G)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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 3,983,378円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 1,656,103,885 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 12,003,488 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 1,672,090,751 |
| (f) 1 万口当たり当期分配対象額 | 410.32 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

組入上位10銘柄

(2023年 3月22日現在)

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|----------------------|-------|------|
| 359回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 4.1% |
| 154回 利付国庫債券 (20年) | 日本・円 | 3.2 |
| 183回 利付国庫債券 (20年) | 日本・円 | 3.1 |
| 152回 利付国庫債券 (5年) | 日本・円 | 3.0 |
| 354回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 3.0 |
| 155回 利付国庫債券 (5年) | 日本・円 | 2.8 |
| 362回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 2.5 |
| 170回 利付国庫債券 (20年) | 日本・円 | 2.3 |
| 350回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 2.1 |
| 1回 武田薬品工業期限前償還条項付劣後債 | 日本・円 | 2.0 |
| 組入銘柄数 | 140銘柄 | |

*アセットマネジメントOne株式会社が開示している資料に基づき作成しています。

<補足情報>

フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ファンド (適格機関投資家転売制限付き)の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|---|
| 設 定 形 態 | 国内証券投資信託 |
| 運 用 方 針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の取引所に上場されている株式に投資を行うことにより、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。 |
| 主 な 投 資 対 象 | フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none">●株式への実質投資割合には制限を設けません。●転換社債、ならびに新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。●新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。●外貨建資産への実質的な投資は原則として行ないません。●同一発行体への実質的な投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。●同一発行体の発行する有価証券への実質的な投資は、取得時において当該発行体の発行するすべての種類の有価証券の発行総額の10%以内とします。●マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。 |
| 決 算 日 | 3月25日 |
| 分 配 方 針 | <ul style="list-style-type: none">●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

■損益の状況

当期 自2022年3月26日 至2023年3月27日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|-----------------|
| (A) 有価証券売買損益 | 75,506,673 |
| 売 買 益 | 77,493,576 |
| 売 買 損 | △1,986,903 |
| (B) 信託報酬等 | △17,942,084 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 57,564,589 |
| (D) 前期繰越損益金 | 796,586,820 |
| (E) 追加信託差損益金 | 1,532,438,911 |
| (配当等相当額) | (1,159,856,205) |
| (売買損益相当額) | (372,582,706) |
| (F) 合計(C+D+E) | 2,386,590,320 |
| 次期繰越損益金(F) | 2,386,590,320 |
| 追加信託差損益金 | 1,532,438,911 |
| (配当等相当額) | (1,159,856,205) |
| (売買損益相当額) | (372,582,706) |
| 分配準備積立金 | 854,151,409 |

(注1) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (E)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4) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 6,904,695円 |
| (c) 収益調整金 | 1,532,438,911円 |
| (d) 分配準備積立金 | 847,246,714円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 2,386,590,320円 |
| 1万口当たり分配可能額 | 8,301.42円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1万口当たり分配金額(税引前) | 0円 |

■組入資産の明細 (2023年3月27日現在)

●親投資信託残高

| 種 類 | 期首 (前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・マザーファンド | 千口 1,140,150 | 千口 1,640,341 | 千円 5,261,395 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

<フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・ファンド(適格機関投資家転売制限付き)の主たる投資対象であるフィデリティ・ジャパン・サステナブル・グロース・マザーファンドの情報を掲載いたします。

■組入資産の明細 (2023年3月27日現在)

●国内株式

上場株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.5%) | | | |
| サカタのタネ | 8.8 | 14.4 | 55,512 |
| 建設業 (1.0%) | | | |
| ウエストホールディングス | 1.7 | — | — |
| ライト工業 | 13.2 | 22.7 | 44,514 |
| 住友電設 | 12 | 26.7 | 66,216 |
| 食料品 (3.9%) | | | |
| ヤクルト本社 | 6.2 | 14.6 | 138,262 |
| アサヒグループホールディングス | 19.1 | 36.9 | 177,489 |
| 味の素 | — | 17.5 | 77,787 |
| アリアケジャパン | 4.8 | 3.9 | 18,603 |
| 化学 (9.6%) | | | |
| 日産化学 | 10.1 | 20.2 | 120,392 |
| 信越化学工業 | 10.2 | 13.3 | 278,768 |
| 住友ベークライト | 9.3 | 13.9 | 68,110 |
| アイカ工業 | 1.2 | — | — |
| 日油 | 36.9 | 57.3 | 342,081 |
| 花王 | 4.1 | — | — |
| 関西ペイント | 13.4 | 18.8 | 33,388 |
| ニフコ | 29.6 | 47.7 | 172,674 |
| 医薬品 (5.3%) | | | |
| アステラス製薬 | 75.4 | 124.2 | 231,819 |
| 日本新薬 | 5.5 | 16.4 | 96,760 |
| エーザイ | 6.4 | 10.8 | 78,872 |
| ロート製薬 | — | 44.6 | 118,145 |
| 大塚ホールディングス | 6.3 | 9.7 | 38,974 |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | |
| フジミインコーポレーテッド | 7.7 | 12.3 | 85,116 |
| 金属製品 (1.5%) | | | |
| リンナイ | 10.2 | 16.3 | 155,176 |
| 機械 (5.9%) | | | |
| 三浦工業 | 9.4 | 23 | 76,130 |
| SMC | 1.5 | 3.3 | 226,083 |
| ダイキン工業 | 3 | 2.4 | 55,320 |
| ダイフク | — | 7.4 | 53,354 |
| アマノ | — | 38.3 | 96,094 |
| ホシザキ | 4 | 13.7 | 65,143 |
| マキタ | 27.7 | 17.1 | 55,917 |
| 電気機器 (20.1%) | | | |
| 日立製作所 | 28.9 | 46.7 | 326,433 |
| 日本電産 | 5 | — | — |
| エレコム | 4 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ソニーグループ | 22.9 | 29.6 | 338,920 |
| TDK | — | 7.5 | 34,987 |
| 横河電機 | 49.4 | 38.1 | 78,905 |
| アズビル | 6.2 | — | — |
| キーエンス | 4.2 | 8.7 | 539,661 |
| イリソ電子工業 | 3.3 | 6.1 | 29,707 |
| オブテックスグループ | 3.6 | — | — |
| 浜松ホトニクス | 5.7 | 9.6 | 66,624 |
| 村田製作所 | 12.3 | 25.6 | 199,449 |
| 小糸製作所 | 23.8 | 63.3 | 148,501 |
| 東京エレクトロン | 0.3 | 7.6 | 370,500 |
| 輸送用機器 (4.0%) | | | |
| デンソー | 17.1 | 33 | 235,884 |
| スズキ | 14.8 | 40.1 | 190,234 |
| シマノ | 2.2 | — | — |
| 精密機器 (7.5%) | | | |
| テルモ | — | 24 | 83,376 |
| 島津製作所 | 30.8 | 54.3 | 218,557 |
| オリンパス | 105.5 | 164.8 | 371,624 |
| HOYA | — | 8.4 | 117,012 |
| その他製品 (1.8%) | | | |
| ヤマハ | 14.9 | 39 | 193,440 |
| 陸運業 (0.8%) | | | |
| 山九 | 10.7 | 16.4 | 79,868 |
| 日立物流 | 5.8 | — | — |
| 情報・通信業 (12.1%) | | | |
| コムチュア | 5.1 | — | — |
| プラスアルファ・コンサルティング | — | 30 | 90,750 |
| 野村総合研究所 | 34.9 | 54.4 | 163,744 |
| シンプレクス・ホールディングス | 14.3 | 33.5 | 77,787 |
| ウイングアーク1st | 23.8 | 10.3 | 19,982 |
| Sansan | 1.9 | — | — |
| JMDC | 2.6 | 5.1 | 23,613 |
| オービック | 6 | 11.7 | 243,711 |
| ジャストシステム | 9 | 7.3 | 25,659 |
| Zホールディングス | 93 | — | — |
| フューチャー | — | 39.9 | 71,820 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 6.4 | 27.9 | 90,535 |
| 大塚商会 | 24.1 | 25.2 | 114,786 |
| デジタルガレージ | 10 | 16.1 | 68,103 |
| アルゴグラフィックス | 25.5 | 42 | 150,780 |
| 兼松エレクトロニクス | 18 | — | — |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | | |
|---------------------------------|------------|---------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| カブコン | 11.1 | 29.9 | 140,081 | |
| 卸売業 (9.2%) | | | | |
| あいホールディングス | 18 | 25.9 | 57,161 | |
| 伊藤忠商事 | 78.5 | 109.9 | 460,041 | |
| 三井物産 | — | 36 | 136,116 | |
| 山善 | 16.4 | 26.2 | 26,409 | |
| 中央自動車工業 | 11.1 | 14.2 | 37,587 | |
| ミスミグループ本社 | 50.3 | 81.2 | 261,870 | |
| 小売業 (7.2%) | | | | |
| エービーシー・マート | 9.3 | 10.9 | 77,390 | |
| セリア | 9.5 | 10.9 | 28,906 | |
| ジンズホールディングス | 4.7 | — | — | |
| 良品計画 | 56.7 | 51.8 | 73,556 | |
| バン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス | 18 | 54.3 | 134,609 | |
| 日本瓦斯 | — | 11 | 21,098 | |
| ニトリホールディングス | 5.5 | 13.8 | 225,423 | |
| ファーストリテイリング | 0.9 | 7.4 | 204,573 | |
| 保険業 (4.3%) | | | | |
| 東京海上ホールディングス | 43.6 | 179.1 | 452,675 | |
| その他金融業 (1.0%) | | | | |
| 全国保証 | 3.8 | — | — | |
| オリックス | 52.2 | 50.2 | 107,327 | |
| 不動産業 (0.7%) | | | | |
| オープンハウスグループ | 8.9 | 13.6 | 66,368 | |
| アズーム | — | 2 | 11,840 | |
| サービス業 (2.7%) | | | | |
| バーソルホールディングス | 6.2 | 15.6 | 40,622 | |
| ディップ | 9.6 | 15.7 | 53,694 | |
| プレステージ・インターナショナル | 42.3 | 93.7 | 54,720 | |
| エイジス | 0.3 | — | — | |
| エン・ジャパン | 12.6 | — | — | |
| テクノプロ・ホールディングス | 11.2 | 17.2 | 61,490 | |
| リクルートホールディングス | 35.2 | 12.6 | 46,620 | |
| E n j i n | — | 14.5 | 17,487 | |
| セコム | 6.7 | — | — | |
| イオンディライト | 14 | 4.7 | 13,926 | |
| 合計 | 千株 | 千株 | 千円 | |
| | 株 数 ・ 金 額 | 1,520.3 | 2,475.9 | 10,603,254 |
| | 銘 柄 数<比 率> | 87銘柄 | 82銘柄 | <98.7%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式ファンド (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) の運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|---|
| 設 定 形 態 | 国内証券投資信託 |
| 運 用 方 針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国を中心に世界（日本を含みます。）の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている企業の株式に投資を行い、投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 |
| 主 な 投 資 対 象 | フィデリティ・米国株式マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> ●株式への実質投資割合には制限を設けません。 ●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ●投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 |
| 決 算 日 | 2月20日および8月20日 |
| 分 配 方 針 | <ul style="list-style-type: none"> ●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 |

■ 損益の状況

当期 自2022年8月23日 至2023年2月20日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|---------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △161,057,874 |
| 売 買 益 | 1,375,117 |
| 売 買 損 | △162,432,991 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △12,329,694 |
| (C) 当 期 損 益 金 (A + B) | △173,387,568 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 372,240,517 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 458,319,912 |
| (配 当 等 相 当 額) | (204,750,247) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (253,569,665) |
| (F) 合 計 (C + D + E) | 657,172,861 |
| (G) 収 益 分 配 金 | △22,405,980 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F + G) | 634,766,881 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 458,319,912 |
| (配 当 等 相 当 額) | (204,793,512) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (253,526,400) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 360,261,455 |
| 繰 越 損 益 金 | △183,814,486 |

円

- (注1) (A) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (E) 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4) 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する費用として、純資産総額に対して年0.36%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。
(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|--------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 10,426,918円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 274,505,426円 |
| (d) 分配準備積立金 | 372,240,517円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 657,172,861円 |
| 1万口当たり分配可能額 | 2,287.76円 |
| (f) 分配金額 | 22,405,980円 |
| 1万口当たり分配金額(税引前) | 78円 |

■ 組入資産の明細 (2023年2月20日現在)

● 親投資信託残高

| 項 目 | 当 期 末 | | |
|--------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| | 期 首 (前期末) | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・米国株式マザーファンド | 千口 1,839,712 | 口 1,846,736 | 千円 3,507,322 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

<フィデリティ・米国株式マザーファンド>

ご参考として、フィデリティ・インスティテューショナル・米国株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）の主たる投資対象であるフィデリティ・米国株式マザーファンドの情報を掲載いたします。

■損益の状況

当期 自2021年5月21日 至2022年5月20日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,379,128,363 |
| 受 取 配 当 金 | 1,360,339,796 |
| 受 取 利 息 | 1,346,849 |
| そ の 他 収 益 金 | 17,441,718 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 2,086,671,842 |
| 売 買 益 | 39,297,210,102 |
| 売 買 損 | △37,210,538,260 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △48,944,518 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 3,416,855,687 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 58,805,711,820 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △14,399,439,031 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 30,383,262,513 |
| (H) 合 計 (D + E + F + G) | 78,206,390,989 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 78,206,390,989 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)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。

(注4) (G)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。

■組入資産の明細（2022年5月20日現在）

(1) 国内株式

上場株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ガラス・土石製品 (16.4%) | | | |
| TOTO | 23.8 | 23.8 | 100,555 |
| 電気機器 (－) | | | |
| ソニーグループ | 9.9 | － | － |
| 輸送用機器 (83.6%) | | | |
| トヨタ自動車 | 46.4 | 249.731 | 511,449 |
| その他製品 (－) | | | |
| 任天堂 | 1.3 | － | － |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小売業 (－) | | | |
| ZOZO | 8.1 | － | － |
| 合計 | | | |
| 株 数 ・ 金 額 | 千株 | 千株 | 千円 |
| | 89.5 | 273.531 | 612,004 |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 5銘柄 | 2銘柄 | <0.3%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国株式

上場、登録株式

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ・・・NASDAQ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| ADOBE INC | 490 | 132.22 | 5,214 | 666,672 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 1,280 | 2,289.04 | 22,128 | 2,829,083 | 半導体・半導体製造装置 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 386 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| ANALOG DEVICES INC | 202 | 321.15 | 5,168 | 660,803 | 半導体・半導体製造装置 |
| APPLE INC | 2,785 | 3,909.63 | 53,698 | 6,865,387 | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 188 | 410.06 | 4,541 | 580,567 | 半導体・半導体製造装置 |
| BED BATH & BEYOND INC | 49 | — | — | — | 小売 |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 435 | 465.56 | 6,696 | 856,102 | ソフトウェア・サービス |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | — | 58.95 | 710 | 90,900 | ソフトウェア・サービス |
| CINTAS CORP | 103 | 42.99 | 1,542 | 197,206 | 商業・専門サービス |
| EXPEDITORS INTL OF WASH INC | 11 | — | — | — | 運輸 |
| HOLOGIC INC | 114.06 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SERVICES INC | 30.91 | 107.38 | 1,724 | 220,507 | 運輸 |
| INTEL CORP | 130 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| INTUIT INC | 90 | 47.79 | 1,731 | 221,381 | ソフトウェア・サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 133 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | 1,348 | 1,198.81 | 5,911 | 755,763 | 半導体・半導体製造装置 |
| MATTEL INC | 131 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| MICROSOFT CORP | 2,386 | 2,652.02 | 67,133 | 8,582,984 | ソフトウェア・サービス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | — | 21.79 | 151 | 19,333 | 半導体・半導体製造装置 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINES INC | — | 137.23 | 3,272 | 418,392 | 運輸 |
| PACCAR INC | 191.29 | 53.79 | 437 | 55,992 | 資本財 |
| PENN NATIONAL GAMING | 65 | — | — | — | 消費者サービス |
| PEPSICO INC | — | 479.86 | 7,735 | 988,963 | 食品・飲料・タバコ |
| QUALCOMM INC | 1,476 | 1,894.02 | 24,730 | 3,161,758 | 半導体・半導体製造装置 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC | 315 | 437.65 | 28,760 | 3,676,987 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| STARBUCKS CORP | 63 | — | — | — | 消費者サービス |
| STEEL DYNAMICS INC | 322 | 475.74 | 3,603 | 460,736 | 素材 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 57 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 256 | 1,059.6 | 27,067 | 3,460,577 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A | 17 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| ASML HLDG NV (NY REG SHS) NEW | 16.5 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| SILGAN HOLDINGS INC | 219.44 | — | — | — | 素材 |
| AMAZON COM INC | 257.23 | 222.98 | 47,859 | 6,118,898 | 小売 |
| SEMTECH CORP | 301.72 | 121.5 | 725 | 92,798 | 半導体・半導体製造装置 |
| EBAY INC | 963 | — | — | — | 小売 |
| NVIDIA CORP | 832 | 3,075 | 52,656 | 6,732,107 | 半導体・半導体製造装置 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC A | — | 58.9 | 924 | 118,181 | 消費者サービス |
| PATTERSON COMPANIES INC | 448.01 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 292 | 401.77 | 16,992 | 2,172,434 | 食品・生活必需品小売り |
| SYNAPTICS INC | 259 | 513.41 | 7,166 | 916,195 | 半導体・半導体製造装置 |
| NETFLIX INC | 870 | 627.34 | 11,510 | 1,471,609 | メディア・娯楽 |
| COMCAST CORP CL-A | 821 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| GARMIN LTD | 114.29 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | — | 314.5 | 2,211 | 282,748 | ソフトウェア・サービス |
| HENRY SCHEIN INC | 104 | 57.75 | 478 | 61,185 | ヘルスケア機器・サービス |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | — | 816.49 | 4,578 | 585,304 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 60 | 223.54 | 4,876 | 623,435 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 4 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DEXCOM INC | 45 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| CME GROUP INC CL A | — | 15.39 | 292 | 37,414 | 各種金融 |
| DOLLAR TREE INC | — | 272.02 | 3,687 | 471,482 | 小売 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 234 | 43.2 | 148 | 18,960 | 食品・飲料・タバコ |
| DISCOVERY INC A | 110.1 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| FORTINET INC | 21 | 110.64 | 3,044 | 389,222 | ソフトウェア・サービス |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 32 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| JAZZ PHARMA PLC | 122 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TESLA INC | 0.8 | 69.99 | 4,965 | 634,804 | 自動車・自動車部品 |
| ACCELERON PHARMA INC | 34 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CDW CORPORATION | 44 | 202.13 | 3,273 | 418,516 | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | 444 | 482.27 | 4,308 | 550,854 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | — | 161.86 | 2,101 | 268,646 | エネルギー |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 25 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| QORVO INC | 253 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| MONSTER BEVERAGE CORP NEW | 129 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| PAYPAL HLDGS INC | 512 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC CL C | 75.5 | 187.29 | 41,483 | 5,303,607 | メディア・娯楽 |
| ALPHABET INC CL A | 127.2 | 133.19 | 29,404 | 3,759,312 | メディア・娯楽 |
| ATLASSIAN CORP PLC CLS A | 691 | 400.31 | 6,995 | 894,364 | ソフトウェア・サービス |
| LIBERTY FORMULA ONE-C | 54 | 365.9 | 2,241 | 286,622 | メディア・娯楽 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC A | 44.5 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| ULTA BEAUTY INC | — | 21.06 | 739 | 94,590 | 小売 |
| OKTA INC CL A | 720 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ARGENX SE SPONSORED ADR | — | 5.21 | 166 | 21,313 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZAI LAB LTD UNSPNRD ADR | 41.24 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WIX.COM LTD | 4 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ROKU INC CLASS A | 5 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| MONGODB INC CL A | 158.67 | 138.11 | 3,388 | 433,188 | ソフトウェア・サービス |
| NATIONAL VISION HOLDINGS INC | 56 | 207.38 | 559 | 71,560 | 小売 |
| ZSCALER INC | 7 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| DROPBOX INC CL A | 294 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| BROADCOM INC | — | 155.42 | 8,489 | 1,085,343 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTELLIA THERAPEUTICS INC | — | 33.31 | 158 | 20,318 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GUARDANT HEALTH INC | 50 | 6.91 | 24 | 3,069 | ヘルスケア機器・サービス |
| GALAPAGOS GENOMICS NV | — | 165.47 | 942 | 120,479 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC | 203 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| DATADOG INC CL A | — | 464.64 | 4,484 | 573,399 | ソフトウェア・サービス |
| BIONTECH SE ADR | — | 10.74 | 180 | 23,050 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KODIAK SCIENCES INC | 7 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 94 | 104.69 | 419 | 53,672 | メディア・娯楽 |
| ROYALTY PHARMA PLC | 424 | 593.46 | 2,360 | 301,826 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 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 |
| MATCH GROUP INC | 百株 59.47 | 百株 — | — | — | メディア・娯楽 |
| DUCK CREEK TECHNOLOGIES INC | 361 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ACADEMY SPORTS & OUTDOORS INC | 330 | 402.75 | 1,270 | 162,455 | 小売 |
| TECHTARGET INC | 19 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| MARAVAI LIFESCIENCES HLDGS INC | 275 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIRBNB INC CLASS A | — | 315.43 | 3,601 | 460,421 | 消費者サービス |
| CULLINAN ONCOLOGY INC | 25 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| QUALTRICS INTERNATIONAL INC | 63 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| BUMBLE INC | 136 | 344.02 | 974 | 124,559 | メディア・娯楽 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 88 | 1,782.24 | 9,673 | 1,236,820 | 半導体・半導体製造装置 |
| DUOLINGO INC | — | 3 | 23 | 3,065 | 消費者サービス |
| KNOWBE4 INC | — | 270.86 | 408 | 52,221 | ソフトウェア・サービス |
| OLAPLEX HOLDINGS INC | — | 141.12 | 200 | 25,619 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| VITA COCO CO INC/THE | — | 53 | 53 | 6,823 | 食品・飲料・タバコ |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | — | 115.53 | 661 | 84,531 | 公益事業 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 777 | 58.38 | 453 | 58,024 | メディア・娯楽 |
| OPTION CARE HEALTH INC | — | 349 | 1,008 | 128,906 | ヘルスケア機器・サービス |
| ENPHASE ENERGY INC | — | 9.54 | 157 | 20,190 | 半導体・半導体製造装置 |
| META PLATFORMS INC CL A | 2,619 | 3,840.54 | 73,465 | 9,392,588 | メディア・娯楽 |
| FRESHPET INC | 6 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| INTRA-CELLULAR THERAPIES INC | — | 63.96 | 369 | 47,207 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MONOLITHIC POWER SYS INC | — | 8.54 | 355 | 45,495 | 半導体・半導体製造装置 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 14 | 53.78 | 3,253 | 413,598 | 小売 |
| SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC | 122.12 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SURGERY PARTNERS INC | 99 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| DOMO INC CL B | — | 95 | 288 | 36,910 | ソフトウェア・サービス |
| WARNER MUSIC GRP CORP CL A | — | 1,157.69 | 3,481 | 445,068 | メディア・娯楽 |
| COINBASE GLOBAL INC | — | 23.08 | 155 | 19,894 | 各種金融 |
| ALIGNMENT HEALTHCARE INC (アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所) | 39 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| AES CORP | 239.74 | — | — | — | 公益事業 |
| ABBOTT LABORATORIES | 492 | 455.68 | 5,123 | 655,060 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHUBB LTD | 230 | 282.01 | 5,749 | 735,088 | 保険 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 72 | 369.56 | 5,691 | 727,622 | 各種金融 |
| AUTOZONE INC | 1 | 32.79 | 6,195 | 792,070 | 小売 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL A | 1.73 | 2.16 | 98,502 | 12,593,569 | 各種金融 |
| BEST BUY CO INC | 140 | — | — | — | 小売 |
| BIO RAD LABORATORIES CL A | 61 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLOCK H & R INC | 190.38 | — | — | — | 消費者サービス |
| BOSTON BEER COMPANY CL A | 1 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 384.25 | 878.99 | 6,676 | 853,629 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CSX CORP | — | 45.58 | 141 | 18,029 | 運輸 |
| CVS HEALTH CORP | 50 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 271 | 109.52 | 1,241 | 158,686 | 各種金融 |
| CARLISLE COS INC | — | 5.96 | 147 | 18,918 | 資本財 |
| COCA COLA CO | 308.09 | 923.04 | 5,538 | 708,063 | 食品・飲料・タバコ |
| DANAHER CORP | 470 | 250.11 | 6,235 | 797,207 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 87.66 | 28.3 | 641 | 82,056 | 耐久消費財・アパレル |
| DEERE & CO | 93 | 123.6 | 4,506 | 576,182 | 資本財 |
| DISNEY (WALT) CO | 704.07 | 231.13 | 2,383 | 304,778 | メディア・娯楽 |
| EOG RESOURCES INC | — | 348.94 | 4,246 | 542,927 | エネルギー |
| EQUIFAX INC | 27 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| FMC CORP NEW | 13 | — | — | — | 素材 |
| M&T BANK CORP | 66 | — | — | — | 銀行 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 7,061.38 | 1,105.52 | 8,373 | 1,070,514 | 資本財 |
| GSK PLC SPONS ADR | — | 35.33 | 153 | 19,675 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HALLIBURTON CO | — | 309.78 | 1,117 | 142,816 | エネルギー |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 117 | 63.6 | 206 | 26,369 | 自動車・自動車部品 |
| HOME DEPOT INC | 508 | 311.15 | 8,953 | 1,144,724 | 小売 |
| HUMANA INC | 14 | 3.48 | 150 | 19,220 | ヘルスケア機器・サービス |
| HARTFORD FINL SVCS GROUP INC | 159 | 202.96 | 1,368 | 174,996 | 保険 |
| IDEX CORPORATION | 9 | — | — | — | 資本財 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 12 | — | — | — | 資本財 |
| JOHNSON & JOHNSON | — | 196.62 | 3,420 | 437,248 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KOHL'S CORP | — | 95 | 427 | 54,704 | 小売 |
| KROGER CO | — | 84.14 | 403 | 51,635 | 食品・生活必需品小売り |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 442 | 275.94 | 6,495 | 830,395 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LENNAR CORP-CL A | 245 | 522.34 | 3,795 | 485,298 | 耐久消費財・アパレル |
| LILLY (ELI) & CO | 1,032 | 1,094.9 | 31,343 | 4,007,292 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | — | 95.06 | 4,045 | 517,273 | 資本財 |
| LOWES COS INC | 44 | — | — | — | 小売 |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | — | 67.35 | 1,022 | 130,770 | 保険 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 63 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| NEWMONT CORP | 81 | 452.7 | 2,992 | 382,629 | 素材 |
| NIKE INC CL B | 643 | 333.08 | 3,545 | 453,267 | 耐久消費財・アパレル |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 24 | 117.11 | 5,252 | 671,517 | 資本財 |
| NUCOR CORP | 334.19 | 532.35 | 6,425 | 821,563 | 素材 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | — | 501.99 | 3,210 | 410,491 | エネルギー |
| OWENS AND MINOR INC | 77 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| PG&E CORP | 1,901 | 1,269.99 | 1,541 | 197,115 | 公益事業 |
| PPG INDUSTRIES INC | 160 | — | — | — | 素材 |
| PFIZER INC | — | 1,025.24 | 5,192 | 663,904 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PROCTER & GAMBLE CO | — | 77.71 | 1,101 | 140,782 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PROGRESSIVE CORP OHIO | 340 | 1,136.22 | 12,546 | 1,604,024 | 保険 |
| TRAVELERS COMPANIES INC | 271 | 848.44 | 14,364 | 1,836,448 | 保険 |
| SCHLUMBERGER LTD | — | 71.59 | 292 | 37,389 | エネルギー |
| SCHWAB CHARLES CORP | 290 | 515.75 | 3,231 | 413,171 | 各種金融 |
| SHERWIN WILLIAMS CO | 464 | 164.59 | 4,268 | 545,787 | 素材 |
| SOUTHERN CO | — | 107 | 784 | 100,315 | 公益事業 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 43 | — | — | — | 運輸 |
| STRYKER CORP | 19 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| TJX COMPANIES INC | 652 | 281.07 | 1,726 | 220,675 | 小売 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 172 | 60.4 | 3,326 | 425,289 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNION PACIFIC CORP | 238 | 151.52 | 3,280 | 419,400 | 運輸 |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WALMART INC | — | 10.09 | 120 | 15,360 | 食品・生活必需品小売り |
| WATERS CORP | 9 | 231.26 | 7,488 | 957,454 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WHIRLPOOL CORP | 30 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| WILLIAMS-SONOMA INC | 80.32 | 180.88 | 2,032 | 259,791 | 小売 |
| MORGAN STANLEY | 2,454 | 2,123.36 | 16,978 | 2,170,686 | 各種金融 |
| VALERO ENERGY CORP | — | 155.45 | 1,931 | 246,957 | エネルギー |
| METTLER-TOLEDO INTL INC | 10.9 | 5.5 | 670 | 85,766 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FREEMPORT MCMORAN INC | 778 | 1,894.2 | 6,955 | 889,260 | 素材 |
| FEDEX CORP | 9 | — | — | — | 運輸 |
| BANK OF AMERICA CORPORATION | 5,855 | 5,666.52 | 19,521 | 2,495,780 | 銀行 |
| WELLS FARGO COMPANY | 477 | 829.39 | 3,483 | 445,357 | 銀行 |
| MCKESSON CORP | 22 | 0.44 | 14 | 1,795 | ヘルスケア機器・サービス |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | — | 185.59 | 4,925 | 629,780 | エネルギー |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC. | 303 | 175.03 | 5,394 | 689,677 | 各種金融 |
| UNITED PARCEL SERVICE INC CL B | 946 | 1,068.24 | 17,881 | 2,286,120 | 運輸 |
| ARTHUR J GALLAGHER AND CO | 83 | 92.23 | 1,431 | 183,064 | 保険 |
| EXXON MOBIL CORP | — | 465.67 | 4,244 | 542,610 | エネルギー |
| HONEYWELL INTL INC | 160 | — | — | — | 資本財 |
| DR HORTON INC | 288 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 224.32 | 583.27 | 5,504 | 703,727 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 1,239 | 1,521.17 | 72,795 | 9,306,916 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEVON ENERGY CORP | — | 528.27 | 3,672 | 469,465 | エネルギー |
| NRG ENERGY INC | — | 35.57 | 164 | 21,014 | 公益事業 |
| PETROLEO BRASILEIRO SPONS ADR | — | 4,412.54 | 6,649 | 850,163 | エネルギー |
| MOODYS CORP | 1 | — | — | — | 各種金融 |
| TAPESTRY INC | 92 | 55.17 | 170 | 21,844 | 耐久消費財・アパレル |
| ASTRAZENECA PLC SPONS ADR | — | 80.11 | 517 | 66,102 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHARLES RIVER LABS INTL INC | 4 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP | — | 85 | 402 | 51,456 | 公益事業 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,350 | 973.8 | 11,521 | 1,472,963 | 銀行 |
| LABORATORY CORP OF AMER HLDGS | 34 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| AMPHENOL CORPORATION CLASS A | 1,804 | 2,486.34 | 16,805 | 2,148,541 | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| HDFC BANK LTD SPON ADR | 40 | — | — | — | 銀行 |
| AMETEK INC NEW | 37.33 | — | — | — | 資本財 |
| BUNGE LIMITED | 19 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 63 | 90.19 | 1,347 | 172,246 | ヘルスケア機器・サービス |
| CHEVRON CORP | — | 252.06 | 4,205 | 537,720 | エネルギー |
| CENTENE CORP | — | 64.47 | 532 | 68,115 | ヘルスケア機器・サービス |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 118 | — | — | — | 資本財 |
| CONSTELLATION BRANDS INC CLASS A | 97 | 12.26 | 287 | 36,808 | 食品・飲料・タバコ |
| CONOCOPHILLIPS | — | 611.89 | 6,400 | 818,365 | エネルギー |
| DICKS SPORTING GOODS INC | 78 | 382.62 | 3,032 | 387,723 | 小売 |
| ACUITY BRANDS INC | 65 | — | — | — | 資本財 |
| SALESFORCE INC | 1,501.48 | 656.57 | 10,216 | 1,306,144 | ソフトウェア・サービス |
| TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC | 19 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | — | 190.09 | 1,907 | 243,880 | 素材 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 20.5 | 4.5 | 572 | 73,209 | 消費者サービス |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| HEICO CORP CL A | 41.75 | — | — | — | 資本財 |
| DIAGEO PLC SPON ADR | — | 171 | 3,071 | 392,691 | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORP | 184.06 | 197.84 | 2,244 | 286,908 | エネルギー |
| MASTERCARD INC CL A | 11 | 4.08 | 135 | 17,329 | ソフトウェア・サービス |
| CONTINENTAL RES OKLA | — | 131.82 | 777 | 99,383 | エネルギー |
| ARCELORMITTAL CL A (NY REG) | 204 | 52.23 | 149 | 19,124 | 素材 |
| MSCI INC | 46 | 12.49 | 512 | 65,473 | 各種金融 |
| VISA INC CL A | 519 | 7 | 138 | 17,663 | ソフトウェア・サービス |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | — | 689.87 | 1,489 | 190,423 | 素材 |
| ACCENTURE PLC CL A | 524 | 611.1 | 16,720 | 2,137,691 | ソフトウェア・サービス |
| MERCK & CO INC NEW | — | 269.22 | 2,479 | 316,971 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO | 538 | 631.16 | 2,279 | 291,466 | 自動車・自動車部品 |
| HCA HLDGS INC | 86 | 349.79 | 7,105 | 908,410 | ヘルスケア機器・サービス |
| CITIGROUP INC | 157 | — | — | — | 銀行 |
| NEXTERA ENERGY INC | — | 410.5 | 2,892 | 369,791 | 公益事業 |
| CHENIERE ENERGY INC | — | 171.51 | 2,237 | 286,001 | エネルギー |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 477 | 1,172.74 | 6,790 | 868,122 | 保険 |
| SERVICENOW INC | 86 | 25.96 | 1,107 | 141,641 | ソフトウェア・サービス |
| PALO ALTO NETWORKS INC | — | 64.75 | 2,825 | 361,239 | ソフトウェア・サービス |
| ABBVIE INC | 563 | 350.01 | 5,310 | 678,928 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZOETIS INC CL A | 221 | 351.3 | 5,572 | 712,466 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FORTUNE BRANDS HOME & SEC INC | 579.27 | 856.26 | 5,688 | 727,337 | 資本財 |
| BATH & BODY WORKS INC | 29 | — | — | — | 小売 |
| T-MOBILE US INC | 596.1 | — | — | — | 電気通信サービス |
| BURLINGTON STORES INC | 32 | — | — | — | 小売 |
| VEEVA SYS INC CL A | 50 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| TWITTER INC | 283 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 103 | 754.8 | 9,941 | 1,271,017 | 消費者サービス |
| XPO LOGISTICS INC | 10 | — | — | — | 運輸 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 93 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ANTERO RES CORP | — | 85.53 | 300 | 38,458 | エネルギー |
| ARISTA NETWORKS INC | — | 396.25 | 4,006 | 512,178 | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| WAYFAIR INC | 46 | 12.5 | 62 | 7,945 | 小売 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 26 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| ANTHEM INC | 4 | 69.25 | 3,323 | 424,902 | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDTRONIC PLC | 189 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| HUBSPOT INC | 3 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| WESTROCK CO | 23 | — | — | — | 素材 |
| TWILIO INC CLASS A | 28 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| SQUARE INC CL A | 161 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| SNAP INC - A | 674 | 113.63 | 263 | 33,704 | メディア・娯楽 |
| INGERSOLL RAND INC | 112.5 | 199.1 | 881 | 112,714 | 資本財 |
| BAKER HUGHES CO | — | 406.03 | 1,419 | 181,532 | エネルギー |
| NUTRIEN LTD (US) | — | 162.03 | 1,642 | 209,972 | 素材 |
| SPOTIFY TECHNOLOGY SA | 90 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| BIOHAVEN PHARM HOLDING CO LTD | — | 11 | 155 | 19,836 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CIGNA CORP | — | 11.38 | 292 | 37,374 | ヘルスケア機器・サービス |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC CL C | 288 | 1,077.19 | 4,427 | 566,024 | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| DOW INC | — | 23.51 | 161 | 20,667 | 素材 |
| LEVI STRAUSS & COMPANY CL A | 82.04 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 355 | — | — | — | 運輸 |
| CORTEVA INC | — | 166.42 | 981 | 125,533 | 素材 |
| DYNATRACE INC | 278 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| CLOUDFLARE INC | 524 | 505.14 | 2,929 | 374,576 | ソフトウェア・サービス |
| ENVISTA HOLDINGS CORP | 262 | 135.15 | 568 | 72,727 | ヘルスケア機器・サービス |
| VERTIV HOLDINGS LLC | 28 | — | — | — | 資本財 |
| AON PLC | — | 15.65 | 417 | 53,354 | 保険 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 117 | 138.52 | 1,005 | 128,555 | 資本財 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 141 | 70.09 | 262 | 33,523 | 資本財 |
| CPG NEWCO LLC | 11 | — | — | — | 資本財 |
| OAK STREET HEALTH INC | 159.1 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| SNOWFLAKE INC CL A | — | 20.26 | 297 | 38,029 | ソフトウェア・サービス |
| SUNSHINE SILVER MINING & REFIN | 273 | — | — | — | 素材 |
| DOORDASH INC | — | 23.34 | 156 | 19,978 | 小売 |
| GFL ENVIRONMENTAL INC | 176 | 42.57 | 120 | 15,451 | 商業・専門サービス |
| ROBLOX CORP | 39 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| COUPANG INC A | 112 | 962.56 | 1,246 | 159,366 | 小売 |
| MP MATERIALS CORP | — | 32 | 124 | 15,931 | 素材 |
| UIPATH INC A | 10 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ENDEAVOR GROUP HOLDINGS INC | 108 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| DOXIMITY INC | — | 137.39 | 446 | 57,122 | ヘルスケア機器・サービス |
| CLEAR SECURE INC | — | 70.9 | 204 | 26,096 | ソフトウェア・サービス |
| ON HOLDING AG | — | 684.08 | 1,418 | 181,303 | 耐久消費財・アパレル |
| NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS | — | 339 | 146 | 18,766 | 銀行 |
| BLACKROCK INC | 107 | 1.26 | 74 | 9,553 | 各種金融 |
| CELANESE CORP | 9 | — | — | — | 素材 |
| PENTAIR PLC | 46 | — | — | — | 資本財 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | — | 15.89 | 491 | 62,839 | ヘルスケア機器・サービス |
| MOSAIC CO NEW | — | 106.82 | 653 | 83,539 | 素材 |
| POSCO SPON ADR | 18 | — | — | — | 素材 |
| PHILLIPS 66 | — | 70.91 | 675 | 86,424 | エネルギー |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | — | 7.03 | 290 | 37,136 | 資本財 |
| TRANSDIGM GROUP INC | — | 26.95 | 1,458 | 186,452 | 資本財 |
| WEST PHARMACEUTICAL SVCS INC | 7 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WESTLAKE CORP | 73 | 105.13 | 1,359 | 173,830 | 素材 |
| CLARIVATE PLC | 470 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| ALBERTSONS COS INC | — | 151.01 | 409 | 52,301 | 食品・生活必需品小売り |
| NUVATION BIO INC | — | 194 | 80 | 10,243 | 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 銘柄 数 <比 率> | 76,824.21 231銘柄 | 92,248.44 212銘柄 | 1,295,029 — | 165,569,546 <88.9%> |
| (カナダ・・・トロント) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| BARRICK GOLD CORP | 1,103.18 | 1,664.81 | 4,421 | 440,714 | 素材 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 267 | 885.03 | 7,008 | 698,542 | エネルギー |
| ROYAL BANK OF CANADA | 454 | 586.43 | 7,446 | 742,191 | 銀行 |

| 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 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| THOMSON REUTERS CORP | 75 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 542 | 745.47 | 6,840 | 681,785 | 銀行 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDS LTD | 3 | 7 | 483 | 48,170 | 保険 | |
| IMPERIAL OIL LTD | — | 23 | 150 | 14,951 | エネルギー | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD (CANA) | 23 | 80 | 553 | 55,209 | 素材 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 931.05 | 440.75 | 3,877 | 386,492 | 運輸 | |
| ALIMENTATION COUCHE A MULT VTG | — | 141.11 | 783 | 78,099 | 食品・生活必需品小売り | |
| FIRST QUANTUM MINERALS INC | 123 | 72.66 | 265 | 26,491 | 素材 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 379 | 459.63 | 2,727 | 271,890 | 各種金融 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 37 | 102.23 | 542 | 54,084 | 素材 | |
| FRANCO-NEVADA CORP | 261.04 | 267.04 | 4,753 | 473,762 | 素材 | |
| INTACT FINL CORP | 32 | 52 | 914 | 91,176 | 保険 | |
| SUNCOR ENERGY INC | — | 287.43 | 1,396 | 139,144 | エネルギー | |
| CENOVUS ENERGY INC | — | 275.13 | 744 | 74,231 | エネルギー | |
| NOVAGOLD RESOURCES INC | 1,290 | 1,370.83 | 1,006 | 100,286 | 素材 | |
| TOURMALINE OIL CORP | — | 17 | 122 | 12,230 | エネルギー | |
| SHOPIFY INC CL A | 66 | 22.07 | 1,107 | 110,353 | ソフトウェア・サービス | |
| ARITZIA INC | 119 | — | — | — | 小売 | |
| IVANHOE MINES LTD | 787.97 | 787.97 | 799 | 79,636 | 素材 | |
| ORLA MINING LTD | — | 8,193.29 | 4,416 | 440,160 | 素材 | |
| STELCO HLDGS INC | — | 55 | 212 | 21,138 | 素材 | |
| DENTALCORP HOLDINGS LTD | — | 356.63 | 427 | 42,618 | ヘルスケア機器・サービス | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMEN-A | — | 2.8 | 16 | 1,660 | 保険 | |
| DOLLARAMA INC | — | 54.58 | 360 | 35,914 | 小売 | |
| LUNDIN GOLD INC | 175 | — | — | — | 素材 | |
| 小 計 | 株 数、金 額 | 6,668.24 | 16,949.89 | 51,378 | 5,120,937 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 18銘柄 | 25銘柄 | — | <2.8%> | |
| (オーストラリア・・・オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | |
| SUNRISE ENERGY METALS LTD | 51.03 | 51.03 | 14 | 1,341 | 素材 | |
| XERO LTD (AU) | 40 | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| CLEAN TEQ WATER PTY LTD | — | 25.51 | 1 | 125 | 商業・専門サービス | |
| 小 計 | 株 数、金 額 | 91.03 | 76.54 | 16 | 1,467 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 2銘柄 | 2銘柄 | — | <0.0%> | |
| (香港・・・香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 90 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| AIA GROUP LTD | 420 | — | — | — | 保険 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 204 | — | — | — | 小売 | |
| ZAI LAB LTD | 47 | 370 | 1,017 | 16,575 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 620 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| WUXI APPTTEC CO LTD H | 104 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 690 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC H | 155 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス | |
| JD.COM INC CL A | 13 | — | — | — | 小売 | |
| XPENG INC CL A | — | 118.1 | 1,072 | 17,478 | 自動車・自動車部品 | |
| 小 計 | 株 数、金 額 | 2,343 | 488.1 | 2,090 | 34,053 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 9銘柄 | 2銘柄 | — | <0.0%> | |
| (イギリス・・・ロンドン) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | |
| DIAGEO PLC | 58 | 1,634.69 | 5,835 | 929,649 | 食品・飲料・タバコ | |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 百株 496.68 | 百株 808.89 | 千イギリス・ポンド 1,736 | 千円 276,654 | 保険 |
| DIRECT LINE INSURANCE GRP PLC | 310 | — | — | — | 保険 |
| GLENCORE XSTRATA PLC | — | 798.5 | 397 | 63,333 | 素材 |
| FERGUSON PLC | — | 3.81 | 36 | 5,758 | 資本財 |
| DR. MARTENS LTD | 3,169 | 3,535.57 | 691 | 110,165 | 耐久消費財・アパレル |
| DELIVEROO HOLDINGS PLC | 963 | 934.25 | 83 | 13,379 | 小売 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 4,996.68 | 7,715.71 | 8,781 | 1,398,940 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 5銘柄 | 6銘柄 | — | <0.8%> |
| (スイス・・・SIX Swiss Exchange) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| SONOVA HOLDING AG REG CL B | 15.9 | 69.93 | 2,219 | 291,585 | ヘルスケア機器・サービス |
| IDORSIA LTD | 631.45 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NESTLE SA (REG) | — | 25.82 | 292 | 38,458 | 食品・飲料・タバコ |
| (スイス・・・SWX Europe) | — | 41.98 | 1,330 | 174,767 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCHE HLDGS GENUSSCHEIN | — | 41.98 | 1,330 | 174,767 | 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 647.35 | 137.73 | 3,842 | 504,811 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 2銘柄 | 3銘柄 | — | <0.3%> |
| (デンマーク・・・コペンハーゲン) | 百株 | 百株 | 千デンマーク・クローネ | 千円 | |
| VESTAS WIND SYSTEMS AS | 1,233.3 | — | — | — | 資本財 |
| GENMAB AS | 31 | — | — | — | 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 1,264.3 | — | — | — | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 2銘柄 | — | — | <—> |
| (ノルウェー・・・オスロ) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| AUTOSTORE HOLDINGS LTD | — | 119.66 | 253 | 3,338 | 資本財 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 — | 119.66 | 253 | 3,338 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | — | 1銘柄 | — | <0.0%> |
| (スウェーデン・・・ストックホルム) | 百株 | 百株 | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| EVOLUTION AB | 53.63 | — | — | — | 消費者サービス |
| THULE GROUP AB/THE | — | 60 | 1,875 | 24,138 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 53.63 | 60 | 1,875 | 24,138 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 1銘柄 | 1銘柄 | — | <0.0%> |
| (インド・・・ナショナル証券取引所) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | |
| HDFC BANK LTD (DEMAT) | 128 | — | — | — | 銀行 |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 268 | 52.6 | 9,380 | 15,571 | 銀行 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 396 | 52.6 | 9,380 | 15,571 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 2銘柄 | 1銘柄 | — | <0.0%> |
| (韓国・・・KOSDAQ) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| NAVER CORP | 8.03 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| (韓国・・・韓国取引所) | — | — | — | — | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 134 | 134 | 2,438,800 | 246,318 | 自動車・自動車部品 |
| SAMSUNG ELECTRONICS | 56.3 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 15.7 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェア及び機器 |
| LG CHEMICAL LTD | 1.76 | — | — | — | 素材 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 215.79 | 134 | 2,438,800 | 246,318 | |
| | 銘柄 数 <比 率> | 5銘柄 | 1銘柄 | — | <0.1%> |
| ユーロ (オランダ・・・アムステルダム) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP INC | — | 2,404.18 | 4,813 | 650,692 | メディア・娯楽 |

| 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 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ(オランダ・・・EURONEXT アムステルダム) | ADYEN BV | 百株 21.33 | 百株 8.39 | 千ユーロ 1,216 | 千円 164,442 | ソフトウェア・サービス |
| 小 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 21.33 1銘柄 | 2,412.57 2銘柄 | 6,029 — | 815,134 <0.4%> | |
| ユーロ(ベルギー・・・EURONEXT ブリュッセル) | UCB SA ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 百株 69 — | 百株 19.62 141.8 | 千ユーロ 173 724 | 千円 23,516 97,900 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 食品・飲料・タバコ |
| 小 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 69 1銘柄 | 161.42 2銘柄 | 898 — | 121,417 <0.1%> | |
| ユーロ(ルクセンブルグ・・・EURONEXT パリ) | EUROFINS SCIENTIFIC SA ユーロ(ルクセンブルグ・・・XETRA) SUSE SA | 百株 86.1 67 | 百株 — — | 千ユーロ — — | 千円 — — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス ソフトウェア・サービス |
| 小 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 153.1 2銘柄 | — — | — — | — <—> | |
| ユーロ(フランス・・・EURONEXT パリ) | HERMES INTERNATIONAL EDENRED LVMH MOET HENNESSY LOUIS VU SE L'OREAL PRIME DE FIDELITE 2023 | 百株 1.28 22.47 6.21 16 | 百株 — — — 16 | 千ユーロ — — — 493 | 千円 — — — 66,762 | 耐久消費財・アパレル ソフトウェア・サービス 耐久消費財・アパレル 家庭用品・パーソナル用品 |
| 小 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 45.96 4銘柄 | 16 1銘柄 | 493 — | 66,762 <0.0%> | |
| ユーロ(スペイン・・・SIBEL) | BANCO SANTANDER SA (SPAIN) | 百株 — | 百株 562.66 | 千ユーロ 154 | 千円 20,842 | 銀行 |
| 小 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | — — | 562.66 1銘柄 | 154 — | 20,842 <0.0%> | |
| ユーロ計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 289.39 8銘柄 | 3,152.65 6銘柄 | 7,575 — | 1,024,156 <0.6%> | |
| 合 計 | 株 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 93,789.62 285銘柄 | 121,135.32 260銘柄 | — — | 173,943,281 <93.4%> | |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|-----------------------|-----------|-------------|------------|-------------------|
| | | 単位数又は口数 | 単位数又は口数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| WELLTOWER INC | | — | 8.765 | 767 | 98,075 |
| EQUITY COMMONWEALTH | | 18.9 | 25.328 | 657 | 84,063 |
| PROLOGIS INC | | 2.9 | 26.02 | 3,115 | 398,267 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | — | 1.804 | 132 | 16,915 |
| 小 計 | 口 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 21.8 2 | 61.917 4 | 4,672 — | 597,321 <0.3%> |
| 合 計 | 口 数、金 額 銘柄 数 <比 率> | 21.8 2 | 61.917 4 | — — | 597,321 <0.3%> |

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

フィデリティ・ファンズーサステナブル・アジア株式ファンドの運用状況

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|---------|--|
| 設 定 形 態 | ルクセンブルグ籍証券投資法人／米ドル建て |
| 投 資 目 的 | 主としてアジア(除く日本)の取引所に上場されている企業の株式に投資を行いません。当ファンドは純資産の70%以上を、各業種で優れたサステナビリティ特性を有する企業の株式に投資する「ベスト・イン・クラス」戦略を採用しています。サステナビリティ特性とは、効果的な企業統治と環境・社会問題への優れた取り組み(ESG)を含む企業の性質を指しています。 |
| 決 算 日 | 4月30日 |

運用および純資産変動計算書

2022年4月30日に終了した年度

| 通貨 | 米ドル |
|--------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金および受取利息 | 41,138,183 |
| スワップ取引に係る受取利息 | — |
| デリバティブ収益 | 7,802 |
| 雑益 | — |
| 純利益 | 41,145,985 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 44,298,232 |
| 管理費 | 8,391,068 |
| 国税 | 1,593,114 |
| 保管費用 | 1,373,168 |
| 販売手数料 | 663,898 |
| 成功報酬 | — |
| その他費用 | 522,283 |
| 費用合計 | 56,841,763 |
| スワップ取引に係る支払利息 | — |
| デリバティブ費用 | 167,091 |
| 差金決済取引に係る財務費用 | — |
| 選付ブローカー費用 | — |
| 管理費用の払戻 | — |
| 払戻費用 | — |
| 費用選付 | — |
| 総費用 | 57,008,854 |
| 純投資収益(損失) | (15,862,869) |
| 有価証券に係る実現純(損)益 | 397,545,080 |
| 外貨取引に係る実現純(損)益 | (1,113,757) |
| 差金決済取引に係る実現純(損)益 | 3,557,171 |
| 外国為替予約取引に係る実現純(損)益 | (319,473) |
| オプション取引に係る実現純(損)益 | — |
| 先物取引に係る実現純(損)益 | — |
| スワップ取引に係る実現純(損)益 | — |
| 有価証券に係る未実現評価(損)益の変動額 | (1,344,927,598) |
| 外貨取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | 144,362 |
| 差金決済取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (2,534,876) |
| 外国為替予約取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | (177,561) |
| オプション取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 先物取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| スワップ取引に係る未実現評価(損)益の変動額 | — |
| 運用実績 | (963,689,521) |
| 受益者への分配金 | (823,917) |
| 設定解約 | |
| 当期設定額 | 1,039,630,211 |
| 当期解約額 | (808,817,971) |
| 調整勘定 | 452,708 |
| 設定解約に伴う増加(減少)額 | 231,264,948 |
| 純増加(減少) | (733,248,490) |
| 純資産額 | |
| 期首 | 4,000,711,218 |
| 期末 | 3,267,462,728 |

投資資産明細表 2022年4月30日現在

| | 国コード | 通貨 | 株数または 面額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets | | 国コード | 通貨 | 株数または 面額 | 時価 (米ドル) | % Net Assets |
|--|------|-----|-------------|--------------------|-----------------|--------|------|----|-------------|----------------------|-----------------|
| 公認の証券取引所で取引される証券 | | | | | | | | | | | |
| エネルギー | | | | | | | | | | | |
| China Suntien Green Energy | CN | HKD | 62,019,275 | 35,174,776 | 1.08 | | | | | | |
| | | | | 35,174,776 | 1.08 | | | | | | |
| 公益事業 | | | | | | | | | | | |
| AC Energy | PH | PHP | 144,481,894 | 19,981,980 | 0.61 | | | | | | |
| | | | | 19,981,980 | 0.61 | | | | | | |
| 素材 | | | | | | | | | | | |
| Avia Avian | ID | IDR | 517,582,148 | 29,233,548 | 0.89 | | | | | | |
| Guangdong Huate Gas | CN | CNY | 648,138 | 5,240,755 | 0.16 | | | | | | |
| Shandong Sinocera Functional Material (A) | CN | CNY | 728,700 | 3,600,707 | 0.11 | | | | | | |
| | | | | 38,074,810 | 1.17 | | | | | | |
| 資本財・サービス | | | | | | | | | | | |
| Havells India | IN | INR | 1,857,628 | 31,811,738 | 0.97 | | | | | | |
| Titan Wind Energy Suzhou | CN | CNY | 13,725,450 | 20,851,844 | 0.64 | | | | | | |
| Yijiahe Technology | CN | CNY | 1,639,472 | 10,285,543 | 0.31 | | | | | | |
| Eston Automation (A) | CN | CNY | 3,135,615 | 7,015,397 | 0.21 | | | | | | |
| Hongshu Hongshu Digital Technology | CN | CNY | 222,263 | 5,340,635 | 0.16 | | | | | | |
| Eston Automation (A) | CN | CNY | 1,189,926 | 2,663,953 | 0.08 | | | | | | |
| | | | | 77,948,910 | 2.39 | | | | | | |
| 情報技術 | | | | | | | | | | | |
| Samsung Electronics | KR | KRW | 5,242,090 | 280,773,514 | 8.59 | | | | | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing | TW | TWD | 14,174,168 | 259,226,764 | 7.93 | | | | | | |
| Tencent Holdings | CN | HKD | 3,630,477 | 171,645,076 | 5.25 | | | | | | |
| SK Hynix | KR | KRW | 839,456 | 74,497,616 | 2.28 | | | | | | |
| NAVER | KR | KRW | 125,603 | 28,335,127 | 0.87 | | | | | | |
| Infosys ADR | IN | USD | 1,365,105 | 27,370,365 | 0.84 | | | | | | |
| Cognizant Technology Solutions (A) | US | USD | 303,006 | 24,938,618 | 0.76 | | | | | | |
| Foxconn Industrial Internet (A) | CN | CNY | 14,805,523 | 21,559,831 | 0.65 | | | | | | |
| LONGi Green Energy Technology | CN | CNY | 2,020,552 | 20,686,185 | 0.63 | | | | | | |
| MediaTek | TW | TWD | 485,404 | 13,597,432 | 0.42 | | | | | | |
| Foxconn Industrial Internet | CN | CNY | 6,408,520 | 9,245,530 | 0.28 | | | | | | |
| LONGi Green Energy Technology | CN | CNY | 756,015 | 7,739,995 | 0.24 | | | | | | |
| Opt Machine Vision Technology | CN | CNY | 230,411 | 5,186,291 | 0.16 | | | | | | |
| Infosys | IN | INR | 101,000 | 2,064,015 | 0.06 | | | | | | |
| | | | | 946,706,359 | 28.97 | | | | | | |
| 一般消費財・サービス | | | | | | | | | | | |
| Melton (B) | CN | HKD | 5,391,478 | 115,013,466 | 3.52 | | | | | | |
| JD.com (A) | CN | HKD | 3,233,059 | 102,133,445 | 3.13 | | | | | | |
| Galaxy Entertainment Group | HK | HKD | 13,167,115 | 75,762,323 | 2.32 | | | | | | |
| Eicher Motors | IN | INR | 1,358,130 | 46,604,089 | 1.43 | | | | | | |
| Shenzhen International Group Holdings | CN | HKD | 3,007,612 | 41,233,705 | 1.26 | | | | | | |
| ANTA Sports Products | CN | HKD | 3,546,672 | 41,112,847 | 1.26 | | | | | | |
| Tip.com Group ADR | CN | USD | 1,393,784 | 34,147,696 | 1.05 | | | | | | |
| Hyundai Mobis | KR | KRW | 171,561 | 28,128,604 | 0.86 | | | | | | |
| Zhejiang Supor (A) | CN | CNY | 3,018,278 | 25,188,969 | 0.77 | | | | | | |
| Alibaba Group Holding | CN | HKD | 1,433,965 | 17,988,685 | 0.55 | | | | | | |
| Sea ADR | SG | USD | 81,282 | 7,222,709 | 0.22 | | | | | | |
| Zhejiang Supor | CN | CNY | 75,871 | 633,178 | 0.02 | | | | | | |
| | | | | 535,169,714 | 16.38 | | | | | | |
| 生活必需品 | | | | | | | | | | | |
| CP ALL (T) | TH | THB | 31,410,261 | 59,488,268 | 1.82 | | | | | | |
| China Mengniu Dairy | HK | HKD | 7,935,123 | 42,962,447 | 1.31 | | | | | | |
| Thai Beverage | TH | SGD | 64,727,595 | 32,026,575 | 0.98 | | | | | | |
| Vietnam Dairy Products | VN | VND | 4,309,638 | 13,925,366 | 0.43 | | | | | | |
| | | | | 148,402,656 | 4.54 | | | | | | |
| ヘルスケア | | | | | | | | | | | |
| Wuxi Biologics Cayman | CN | HKD | 7,015,204 | 52,904,358 | 1.62 | | | | | | |
| Hansoh Pharmaceutical Group | CN | HKD | 15,913,323 | 26,296,428 | 0.80 | | | | | | |
| Innovent Biologics | CN | HKD | 4,923,594 | 15,540,092 | 0.48 | | | | | | |
| Zai Lab ADR | CN | USD | 374,943 | 15,260,185 | 0.47 | | | | | | |
| Ocumension Therapeutics | CN | HKD | 11,480,718 | 13,831,287 | 0.42 | | | | | | |
| Medlive Technology | CN | HKD | 6,526,284 | 7,677,564 | 0.23 | | | | | | |
| | | | | 131,509,914 | 4.02 | | | | | | |
| 金融 | | | | | | | | | | | |
| AIA Group | HK | HKD | 25,307,217 | 250,037,858 | 7.65 | | | | | | |
| ICICI Bank | IN | INR | 16,549,592 | 154,950,377 | 4.71 | | | | | | |
| ICICI Bank | IN | INR | 12,794,151 | 124,284,611 | 3.80 | | | | | | |
| United Overseas Bank | SG | SGD | 4,270,642 | 92,364,966 | 2.83 | | | | | | |
| Hong Kong Exchanges and Clearing | HK | HKD | 1,827,085 | 78,203,867 | 2.39 | | | | | | |
| China Merchants Bank (H) | CN | HKD | 8,579,821 | 51,996,660 | 1.59 | | | | | | |
| Prudential (HK) | GB | HKD | 3,015,542 | 38,015,436 | 1.16 | | | | | | |
| HDFC Bank | IN | INR | 2,005,387 | 36,198,880 | 1.11 | | | | | | |
| HDFC Bank ADR | IN | USD | 597,377 | 33,461,344 | 1.02 | | | | | | |
| Bank Rakyat Indonesia Persero | ID | IDR | 85,291,116 | 28,560,066 | 0.87 | | | | | | |
| Bank Central Asia | ID | IDR | 48,933,225 | 27,430,122 | 0.84 | | | | | | |
| HDFC Standard Life Insurance | IN | INR | 2,863,470 | 21,781,490 | 0.67 | | | | | | |
| KakaoBank | KR | KRW | 6,18,955 | 20,675,367 | 0.63 | | | | | | |
| PB Fintech | IN | INR | 2,019,438 | 17,566,609 | 0.54 | | | | | | |
| | | | | 975,528,233 | 29.86 | | | | | | |
| 不動産 | | | | | | | | | | | |
| China Resources Land | HK | HKD | 15,447,300 | 69,251,917 | 2.12 | | | | | | |
| | | | | 69,251,917 | 2.12 | | | | | | |
| オープンエンド型ファンド | | | | | | | | | | | |
| Fidelity IIF - The US Dollar Fund - A-ACC-USD | IE | USD | 5,269 | 95,787,609 | 2.93 | | | | | | |
| | | | | 95,787,609 | 2.93 | | | | | | |
| エクイティ・リンク債 | | | | | | | | | | | |
| UBS (Eston Automation (A)) ELN 23/03/2023 | CN | USD | 3,950,181 | 8,845,478 | 0.27 | | | | | | |
| HSBC (Eston Automation (A)) ELN 21/11/2022 | CN | USD | 728,818 | 1,631,644 | 0.05 | | | | | | |
| | | | | 10,475,122 | 0.32 | | | | | | |
| その他の市場で取引される証券 | | | | | | | | | | | |
| 一般消費財・サービス | | | | | | | | | | | |
| Tip.com Group | CN | HKD | 9,937 | 239,080 | 0.01 | | | | | | |
| | | | | 239,080 | 0.01 | | | | | | |
| エクイティ・リンク債 | | | | | | | | | | | |
| BNP (Shandong Sinocera Funct. (A)) ELN 20/09/2024 | CN | USD | 8,444,573 | 41,726,923 | 1.28 | | | | | | |
| BNP (Guangdong Huate Gas (A)) ELN 30/10/2024 | CN | USD | 2,422,322 | 19,586,560 | 0.60 | | | | | | |
| JP Morgan (Shang Titan Science (A)) ELN 23/04/2023 | CN | USD | 615,383 | 12,206,815 | 0.37 | | | | | | |
| UBS (Opt Machine Vision Tech. (A)) ELN 03/03/2023 | CN | USD | 408,918 | 9,205,420 | 0.28 | | | | | | |
| BNP (Hangzhou Honghua Digital (A)) ELN 12/11/2024 | CN | USD | 373,155 | 8,999,923 | 0.28 | | | | | | |
| HSBC (Titan Wind Energy Suzhou (A)) ELN 29/07/2022 | CN | USD | 4,361,990 | 6,620,426 | 0.20 | | | | | | |
| JP Morgan (Eston Automation (A)) ELN 10/11/2022 | CN | USD | 1,114,580 | 2,495,269 | 0.08 | | | | | | |
| Macquarie (Viet. Tech&Com. (A)) ELN 08/10/2022 | CN | USD | 1,275,102 | 2,412,494 | 0.07 | | | | | | |
| | | | | 105,254,030 | 3.16 | | | | | | |
| 非上場 | | | | | | | | | | | |
| 情報技術 | | | | | | | | | | | |
| GoTo Gojek Tokopedia | ID | IDR | 757,344,672 | 12,078,229 | 0.37 | | | | | | |
| Beisen Hlds 0% (Pref'd) (Perpetual) | CN | USD | 401,936 | 8,485,477 | 0.26 | | | | | | |
| | | | | 20,563,706 | 0.63 | | | | | | |
| その他 | | | | | | | | | | | |
| | | | | | (3) | | | | | | |
| | | | | | (0.00) | | | | | | |
| 投資資産合計 (取得価額 USD 3,155,674,610) | | | | | | | | | | 3,208,088,813 | 98.18 |
| 契約額等 | | | | | | | | | | 未実現 (損 % Net | % Net |
| 通貨 | | | | | | | | | |) 益 (米ドル) | Assets |
| 差金決済取引 | | | | | | | | | | | |
| ベトナム Tech. & Com. Joint Stock Bank (MS) | USD | | 14,892,850 | (2,444,096) | (0.07) | | | | | | |
| | | | | (2,444,096) | (0.07) | | | | | | |
| 外国為替先物取引 | | | | | | | | | | 未実現 (損 % Net | % Net |
| A-ACC Shares (EUR) (hedged) | | | | | | | | | |) 益 (米ドル) | Assets |
| Bought USD Solid KRW at 0.000815 20/05/2022 | | | | 174,712 | 4,619 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid CNY at 0.163604 20/05/2022 | | | | 60,332 | 2,381 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid TWD at 0.034585 20/05/2022 | | | | 114,799 | 1,930 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid SGD at 0.738456 20/05/2022 | | | | 52,100 | 1,069 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid EUR at 1.083410 20/05/2022 | | | | 22,251 | 609 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid INR at 0.020072 20/05/2022 | | | | 226,235 | 605 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid IDR at 0.000070 20/05/2022 | | | | 40,438 | 500 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid EUR at 1.068331 20/05/2022 | | | | 33,323 | 456 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid HKD at 0.127579 20/05/2022 | | | | 499,140 | 333 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid THB at 0.029542 20/05/2022 | | | | 24,811 | 288 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid KRW at 0.0200814 20/05/2022 | | | | 4,174 | 107 | 0.00 | | | | | |
| Bought INR Solid USD at 76.778685 20/05/2022 | | | | 14,810 | 26 | 0.00 | | | | | |
| Bought TWD Solid USD at 29.501021 20/05/2022 | | | | 5,556 | 19 | 0.00 | | | | | |
| Bought HKD Solid USD at 7.843706 20/05/2022 | | | | 22,349 | 1 | 0.00 | | | | | |
| Bought PHP Solid USD at 52.439367 20/05/2022 | | | | 534 | 0 | 0.00 | | | | | |
| Bought USD Solid PHP at 0.019075 20/05/2022 | | | | 9,273 | (2) | (0.00) | | | | | |
| Bought HKD Solid USD at 7.842427 20/05/2022 | | | | 14,906 | (2) | (0.00) | | | </ | | |

| 契約額等 USD | 未実現 (損 益 (来下 ル) | % Net Assets |
|--|-----------------------|-------------------------|
| Y-ACC Shares (EUR) (hedged) | | |
| Bought USD Sold KRW at 0.000815 20/05/2022 | 674,742 | 17,839 0.00 |
| Bought USD Sold CNY at 0.156304 20/05/2022 | 235,765 | 9,194 0.00 |
| Bought USD Sold TWD at 0.034585 20/05/2022 | 443,354 | 7,453 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.083410 20/05/2022 | 183,383 | 5,022 0.00 |
| Bought USD Sold SGD at 0.738456 20/05/2022 | 201,509 | 4,150 0.00 |
| Bought USD Sold INR at 0.013082 20/05/2022 | 873,725 | 2,330 0.00 |
| Bought USD Sold IDR at 0.000070 20/05/2022 | 168,388 | 2,076 0.00 |
| Bought USD Sold EUR at 1.068351 20/05/2022 | 138,249 | 1,809 0.00 |
| Bought USD Sold KRW at 0.000816 20/05/2022 | 52,772 | 1,479 0.00 |
| Bought USD Sold THB at 0.029680 20/05/2022 | 85,989 | 1,406 0.00 |
| Bought USD Sold HKD at 0.127579 20/05/2022 | 1,927,674 | 1,286 0.00 |
| Bought USD Sold CNY at 0.156428 20/05/2022 | 18,287 | 754 0.00 |
| Bought USD Sold TWD at 0.034607 20/05/2022 | 34,673 | 605 0.00 |
| Bought USD Sold KRW at 0.000814 20/05/2022 | 17,316 | 442 0.00 |
| Bought USD Sold SGD at 0.733273 20/05/2022 | 15,702 | 210 0.00 |
| Bought USD Sold INR at 0.013085 20/05/2022 | 68,334 | 197 0.00 |
| Bought USD Sold THB at 0.029839 20/05/2022 | 6,725 | 146 0.00 |
| Bought USD Sold HKD at 0.127605 20/05/2022 | 150,762 | 130 0.00 |
| Bought USD Sold THB at 0.029542 20/05/2022 | 10,612 | 123 0.00 |
| Bought INR Sold USD at 76.778699 20/05/2022 | 61,633 | 008 0.00 |
| Bought TWD Sold USD at 29.301001 20/05/2022 | 23,114 | 79 0.00 |
| Bought USD Sold PHP at 0.019129 20/05/2022 | 2,801 | 7 0.00 |
| Bought HKD Sold USD at 7.843707 20/05/2022 | 92,673 | 3 0.00 |
| Bought PHP Sold USD at 52.438931 20/05/2022 | 2,210 | 1 0.00 |
| Bought USD Sold PHP at 0.019075 20/05/2022 | 35,810 | (8) (0.00) |
| Bought HKD Sold USD at 7.842428 20/05/2022 | 61,920 | (8) (0.00) |
| Bought IDR Sold USD at 14525.873694 20/05/2022 | 8,676 | (12) (0.00) |
| Bought INR Sold USD at 76.600515 20/05/2022 | 22,407 | (13) (0.00) |
| Bought KRW Sold USD at 1256.219859 20/05/2022 | 23,188 | (35) (0.00) |
| Bought TWD Sold USD at 29.245603 20/05/2022 | 16,030 | (84) (0.00) |
| Bought CNY Sold USD at 6.583842 20/05/2022 | 12,151 | (120) (0.00) |
| Bought INR Sold USD at 76.481601 20/05/2022 | 64,516 | (137) (0.00) |
| Bought INR Sold USD at 76.387204 20/05/2022 | 33,750 | (180) (0.00) |
| Bought CNY Sold USD at 6.543302 20/05/2022 | 14,824 | (237) (0.00) |
| Bought KRW Sold USD at 1236.000012 20/05/2022 | 16,896 | (312) (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.918640 20/05/2022 | 413,764 | (12,937) (0.00) |
| Bought EUR Sold USD at 0.915157 20/05/2022 | 5,311,229 | (185,684) (0.01) |
| | | (142,978) (0.00) |
| その他資産 (負債控除後) | 61,995,572 | 1.90 |
| Net Assets | 3,267,462,728 | 100.00 |