

## ブラックロック・ グローバル・フレキシブル・ バランス・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／資産複合   |
| 信託期間   | 無期限(設定日:2007年6月29日)   |
| 決算日    | 4月20日および10月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)  |
| 運用方針   | <p>①主として「ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) グローバル・アロケーション・ファンド クラスJ投資証券」および「ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」(以下各々を「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)への投資を通じて、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行います。</p> <p>②外貨建資産については、原則が為替ヘッジを行いません。</p>                               |
| 主要運用対象 | <p>当ファンドは、「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」に投資します。</p> <p>「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」を主要投資対象ファンドとし、その組入比率を高位に保ちます。</p>  |
| 組入制限   | <p>①投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>  |
| 分配方針   | <p>年2回の毎決算時(4月20日および10月20日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> |

### 第32期 運用報告書(全体版) (決算日:2023年4月20日)

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

### ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

[www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

## CONTENTS

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

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |           |           | (参考指数)   |           | 投資信託証券<br>組入比率 | 純資産   |
|------------------|--------|-----------|-----------|----------|-----------|----------------|-------|
|                  | (分配落)  | 税込<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 複合インデックス | 期中<br>騰落率 |                |       |
|                  | 円      | 円         | %         |          | %         | %              | 百万円   |
| 28期(2021年4月20日)  | 17,355 | 0         | 16.4      | 176.19   | 14.8      | 98.3           | 2,299 |
| 29期(2021年10月20日) | 18,480 | 0         | 6.5       | 191.03   | 8.4       | 99.8           | 2,608 |
| 30期(2022年4月20日)  | 19,131 | 0         | 3.5       | 201.06   | 5.3       | 99.5           | 2,531 |
| 31期(2022年10月20日) | 19,238 | 0         | 0.6       | 198.23   | △ 1.4     | 98.9           | 2,221 |
| 32期(2023年4月20日)  | 18,999 | 0         | △ 1.2     | 201.00   | 1.4       | 98.9           | 2,213 |

(注1) 基準価額は1万円当り。

(注2) 複合インデックスとは、以下の指数を円換算し、それぞれの割合で合成した指数です。

S&P500種指数36%、FTSE World Index (Ex-US) 24%、5Yr US Treasury Note 24%、FTSE Non-USD World Govt Bond Index16%。

(注3) 複合インデックスを構成する指数は、各種金融機関等で公表されており、その機関等の知的財産です。またこれらの機関等は、当ファンドの運用成果等に関する一切の責任を負いません。

(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスLLCの登録商標です。

(注5) FTSE World Index (Ex-US) は、FTSE インターナショナルリミテッドにより算出される指数です。FTSE®は、ロンドン証券取引所 (London Stock Exchange Plc) およびフィナンシャル・タイムズ社 (The Financial Times Limited) の商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSEの指数(インデックス)は、いずれもFTSEの商標であり、そのあらゆる権利はFTSEおよび/又は、その許諾者に帰属します。すべての情報は、参考のために提供されるだけです。FTSEは、FTSEの指数又はその基礎データのいかなる誤りもしくは欠落等に関して一切責任を負うものではありません。

(注6) FTSE Non-USD World Govt Bond Indexは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(注7) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額     |        | (参考指数)   |        | 投資信託証券<br>組入比率 |
|----------------------|-------------|--------|----------|--------|----------------|
|                      |             | 騰落率    | 複合インデックス | 騰 落 率  |                |
| (期 首)<br>2022年10月20日 | 円<br>19,238 | %<br>- | 198.23   | %<br>- | %<br>98.9      |
| 10月末                 | 19,485      | 1.3    | 202.24   | 2.0    | 99.0           |
| 11月末                 | 19,013      | △ 1.2  | 197.72   | △ 0.3  | 98.8           |
| 12月末                 | 17,932      | △ 6.8  | 187.19   | △ 5.6  | 98.6           |
| 2023年1月末             | 18,515      | △ 3.8  | 192.14   | △ 3.1  | 99.0           |
| 2月末                  | 18,796      | △ 2.3  | 195.96   | △ 1.1  | 99.0           |
| 3月末                  | 18,606      | △ 3.3  | 196.37   | △ 0.9  | 98.9           |
| (期 末)<br>2023年4月20日  | 18,999      | △ 1.2  | 201.00   | 1.4    | 98.9           |

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 複合インデックスとは、以下の指数を円換算し、それぞれの割合で合成した指数です。

S&P500種指数36%、FTSE World Index (Ex-US) 24%、5Yr US Treasury Note 24%、FTSE Non-USD World Govt Bond Index16%。

(注3) 複合インデックスを構成する指数は、各種金融機関等で公表されており、その機関等の知的財産です。またこれらの機関等は、当ファンドの運用成果等に関する一切の責任を負いません。

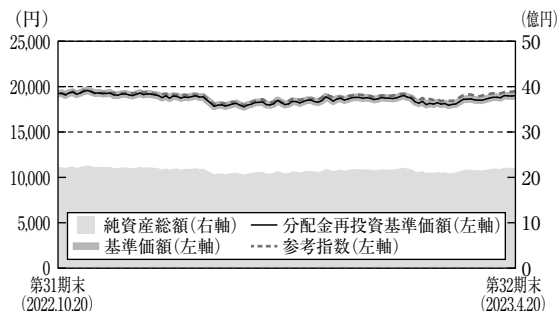
(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスLLCの登録商標です。

(注5) FTSE World Index (Ex-US) は、FTSEインターナショナルリミテッドにより算出される指数です。FTSE®は、ロンドン証券取引所 (London Stock Exchange Plc) およびフィナンシャル・タイムズ社 (The Financial Times Limited) の商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSEの指数(インデックス)は、いずれもFTSEの商標であり、そのあらゆる権利はFTSEおよび/又は、その許諾者に帰属します。すべての情報は、参考のために提供されるだけです。FTSEは、FTSEの指数又はその基礎データのいかなる誤りもしくは欠落等に関して一切責任を負うものではありません。

(注6) FTSE Non-USD World Govt Bond Indexは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## ■当期中の基準価額等の推移について

(第32期:2022年10月21日～2023年4月20日)



第32期首:19,238円

第32期末:18,999円(既払分配金0円)

騰落率:△1.2%(分配金再投資ベース)

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

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

\*参考指数は、複合インデックスです。

\*分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

## ◇運用担当者コメント

### 投資環境について

#### <グローバル株式市場>

世界の株式市場は、米インフレの鈍化が見られ始めたことでFRB(米連邦準備制度理事会)によるさらなる金融引き締め懸念が後退したことや堅調な労働市場などがリスク資産の下支え要因となり、堅調に推移しました。

#### <グローバル債券市場>

債券市場では、米国インフレの鈍化が見られ始めたことから、足許まで急ピッチで続いてきたFRBの利上げサイクルの終焉が市場参加者から意識される中、米国金利は低下(債券価格は上昇)しました。

## ポートフォリオについて

### <当ファンド>

当期、当ファンドは、主要投資対象である「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」を高位に、「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」を低位に組み入れた運用を行いました。

投資先ファンドにおける運用経過は以下の通りです。

### <BGF グローバル・アロケーション・ファンド>

- ・株式ポートフォリオに関しては、参照ベンチマーク対比アンダーウェイトを維持しました。経済成長の鈍化や、金融状況の逼迫により、企業業績が圧迫される恐れがあることを踏まえると、株式市場は今後数ヶ月にわたり不安定な展開になる可能性に鑑み、株式に対しては慎重な姿勢を維持しました。セクターのポジションに関しては、インフレ・ヘッジ効果が期待できるエネルギー・セクターや一部のコモディティ関連セクター(例えば、農業セクター)への建設的な見通しを維持しました。また、ソフトウェア、高級品小売、医療機器、およびマネージド・ケア(管理医療)など、安定した成長が期待できるセクターの企業を選別的にオーバーウェイトとしました。
- ・債券ポートフォリオに関しては、FRBが金融引き締めを進める中、引き続き、先進国国債などの優良資産をアンダーウェイトとしました。一方、市場のタカ派織り込みが大きく進展した中、金利が現在の水準から大幅に上昇する可能性は低く、利回り水準も魅力的であることから、米国債への配分を増やしました。
- ・また、クレジットについては、インカム収入の獲得を企図して保有を継続しました。
- ・コモディティは、金は長期的なインフレに対する効果的な部分ヘッジになり得るが、足元では、デュレーションが非常に短い高格付け債券(およびキャッシュ)によって高い利回りを確保することが可能であり、利回りが低い金といった資産と比べて非常に魅

力的なキャッシュフローを獲得することができるため、金関連の証券は限定的な保有としています。

- ・ 現金等については、ポートフォリオのリスクを抑制する目的や、今後の投資機会に活用するため、高い水準の保有を維持しました。

## <BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は-1.2%と下落しました。当期、主要投資対象ファンドである「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」が+10.8%と上昇した一方、当該ファンドは米ドル建てのため、米ドルが円に対して下落したことがマイナス要因となりました。

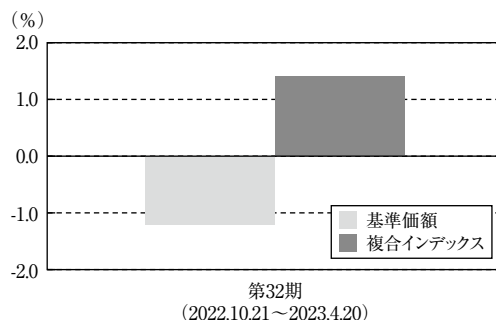
### ■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

| 組入ファンド                 | 騰落率   |
|------------------------|-------|
| BGF グローバル・アロケーション・ファンド | 10.8% |

### ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。下記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

### ■基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



### 分配金について

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

### ■分配原資の内訳(1万口当り)

| 項目         | 当期                          |
|------------|-----------------------------|
|            | 2022年10月21日<br>～ 2023年4月20日 |
| 当期分配金(税込み) | -円                          |
| 対基準価額比率    | -%                          |
| 当期の収益      | -円                          |
| 当期の収益以外    | -                           |
| 翌期繰越分配対象額  | 9,072                       |

(注1)「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。

また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

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

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

## 今後の運用方針について

### <当ファンド>

引き続き主要投資対象ファンドである「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」を高位に組入れる運用を行う方針です。

投資先ファンドにおける市場見通しおよび今後の運用方針は以下の通りです。

### <BGF グローバル・アロケーション・ファンド>

株式は、参照ベンチマークに対するアンダーウェイトを維持しつつ、優良企業や価格決定力のある企業を選好しています。銀行セクターの危機が伝播するリスクはひとまず回避されたものの、米国の多くの地方銀行で預金流出が発生したため、これは今後の銀行による信用供与を抑制し、景気の押し下げ要因となる恐れがあります。さらに、米国株式のバリュエーションは過去の水準と比べて割安ではなく、米国の短期金利は高止まりしています。こうした環境の中で、当ファンドは株式のアンダーウェイトを維持していますが、米国以外の資産については建設的な見方を強めています。銘柄選択を重視し、優良企業や価格決定力のある企業をポートフォリオの中核に据え、経済成長が減速する中でも安定的にキャッシュフローを創出できると考えられる企業に注目しています。

債券ポートフォリオに関しては、米国の短期金利は過去と比べて高い水準にあるため、債券についても前向きな見方を強めています。当ファンドでは米国の利上げが最終局面に入っていると判断しているため、デュレーションへの配分を増やし、ベンチマークと同等の配分に近づけました。また、インカムを生み出す資産を通じて質の高い利回りを確保すると同時に、一定のキャッシュ比率を維持し、デリバティブも活用しています。

### <BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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

## ◇ファンド状況

## ■ 1万口当りの費用明細

| 項目           | 第32期                   |         | 項目の概要   |
|--------------|------------------------|---------|---|
|              | (2022.10.21～2023.4.20) |         |   |
|              | 金額                     | 比率      |   |
| (a) 信託報酬     | 156                    | 0.839   | 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は18,647円です。                      |
| (投信会社)       | ( 77)                  | (0.411) | 投信会社分は、委託した資金の運用の対価   |
| (販売会社)       | ( 77)                  | (0.411) | 販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                 |
| (受託銀行)       | ( 3)                   | (0.016) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                    |
| (b) 売買委託手数料  | -                      | -       | 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税  | -                      | -       | 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数<br>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    | 16                     | 0.087   | その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数   |
| (保管費用)       | ( 6)                   | (0.031) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                |
| (印刷費用・監査費用等) | ( 10)                  | (0.055) | 目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用                   |
| (その他)        | ( 0)                   | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用  |
| 合計           | 173                    | 0.926   |   |

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

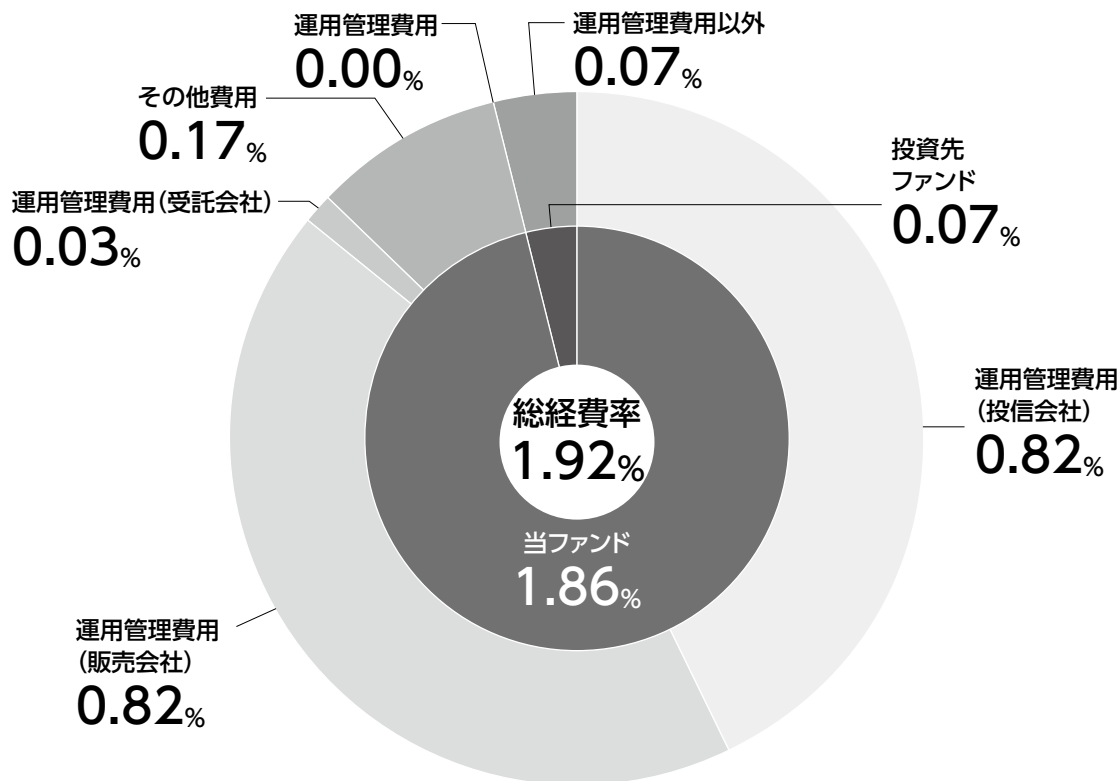
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



## (参考情報)

## ■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.92%です。

|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③)          | 1.92% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.86% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.00% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.07% |

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

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5)①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

## ◇運用内容

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

当期における売買はありません。

## ■主要な売買銘柄

当期における売買はありません。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2022年10月21日から2023年4月20日まで)

当期における株式の売買はありません。

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

上期期間における利害関係人との取引はありません。

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

## ■組入資産の明細

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名                           | 当 期 末 |        |        | 比 率  |
|---------------------------------|-------|--------|--------|------|
|                                 | 口 数   | 評 価 額  |        |      |
|                                 |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額 |      |
| BGF グローバル・アロケーション・ファンド          | 千口    | 千米ドル   | 百万円    | %    |
| BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド | 181   | 16,059 | 2,166  | 97.9 |
|                                 | 10    | 163    | 22     | 1.0  |
| 合 計                             | 191   | 16,223 | 2,188  | 98.9 |

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

(注2) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2023年4月20日現在

| 項 目                     | 当 期 末     |       |
|-------------------------|-----------|-------|
|                         | 評 価 額     | 比 率   |
|                         | 千円        | %     |
| 投 資 信 託 証 券             | 2,188,882 | 98.0  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 43,931    | 2.0   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 2,232,814 | 100.0 |

(注1) 当期末における外貨建資産(2,188,882千円)の投資信託財産総額(2,232,814千円)に対する比率は、98.0%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米ドル=134.92円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年4月20日現在

| 項 目                         | 当 期 末           |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産                     | 2,232,814,102 円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等             | 43,931,563      |
| 投 資 証 券 ( 評 価 額 )           | 2,188,882,539   |
| (B) 負 債                     | 19,682,150      |
| 未 払 解 約 金                   | 352,174         |
| 未 払 信 託 報 酬                 | 18,144,141      |
| そ の 他 未 払 費 用               | 1,185,835       |
| (C) 純 資 産 総 額 ( A - B )     | 2,213,131,952   |
| 元 本                         | 1,164,872,044   |
| 次 期 繰 越 損 益 金               | 1,048,259,908   |
| (D) 受 益 権 総 口 数             | 1,164,872,044 口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 ( C / D ) | 18,999 円        |

(注記事項)

期首元本額

1,154,511,048 円

期中追加設定元本額

25,481,885 円

期中一部解約元本額

15,120,889 円

## ■損益の状況

自 2022年10月21日 至 2023年4月20日

| 項 目                     | 当 期             |
|-------------------------|-----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益     | △ 6,553,594 円   |
| 売 買 益                   | 212,923,025     |
| 売 買 損                   | △ 219,476,619   |
| (B) 信 託 報 酬 等           | △ 20,025,612    |
| (C) 当 期 損 益 金 ( A + B ) | △ 26,579,206    |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金       | 645,183,129     |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金     | 429,655,985     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )         | ( 411,664,943 ) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )       | ( 17,991,042 )  |
| (F) 合 計 ( C + D + E )   | 1,048,259,908   |
| 次 期 繰 越 損 益 金 ( F )     | 1,048,259,908   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金         | 429,655,985     |
| ( 配 当 等 相 当 額 )         | ( 411,664,943 ) |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )       | ( 17,991,042 )  |
| 分 配 準 備 積 立 金           | 645,183,129     |
| 繰 越 損 益 金               | △ 26,579,206    |

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

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

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

## ■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第32期計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(411,664,943円)、分配準備積立金(645,183,129円)により、分配対象収益は1,056,848,072円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

## &lt;参考情報&gt;

**ブラックロック・グローバル・ファンズ  
グローバル・アロケーション・ファンドの運用状況について  
(計算期間:2021年9月1日～2022年8月31日)**

ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人)グローバル・アロケーション・ファンド(以下BGF グローバル・アロケーション・ファンド)はブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(8月末日)です。従って、入手可能な直前の計算期間(決算)である2022年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

| BGF グローバル・アロケーション・ファンド      |   |
|-----------------------------|---|
| 商 品 分 類                     | ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)   |
| 投 資 目 的<br>お よ び<br>投 資 態 度 | トータル・リターンを最大化することを目指します。ファンドは、世界の株式、債券および短期証券に特に制限なく投資します。通常の市況では、純資産の70%以上を国や企業が発行する有価証券に投資します。ファンドは、割安と判断される有価証券へ投資します。ファンドは、小規模企業および新興国の成長企業の株式に、また債券の投資部分においてはハイ・イールド債券にも投資することができます。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。 |
| 設 定 日                       | 1997年1月3日   |
| 存 続 期 間                     | 無期限   |
| 主 な 投 資 制 限                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。</li> </ul>                         |
| 管 理 報 酬                     | ありません。(注)   |
| そ の 他 費 用                   | 保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。  |
| 決 算 日                       | 年1回(原則として8月末日)に決算を行います。   |
| 収 益 分 配 方 針                 | 分配を行いません。   |
| 申 込 手 数 料                   | ありません。  |
| 管 理 会 社                     | ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー   |
| 投 資 顧 問 会 社                 | ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー  |
| 保 管 会 社                     | ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ   |

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

## 損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドは、BGF グローバル・アロケーション・ファンドのクラスJ投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

|                         | BGF グローバル・<br>アロケーション・ファンド<br>米ドル |
|-------------------------|-----------------------------------|
| <b>期首純資産</b>            | 18,768,461,196                    |
| <b>収益</b>               |                                   |
| 預金利息                    | 406,105                           |
| 債券利息、源泉徴収税控除後           | 112,866,334                       |
| スワップ利息                  | 28,570,292                        |
| 差金決済契約に係る受取利息           | 53,100                            |
| 短期金融商品預け入れによる利息         | 52,976                            |
| 集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後  | 1,150,568                         |
| 配当金、源泉徴収税控除後            | 165,620,430                       |
| 差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後      | 13,998                            |
| 有価証券貸付による収益             | 2,366,590                         |
| 投資運用報酬リベート              | 71,764                            |
| その他の払戻し                 | 62,916                            |
| <b>収益合計</b>             | 311,235,073                       |
| <b>費用</b>               |                                   |
| スワップ利息                  | 11,066,220                        |
| 差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後      | 1,927,089                         |
| 年間サービス費用                | 31,862,003                        |
| ローン・コミットメント・フィー         | 117,105                           |
| 保管および預託報酬               | 2,164,905                         |
| 販売報酬                    | 15,231,194                        |
| 税金                      | 7,184,555                         |
| 投資運用報酬                  | 210,652,502                       |
| <b>費用合計</b>             | 280,205,573                       |
| <b>純利益</b>              | 31,029,500                        |
| 以下に係る実現純評価益／(損)：        |                                   |
| 投資有価証券                  | 566,315,741                       |
| 事後通告証券契約                | ( 3,163,067)                      |
| 差金決済契約                  | 37,430,485                        |
| 上場先物取引                  | 110,580,444                       |
| オプション／スワップション契約         | 39,134,606                        |
| スワップ取引                  | 33,508,814                        |
| 先渡為替予約                  | ( 762,326,456)                    |
| その他の取引に係る外国通貨           | 32,980,022                        |
| <b>当期実現純評価益／(損)</b>     | 54,460,589                        |
| 以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：   |                                   |
| 投資有価証券                  | ( 3,320,399,957)                  |
| 事後通告証券契約                | ( 2,139,296)                      |
| 差金決済契約                  | 4,332,461                         |
| 上場先物取引                  | 26,509,611                        |
| オプション／スワップション契約         | ( 44,087,563)                     |
| スワップ取引                  | ( 40,140,602)                     |
| 先渡為替予約                  | ( 111,673,560)                    |
| その他の取引に係る外国通貨           | ( 465,435)                        |
| <b>当期末実現評価益／(損)の純変動</b> | ( 3,488,064,341)                  |
| <b>運用成績による純資産の減少</b>    | ( 3,402,574,252)                  |
| <b>資本の変動</b>            |                                   |
| 投資証券発行による正味受取額          | 3,249,295,034                     |
| 投資証券買戻しによる正味支払額         | ( 3,508,196,590)                  |
| <b>資本の変動による純資産の減少</b>   | ( 258,901,556)                    |
| 配当金宣言額                  | ( 10,173,670)                     |
| <b>期末純資産</b>            | 15,096,811,718                    |

BGF グローバル・アロケーション・ファンド  
 投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

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

| 保有高                   | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------------------|---|-------------|--------------|
| <b>ファンド</b>           |   |             |              |
| 1,474,946             | <b>アイルランド</b><br>iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF         | 11,135,842  | 0.08         |
| 1,609,000             | <b>ルクセンブルグ</b><br>BlackRock Global Funds - Emerging Markets Bond Fund | 31,681,210  | 0.21         |
| 44,961                | BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund | 4,934,020   | 0.03         |
|                       |   | 36,615,230  | 0.24         |
| 181,119               | <b>米国</b><br>SPDR Gold Shares   | 28,955,495  | 0.19         |
| ファンド合計                |   | 76,706,567  | 0.51         |
| <b>普通／優先株式およびワラント</b> |   |             |              |
| <b>オーストラリア</b>        |   |             |              |
| 368,343               | AGL Energy*   | 1,938,776   | 0.01         |
| 26,796                | Australia & New Zealand Banking                                       | 419,266     | 0.01         |
| 576,585               | BHP*  | 15,880,209  | 0.11         |
| 8,330                 | CSL   | 1,675,816   | 0.01         |
| 419,084               | Endeavour*  | 2,088,091   | 0.02         |
| 126,864               | Goodman   | 1,710,239   | 0.01         |
| 210,190               | QBE Insurance   | 1,738,735   | 0.01         |
| 2,889,032             | South32   | 8,217,022   | 0.05         |
| 207,581               | Treasury Wine Estates   | 1,876,490   | 0.01         |
| 88,592                | Woodside Energy   | 2,031,130   | 0.01         |
|                       |   | 37,575,774  | 0.25         |
| <b>ベルギー</b>           |   |             |              |
| 50,169                | KBC   | 2,383,051   | 0.02         |
| <b>バミューダ</b>          |   |             |              |
| 441,861               | Bunge   | 43,558,657  | 0.29         |
| 78,000                | China Gas   | 110,710     | 0.00         |
| 194,800               | China Resources Gas   | 760,724     | 0.01         |
| 72,500                | Orient Overseas International   | 2,030,362   | 0.02         |
| 43,902                | Signet Jewelers   | 2,879,532   | 0.02         |
|                       |   | 49,339,985  | 0.34         |
| <b>ブラジル</b>           |   |             |              |
| 400,702               | Embraer   | 1,113,151   | 0.01         |
| 155,838               | Engie Brasil Energia  | 1,226,502   | 0.01         |
| 163,391               | Hapvida Participacoes e Investimentos                                 | 232,001     | 0.00         |
| 360,352               | Petroleo Brasileiro   | 2,281,273   | 0.02         |
| 417,507               | Sendas Distribuidora  | 1,485,687   | 0.01         |
| 216,851               | Usinas Siderurgicas de Minas Gerais Usiminas                          | 338,072     | 0.00         |
| 118,161               | Vale  | 1,481,698   | 0.01         |
|                       |   | 8,158,384   | 0.06         |
| <b>英領バージン諸島</b>       |   |             |              |
| 388,504               | Capri*  | 18,865,754  | 0.12         |
| <b>カナダ</b>            |   |             |              |
| 52,194                | Barrick Gold*   | 775,004     | 0.00         |
| 41,952                | Canadian Imperial Bank of Commerce                                    | 2,007,417   | 0.01         |
| 30,376                | Canadian National Railway   | 3,614,786   | 0.03         |
| 2,675,913             | Enbridge*   | 111,416,413 | 0.74         |

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

| 保有高       | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
|           | <b>カナダ(続き)</b>                                 |             |              |
| 8,883     | George Weston                                  | 1,032,739   | 0.01         |
| 35,320    | Imperial Oil*                                  | 1,736,870   | 0.01         |
| 361,986   | Lions Gate Entertainment                       | 3,779,134   | 0.02         |
| 76,946    | Nutrien  | 7,040,356   | 0.05         |
| 34,345    | Pembina Pipeline*                              | 1,211,643   | 0.01         |
| 205,365   | TC Energy*                                     | 9,973,776   | 0.06         |
| 31,378    | Waste Connections                              | 4,394,803   | 0.03         |
|           |  | 146,982,941 | 0.97         |
|           | <b>ケイマン諸島</b>                                  |             |              |
| 100,000   | AAC Technologies*                              | 186,275     | 0.00         |
| 2,377,356 | Alibaba  | 28,563,643  | 0.19         |
| 50,800    | ANTA Sports Products                           | 614,239     | 0.00         |
| 221,500   | ASMP T   | 1,722,928   | 0.01         |
| 48,900    | Baidu  | 881,603     | 0.01         |
| 298,000   | China Feihe                                    | 247,175     | 0.00         |
| 212,000   | China Hongqiao                                 | 206,906     | 0.00         |
| 183,000   | China Mengniu Dairy                            | 831,224     | 0.01         |
| 482,000   | China Resources Cement                         | 297,849     | 0.00         |
| 106,000   | China Resources Land                           | 435,555     | 0.00         |
| 1,380,000 | Country Garden Services                        | 2,735,876   | 0.02         |
| 296,500   | Dali Foods                                     | 135,621     | 0.00         |
| 1,463,182 | Diversey*                                      | 9,203,415   | 0.06         |
| 19,700    | ENN Energy                                     | 287,144     | 0.00         |
| 1,024,000 | Haidilao International                         | 2,426,725   | 0.02         |
| 499,375   | Hedosophia European Growth                     | 4,945,943   | 0.03         |
| 169,284   | Hedosophia European Growth (Wts 13/5/2027)*    | 25,403      | 0.00         |
| 154,452   | Highland Transcend Partners I (Wts 31/12/2027) | 14,827      | 0.00         |
| 364,400   | Hygeia Healthcare                              | 1,980,182   | 0.01         |
| 900,550   | JD Health International*                       | 6,270,551   | 0.04         |
| 130,078   | JD.com   | 4,090,314   | 0.03         |
| 2,994,000 | Jinxin Fertility                               | 1,956,937   | 0.01         |
| 739,200   | Kingsoft                                       | 2,260,377   | 0.02         |
| 403,927   | Li Auto  | 11,750,236  | 0.08         |
| 196,100   | Meituan  | 4,742,218   | 0.03         |
| 8,660,000 | Microport Cardioflow Medtech                   | 3,133,602   | 0.02         |
| 672,000   | Ming Yuan Cloud                                | 557,388     | 0.00         |
| 63,075    | NetEase  | 1,139,571   | 0.01         |
| 450,474   | NU   | 2,198,313   | 0.01         |
| 145,200   | Sands China                                    | 327,452     | 0.00         |
| 64,600    | Shenzhou International                         | 677,803     | 0.00         |
| 749,000   | SITC International*                            | 1,908,620   | 0.01         |
| 1,089,900 | Tencent  | 45,436,788  | 0.30         |
| 436,000   | Tingyi Cayman Islands                          | 775,496     | 0.01         |
| 194,042   | TPB Acquisition I                              | 1,888,029   | 0.01         |
| 64,680    | TPB Acquisition I (Wts 19/2/2023)              | 19,411      | 0.00         |
| 41,240    | TPG Pace Beneficial Finance (Wts 9/10/2027)    | 2,474       | 0.00         |
| 574,000   | Want Want China*                               | 405,163     | 0.00         |
| 938,500   | WH   | 640,924     | 0.00         |
| 356,297   | Wuxi Biologics Cayman                          | 3,164,118   | 0.02         |
| 90,000    | Zhongsheng                                     | 427,146     | 0.00         |
|           |  | 149,515,464 | 0.96         |
|           | <b>チリ</b>                                      |             |              |
| 44,620    | Sociedad Quimica y Minera de Chile             | 4,524,468   | 0.03         |



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

| 保有高       | 銘柄                                     | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
|           | <b>中国</b>                              |             |              |
| 7,019,000 | Agricultural Bank of China             | 2,298,349   | 0.02         |
| 482,779   | Aier Eye Hospital                      | 2,058,770   | 0.01         |
| 648,033   | Amoy Diagnostics                       | 2,353,938   | 0.02         |
| 10,100    | Anhui Gujing Distillery                | 154,487     | 0.00         |
| 87,962    | Asymchem Laboratories Tianjin          | 2,187,271   | 0.01         |
| 1,265,000 | Bank of China                          | 444,844     | 0.00         |
| 30,500    | BYD                                    | 941,199     | 0.01         |
| 503,100   | BYD                                    | 21,000,684  | 0.14         |
| 5,037,000 | China Construction Bank                | 3,125,421   | 0.02         |
| 266,000   | China Life Insurance                   | 382,295     | 0.00         |
| 212,000   | China Merchants Bank*                  | 1,088,550   | 0.01         |
| 1,086,000 | China National Building Material       | 1,029,462   | 0.01         |
| 276,800   | China Pacific Insurance                | 587,555     | 0.00         |
| 5,774,000 | China Petroleum & Chemical             | 2,729,345   | 0.02         |
| 68,500    | China Tourism Duty Free                | 1,941,128   | 0.01         |
| 395,900   | Contemporary Amperex Technology        | 27,717,204  | 0.18         |
| 819,600   | COSCO SHIPPING                         | 1,230,141   | 0.01         |
| 1,088,000 | Dongfeng Motor                         | 691,731     | 0.01         |
| 285,060   | Foshan Haitian Flavouring & Food       | 3,328,684   | 0.02         |
| 1,016,800 | Ganfeng Lithium*                       | 8,984,412   | 0.06         |
| 339,592   | Glodon                                 | 2,414,422   | 0.02         |
| 1,530,500 | Great Wall Motor*                      | 2,316,634   | 0.02         |
| 429,200   | Gree Electric Appliances of Zhuhai     | 1,986,440   | 0.01         |
| 1,768,600 | Guangzhou Baiyun International Airport | 3,463,393   | 0.02         |
| 79,000    | Haier Smart Home                       | 259,690     | 0.00         |
| 607,594   | Hangzhou Robam Appliances              | 2,214,972   | 0.02         |
| 186,100   | Hangzhou Tigermed Consulting*          | 1,851,847   | 0.01         |
| 675,625   | Hundsun Technologies                   | 3,294,416   | 0.02         |
| 6,723,000 | Industrial & Commercial Bank of China  | 3,426,342   | 0.02         |
| 492,800   | Jiangsu Hengrui Medicine               | 2,475,803   | 0.02         |
| 42,900    | JiuGui Liquor                          | 928,149     | 0.01         |
| 13,300    | Kweichow Moutai                        | 3,709,142   | 0.03         |
| 282,400   | Nongfu Spring*                         | 1,685,706   | 0.01         |
| 3,170,000 | PetroChina                             | 1,498,445   | 0.01         |
| 168,100   | Pharmaron Beijing                      | 1,116,940   | 0.01         |
| 740,000   | PICC Property & Casualty               | 801,417     | 0.01         |
| 213,000   | Ping An Insurance of China             | 1,257,874   | 0.01         |
| 64,400    | SG Micro                               | 1,495,427   | 0.01         |
| 85,500    | Shanghai Fosun Pharmaceutical          | 276,154     | 0.00         |
| 238,000   | Shanghai Jinjiang International Hotels | 1,991,224   | 0.01         |
| 199,900   | TBEA                                   | 718,011     | 0.01         |
| 673,307   | Venustech                              | 1,835,772   | 0.01         |
| 513,630   | Wuhan Raycus Fiber Laser Technologies  | 2,115,137   | 0.01         |
| 174,202   | WuXi AppTec                            | 2,263,707   | 0.02         |
| 147,792   | Yifeng Pharmacy Chain                  | 1,143,955   | 0.01         |
| 983,460   | Yonyou Network Technology              | 2,863,871   | 0.02         |
| 880,000   | Zijin Mining                           | 1,002,370   | 0.01         |
| 296,900   | Zijin Mining                           | 378,712     | 0.00         |
| 335,600   | ZTE                                    | 711,513     | 0.00         |
|           |  | 135,772,955 | 0.92         |
|           | <b>キュラソー</b>                           |             |              |
| 215,694   | Schlumberger                           | 8,181,273   | 0.06         |

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

| 保有高       | 銘柄                               | 時価<br>(米ドル)        | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|----------------------------------|--------------------|--------------|
|           | <b>デンマーク</b>                     |                    |              |
| 669       | AP Moller - Maersk               | 1,599,131          | 0.01         |
| 59,234    | DSV                              | 8,708,865          | 0.06         |
| 149,020   | Novo Nordisk                     | 15,976,190         | 0.10         |
| 19,158    | Pandora                          | 1,162,243          | 0.01         |
|           |                                  | <u>27,446,429</u>  | <u>0.18</u>  |
|           | <b>フィンランド</b>                    |                    |              |
| 169,284   | Fortum                           | 1,700,344          | 0.01         |
| 23,246    | Kone                             | 937,915            | 0.01         |
| 188,033   | Wartsila                         | 1,563,604          | 0.01         |
|           |                                  | <u>4,201,863</u>   | <u>0.03</u>  |
|           | <b>フランス</b>                      |                    |              |
| 219,944   | Arkema                           | 18,628,483         | 0.12         |
| 180,744   | Atos*                            | 1,840,767          | 0.01         |
| 458,129   | BNP Paribas                      | 21,408,427         | 0.14         |
| 60,282    | Carrefour*                       | 1,002,319          | 0.01         |
| 814,624   | Cie de Saint-Gobain*             | 33,063,537         | 0.22         |
| 362,443   | Danone*                          | 19,007,449         | 0.13         |
| 63,694    | Engie                            | 760,961            | 0.01         |
| 160,447   | EssilorLuxottica*                | 24,462,659         | 0.16         |
| 13,822    | Hermes International             | 18,017,827         | 0.12         |
| 4,656     | Kering                           | 2,380,707          | 0.02         |
| 68,690    | La Francaise des Jeux SAEM       | 2,252,628          | 0.01         |
| 151,255   | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton | 99,523,280         | 0.66         |
| 4,663     | Remy Cointreau                   | 875,622            | 0.00         |
| 15,508    | Schneider Electric               | 1,874,173          | 0.01         |
| 190,665   | Societe Generale                 | 4,226,957          | 0.03         |
| 178,200   | TotalEnergies                    | 9,029,719          | 0.06         |
|           |                                  | <u>258,355,515</u> | <u>1.71</u>  |
|           | <b>ドイツ</b>                       |                    |              |
| 6,427     | adidas                           | 964,980            | 0.00         |
| 41,663    | BASF                             | 1,752,684          | 0.01         |
| 270,212   | Commerzbank                      | 1,786,331          | 0.01         |
| 11,266    | Deutsche Boerse                  | 1,908,719          | 0.01         |
| 3,249,583 | Deutsche Telekom*                | 61,456,588         | 0.41         |
| 63,577    | Fresenius                        | 1,574,209          | 0.01         |
| 36,267    | Fresenius Medical Care           | 1,243,768          | 0.01         |
| 8,848     | Henkel                           | 573,951            | 0.00         |
| 310,768   | Infineon Technologies            | 7,671,505          | 0.05         |
| 1,162,855 | Mercedes-Benz*                   | 66,008,824         | 0.44         |
| 56,765    | Porsche Automobil                | 4,037,731          | 0.03         |
| 735,569   | SAP*                             | 63,175,809         | 0.42         |
| 782,323   | Siemens*                         | 80,332,233         | 0.53         |
| 50,108    | Symrise                          | 5,288,672          | 0.04         |
| 665,500   | Telefonica Deutschland*          | 1,715,732          | 0.01         |
| 122,822   | Uniper                           | 650,008            | 0.00         |
| 1,614,196 | Vantage Towers                   | 41,825,692         | 0.28         |
| 20,197    | Volkswagen                       | 2,901,943          | 0.02         |
|           |                                  | <u>344,869,379</u> | <u>2.28</u>  |
|           | <b>ガーンジー</b>                     |                    |              |
| 608,833   | Genius Sports*                   | 2,551,010          | 0.02         |
| 111,286   | Genius Sports (Wts 31/12/2028)   | 87,927             | 0.00         |
|           |                                  | <u>2,638,937</u>   | <u>0.02</u>  |

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

| 保有高        | 銘柄                           | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|------------|------------------------------|-------------|--------------|
|            | <b>香港</b>                    |             |              |
| 3,685,400  | AIA                          | 35,663,182  | 0.24         |
| 21,500     | BYD Electronic International | 57,252      | 0.00         |
| 130,000    | China Resources Power        | 259,384     | 0.00         |
| 604,000    | CSPC Pharmaceutical          | 614,881     | 0.00         |
| 2,286,000  | Lenovo                       | 1,893,203   | 0.01         |
|            |                              | 38,487,902  | 0.25         |
|            | <b>インド</b>                   |             |              |
| 88,916     | HCL Technologies             | 1,050,712   | 0.01         |
| 522,816    | Indian Oil                   | 470,453     | 0.00         |
| 372,553    | Vedanta                      | 1,267,113   | 0.01         |
|            |                              | 2,788,278   | 0.02         |
|            | <b>アイルランド</b>                |             |              |
| 76,984     | Allegion                     | 7,428,186   | 0.05         |
| 16,090     | ICON                         | 3,417,677   | 0.02         |
| 54,574     | Kingspan                     | 3,133,898   | 0.02         |
| 40,579     | Linde                        | 11,539,450  | 0.08         |
| 24,847     | Seagate Technology           | 1,647,853   | 0.01         |
| 8,662      | Trane Technologies           | 1,350,059   | 0.01         |
| 11,966     | Willis Towers Watson         | 2,486,535   | 0.02         |
|            |                              | 31,003,658  | 0.21         |
|            | <b>イスラエル</b>                 |             |              |
| 248,327    | Nice                         | 54,023,539  | 0.36         |
|            | <b>イタリア</b>                  |             |              |
| 484,283    | Enel                         | 2,308,118   | 0.02         |
| 25,066     | FinecoBank Banca Fineco      | 274,466     | 0.00         |
| 18,789,767 | Intesa Sanpaolo              | 32,603,015  | 0.21         |
| 111,501    | UniCredit                    | 1,092,957   | 0.01         |
|            |                              | 36,278,556  | 0.24         |
|            | <b>日本</b>                    |             |              |
| 6,700      | AGC                          | 229,278     | 0.00         |
| 112,000    | Astellas Pharma              | 1,601,268   | 0.01         |
| 7,300      | BayCurrent Consulting*       | 2,182,558   | 0.01         |
| 700        | Capcom                       | 19,214      | 0.00         |
| 37,900     | CyberAgent*                  | 373,799     | 0.00         |
| 17,400     | East Japan Railway           | 907,450     | 0.01         |
| 8,600      | Eisai*                       | 352,971     | 0.00         |
| 334,200    | FANUC*                       | 54,257,385  | 0.36         |
| 68,300     | Food & Life*                 | 1,087,938   | 0.01         |
| 8,900      | Fujitsu                      | 1,062,126   | 0.01         |
| 287,600    | Hino Motors*                 | 1,321,918   | 0.01         |
| 56,100     | Honda Motor*                 | 1,505,107   | 0.01         |
| 297,352    | Hoya                         | 30,526,750  | 0.20         |
| 132,600    | Inpex                        | 1,532,296   | 0.01         |
| 212,800    | Japan Post Bank*             | 1,554,549   | 0.01         |
| 21,400     | Kao                          | 933,518     | 0.01         |
| 31,619     | Keyence*                     | 12,036,654  | 0.08         |
| 139,700    | Kose*                        | 13,325,369  | 0.09         |
| 62,900     | Kyowa Kirin                  | 1,420,637   | 0.01         |
| 202,500    | Mazda Motor*                 | 1,795,882   | 0.01         |
| 157,400    | Mitsubishi Electric*         | 1,608,529   | 0.01         |
| 26,400     | Morinaga Milk Industry*      | 811,181     | 0.00         |
| 22,700     | Oracle Japan                 | 1,365,549   | 0.01         |

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

| 保有高       | 銘柄                                    | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|---------------------------------------|-------------|--------------|
|           | <b>日本(続き)</b>                         |             |              |
| 168,403   | Recruit                               | 5,438,929   | 0.04         |
| 135,400   | Ryohin Keikaku*                       | 1,268,110   | 0.01         |
| 53,200    | Sega Sammy                            | 794,522     | 0.01         |
| 4,200     | Shin-Etsu Chemical*                   | 493,664     | 0.00         |
| 32,900    | Shionogi*                             | 1,612,706   | 0.01         |
| 27,800    | SoftBank*                             | 1,113,963   | 0.01         |
| 7,700     | Sysmex*                               | 477,239     | 0.00         |
| 53,600    | Terumo*                               | 1,740,006   | 0.01         |
| 62,100    | Yamato*                               | 975,311     | 0.01         |
| 93,900    | ZOZO*                                 | 2,103,879   | 0.01         |
|           |                                       | 147,830,255 | 0.98         |
|           | <b>ジャージー</b>                          |             |              |
| 301,568   | Aptiv                                 | 28,680,625  | 0.19         |
| 88,487    | Aptiv                                 | 9,727,376   | 0.06         |
| 67,045    | Experian                              | 2,064,030   | 0.02         |
| 9,174,086 | Glencore                              | 50,405,209  | 0.33         |
|           |                                       | 90,877,240  | 0.60         |
|           | <b>ルクセンブルグ</b>                        |             |              |
| 220,200   | Samsonite International               | 539,796     | 0.00         |
|           | <b>メキシコ</b>                           |             |              |
| 539,928   | Fomento Economico Mexicano            | 3,442,039   | 0.02         |
| 40,242    | Grupo Aeroportuario del Sureste       | 863,027     | 0.01         |
| 107,906   | Grupo Bimbo                           | 370,980     | 0.00         |
|           |                                       | 4,676,046   | 0.03         |
|           | <b>オランダ</b>                           |             |              |
| 21,698    | Adyen                                 | 34,345,369  | 0.23         |
| 333,533   | Akzo Nobel                            | 21,235,187  | 0.14         |
| 148,528   | ASML                                  | 73,523,322  | 0.49         |
| 52,023    | Ferrari                               | 10,130,641  | 0.07         |
| 13,281    | Heineken                              | 1,198,462   | 0.01         |
| 7,202,309 | ING Groep                             | 63,508,506  | 0.42         |
| 176,925   | Koninklijke Ahold Delhaize            | 4,872,844   | 0.03         |
| 51,150    | Koninklijke Philips                   | 857,746     | 0.00         |
| 345,298   | LyondellBasell Industries             | 28,556,145  | 0.19         |
| 67,793    | Stellantis                            | 913,972     | 0.01         |
| 201,017   | STMicroelectronics                    | 7,131,134   | 0.05         |
| 14,759    | Wolters Kluwer                        | 1,475,059   | 0.01         |
|           |                                       | 247,748,387 | 1.65         |
|           | <b>ノルウェー</b>                          |             |              |
| 845,811   | Norsk Hydro                           | 5,779,018   | 0.04         |
| 36,055    | Yara International                    | 1,524,639   | 0.01         |
|           |                                       | 7,303,657   | 0.05         |
|           | <b>ポーランド</b>                          |             |              |
| 52,957    | Polski Koncern Naftowy ORLEN          | 678,162     | 0.00         |
|           | <b>サウジアラビア</b>                        |             |              |
| 4,423     | Dr Sulaiman Al Habib Medical Services | 235,330     | 0.00         |
|           | <b>南アフリカ</b>                          |             |              |
| 51,088    | Kumba Iron Ore*                       | 1,153,703   | 0.01         |

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

| 保有高       | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|---|-------------|--------------|
|           | <b>韓国</b>                                 |             |              |
| 123,481   | Amorepacific                              | 11,355,211  | 0.08         |
| 15,698    | Fila                                      | 366,175     | 0.00         |
| 116,445   | Hana Financial                            | 3,417,043   | 0.02         |
| 2,032     | Kakao                                     | 111,509     | 0.00         |
| 26,775    | KB Financial                              | 989,887     | 0.01         |
| 20,166    | Kia                                       | 1,218,207   | 0.01         |
| 26,018    | LG Chem                                   | 12,293,653  | 0.08         |
| 58,825    | LG Display                                | 686,083     | 0.00         |
| 109,161   | LG Energy Solution                        | 37,745,850  | 0.25         |
| 28,435    | Samsung Electronics                       | 1,269,163   | 0.01         |
| 4,910     | Samsung Fire & Marine Insurance           | 715,824     | 0.00         |
| 36,663    | Samsung SDI                               | 16,391,517  | 0.11         |
| 51,556    | SK Telecom                                | 2,008,200   | 0.02         |
|           |   | <hr/>       | <hr/>        |
|           |   | 88,568,322  | 0.59         |
|           | <b>スペイン</b>                               |             |              |
| 1,362,498 | Cellnex Telecom                           | 53,651,030  | 0.36         |
| 40,134    | Endesa                                    | 690,602     | 0.00         |
| 114,940   | Iberdrola                                 | 1,211,990   | 0.01         |
| 18,399    | Industria de Diseno Textil                | 402,559     | 0.00         |
|           |   | <hr/>       | <hr/>        |
|           |   | 55,956,181  | 0.37         |
|           | <b>スウェーデン</b>                             |             |              |
| 676,432   | Atlas Copco                               | 6,992,245   | 0.04         |
| 356,017   | Epiroc                                    | 5,565,238   | 0.04         |
| 10,380    | Evolution                                 | 842,038     | 0.00         |
| 84,858    | H & M Hennes & Mauritz*                   | 890,375     | 0.01         |
| 576,591   | Hexagon                                   | 6,025,037   | 0.04         |
| 70,831    | Husqvarna                                 | 482,984     | 0.00         |
| 118,178   | Swedbank                                  | 1,542,783   | 0.01         |
| 361,255   | Telefonaktiebolaget LM Ericsson           | 2,716,914   | 0.02         |
| 482,479   | Telia                                     | 1,710,534   | 0.01         |
| 2,713,695 | Volvo                                     | 43,264,669  | 0.29         |
|           |   | <hr/>       | <hr/>        |
|           |   | 70,032,817  | 0.46         |
|           | <b>スイス</b>                                |             |              |
| 65,990    | ABB                                       | 1,837,456   | 0.01         |
| 84,060    | Alcon                                     | 5,604,752   | 0.04         |
| 9,298     | Chubb                                     | 1,776,290   | 0.01         |
| 97,259    | Cie Financiere Richemont*                 | 11,057,930  | 0.07         |
| 2,828     | Cie Financiere Richemont (Wts 22/11/2023) | 1,819       | 0.00         |
| 88,031    | Coca-Cola HBC                             | 2,035,641   | 0.01         |
| 24,417    | Lonza                                     | 13,233,571  | 0.09         |
| 103,536   | Nestle                                    | 12,168,038  | 0.08         |
| 35,879    | Novartis                                  | 2,905,508   | 0.02         |
| 12,885    | Roche                                     | 4,182,431   | 0.03         |
| 42,552    | Sika                                      | 9,719,408   | 0.07         |
| 355,865   | TE Connectivity                           | 45,234,000  | 0.30         |
| 18,901    | Temenos                                   | 1,557,443   | 0.01         |
| 2,106     | VAT*                                      | 511,357     | 0.00         |
|           |   | <hr/>       | <hr/>        |
|           |   | 111,825,644 | 0.74         |
|           | <b>台湾</b>                                 |             |              |
| 122,000   | Evergreen Marine Taiwan                   | 353,925     | 0.00         |
| 62,000    | MediaTek                                  | 1,358,654   | 0.01         |
| 138,000   | Nan Ya Printed Circuit Board              | 1,226,416   | 0.01         |
| 3,646,000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing        | 60,492,194  | 0.40         |

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

| 保有高         | 銘柄                                     | 時価<br>(米ドル)        | 純資産比率<br>(%) |
|-------------|--|--------------------|--------------|
|             | <b>台湾(続き)</b>                          |                    |              |
| 626,000     | Unimicron Technology                   | 3,115,862          | 0.02         |
| 348,000     | United Microelectronics                | 469,907            | 0.00         |
|             |  | <b>67,016,958</b>  | <b>0.44</b>  |
|             | <b>英国</b>                              |                    |              |
| 31,107      | Admiral                                | 772,405            | 0.00         |
| 1,504,973   | Alphawave IP                           | 2,341,044          | 0.02         |
| 413,004     | Anglo American                         | 13,225,234         | 0.09         |
| 469,303     | AstraZeneca                            | 58,880,945         | 0.39         |
| 98,124      | AstraZeneca                            | 6,183,774          | 0.04         |
| 10,359      | Atlassian                              | 2,639,577          | 0.02         |
| 809,893     | Auto Trader                            | 6,167,478          | 0.04         |
| 606,968     | BP                                     | 3,079,801          | 0.02         |
| 88,097      | BP                                     | 2,683,435          | 0.02         |
| 75,222      | Burberry                               | 1,546,027          | 0.01         |
| 1,858,621   | Compass                                | 40,228,083         | 0.27         |
| 224,894     | Dr Martens                             | 617,687            | 0.00         |
| 124,714     | GSK                                    | 2,005,123          | 0.01         |
| 436,055     | Kingfisher                             | 1,169,309          | 0.01         |
| 325,243     | Legal & General                        | 954,467            | 0.01         |
| 140,149,814 | Lloyds Banking                         | 71,617,420         | 0.47         |
| 44,434      | National Grid                          | 559,914            | 0.00         |
| 616,002     | NatWest                                | 1,771,268          | 0.01         |
| 173,585     | Rio Tinto                              | 9,570,595          | 0.06         |
| 544,601     | Shell                                  | 28,684,135         | 0.19         |
| 1,257,071   | Shell                                  | 33,081,501         | 0.22         |
| 32,861      | Smith & Nephew                         | 389,478            | 0.00         |
| 63,609      | Spirax-Sarco Engineering               | 7,945,238          | 0.05         |
| 1,235,512   | Unilever                               | 56,502,047         | 0.38         |
|             |  | <b>352,615,985</b> | <b>2.33</b>  |
|             | <b>米国</b>                              |                    |              |
| 20,940      | 2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust | 25,636,084         | 0.17         |
| 937,947     | Abbott Laboratories                    | 97,049,376         | 0.64         |
| 457,239     | AbbVie                                 | 62,074,767         | 0.41         |
| 114,419     | Activision Blizzard                    | 9,031,092          | 0.06         |
| 20,045      | Adobe                                  | 7,599,460          | 0.05         |
| 15,534      | Advance Auto Parts                     | 2,645,751          | 0.02         |
| 19,101      | Agilent Technologies                   | 2,481,029          | 0.02         |
| 263,561     | Air Products and Chemicals             | 67,563,862         | 0.45         |
| 13,176      | Airbnb                                 | 1,510,101          | 0.01         |
| 118,779     | Albemarle                              | 32,336,395         | 0.21         |
| 310,233     | Alcoa                                  | 15,443,399         | 0.10         |
| 14,172      | Align Technology                       | 3,528,261          | 0.02         |
| 1,798,196   | Alphabet                               | 199,761,593        | 1.32         |
| 4,960       | Alphabet                               | 546,294            | 0.00         |
| 163,409     | Altair Engineering                     | 8,588,777          | 0.06         |
| 448,087     | AltC Acquisition                       | 4,356,526          | 0.03         |
| 99,329      | Altria                                 | 4,481,228          | 0.03         |
| 304,400     | Altus Power                            | 3,211,420          | 0.02         |
| 48,134      | Altus Power (Wts 12/1/2027)            | 137,182            | 0.00         |
| 1,347,352   | Amazon.com                             | 174,953,657        | 1.16         |
| 15,263      | American Express                       | 2,367,139          | 0.02         |
| 339,811     | American Tower                         | 86,777,535         | 0.57         |
| 12,816      | Amgen                                  | 3,115,185          | 0.02         |

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

| 保有高       | 銘柄                         | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|----------------------------|-------------|--------------|
|           | <b>米国(続き)</b>              |             |              |
| 38,898    | ANSYS                      | 9,880,481   | 0.07         |
| 41,988    | APA                        | 1,621,996   | 0.01         |
| 1,624,675 | Apple                      | 260,134,838 | 1.72         |
| 329,615   | Applied Materials          | 31,016,771  | 0.21         |
| 874,558   | Archer-Daniels-Midland     | 76,366,405  | 0.51         |
| 461,453   | Astra Space                | 415,308     | 0.00         |
| 1,117     | AutoZone                   | 2,386,739   | 0.02         |
| 277,284   | Baker Hughes               | 6,812,868   | 0.05         |
| 52,839    | Ball                       | 2,972,722   | 0.02         |
| 1,905,897 | Bank of America            | 65,372,267  | 0.43         |
| 345,952   | Becton Dickinson and       | 17,460,197  | 0.11         |
| 3,690     | Berkshire Hathaway         | 1,055,340   | 0.01         |
| 196,983   | Blend Labs                 | 608,677     | 0.00         |
| 14,687    | Boeing                     | 2,384,434   | 0.02         |
| 7,426     | Booking                    | 14,198,512  | 0.09         |
| 1,412,121 | Boston Scientific          | 57,642,779  | 0.38         |
| 54,071    | Boston Scientific          | 5,664,478   | 0.04         |
| 43,465    | Brown-Forman               | 3,194,895   | 0.02         |
| 97,539    | Cadence Design Systems     | 17,145,405  | 0.11         |
| 266,242   | California Resources       | 13,029,884  | 0.09         |
| 178,074   | Cano Health (Wts 3/6/2026) | 267,111     | 0.00         |
| 3,712     | Capital One Financial      | 397,852     | 0.00         |
| 7,244     | CDW                        | 1,265,237   | 0.01         |
| 28,815    | Centene                    | 2,651,124   | 0.02         |
| 734,111   | CF Industries              | 75,635,456  | 0.50         |
| 1,256,533 | Charles Schwab             | 90,646,291  | 0.60         |
| 86,344    | Charter Communications     | 36,177,273  | 0.24         |
| 51,926    | Chesapeake Energy          | 5,064,862   | 0.03         |
| 19,853    | Chevron                    | 3,120,693   | 0.02         |
| 4,568     | Chipotle Mexican Grill     | 7,417,564   | 0.05         |
| 29,367    | Cigna                      | 8,390,152   | 0.06         |
| 2,834     | Cintas                     | 1,168,997   | 0.01         |
| 40,095    | Cisco Systems              | 1,817,506   | 0.01         |
| 387,410   | Citigroup Capital XIII     | 10,615,034  | 0.07         |
| 54,119    | CME                        | 10,690,667  | 0.07         |
| 1,040,470 | Comcast                    | 37,758,656  | 0.25         |
| 1,280,699 | ConocoPhillips             | 138,686,895 | 0.92         |
| 13,696    | Copart                     | 1,651,464   | 0.01         |
| 85,128    | Corteva                    | 5,228,562   | 0.03         |
| 126,220   | Costco Wholesale           | 66,015,584  | 0.44         |
| 116,907   | Coupang                    | 2,002,617   | 0.01         |
| 196,570   | CrowdStrike                | 37,672,640  | 0.25         |
| 15,138    | Crown                      | 1,392,999   | 0.01         |
| 16,975    | Crown Castle               | 2,914,777   | 0.02         |
| 216,646   | CSX                        | 6,841,681   | 0.05         |
| 39,702    | Darling Ingredients        | 2,983,605   | 0.02         |
| 173,510   | Datadog                    | 18,861,405  | 0.12         |
| 37,500    | DaVita                     | 3,285,750   | 0.02         |
| 103,399   | Deere                      | 37,880,224  | 0.25         |
| 22,886    | Dell Technologies          | 898,047     | 0.01         |
| 63,162    | Delta Air Lines            | 1,997,182   | 0.01         |
| 73,526    | Devon Energy               | 5,126,968   | 0.03         |
| 338,079   | Dexcom                     | 28,327,639  | 0.19         |

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

| 保有高       | 銘柄                                 | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|------------------------------------|-------------|--------------|
|           | <b>米国(続き)</b>                      |             |              |
| 64,189    | Domino's Pizza                     | 24,267,935  | 0.16         |
| 42,917    | Dow                                | 2,177,179   | 0.01         |
| 589,394   | DR Horton                          | 42,566,035  | 0.28         |
| 744,977   | Dynatrace                          | 28,875,308  | 0.19         |
| 33,853    | eBay                               | 1,511,198   | 0.01         |
| 304,399   | Edwards Lifesciences               | 27,876,860  | 0.18         |
| 128,209   | Element Solutions                  | 2,400,073   | 0.02         |
| 11,330    | Elevance Health                    | 5,563,597   | 0.04         |
| 42,678    | Eli Lilly                          | 13,132,021  | 0.09         |
| 78,050    | Embark Technology (Wts 31/12/2027) | 8,929       | 0.00         |
| 32,347    | Emerson Electric                   | 2,688,683   | 0.02         |
| 1,065,900 | EQT                                | 50,097,300  | 0.33         |
| 4,253     | Equinix                            | 2,840,579   | 0.02         |
| 8,542     | Essex Property Trust               | 2,287,291   | 0.02         |
| 35,374    | Eversource Energy                  | 3,199,224   | 0.02         |
| 92,280    | Evgo (Wts 15/9/2025)               | 198,402     | 0.00         |
| 123,235   | Excelerate Energy                  | 3,050,066   | 0.02         |
| 30,187    | Expedia                            | 3,147,599   | 0.02         |
| 1,379,100 | Exscientia                         | 13,342,792  | 0.09         |
| 6,722     | Extra Space Storage                | 1,355,155   | 0.01         |
| 372,814   | Exxon Mobil                        | 35,186,185  | 0.23         |
| 160,641   | F5                                 | 25,548,345  | 0.17         |
| 3,712     | FedEx                              | 790,693     | 0.00         |
| 68,557    | Floor & Decor                      | 5,612,076   | 0.04         |
| 25,800    | FMC                                | 2,787,174   | 0.02         |
| 688,241   | Ford Motor                         | 10,605,794  | 0.07         |
| 360,712   | Fortinet                           | 18,039,208  | 0.12         |
| 1,071,343 | Fortive                            | 68,555,238  | 0.45         |
| 1,835,574 | Freeport-McMoRan                   | 53,910,808  | 0.36         |
| 7,154     | Gartner                            | 2,089,397   | 0.01         |
| 18,822    | Generac                            | 4,204,646   | 0.03         |
| 526,361   | General Motors                     | 20,522,815  | 0.14         |
| 8,774     | Genuine Parts                      | 1,372,341   | 0.01         |
| 59,467    | Gilead Sciences                    | 3,767,234   | 0.02         |
| 34,904    | Gores VIII (Wts 31/12/2027)        | 20,953      | 0.00         |
| 182,670   | Green Plains                       | 6,596,214   | 0.04         |
| 300,480   | Halliburton                        | 8,960,314   | 0.06         |
| 37,965    | Healthpeak Properties              | 1,008,350   | 0.01         |
| 59,993    | Hewlett Packard Enterprise         | 820,704     | 0.01         |
| 270,711   | Hilton Worldwide                   | 34,548,138  | 0.23         |
| 79,631    | Hippo (Wts 2/8/2026)               | 13,537      | 0.00         |
| 172,659   | Home Depot                         | 50,126,361  | 0.33         |
| 44,392    | HP                                 | 1,312,671   | 0.01         |
| 254,745   | Humana                             | 124,239,137 | 0.82         |
| 2,613     | Huntington Ingalls Industries      | 605,667     | 0.00         |
| 301,744   | Informatica                        | 6,750,013   | 0.04         |
| 30,530    | Innovid (Wts 31/12/2027)           | 15,570      | 0.00         |
| 39,151    | Intercontinental Exchange          | 3,976,567   | 0.03         |
| 315,501   | International Flavors & Fragrances | 35,184,672  | 0.23         |
| 62,918    | Intuit                             | 27,490,762  | 0.18         |
| 178,544   | Intuitive Surgical                 | 37,349,619  | 0.25         |
| 16,400    | IQVIA                              | 3,572,248   | 0.02         |
| 377,016   | Johnson & Johnson                  | 61,461,148  | 0.41         |



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

| 保有高       | 銘柄                                 | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|------------------------------------|-------------|--------------|
|           | <b>米国(続き)</b>                      |             |              |
| 16,561    | JPMorgan Chase                     | 1,896,566   | 0.01         |
| 46,673    | Juniper Networks                   | 1,352,350   | 0.01         |
| 90,372    | Kinder Morgan                      | 1,637,993   | 0.01         |
| 4,631     | Laboratory of America              | 1,058,137   | 0.01         |
| 2,165     | Lam Research                       | 954,310     | 0.01         |
| 216,912   | Latch (4/6/2026)                   | 32,537      | 0.00         |
| 1,021,318 | Liberty Media Acquisition          | 10,192,753  | 0.07         |
| 609,378   | Liberty Media -Liberty SiriusXM    | 25,636,533  | 0.17         |
| 843,263   | Liberty Media -Liberty SiriusXM    | 35,256,826  | 0.23         |
| 178,087   | Lightning eMotors (Wts 15/12/2025) | 144,921     | 0.00         |
| 22,183    | Live Nation Entertainment          | 2,049,266   | 0.01         |
| 16,794    | LKQ                                | 889,242     | 0.01         |
| 75,010    | Lowe's                             | 14,665,205  | 0.10         |
| 4,716     | Lululemon Athletica                | 1,449,840   | 0.01         |
| 653,121   | Marsh & McLennan                   | 107,196,750 | 0.71         |
| 84,168    | Masco                              | 4,286,676   | 0.03         |
| 45,711    | Masimo                             | 6,927,502   | 0.05         |
| 339,414   | Mastercard                         | 112,169,539 | 0.74         |
| 288,314   | McDonald's                         | 73,303,834  | 0.48         |
| 1,712     | MercadoLibre                       | 1,506,149   | 0.01         |
| 623,295   | Merck                              | 53,908,785  | 0.36         |
| 10,122    | Meta Platforms                     | 1,673,268   | 0.01         |
| 1,955     | Mettler-Toledo International       | 2,414,347   | 0.02         |
| 37,320    | MGM Resorts International          | 1,240,144   | 0.01         |
| 521,563   | Micron Technology                  | 29,353,566  | 0.19         |
| 977,359   | Microsoft                          | 259,791,796 | 1.72         |
| 1,755,970 | Mirion Technologies                | 13,599,988  | 0.09         |
| 196,836   | Mirion Technologies                | 1,524,495   | 0.01         |
| 7,875     | Molina Healthcare                  | 2,676,004   | 0.02         |
| 15,137    | MongoDB                            | 5,092,390   | 0.03         |
| 1,872     | Moody's                            | 540,315     | 0.00         |
| 540,019   | Morgan Stanley                     | 45,750,410  | 0.30         |
| 46,724    | Mosaic                             | 2,558,606   | 0.02         |
| 78,649    | Mr Cooper                          | 3,330,785   | 0.02         |
| 28,579    | NetApp                             | 2,065,119   | 0.01         |
| 850,094   | NextEra Energy                     | 73,235,598  | 0.48         |
| 74,875    | NIKE                               | 8,031,841   | 0.05         |
| 12,168    | Norfolk Southern                   | 2,972,703   | 0.02         |
| 203,519   | NVIDIA                             | 31,156,724  | 0.21         |
| 470,584   | Offerpad                           | 734,111     | 0.01         |
| 155,458   | Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)  | 29,864      | 0.00         |
| 77,073    | ONEOK                              | 4,738,448   | 0.03         |
| 174,934   | Otis Worldwide                     | 12,712,454  | 0.08         |
| 6,084     | Packaging of America               | 838,984     | 0.01         |
| 44,094    | Palo Alto Networks                 | 25,063,471  | 0.17         |
| 94,598    | Park Hotels & Resorts              | 1,341,400   | 0.01         |
| 5,403     | Paycom Software                    | 1,948,808   | 0.01         |
| 431,980   | Peloton Interactive                | 4,317,640   | 0.03         |
| 67,798    | PepsiCo                            | 11,762,953  | 0.08         |
| 7,100     | Phillip Morris International       | 678,050     | 0.00         |
| 19,282    | Phillips 66                        | 1,714,555   | 0.01         |
| 117,500   | Pioneer Natural Resources          | 29,360,900  | 0.20         |
| 389,680   | Planet Labs PBC                    | 2,158,827   | 0.01         |

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

| 保有高       | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------|--|-------------|--------------|
|           | <b>米国(続き)</b>                                  |             |              |
| 14,021    | PNC Financial Services                         | 2,234,386   | 0.01         |
| 21,312    | Prologis                                       | 2,712,378   | 0.02         |
| 35,748    | Public Service Enterprise                      | 2,330,412   | 0.02         |
| 10,884    | PVH  | 657,394     | 0.00         |
| 14,146    | Quest Diagnostics                              | 1,784,801   | 0.01         |
| 437,891   | Raymond James Financial                        | 45,838,430  | 0.30         |
| 69,445    | ResMed   | 15,405,679  | 0.10         |
| 281,782   | Rocket Lab USA*                                | 1,611,793   | 0.01         |
| 40,229    | S&P Global                                     | 14,392,729  | 0.10         |
| 437,172   | Salesforce                                     | 70,109,274  | 0.46         |
| 35,467    | Sarcos Technology and Robotics                 | 116,686     | 0.00         |
| 506,358   | Sarcos Technology and Robotics (Wts 24/9/2026) | 182,339     | 0.00         |
| 13,966    | SBA Communications                             | 4,581,686   | 0.03         |
| 177,571   | Seagen   | 27,601,636  | 0.18         |
| 632,369   | Sempra Energy                                  | 105,143,994 | 0.70         |
| 76,708    | ServiceNow                                     | 34,085,200  | 0.23         |
| 17,318    | Snowflake                                      | 3,229,980   | 0.02         |
| 534,112   | Sonder   | 985,437     | 0.01         |
| 32,293    | Southwest Airlines                             | 1,203,560   | 0.01         |
| 34,134    | Splunk   | 3,186,409   | 0.02         |
| 385,635   | Starbucks                                      | 32,520,600  | 0.21         |
| 202,935   | Starwood Property Trust                        | 4,659,388   | 0.03         |
| 607,300   | Sun Country                                    | 12,376,774  | 0.08         |
| 252,920   | Symbotic                                       | 3,110,916   | 0.02         |
| 56,093    | Synchrony Financial                            | 1,852,752   | 0.01         |
| 40,568    | Tapestry                                       | 1,436,513   | 0.01         |
| 85,401    | Tesla  | 23,819,193  | 0.16         |
| 101,246   | Thermo Fisher Scientific                       | 56,377,823  | 0.37         |
| 621,356   | TJX  | 38,548,926  | 0.25         |
| 223,821   | Toast  | 4,272,743   | 0.03         |
| 36,446    | Toll Brothers                                  | 1,626,221   | 0.01         |
| 150,355   | Tractor Supply                                 | 28,156,981  | 0.19         |
| 16,898    | Travelers                                      | 2,757,923   | 0.02         |
| 7,005     | Twilio   | 508,773     | 0.00         |
| 371,195   | United Parcel Service                          | 72,412,721  | 0.48         |
| 28,621    | United Rentals                                 | 8,382,232   | 0.06         |
| 219,858   | UnitedHealth                                   | 115,519,989 | 0.77         |
| 53,150    | Univar Solutions                               | 1,339,911   | 0.01         |
| 131,591   | US Bancorp                                     | 6,045,290   | 0.04         |
| 694,166   | Valero Energy                                  | 80,162,290  | 0.53         |
| 4,963     | Veeva Systems                                  | 1,022,279   | 0.01         |
| 79,128    | VeriSign                                       | 14,427,408  | 0.10         |
| 63,697    | Verisk Analytics                               | 12,010,069  | 0.08         |
| 57,269    | Verizon Communications                         | 2,426,201   | 0.02         |
| 2,420,185 | Vertiv   | 28,195,155  | 0.19         |
| 28,202    | Visa   | 5,701,316   | 0.04         |
| 8,136     | VMware   | 955,410     | 0.01         |
| 95,050    | Volta (Wts 26/8/2026)                          | 57,011      | 0.00         |
| 319,850   | Vulcan Materials                               | 53,216,643  | 0.35         |
| 245,631   | Walmart  | 32,605,059  | 0.22         |
| 406,455   | Walt Disney                                    | 46,006,642  | 0.31         |
| 898,367   | Wells Fargo                                    | 39,851,560  | 0.26         |
| 3,520     | Wells Fargo                                    | 4,400,000   | 0.03         |

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

| 保有高              | 銘柄  | 時価<br>(米ドル)   | 純資産比率<br>(%) |
|------------------|---|---------------|--------------|
|                  | <b>米国(続き)</b>   |               |              |
| 44,581           | Western Digital   | 1,889,789     | 0.01         |
| 202,213          | Weyerhaeuser  | 6,919,729     | 0.05         |
| 192,712          | WillScot Mobile Mini  | 7,800,982     | 0.05         |
| 28,512           | Workday   | 4,748,103     | 0.03         |
| 353,031          | XPO Logistics   | 18,798,901    | 0.12         |
| 40,100           | Yum China   | 1,982,366     | 0.01         |
| 3,292            | Zebra Technologies  | 990,958       | 0.01         |
| 56,820           | Zoetis  | 9,011,652     | 0.06         |
| 86,784           | Zscaler   | 14,438,254    | 0.10         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 5,128,706,375 | 33.96        |
| 普通/優先株式およびワラント合計 |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 7,737,158,963 | 51.24        |
|                  |   | <hr/>         |              |
| <b>債券</b>        |   |               |              |
|                  | <b>アルゼンチン</b>   |               |              |
| USD 21,885,365   | Argentine Republic Government International Bond 0.5% 9/7/2030                    | 5,175,889     | 0.03         |
| USD 2,291,190    | Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029                      | 536,138       | 0.00         |
| USD 26,992,679   | Argentine Republic Government International Bond 1.5% 9/7/2035                    | 6,046,360     | 0.04         |
| USD 8,980,835    | Argentine Republic Government International Bond 3.875% 9/1/2038                  | 2,514,140     | 0.02         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 14,272,527    | 0.09         |
|                  | <b>オーストラリア</b>  |               |              |
| AUD 328,974,000  | Australia Government Bond 1% 21/11/2031   | 179,546,445   | 1.19         |
| USD 115,000      | National Australia Bank 3.375% 14/1/2026  | 112,039       | 0.00         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 179,658,484   | 1.19         |
|                  | <b>オーストリア</b>   |               |              |
| EUR 10,780,000   | Republic of Austria Government Bond 2.1% 20/9/2117                                | 9,205,773     | 0.06         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  | <b>バミューダ</b>  |               |              |
| USD 780,000      | Li & Fung 4.375% 4/10/2024  | 726,040       | 0.01         |
| USD 510,000      | Li & Fung 4.5% 18/8/2025  | 462,667       | 0.00         |
| USD 1,220,000    | Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038 | 1,034,673     | 0.01         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 2,223,380     | 0.02         |
|                  | <b>ブラジル</b>   |               |              |
| BRL 4,043,570    | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024                                     | 62,957,448    | 0.42         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  | <b>英領バージン諸島</b>   |               |              |
| USD 500,000      | Champion Path 4.85% 27/1/2028   | 335,852       | 0.00         |
| USD 378,785      | Easy Tactic 7.5% 11/7/2028  | 45,431        | 0.00         |
| USD 514,000      | Fortune Star BVI 6.85% 2/7/2024   | 338,806       | 0.00         |
| USD 200,000      | Greenland Global Investment 6.125% 22/4/2023                                      | 96,000        | 0.00         |
| USD 900,000      | HKT Capital No 6 3% 18/1/2032   | 775,112       | 0.00         |
| USD 352,000      | New Metro Global 4.5% 2/5/2026  | 142,705       | 0.00         |
| USD 1,172,000    | NWD Finance BVI 4.125% 10/12/2170   | 907,679       | 0.01         |
| USD 585,000      | RKPF Overseas 2020 A 5.2% 12/1/2026   | 239,850       | 0.00         |
| USD 264,909      | Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033                               | 257,951       | 0.00         |
| USD 867,000      | Studio City Finance 5% 15/1/2029  | 468,180       | 0.00         |
| USD 378,000      | Wanda Properties Overseas 6.875% 23/7/2023  | 311,850       | 0.01         |
|                  |   | <hr/>         |              |
|                  |   | 3,919,416     | 0.02         |
|                  | <b>カナダ</b>  |               |              |
| USD 3,450,000    | Bank of Montreal 0.949% 22/1/2027   | 3,086,961     | 0.02         |
| CAD 104,431,000  | Canadian Government Bond 0.25% 1/3/2026   | 71,335,014    | 0.47         |
| USD 4,539,000    | Canadian Pacific Railway 4% 1/6/2028  | 4,470,825     | 0.03         |
| USD 724,000      | Canadian Pacific Railway 4.8% 1/8/2045  | 716,470       | 0.00         |
| USD 1,735,000    | First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026  | 1,686,086     | 0.01         |

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

| 保有高            | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|----------------|---|-------------|--------------|
| <b>カナダ(続き)</b> |   |             |              |
| USD 2,666,000  | First Quantum Minerals 6.875% 15/10/2027            | 2,517,704   | 0.02         |
| USD 5,572,000  | Rogers Communications 2.95% 15/3/2025               | 5,394,460   | 0.04         |
| USD 130,000    | Royal Bank of Canada 0.65% 29/7/2024                | 122,120     | 0.00         |
| USD 335,000    | Royal Bank of Canada 0.75% 7/10/2024                | 312,414     | 0.00         |
| USD 63,000     | Royal Bank of Canada 1.2% 27/4/2026                 | 56,783      | 0.00         |
| USD 3,156,000  | Royal Bank of Canada 3.625% 4/5/2027                | 3,051,288   | 0.02         |
| USD 4,573,000  | Royal Bank of Canada 4.24% 3/8/2027                 | 4,534,540   | 0.03         |
| USD 72,000     | Thomson Reuters 3.35% 15/5/2026                     | 69,947      | 0.00         |
| USD 1,025,000  | Toronto-Dominion Bank/The 2% 10/9/2031              | 836,804     | 0.01         |
| USD 5,086,000  | Toronto-Dominion Bank/The 2.35% 8/3/2024            | 4,970,886   | 0.03         |
| USD 133,000    | Toronto-Dominion Bank/The 2.8% 10/3/2027            | 125,082     | 0.00         |
|                |   | 103,287,384 | 0.68         |
| <b>ケイマン諸島</b>  |   |             |              |
| USD 680,000    | Agile 5.5% 21/4/2025                                | 275,679     | 0.01         |
| USD 828,928    | AGL CLO 5 4.11% 20/7/2034                           | 792,119     | 0.01         |
| USD 1,153,674  | AGL CLO 5 4.41% 20/7/2034                           | 1,108,801   | 0.01         |
| USD 725,000    | AIMCO CLO Series 2017-A 3.76% 20/4/2034             | 702,518     | 0.01         |
| USD 278,501    | AIMCO CLO Series 2018-A 4.14% 17/4/2031             | 271,255     | 0.00         |
| USD 318,000    | Allegro CLO IV 4.062% 15/1/2030                     | 310,303     | 0.00         |
| USD 250,000    | Allegro CLO XI 4.588% 19/1/2033                     | 244,673     | 0.00         |
| USD 1,085,000  | Apidos CLO XV 3.72% 20/4/2031                       | 1,066,826   | 0.01         |
| USD 250,000    | Apidos CLO XXXI 4.062% 15/4/2031                    | 239,448     | 0.00         |
| USD 400,000    | Atrium XIII 4.283% 21/11/2030                       | 388,114     | 0.00         |
| USD 279,432    | BlueMountain CLO 2014-2 4.46% 20/10/2030            | 267,594     | 0.00         |
| USD 250,000    | Canyon CLO 2020-3 4.212% 15/1/2034                  | 237,132     | 0.00         |
| USD 250,000    | CARLYLE US CLO 2018-1 4.21% 20/4/2031               | 239,962     | 0.00         |
| USD 541,794    | Catskill Park CLO 4.06% 20/4/2029                   | 535,627     | 0.01         |
| USD 350,000    | Central China Real Estate 7.9% 7/11/2023            | 136,500     | 0.00         |
| USD 692,352    | Chenango Park CLO 4.062% 15/4/2030                  | 667,841     | 0.01         |
| USD 1,410,000  | China Aoyuan 5.98% 18/8/2025                        | 94,311      | 0.00         |
| USD 600,000    | China Aoyuan 6.35% 8/2/2024                         | 40,500      | 0.00         |
| USD 1,579,000  | China Aoyuan 7.95% 19/2/2023                        | 107,818     | 0.00         |
| USD 358,000    | China Aoyuan 8.5% 23/1/2022                         | 24,165      | 0.00         |
| USD 756,000    | China Evergrande 10% 11/4/2023                      | 56,352      | 0.00         |
| USD 1,512,000  | China Evergrande 11.5% 22/1/2023                    | 112,958     | 0.00         |
| USD 15,900,000 | China Milk Products 0% 5/1/2012                     | 23,850      | 0.00         |
| USD 320,000    | China SCE 5.95% 29/9/2024                           | 90,494      | 0.00         |
| USD 356,000    | China SCE 7.375% 9/4/2024                           | 108,387     | 0.00         |
| USD 387,293    | CIFC Funding 2017-III 4.51% 20/7/2030               | 377,251     | 0.00         |
| USD 250,000    | CIFC Funding 2018-II 3.75% 20/4/2031                | 246,801     | 0.00         |
| USD 520,000    | CIFI 4.45% 17/8/2026*                               | 247,000     | 0.00         |
| USD 378,000    | CIFI 6% 16/7/2025                                   | 198,450     | 0.00         |
| USD 287,000    | Clear Creek CLO 3.91% 20/10/2030                    | 283,680     | 0.00         |
| USD 692,561    | Cook Park CLO 4.14% 17/4/2030                       | 665,102     | 0.01         |
| USD 350,000    | Fantasia 0% 5/7/2022                                | 32,699      | 0.00         |
| USD 399,000    | Fantasia 9.25% 28/7/2023                            | 38,902      | 0.00         |
| USD 319,000    | Fantasia 9.875% 19/10/2023                          | 31,103      | 0.00         |
| USD 352,000    | Fantasia 10.875% 9/1/2023                           | 34,320      | 0.00         |
| USD 2,470,000  | Fantasia 11.75% 17/4/2022                           | 229,352     | 0.00         |
| USD 956,000    | Fantasia 11.875% 1/6/2023                           | 93,210      | 0.00         |
| USD 250,000    | Goldentree Loan Management US CLO 1 3.73% 20/4/2034 | 242,252     | 0.00         |
| USD 400,000    | Goldentree Loan Management US Clo 3 4.01% 20/4/2030 | 388,889     | 0.00         |
| USD 940,000    | Hilong 9.75% 18/11/2024                             | 394,800     | 0.00         |

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

| 保有高               | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-------------------|--|-------------|--------------|
| <b>ケイマン諸島(続き)</b> |  |             |              |
| USD 687,000       | KWG 7.4% 5/3/2024  | 106,485     | 0.00         |
| USD 450,000       | Madison Park Funding XIII 4.238% 19/4/2030                     | 442,792     | 0.00         |
| USD 418,056       | Madison Park Funding XLI 4.109% 22/4/2027                      | 412,547     | 0.00         |
| USD 280,587       | Madison Park Funding XXVI 4.006% 29/7/2030                     | 278,145     | 0.00         |
| USD 758,000       | Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029                         | 502,175     | 0.01         |
| USD 200,000       | MGM China 5.25% 18/6/2025                                      | 169,066     | 0.00         |
| USD 500,000       | MGM China 5.375% 15/5/2024                                     | 448,750     | 0.00         |
| USD 378,000       | MGM China 5.875% 15/5/2026                                     | 317,421     | 0.00         |
| USD 1,460,000     | Modern Land China 9.8% 11/4/2023                               | 240,900     | 0.00         |
| USD 378,000       | Modern Land China 11.5% 13/11/2022                             | 62,370      | 0.00         |
| USD 378,000       | Modern Land China 11.95% 4/3/2024                              | 62,370      | 0.00         |
| USD 250,000       | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 4.138% 19/10/2031        | 243,314     | 0.00         |
| USD 292,000       | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 4.16% 20/7/2031          | 283,249     | 0.00         |
| USD 250,000       | Palmer Square CLO 2018-1 3.77% 18/4/2031                       | 246,497     | 0.00         |
| USD 370,796       | Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 4.758% 23/8/2031 | 358,554     | 0.00         |
| USD 653,058       | Pikes Peak CLO 1 3.963% 24/7/2031                              | 643,473     | 0.01         |
| USD 400,000       | Pikes Peak CLO 8 3.88% 20/7/2034                               | 388,592     | 0.00         |
| USD 256,000       | Powerlong Real Estate 6.25% 10/8/2024                          | 36,274      | 0.00         |
| USD 578,000       | Redsun Properties 10.5% 3/10/2022                              | 49,130      | 0.00         |
| USD 250,000       | Rockford Tower CLO 2018-1 4.084% 20/5/2031                     | 246,715     | 0.00         |
| USD 736,000       | Ronshine China 6.75% 5/8/2024                                  | 51,520      | 0.00         |
| USD 1,563,000     | Ronshine China 7.1% 25/1/2025                                  | 109,410     | 0.00         |
| USD 200,000       | Ronshine China 8.1% 9/6/2023                                   | 14,000      | 0.00         |
| USD 590,000       | Sands China 4.875% 18/6/2030                                   | 474,950     | 0.01         |
| USD 500,000       | Shimao 3.45% 11/1/2031   | 68,750      | 0.00         |
| USD 558,000       | Shui On Development 5.5% 3/3/2025                              | 420,196     | 0.01         |
| USD 790,000       | Sinic 0% 18/6/2022   | 22,953      | 0.00         |
| USD 330,000       | Sinic 8.5% 24/1/2022   | 7,927       | 0.00         |
| USD 325,000       | Sunac China 7% 9/7/2025  | 47,125      | 0.00         |
| USD 493,000       | Times China 6.75% 8/7/2025                                     | 78,698      | 0.00         |
| USD 1,075,805     | Trinitas CLO XIV 4.783% 25/1/2034                              | 1,040,207   | 0.01         |
| USD 627,088       | Trinitas CLO XIV 5.783% 25/1/2034                              | 615,346     | 0.01         |
| USD 249,139       | Voya CLO 2013-3 3.89% 18/10/2031                               | 245,807     | 0.00         |
| USD 278,501       | York CLO 1 4.409% 22/10/2029                                   | 268,983     | 0.00         |
| USD 945,000       | Yuzhou 7.375% 13/1/2026  | 70,875      | 0.00         |
| USD 408,000       | Yuzhou 7.7% 20/2/2025  | 30,600      | 0.00         |
| USD 450,000       | Yuzhou 8.5% 4/2/2023   | 33,750      | 0.00         |
| USD 1,310,000     | Yuzhou 8.5% 26/2/2024  | 98,250      | 0.00         |
| USD 262,000       | Zhenro Properties 7.35% 5/2/2025                               | 11,522      | 0.00         |
|                   |  | 20,896,726  | 0.14         |
| <b>中国</b>         |  |             |              |
| USD 1,078,000     | ZhongAn Online P&C Insurance 3.5% 8/3/2026                     | 883,421     | 0.01         |
| <b>フランス</b>       |  |             |              |
| EUR 10,902,000    | CAB SELAS 3.375% 1/2/2028                                      | 9,133,596   | 0.06         |
| EUR 5,489,000     | Chrome Bidco 3.5% 31/5/2028                                    | 4,828,777   | 0.03         |
| EUR 5,512,000     | Chrome Holdco 5% 31/5/2029                                     | 4,390,463   | 0.03         |
| EUR 21,789,000    | Picard Groupe 3.875% 1/7/2026                                  | 19,383,127  | 0.13         |
|                   |  | 37,735,963  | 0.25         |
| <b>ドイツ</b>        |  |             |              |
| EUR 7,400,000     | Adler Pelzer 4.125% 1/4/2024                                   | 5,748,354   | 0.04         |
| EUR 6,140,000     | APCOA Parking 5% 15/1/2027                                     | 5,713,152   | 0.04         |
| EUR 6,853,000     | Douglas 6% 8/4/2026  | 5,759,549   | 0.04         |

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

| 保有高            | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|----------------|--|-------------|--------------|
|                | <b>ドイツ(続き)</b>   |             |              |
| EUR 5,752,575  | Kirk Beauty SUN 8.25% 1/10/2026  | 3,749,216   | 0.02         |
| EUR 2,752,567  | KME 6.75% 1/2/2023*  | 2,659,561   | 0.02         |
|                |  | 23,629,832  | 0.16         |
|                | <b>グアテマラ</b>   |             |              |
| USD 376,000    | Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041                                | 299,167     | 0.00         |
|                | <b>香港</b>  |             |              |
| USD 700,000    | AIA 2.7% 7/10/2170   | 618,877     | 0.01         |
| USD 945,000    | Bank of East Asia 5.825% 21/4/2171                                       | 901,492     | 0.01         |
| USD 595,000    | Bank of East Asia 5.875% 19/3/2171                                       | 580,753     | 0.00         |
| USD 800,000    | Nanyang Commercial Bank 3.8% 20/11/2029                                  | 769,410     | 0.01         |
| USD 945,000    | Yango Justice International 7.875% 4/9/2024                              | 61,425      | 0.00         |
| USD 766,000    | Yango Justice International 9.25% 15/4/2023                              | 49,790      | 0.00         |
| USD 284,000    | Yango Justice International 10.25% 15/9/2022                             | 17,878      | 0.00         |
| USD 306,000    | Yanlord Land HK 5.125% 20/5/2026   | 229,836     | 0.00         |
|                |  | 3,229,461   | 0.03         |
|                | <b>インド</b>   |             |              |
| USD 880,000    | Bharti Airtel 3.25% 3/6/2031*  | 763,000     | 0.01         |
| USD 210,000    | GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027                     | 182,256     | 0.00         |
| USD 325,000    | HDFC Bank 3.7% 25/2/2171   | 281,647     | 0.00         |
| USD 670,000    | Indian Railway Finance 3.249% 13/2/2030                                  | 586,772     | 0.01         |
| USD 300,000    | Power Finance 4.5% 18/6/2029   | 284,687     | 0.00         |
| USD 700,000    | REC 2.75% 13/1/2027  | 630,847     | 0.01         |
| USD 444,000    | Shriram Transport Finance 5.1% 16/7/2023                                 | 436,230     | 0.00         |
| USD 700,000    | Summit Digital Infrastructure 2.875% 12/8/2031                           | 544,852     | 0.00         |
|                |  | 3,710,291   | 0.03         |
|                | <b>インドネシア</b>  |             |              |
| USD 820,000    | Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026                            | 768,750     | 0.00         |
|                | <b>アイルランド</b>  |             |              |
| EUR 116,000    | Avoca CLO XV 1.05% 15/4/2031   | 109,861     | 0.00         |
| EUR 404,000    | Harvest CLO XVIII 1.2% 15/10/2030  | 384,468     | 0.00         |
| EUR 410,000    | OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 1.942% 21/1/2035 | 392,898     | 0.00         |
| EUR 280,000    | OAK Hill European Credit Partners VI 1.247% 20/1/2032                    | 266,087     | 0.00         |
| EUR 472,000    | OCP Euro CLO 2017-2 1.35% 15/1/2032                                      | 451,507     | 0.00         |
| USD 1,270,000  | Prodigy Finance CM2021-1 4.944% 25/7/2051                                | 1,276,151   | 0.01         |
| USD 740,000    | Prodigy Finance CM2021-1 6.194% 25/7/2051                                | 731,850     | 0.01         |
| USD 490,000    | Prodigy Finance CM2021-1 8.344% 25/7/2051                                | 492,569     | 0.01         |
| USD 14,836,000 | Shire Acquisitions Investments Ireland 3.2% 23/9/2026                    | 14,209,817  | 0.09         |
| EUR 250,000    | Voya Euro CLO II 1.67% 15/7/2035   | 237,713     | 0.00         |
|                |  | 18,552,921  | 0.12         |
|                | <b>マン島</b>   |             |              |
| USD 1,070,000  | Gohl Capital 4.25% 24/1/2027   | 970,835     | 0.01         |
|                | <b>イタリア</b>  |             |              |
| EUR 6,400,000  | Castor 5.25% 15/2/2029   | 6,012,254   | 0.04         |
| EUR 2,005,000  | Castor 6% 15/2/2029  | 1,823,661   | 0.01         |
| EUR 13,500,000 | Forno d' Asolo 5.5% 30/4/2027  | 11,952,648  | 0.08         |
| EUR 68,410,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 1/8/2030                         | 56,246,677  | 0.37         |
| EUR 6,765,000  | Marcolin 6.125% 15/11/2026   | 6,155,182   | 0.04         |
| EUR 6,914,000  | Shiba Bidco 4.5% 31/10/2028*   | 5,853,252   | 0.04         |
|                |  | 88,043,674  | 0.58         |

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

| 保有高               | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-------------------|--|-------------|--------------|
|                   | <b>日本</b>  |             |              |
| USD 1,217,000     | Nissan Motor 3.522% 17/9/2025                          | 1,154,471   | 0.01         |
| USD 2,525,000     | Takeda Pharmaceutical 3.175% 9/7/2050                  | 1,877,372   | 0.01         |
| USD 2,004,000     | Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028                    | 2,038,568   | 0.01         |
|                   |  | 5,070,411   | 0.03         |
|                   | <b>ジャージー</b>   |             |              |
| USD 4,459,000     | Aptiv 3.1% 1/12/2051                                   | 2,828,810   | 0.02         |
| EUR 4,813,000     | Kane Bidco 5% 15/2/2027                                | 4,365,659   | 0.03         |
| GBP 5,786,000     | Kane Bidco 6.5% 15/2/2027                              | 5,990,605   | 0.04         |
| GBP 2,761,000     | Wheel Bidco 6.75% 15/7/2026                            | 2,703,652   | 0.02         |
|                   |  | 15,888,726  | 0.11         |
|                   | <b>ルクセンブルグ</b>   |             |              |
| EUR 17,000,000    | BK LC Lux Finco1 5.25% 30/4/2029                       | 14,637,865  | 0.10         |
| USD 1,500,000     | EIG Pearl 3.545% 31/8/2036                             | 1,316,694   | 0.01         |
| EUR 3,031,000     | Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025                   | 2,706,818   | 0.02         |
| GBP 5,154,000     | Garfunkelux Holdco 3 7.75% 1/11/2025                   | 5,332,697   | 0.03         |
| EUR 7,733,000     | Herens Midco 5.25% 15/5/2029                           | 5,675,064   | 0.04         |
| EUR 2,000,000     | Herens Midco 5.25% 15/5/2029                           | 1,466,861   | 0.01         |
| EUR 5,570,000     | Picard Bondco 5.375% 1/7/2027*                         | 4,579,036   | 0.03         |
| EUR 5,376,000     | Sani/Ikos Financial 1 5.625% 15/12/2026                | 4,790,601   | 0.03         |
|                   |  | 40,505,636  | 0.27         |
|                   | <b>マレーシア</b>   |             |              |
| USD 1,400,000     | CIMB Bank 2.125% 20/7/2027                             | 1,255,656   | 0.01         |
| USD 730,000       | Dua Capital 2.78% 11/5/2031                            | 598,020     | 0.00         |
| USD 800,000       | TNB Global Ventures Capital 4.851% 1/11/2028           | 802,736     | 0.01         |
|                   |  | 2,656,412   | 0.02         |
|                   | <b>モーリシャス</b>  |             |              |
| USD 523,000       | CA Magnum 5.375% 31/10/2026                            | 473,315     | 0.00         |
| USD 262,000       | India Green Power 4% 22/2/2027                         | 210,255     | 0.00         |
| USD 1,000,000     | UPL 4.625% 16/6/2030                                   | 827,607     | 0.01         |
| USD 320,000       | UPL 5.25% 27/11/2170                                   | 238,738     | 0.00         |
|                   |  | 1,749,915   | 0.01         |
|                   | <b>メキシコ</b>  |             |              |
| MXN 2,613,200,000 | Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026                           | 115,891,008 | 0.77         |
|                   | <b>モンゴル</b>  |             |              |
| USD 750,000       | Mongolia Government International Bond 3.5% 7/7/2027   | 627,187     | 0.00         |
| USD 257,000       | Mongolia Government International Bond 5.125% 7/4/2026 | 237,404     | 0.00         |
|                   |  | 864,591     | 0.00         |
|                   | <b>オランダ</b>  |             |              |
| USD 485,000       | Greenko Dutch 3.85% 29/3/2026                          | 409,825     | 0.00         |
| USD 121,000       | ING Groep 1.4% 1/7/2026                                | 109,505     | 0.00         |
| USD 805,000       | ING Groep 3.869% 28/3/2026                             | 784,516     | 0.01         |
| USD 276,000       | ING Groep 4.625% 6/1/2026                              | 274,921     | 0.00         |
| USD 8,592,000     | LYB International Finance II 3.5% 2/3/2027             | 8,175,045   | 0.06         |
| USD 555,000       | LyondellBasell Industries 5.75% 15/4/2024              | 567,749     | 0.00         |
| USD 1,040,000     | Minejesa Capital 4.625% 10/8/2030                      | 956,800     | 0.01         |
| USD 92,000        | Mondelez International Netherlands 1.25% 24/9/2026     | 81,907      | 0.00         |
| USD 1,169,000     | Mong Duong Finance 5.125% 7/5/2029                     | 970,700     | 0.01         |
| EUR 8,000,000     | Nobian Finance 3.625% 15/7/2026*                       | 6,561,626   | 0.04         |
| USD 871,000       | NXP / NXP Funding 5.35% 1/3/2026                       | 890,053     | 0.01         |
| USD 1,578,000     | NXP / NXP Funding / NXP USA 2.5% 11/5/2031             | 1,278,776   | 0.01         |
| USD 1,033,000     | NXP / NXP Funding / NXP USA 3.25% 30/11/2051           | 703,351     | 0.00         |
| EUR 4,181,000     | Titan II 5.125% 15/7/2029                              | 3,567,491   | 0.02         |

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

| 保有高            | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|----------------|---|-------------|--------------|
|                | <b>オランダ(続き)</b>   |             |              |
| USD 1,644,000  | Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026                  | 1,581,018   | 0.01         |
| USD 257,000    | Vivo Energy Investments 5.125% 24/9/2027                  | 241,323     | 0.00         |
| EUR 25,365,000 | Ziggo 2.875% 15/1/2030                                    | 20,346,421  | 0.13         |
|                |   | 47,501,027  | 0.31         |
|                | <b>フィリピン</b>  |             |              |
| USD 675,000    | Globe Telecom 4.2% 2/5/2171                               | 633,398     | 0.00         |
| USD 1,000,000  | Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045 | 717,500     | 0.01         |
| USD 756,000    | Rizal Commercial Banking 6.5% 27/2/2171                   | 713,343     | 0.01         |
|                |   | 2,064,241   | 0.02         |
|                | <b>シンガポール</b>   |             |              |
| USD 750,000    | ABJA Investment 5.45% 24/1/2028                           | 742,500     | 0.01         |
| USD 1,000,000  | BOC Aviation 3.5% 18/9/2027                               | 948,594     | 0.01         |
| USD 1,000,000  | DBS 3.3% 27/8/2171  | 951,725     | 0.01         |
| USD 643,000    | GLP 4.5% 17/11/2170                                       | 448,814     | 0.00         |
| USD 1,057,968  | LLPL Capital 6.875% 4/2/2039                              | 1,022,582   | 0.01         |
| USD 756,000    | LMIRT Capital 7.5% 9/2/2026                               | 574,560     | 0.00         |
| USD 956,000    | Theta Capital 8.125% 22/1/2025                            | 816,333     | 0.00         |
| USD 200,000    | TML 4.35% 9/6/2026  | 175,649     | 0.00         |
|                |   | 5,680,757   | 0.04         |
|                | <b>韓国</b>   |             |              |
| USD 300,000    | Hanwha Life Insurance 3.379% 4/2/2032                     | 266,824     | 0.00         |
| USD 1,000,000  | Hanwha Life Insurance 4.7% 23/10/2170                     | 988,937     | 0.01         |
| USD 1,100,000  | Kookmin Bank 2.5% 4/11/2030                               | 918,291     | 0.00         |
| USD 1,430,000  | LG Chem 2.375% 7/7/2031                                   | 1,200,394   | 0.01         |
| USD 500,000    | Shinhan Financial 2.875% 12/11/2170                       | 446,055     | 0.00         |
| USD 1,500,000  | SK Hynix 2.375% 19/1/2031                                 | 1,182,679   | 0.01         |
|                |   | 5,003,180   | 0.03         |
|                | <b>スペイン</b>   |             |              |
| EUR 18,686,000 | Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066                     | 18,894,543  | 0.13         |
|                | <b>スイス</b>  |             |              |
| USD 5,478,000  | UBS 1.008% 30/7/2024                                      | 5,315,586   | 0.04         |
| USD 1,796,000  | UBS 2.095% 11/2/2032                                      | 1,411,536   | 0.01         |
| USD 2,231,000  | UBS 4.488% 12/5/2026                                      | 2,210,093   | 0.01         |
| USD 1,850,000  | UBS 4.703% 5/8/2027                                       | 1,820,042   | 0.01         |
|                |   | 10,757,257  | 0.07         |
|                | <b>タイ</b>   |             |              |
| USD 372,000    | Bangkok Bank Hong Kong 3.733% 25/9/2034                   | 324,654     | 0.00         |
| USD 300,000    | Bangkok Bank Hong Kong 5% 23/3/2171                       | 281,949     | 0.00         |
| USD 550,000    | GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031                        | 459,852     | 0.00         |
| USD 564,000    | Kasikornbank Hong Kong 3.343% 2/10/2031                   | 505,774     | 0.00         |
| USD 262,000    | Krung Thai Bank 4.4% 25/9/2170                            | 225,320     | 0.00         |
| USD 800,000    | Muang Thai Life Assurance 3.552% 27/1/2037                | 701,723     | 0.01         |
| USD 206,000    | TMBThanachart Bank 4.9% 2/6/2171                          | 191,322     | 0.00         |
|                |   | 2,690,594   | 0.01         |
|                | <b>英国</b>   |             |              |
| USD 1,025,000  | AstraZeneca 1.375% 6/8/2030                               | 845,351     | 0.01         |
| USD 3,162,000  | AstraZeneca 2.125% 6/8/2050                               | 2,088,086   | 0.01         |
| EUR 11,535,000 | BCP V Modular Services Finance 6.75% 30/11/2029*          | 8,724,795   | 0.06         |
| GBP 8,806,000  | BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028       | 8,311,206   | 0.05         |
| GBP 8,179,000  | Boparan Finance 7.625% 30/11/2025*                        | 6,882,155   | 0.05         |
| GBP 2,384,000  | Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027       | 2,196,690   | 0.02         |
| GBP 18,309,000 | Deuce Finco 5.5% 15/6/2027                                | 17,893,745  | 0.12         |



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

| 保有高            | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|----------------|---|-------------|--------------|
| <b>英国(続き)</b>  |   |             |              |
| USD 5,009,000  | GlaxoSmithKline Capital 3% 1/6/2024                               | 4,964,847   | 0.03         |
| USD 5,403,000  | GSK Consumer Healthcare Capital UK 3.125% 24/3/2025               | 5,211,365   | 0.03         |
| USD 4,748,000  | HSBC 0.732% 17/8/2024   | 4,559,846   | 0.03         |
| USD 1,387,000  | HSBC 0.976% 24/5/2025   | 1,294,576   | 0.01         |
| GBP 4,843,000  | Inspired Entertainment Financing 7.875% 1/6/2026                  | 5,415,950   | 0.04         |
| USD 298,000    | Lloyds Bank 3.5% 14/5/2025  | 291,698     | 0.00         |
| GBP 15,619,000 | Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027                                 | 15,065,401  | 0.10         |
| GBP 18,068,000 | Punch Finance 6.125% 30/6/2026                                    | 18,447,262  | 0.12         |
| USD 1,025,000  | Royalty Pharma 2.15% 2/9/2031                                     | 815,990     | 0.01         |
| USD 818,000    | Sky 3.75% 16/9/2024   | 813,656     | 0.00         |
| USD 500,000    | Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2024                    | 433,263     | 0.00         |
| USD 1,398,000  | Vodafone 4.125% 30/5/2025   | 1,392,431   | 0.01         |
|                |   | 105,648,313 | 0.70         |
| <b>米国</b>      |   |             |              |
| USD 2,640,000  | 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035       | 2,483,114   | 0.02         |
| USD 6,276,000  | AbbVie 2.95% 21/11/2026   | 5,932,710   | 0.04         |
| USD 150,000    | AbbVie 3.2% 14/5/2026   | 144,125     | 0.00         |
| USD 7,639,000  | AbbVie 3.6% 14/5/2025   | 7,507,360   | 0.05         |
| USD 4,583,000  | AbbVie 3.8% 15/3/2025   | 4,528,178   | 0.03         |
| USD 4,203,000  | AbbVie 4.25% 21/11/2049   | 3,749,474   | 0.02         |
| USD 1,053,000  | AbbVie 4.3% 14/5/2036   | 987,046     | 0.01         |
| USD 1,357,172  | AccessLex Institute 3.297% 25/5/2036                              | 1,312,167   | 0.01         |
| USD 470,000    | Aetna 3.5% 15/11/2024   | 464,374     | 0.00         |
| USD 1,206,000  | Affinity Gaming 6.875% 15/12/2027                                 | 1,051,533   | 0.01         |
| USD 6,815,000  | Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029 | 5,630,894   | 0.04         |
| USD 1,025,000  | Alexandria Real Estate Equities 1.875% 1/2/2033                   | 781,354     | 0.01         |
| USD 1,769,000  | Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027                                  | 1,759,029   | 0.01         |
| USD 11,736,000 | Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024                                    | 11,912,157  | 0.08         |
| USD 1,025,000  | Allstate 1.45% 15/12/2030   | 826,819     | 0.01         |
| USD 1,039,000  | Alphabet 1.1% 15/8/2030   | 853,901     | 0.01         |
| USD 1,049,000  | Alphabet 2.25% 15/8/2060  | 681,999     | 0.00         |
| USD 2,042,000  | Amazon.com 2.5% 3/6/2050  | 1,445,591   | 0.01         |
| USD 1,033,000  | Amazon.com 2.7% 3/6/2060  | 705,381     | 0.00         |
| USD 127,000    | American Express 2.25% 4/3/2025                                   | 121,342     | 0.00         |
| USD 3,112,000  | American Express 3.95% 1/8/2025                                   | 3,083,594   | 0.02         |
| USD 3,010,000  | American Express 4.05% 3/5/2029                                   | 2,937,982   | 0.02         |
| USD 2,318,000  | American International 3.9% 1/4/2026                              | 2,286,130   | 0.02         |
| USD 1,025,000  | American Tower 1.875% 15/10/2030                                  | 812,923     | 0.01         |
| USD 1,033,000  | American Tower 3.1% 15/6/2050                                     | 729,023     | 0.00         |
| USD 5,964,000  | American Tower 3.375% 15/5/2024                                   | 5,869,367   | 0.04         |
| USD 2,373,000  | American Tower 4.4% 15/2/2026                                     | 2,362,120   | 0.02         |
| USD 124,000    | Amgen 1.9% 21/2/2025  | 118,151     | 0.00         |
| USD 1,025,000  | Amgen 2% 15/1/2032  | 838,064     | 0.01         |
| USD 1,033,000  | Amgen 2.77% 1/9/2053  | 694,667     | 0.00         |
| USD 4,074,000  | Amgen 3% 15/1/2052  | 2,915,552   | 0.02         |
| USD 718,000    | Amgen 3.125% 1/5/2025   | 704,358     | 0.00         |
| USD 3,976,000  | Amgen 4.05% 18/8/2029   | 3,890,783   | 0.03         |
| USD 1,025,000  | Amphenol 2.2% 15/9/2031   | 853,486     | 0.01         |
| USD 67,000     | Amphenol 4.35% 1/6/2029   | 66,792      | 0.00         |
| USD 5,325,000  | Anheuser-Busch / Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.65% 1/2/2026    | 5,250,292   | 0.03         |
| USD 4,383,000  | Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.75% 23/1/2029                    | 4,486,074   | 0.03         |
| USD 387,000    | Anheuser-Busch InBev Worldwide 5.875% 15/6/2035                   | 414,620     | 0.00         |
| USD 3,382,000  | Aon 4.5% 15/12/2028   | 3,362,254   | 0.02         |

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

| 保有高           | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---------------|--|-------------|--------------|
|               | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 3,156,000 | Aon / Aon Global 2.9% 23/8/2051  | 2,210,733   | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Apple 2.4% 20/8/2050   | 728,073     | 0.00         |
| USD 1,203,000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027 | 1,186,850   | 0.01         |
| USD 4,369,000 | AT&T 1.7% 25/3/2026  | 4,001,461   | 0.03         |
| USD 650,000   | Avaya 6.125% 15/9/2028   | 357,051     | 0.00         |
| USD 460,000   | BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033                       | 421,640     | 0.00         |
| USD 1,210,000 | BANK 2017-BNK9 3.538% 15/11/2054   | 1,161,933   | 0.01         |
| USD 285,000   | Bank of America 1.53% 6/12/2025  | 266,223     | 0.00         |
| USD 139,000   | Bank of America 1.658% 11/3/2027   | 124,849     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Bank of America 1.922% 24/10/2031  | 816,346     | 0.01         |
| USD 461,000   | Bank of America 2.456% 22/10/2025  | 441,621     | 0.00         |
| USD 970,000   | Bank of America 2.676% 19/6/2041   | 706,618     | 0.00         |
| USD 1,033,000 | Bank of America 2.972% 21/7/2052   | 733,598     | 0.00         |
| USD 1,118,000 | Bank of America 3.366% 23/1/2026   | 1,082,946   | 0.01         |
| USD 4,646,000 | Bank of America 3.384% 2/4/2026  | 4,494,524   | 0.03         |
| USD 191,000   | Bank of America 3.458% 15/3/2025   | 188,056     | 0.00         |
| USD 148,000   | Bank of America 3.5% 19/4/2026   | 144,410     | 0.00         |
| USD 135,000   | Bank of America 3.705% 24/4/2028   | 128,631     | 0.00         |
| USD 317,000   | Bank of America 3.824% 20/1/2028   | 304,405     | 0.00         |
| USD 7,674,000 | Bank of America 3.841% 25/4/2025   | 7,602,310   | 0.05         |
| USD 4,601,000 | Bank of America 4.183% 25/11/2027  | 4,500,533   | 0.03         |
| USD 2,372,000 | Bank of America 4.271% 23/7/2029   | 2,281,841   | 0.02         |
| USD 1,268,000 | Bank of America 4.571% 27/4/2033   | 1,224,138   | 0.01         |
| USD 3,745,000 | Bank of America 4.827% 22/7/2026   | 3,757,326   | 0.02         |
| USD 5,218,000 | Bank of America 5.015% 22/7/2033   | 5,204,306   | 0.03         |
| USD 1,025,000 | Bank of New York Mellon 1.65% 28/1/2031  | 833,551     | 0.01         |
| USD 1,578,000 | Bank of New York Mellon 2.5% 26/1/2032   | 1,340,731   | 0.01         |
| USD 8,454,000 | Bank of New York Mellon 3.85% 26/4/2029  | 8,165,943   | 0.05         |
| USD 5,608,000 | Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026   | 5,643,247   | 0.04         |
| USD 222,473   | Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 3.494% 25/11/2035                          | 199,567     | 0.00         |
| USD 253,643   | Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 2.954% 25/10/2036                          | 237,990     | 0.00         |
| USD 1,063,000 | BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 5.016% 15/8/2036                                  | 1,023,572   | 0.01         |
| USD 2,951,000 | BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 3.512% 15/3/2037                                  | 2,700,407   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Becton Dickinson 1.957% 11/2/2031  | 842,311     | 0.01         |
| USD 3,131,000 | Becton Dickinson 3.363% 6/6/2024   | 3,097,140   | 0.02         |
| USD 9,283,000 | Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027   | 9,039,579   | 0.06         |
| USD 1,108,000 | Becton Dickinson 4.298% 22/8/2032  | 1,083,517   | 0.01         |
| USD 294,000   | Berry Global 4.875% 15/7/2026  | 286,858     | 0.00         |
| USD 610,912   | BHMS 2018-ATLS 3.641% 15/7/2035  | 593,589     | 0.00         |
| USD 1,715,558 | BHMS 2018-ATLS 4.291% 15/7/2035  | 1,646,168   | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Blackstone Finance 2% 30/1/2032  | 811,026     | 0.01         |
| USD 2,426,000 | Blackstone Finance 3.15% 2/10/2027   | 2,275,527   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Boston Properties 2.55% 1/4/2032   | 819,744     | 0.01         |
| USD 3,233,000 | Boston Properties 2.75% 1/10/2026  | 3,018,880   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Bristol-Myers Squibb 1.45% 13/11/2030  | 841,573     | 0.01         |
| USD 1,487,000 | Bristol-Myers Squibb 2.55% 13/11/2050  | 1,040,774   | 0.01         |
| USD 245,000   | Bristol-Myers Squibb 3.25% 27/2/2027   | 240,510     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Broadcom 2.45% 15/2/2031   | 825,607     | 0.01         |
| USD 3,925,000 | Broadcom 3.15% 15/11/2025  | 3,800,741   | 0.03         |
| USD 1,939,000 | Broadcom 4.926% 15/5/2037  | 1,748,456   | 0.01         |
| USD 5,439,000 | Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027                              | 5,241,984   | 0.03         |
| USD 2,281,200 | BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033                                   | 2,100,217   | 0.01         |
| USD 1,424,687 | CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 4.541% 15/12/2037                       | 1,385,900   | 0.01         |

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

| 保有高           | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---------------|--|-------------|--------------|
|               | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 4,493,000 | Capital One Financial 3.9% 29/1/2024   | 4,483,967   | 0.03         |
| USD 1,055,000 | Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029   | 793,065     | 0.01         |
| USD 895,000   | CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029  | 871,954     | 0.01         |
| USD 527,428   | CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3.911% 13/11/2050   | 486,077     | 0.00         |
| USD 2,243,000 | CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030   | 2,078,364   | 0.01         |
| USD 275,000   | Centennial Resource Production 5.375% 15/1/2026  | 253,403     | 0.00         |
| USD 666,649   | CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 5.295% 15/2/2033                                    | 652,686     | 0.00         |
| USD 741,368   | CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 6.661% 15/2/2033                                    | 718,209     | 0.00         |
| USD 1,190,000 | Change Healthcare / Change Healthcare Finance 5.75% 1/3/2025                                 | 1,167,586   | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Charles Schwab 1.65% 11/3/2031   | 831,942     | 0.01         |
| USD 238,000   | Charles Schwab 3.45% 13/2/2026   | 235,529     | 0.00         |
| USD 122,000   | Charles Schwab 4.2% 24/3/2025  | 122,960     | 0.00         |
| USD 606,000   | Charles Schwab 4.625% 22/3/2030  | 615,133     | 0.00         |
| USD 4,103,000 | Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.3% 1/2/2032    | 3,140,250   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.8% 1/4/2031    | 835,196     | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.85% 1/4/2061   | 676,342     | 0.00         |
| USD 729,000   | Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028   | 689,544     | 0.00         |
| USD 6,529,000 | Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025 | 6,522,283   | 0.04         |
| USD 1,968,000 | Cheever Escrow Issuer 7.125% 1/10/2027   | 1,921,122   | 0.01         |
| USD 2,450,000 | Cheniere Energy 4.625% 15/10/2028  | 2,361,653   | 0.02         |
| USD 77,000    | Churchill Downs 5.5% 1/4/2027  | 73,947      | 0.00         |
| USD 200,000   | Cigna 1.25% 15/3/2026  | 180,723     | 0.00         |
| USD 67,000    | Cisco Systems 2.5% 20/9/2026   | 64,494      | 0.00         |
| USD 583,000   | Citigroup 0.981% 1/5/2025  | 549,905     | 0.00         |
| USD 6,072,000 | Citigroup 3.29% 17/3/2026  | 5,870,798   | 0.04         |
| USD 764,000   | Citigroup 3.352% 24/4/2025   | 749,301     | 0.01         |
| USD 50,000    | Citigroup 3.4% 1/5/2026  | 48,388      | 0.00         |
| USD 4,085,000 | Citigroup 3.785% 17/3/2033   | 3,694,875   | 0.02         |
| USD 1,475,000 | Citigroup 4.14% 24/5/2025  | 1,467,027   | 0.01         |
| USD 1,223,900 | Citigroup CCommercial Mortgage Trust 2018-C6 4.412% 10/11/2051                               | 1,223,778   | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Clorox 1.8% 15/5/2030  | 841,482     | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Coca-Cola 1.375% 15/3/2031   | 841,085     | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Coca-Cola 2.5% 15/3/2051   | 745,684     | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Comcast 1.5% 15/2/2031   | 826,303     | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Comcast 2.45% 15/8/2052  | 682,810     | 0.00         |
| USD 729,000   | Comcast 2.65% 15/8/2062  | 467,951     | 0.00         |
| USD 8,514,000 | Comcast 3.55% 1/5/2028   | 8,250,159   | 0.05         |
| USD 401,000   | Comcast 3.95% 15/10/2025   | 400,361     | 0.00         |
| USD 1,894,000 | Comcast 4.25% 15/10/2030   | 1,877,877   | 0.01         |
| USD 809,000   | Comcast 5.65% 15/6/2035  | 875,422     | 0.01         |
| USD 846,453   | COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust 4.943% 10/5/2047   | 807,647     | 0.01         |
| USD 2,402,878 | COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047  | 2,349,566   | 0.02         |
| USD 232,000   | Conagra Brands 4.3% 1/5/2024   | 232,157     | 0.00         |
| USD 4,580,000 | Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026   | 4,202,098   | 0.03         |
| USD 1,316,025 | Connecticut Avenue Trust 2022-R01 5.333% 25/12/2041  | 1,214,787   | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Costco Wholesale 1.75% 20/4/2032   | 848,627     | 0.01         |
| USD 3,781,000 | Cox Communications 3.85% 1/2/2025  | 3,714,729   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Crown Castle 2.5% 15/7/2031  | 848,167     | 0.01         |
| USD 3,933,000 | Crown Castle 3.7% 15/6/2026  | 3,817,213   | 0.03         |
| USD 802,545   | CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4.798% 15/11/2048                                    | 758,750     | 0.01         |
| USD 1,033,000 | CSX 2.5% 15/5/2051   | 703,010     | 0.00         |
| USD 2,958,000 | CSX 4.25% 15/3/2029  | 2,944,523   | 0.02         |
| USD 4,298,000 | CVS Health 1.3% 21/8/2027  | 3,737,542   | 0.02         |

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

| 保有高            | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|----------------|--|-------------|--------------|
|                | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 1,025,000  | CVS Health 1.75% 21/8/2030   | 833,212     | 0.01         |
| USD 4,776,000  | CVS Health 2.875% 1/6/2026   | 4,570,015   | 0.03         |
| USD 3,739,000  | CVS Health 4.3% 25/3/2028  | 3,716,060   | 0.02         |
| USD 4,530,000  | CVS Health 5.05% 25/3/2048   | 4,411,376   | 0.03         |
| USD 4,006,000  | Danaher 2.8% 10/12/2051  | 2,908,799   | 0.02         |
| USD 1,200,964  | DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 3.669% 15/5/2035                                 | 1,174,056   | 0.01         |
| USD 5,354,649  | DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 4.369% 15/5/2035                                 | 5,135,924   | 0.03         |
| USD 1,341,475  | DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 3.716% 19/12/2030                                | 1,304,053   | 0.01         |
| USD 1,010,000  | DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 4.116% 19/12/2030                                | 979,683     | 0.01         |
| USD 666,000    | Deere 2.75% 15/4/2025  | 649,119     | 0.00         |
| USD 1,033,000  | Dell International / EMC 3.45% 15/12/2051                                      | 695,441     | 0.00         |
| USD 3,659,000  | Dell International / EMC 6.02% 15/6/2026                                       | 3,811,856   | 0.03         |
| USD 2,269,000  | Discovery Communications 3.8% 13/3/2024  | 2,248,314   | 0.02         |
| USD 3,778,000  | Dollar General 3.875% 15/4/2027  | 3,721,663   | 0.02         |
| USD 2,255,000  | Dow Chemical 4.8% 30/11/2028   | 2,278,350   | 0.02         |
| USD 1,025,000  | Duke Realty 2.25% 15/1/2032  | 855,296     | 0.01         |
| USD 6,580,000  | Earthstone Energy 8% 15/4/2027   | 6,457,020   | 0.04         |
| USD 1,472,000  | eBay 1.9% 11/3/2025  | 1,391,273   | 0.01         |
| USD 89,000     | Elevance Health 2.375% 15/1/2025   | 85,471      | 0.00         |
| USD 3,854,000  | Elevance Health 3.125% 15/5/2050   | 2,926,887   | 0.02         |
| USD 5,377,000  | Elevance Health 3.65% 1/12/2027  | 5,222,161   | 0.03         |
| USD 1,033,000  | Eli Lilly 2.25% 15/5/2050  | 725,242     | 0.00         |
| USD 3,412,000  | Equinix 1.45% 15/5/2026  | 3,056,492   | 0.02         |
| USD 1,383,000  | Equinix 2.5% 15/5/2031   | 1,145,705   | 0.01         |
| USD 517,000    | Equinix 3% 15/7/2050   | 356,472     | 0.00         |
| USD 1,025,000  | Expedia 2.95% 15/3/2031  | 861,525     | 0.01         |
| USD 1,131,596  | Fannie Mae-Aces 3.87% 25/9/2030  | 1,135,653   | 0.01         |
| USD 3,074,000  | FedEx 4.25% 15/5/2030  | 3,011,675   | 0.02         |
| USD 99,000     | Fidelity National Information Services 1.15% 1/3/2026                          | 88,008      | 0.00         |
| USD 2,733,000  | Fifth Third Bancorp 4.055% 25/4/2028   | 2,674,612   | 0.02         |
| USD 3,083,000  | Fifth Third Bancorp 4.772% 28/7/2030   | 3,075,133   | 0.02         |
| USD 1,043,000  | Fiserv 3.2% 1/7/2026   | 994,721     | 0.01         |
| USD 6,279,000  | Ford Motor 6.1% 19/8/2032  | 6,170,939   | 0.04         |
| USD 35,704,088 | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.943% 25/5/2029  | 1,500,107   | 0.01         |
| USD 31,632,967 | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.133% 25/10/2030 | 2,066,107   | 0.01         |
| USD 4,886,783  | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.529% 25/7/2030  | 420,845     | 0.00         |
| USD 22,619,625 | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.645% 25/1/2030  | 2,020,093   | 0.01         |
| USD 9,670,015  | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.699% 25/4/2030  | 906,527     | 0.01         |
| USD 5,520,714  | Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.814% 25/4/2030  | 551,215     | 0.00         |
| USD 1,530,711  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 5.583% 25/1/2042                       | 1,397,611   | 0.01         |
| USD 1,502,000  | Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 5.583% 25/8/2033          | 1,427,967   | 0.01         |
| USD 3,767,000  | Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024   | 3,334,172   | 0.02         |
| USD 3,296,000  | Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025   | 2,864,779   | 0.02         |
| USD 3,311,000  | Frontier Communications 5% 1/5/2028  | 2,913,018   | 0.02         |
| USD 4,105,000  | Frontier Communications 5.875% 15/10/2027                                      | 3,837,140   | 0.03         |
| USD 6,271,000  | Frontier Communications 6.75% 1/5/2029   | 5,438,180   | 0.04         |
| USD 4,980,000  | Frontier Communications 8.75% 15/5/2030  | 5,148,573   | 0.03         |
| USD 65,000     | Frontier Florida 6.86% 1/2/2028  | 61,984      | 0.00         |
| USD 3,810,000  | Frontier North 6.73% 15/2/2028   | 3,498,190   | 0.02         |
| USD 254,000    | Full House Resorts 8.25% 15/2/2028   | 232,152     | 0.00         |
| USD 92,000     | GATX 3.5% 15/3/2028  | 85,285      | 0.00         |
| USD 823,000    | GCI 4.75% 15/10/2028   | 742,848     | 0.01         |
| USD 1,701,000  | General Motors 5.4% 15/10/2029   | 1,663,342   | 0.01         |

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

| 保有高           | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---------------|--|-------------|--------------|
|               | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 1,025,000 | General Motors Financial 2.35% 8/1/2031                            | 803,090     | 0.01         |
| USD 5,238,000 | General Motors Financial 2.7% 20/8/2027                            | 4,665,957   | 0.03         |
| USD 4,717,000 | General Motors Financial 2.9% 26/2/2025                            | 4,509,251   | 0.03         |
| USD 5,148,000 | General Motors Financial 5.25% 1/3/2026                            | 5,194,307   | 0.03         |
| USD 2,220,000 | Georgia-Pacific 2.3% 30/4/2030                                     | 1,935,034   | 0.01         |
| USD 110,000   | Georgia-Pacific 3.6% 1/3/2025                                      | 108,427     | 0.00         |
| USD 1,882,000 | Georgia-Pacific 7.75% 15/11/2029                                   | 2,262,610   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Gilead Sciences 1.65% 1/10/2030                                    | 839,548     | 0.01         |
| USD 4,120,000 | Gilead Sciences 2.8% 1/10/2050                                     | 2,865,463   | 0.02         |
| USD 1,578,000 | Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026                                     | 1,552,438   | 0.01         |
| USD 1,811,000 | Gilead Sciences 4.6% 1/9/2035                                      | 1,781,175   | 0.01         |
| USD 4,010,000 | Gilead Sciences 4.75% 1/3/2046                                     | 3,874,338   | 0.03         |
| USD 480,000   | Global Payments 2.65% 15/2/2025                                    | 457,571     | 0.00         |
| USD 683,000   | Global Payments 4.95% 15/8/2027                                    | 680,756     | 0.00         |
| USD 173,000   | Goldman Sachs 0.855% 12/2/2026                                     | 157,687     | 0.00         |
| USD 5,125,000 | Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026                                     | 4,570,279   | 0.03         |
| USD 4,734,000 | Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032                                     | 3,765,738   | 0.03         |
| USD 1,025,000 | Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032                                     | 834,289     | 0.01         |
| USD 2,058,000 | Goldman Sachs 2.908% 21/7/2042                                     | 1,518,493   | 0.01         |
| USD 6,037,000 | Goldman Sachs 3.102% 24/2/2033                                     | 5,169,875   | 0.03         |
| USD 2,372,000 | Goldman Sachs 3.814% 23/4/2029                                     | 2,235,791   | 0.01         |
| USD 3,987,596 | GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048    | 3,409,633   | 0.02         |
| USD 4,873,000 | GoTo 5.5% 1/9/2027   | 3,556,488   | 0.02         |
| USD 1,170,000 | GSK Consumer Healthcare Capital US 3.024% 24/3/2024                | 1,144,942   | 0.01         |
| USD 7,898,000 | GSK Consumer Healthcare Capital US 3.375% 24/3/2027                | 7,452,275   | 0.05         |
| USD 1,025,000 | HCA 2.375% 15/7/2031   | 816,519     | 0.01         |
| USD 1,033,000 | HCA 3.5% 15/7/2051   | 721,442     | 0.00         |
| USD 4,456,000 | HCA 5.25% 15/4/2025  | 4,511,259   | 0.03         |
| USD 4,365,000 | HCA 5.875% 15/2/2026   | 4,456,272   | 0.03         |
| USD 1,025,000 | Home Depot 1.375% 15/3/2031  | 827,866     | 0.01         |
| USD 4,171,000 | Home Depot 2.375% 15/3/2051  | 2,804,648   | 0.02         |
| USD 3,913,000 | Home Depot 2.75% 15/9/2051   | 2,836,170   | 0.02         |
| USD 238,000   | HP 3% 17/6/2027  | 221,062     | 0.00         |
| USD 546,920   | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 3.076% 10/8/2038             | 482,203     | 0.00         |
| USD 79,000    | Humana 1.35% 3/2/2027  | 69,260      | 0.00         |
| USD 5,830,000 | Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028                              | 5,709,250   | 0.04         |
| USD 196,000   | Intel 3.1% 15/2/2060   | 136,663     | 0.00         |
| USD 1,188,000 | Intel 3.4% 25/3/2025   | 1,174,812   | 0.01         |
| USD 1,790,000 | Intercontinental Exchange 1.85% 15/9/2032                          | 1,424,640   | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Intercontinental Exchange 3% 15/9/2060                             | 718,121     | 0.00         |
| USD 3,090,000 | Intercontinental Exchange 4% 15/9/2027                             | 3,063,255   | 0.02         |
| USD 1,033,000 | International Business Machines 2.95% 15/5/2050                    | 740,882     | 0.00         |
| USD 4,652,000 | International Business Machines 3.3% 15/5/2026                     | 4,519,371   | 0.03         |
| USD 4,499,000 | International Business Machines 4.15% 27/7/2027                    | 4,497,537   | 0.03         |
| USD 1,033,000 | Johnson & Johnson 2.25% 1/9/2050                                   | 718,280     | 0.00         |
| USD 772,280   | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-WPT 4.876% 5/7/2033 | 759,244     | 0.01         |
| USD 192,000   | JPMorgan Chase 0.969% 23/6/2025                                    | 180,094     | 0.00         |
| USD 706,000   | JPMorgan Chase 1.561% 10/12/2025                                   | 659,050     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031                                   | 811,265     | 0.01         |
| USD 6,325,000 | JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026                                    | 5,925,557   | 0.04         |
| USD 2,058,000 | JPMorgan Chase 2.525% 19/11/2041                                   | 1,458,886   | 0.01         |
| USD 1,115,000 | JPMorgan Chase 3.54% 1/5/2028                                      | 1,057,813   | 0.01         |
| USD 4,820,000 | JPMorgan Chase 4.08% 26/4/2026                                     | 4,772,602   | 0.03         |

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

| 保有高           | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---------------|--|-------------|--------------|
|               | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 5,072,000 | JPMorgan Chase 4.323% 26/4/2028                      | 4,983,869   | 0.03         |
| USD 2,917,000 | JPMorgan Chase 4.586% 26/4/2033                      | 2,842,502   | 0.02         |
| USD 4,371,000 | JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028                      | 4,379,644   | 0.03         |
| USD 5,220,000 | JPMorgan Chase 4.912% 25/7/2033                      | 5,222,493   | 0.03         |
| USD 3,071,000 | Keurig Dr Pepper 3.95% 15/4/2029                     | 2,938,388   | 0.02         |
| USD 2,225,000 | Keurig Dr Pepper 4.597% 25/5/2028                    | 2,239,807   | 0.01         |
| USD 1,025,000 | Kilroy Realty 2.5% 15/11/2032                        | 797,949     | 0.01         |
| USD 675,000   | Kimberly-Clark 2.875% 7/2/2050                       | 511,877     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Kimco Realty 2.25% 1/12/2031                         | 825,568     | 0.01         |
| USD 1,257,000 | Kimco Realty 4.6% 1/2/2033                           | 1,225,251   | 0.01         |
| USD 1,481,000 | Kinetik 5.875% 15/6/2030                             | 1,413,808   | 0.01         |
| USD 6,322,000 | Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026                        | 5,998,884   | 0.04         |
| USD 4,435,000 | Kraft Heinz Foods 4.375% 1/6/2046                    | 3,792,580   | 0.03         |
| USD 536,000   | Lam Research 3.75% 15/3/2026                         | 535,564     | 0.00         |
| USD 2,048,000 | Lightning eMotors 7.5% 15/5/2024                     | 1,385,580   | 0.01         |
| USD 463,000   | Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029                    | 369,557     | 0.00         |
| USD 3,463,000 | Lowe's 1.7% 15/9/2028                                | 2,983,940   | 0.02         |
| USD 1,025,000 | Lowe's 1.7% 15/10/2030                               | 826,072     | 0.01         |
| USD 1,578,000 | Lowe's 2.8% 15/9/2041                                | 1,142,393   | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Lowe's 3% 15/10/2050                                 | 722,476     | 0.00         |
| USD 2,430,000 | Lowe's 3.35% 1/4/2027                                | 2,348,303   | 0.02         |
| USD 93,000    | Lowe's 4% 15/4/2025                                  | 92,948      | 0.00         |
| USD 5,208,000 | Lowe's 4.25% 1/4/2052                                | 4,494,974   | 0.03         |
| USD 4,217,000 | Lumen Technologies 5.125% 15/12/2026                 | 3,671,447   | 0.02         |
| USD 1,595,000 | Magallanes 3.428% 15/3/2024                          | 1,560,440   | 0.01         |
| USD 3,645,000 | Magallanes 3.638% 15/3/2025                          | 3,523,574   | 0.02         |
| USD 2,672,000 | Marsh & McLennan 3.75% 14/3/2026                     | 2,655,008   | 0.02         |
| USD 2,924,000 | Marsh & McLennan 5.875% 1/8/2033                     | 3,186,194   | 0.02         |
| USD 168,000   | McDonald's 3.3% 1/7/2025                             | 165,327     | 0.00         |
| USD 3,902,000 | Medline Borrower 3.875% 1/4/2029                     | 3,298,253   | 0.02         |
| USD 3,165,000 | Mercedes-Benz Finance North America 2.125% 10/3/2025 | 2,999,874   | 0.02         |
| USD 1,033,000 | Merck 2.45% 24/6/2050                                | 723,928     | 0.00         |
| USD 1,205,000 | Merck 2.75% 10/2/2025                                | 1,177,865   | 0.01         |
| USD 947,000   | Merck 3.6% 15/9/2042                                 | 825,624     | 0.01         |
| USD 436,000   | Merck Sharp & Dohme 5.95% 1/12/2028                  | 478,404     | 0.00         |
| USD 44,000    | Meritor 4.5% 15/12/2028                              | 45,223      | 0.00         |
| USD 2,344,000 | Meta Platforms 3.5% 15/8/2027                        | 2,280,823   | 0.02         |
| USD 3,156,000 | Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 7/1/2031    | 2,507,634   | 0.02         |
| USD 60,000    | Metropolitan Life Global Funding I 1.875% 11/1/2027  | 54,066      | 0.00         |
| USD 2,429,000 | Metropolitan Life Global Funding I 3% 19/9/2027      | 2,270,909   | 0.02         |
| USD 7,561,000 | Microsoft 2.525% 1/6/2050                            | 5,611,228   | 0.04         |
| USD 1,033,000 | Microsoft 2.675% 1/6/2060                            | 743,453     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Mondelez International 1.5% 4/2/2031                 | 815,242     | 0.01         |
| USD 252,000   | Moody's 2.55% 18/8/2060                              | 157,570     | 0.00         |
| USD 781,000   | Moody's 3.1% 29/11/2061                              | 543,593     | 0.00         |
| USD 1,500,000 | Morgan Stanley 0.79% 30/5/2025                       | 1,403,858   | 0.01         |
| USD 147,000   | Morgan Stanley 1.512% 20/7/2027                      | 130,502     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Morgan Stanley 1.794% 13/2/2032                      | 809,093     | 0.01         |
| USD 576,000   | Morgan Stanley 1.928% 28/4/2032                      | 458,675     | 0.00         |
| USD 1,033,000 | Morgan Stanley 2.802% 25/1/2052                      | 714,211     | 0.00         |
| USD 5,513,000 | Morgan Stanley 3.125% 27/7/2026                      | 5,271,582   | 0.03         |
| USD 6,305,000 | Morgan Stanley 3.62% 17/4/2025                       | 6,225,659   | 0.04         |
| USD 453,000   | Morgan Stanley 3.625% 20/1/2027                      | 441,320     | 0.00         |

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

| 保有高           | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---------------|---|-------------|--------------|
|               | <b>米国(続き)</b>   |             |              |
| USD 6,108,000 | Morgan Stanley 4.21% 20/4/2028  | 5,981,379   | 0.04         |
| USD 1,690,000 | Morgan Stanley 4.679% 17/7/2026   | 1,693,950   | 0.01         |
| USD 5,976,000 | Morgan Stanley 4.889% 20/7/2033   | 5,990,820   | 0.04         |
| USD 395,094   | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.479% 15/5/2048              | 372,159     | 0.00         |
| USD 2,057,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3.72% 15/12/2049              | 1,999,022   | 0.01         |
| USD 1,299,000 | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040                                   | 1,214,061   | 0.01         |
| USD 2,093,047 | Mosaic Solar Loan Trust 2021-2 2.09% 22/4/2047  | 1,761,021   | 0.01         |
| USD 3,024,000 | Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030   | 2,393,721   | 0.02         |
| USD 3,475,000 | Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028  | 2,931,238   | 0.02         |
| USD 647,000   | Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027  | 578,390     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Nestle 2.5% 14/9/2041   | 790,802     | 0.01         |
| USD 1,384,000 | New Home 7.25% 15/10/2025   | 1,144,396   | 0.01         |
| USD 947,000   | New York Life Global Funding 1.2% 7/8/2030  | 749,852     | 0.01         |
| USD 2,755,000 | Newmont 2.6% 15/7/2032  | 2,260,292   | 0.02         |
| USD 3,288,000 | Norfolk Southern 3% 15/3/2032   | 2,963,735   | 0.02         |
| USD 694,000   | Norfolk Southern 4.837% 1/10/2041   | 688,207     | 0.00         |
| USD 3,223,000 | Northern Trust 4% 10/5/2027   | 3,221,181   | 0.02         |
| USD 109,000   | Novartis Capital 3% 20/11/2025  | 106,911     | 0.00         |
| USD 139,000   | Oncor Electric Delivery 5.75% 15/3/2029   | 150,890     | 0.00         |
| USD 5,974,000 | ONEOK Partners 4.9% 15/3/2025   | 5,976,029   | 0.04         |
| USD 4,918,000 | Oracle 2.5% 1/4/2025  | 4,676,775   | 0.03         |
| USD 3,156,000 | Oracle 2.95% 1/4/2030   | 2,708,822   | 0.02         |
| USD 786,000   | Oracle 3.4% 8/7/2024  | 774,837     | 0.00         |
| USD 1,033,000 | Oracle 3.6% 1/4/2050  | 712,510     | 0.00         |
| USD 3,267,000 | Oracle 3.95% 25/3/2051  | 2,387,131   | 0.02         |
| USD 70,000    | Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027                              | 64,325      | 0.00         |
| USD 2,302,500 | Pacific Gas and Electric 4.5% 1/7/2040  | 1,818,303   | 0.01         |
| USD 950,000   | Paramount Global 6.375% 30/3/2062   | 875,412     | 0.01         |
| USD 2,257,000 | Parker-Hannifin 4.25% 15/9/2027   | 2,238,562   | 0.01         |
| USD 1,583,000 | Peninsula Pacific Entertainment / Peninsula Pacific Entertainment Finance 8.5% 15/11/2027 | 1,698,090   | 0.01         |
| USD 219,000   | PepsiCo 2.375% 6/10/2026  | 208,366     | 0.00         |
| USD 807,000   | Periana 5.95% 19/4/2026   | 742,658     | 0.01         |
| USD 5,032,000 | Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027   | 3,812,671   | 0.03         |
| USD 4,015,000 | Pitney Bowes 7.25% 15/3/2029  | 2,758,242   | 0.02         |
| USD 4,158,000 | PNC Bank 3.25% 1/6/2025   | 4,084,402   | 0.03         |
| USD 242,000   | PNC Bank 4.2% 1/11/2025   | 241,229     | 0.00         |
| USD 1,342,000 | PPG Industries 1.2% 15/3/2026   | 1,209,108   | 0.01         |
| USD 93,000    | Principal Life Global Funding II 0.75% 12/4/2024  | 87,646      | 0.00         |
| USD 86,000    | Principal Life Global Funding II 1.25% 16/8/2026  | 76,000      | 0.00         |
| USD 3,415,000 | Prudential Financial 5.625% 15/6/2043   | 3,416,093   | 0.02         |
| USD 4,860,000 | Prudential Financial 5.875% 15/9/2042   | 4,848,555   | 0.03         |
| USD 1,562,000 | Public Service Enterprise 2.45% 15/11/2031  | 1,307,039   | 0.01         |
| USD 176,000   | Regions Financial 2.25% 18/5/2025   | 168,098     | 0.00         |
| USD 316,000   | Reliance Steel & Aluminum 2.15% 15/8/2030   | 255,706     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Republic Services 1.45% 15/2/2031   | 813,849     | 0.01         |
| USD 1,301,000 | Republic Services 5.7% 15/5/2041  | 1,397,036   | 0.01         |
| USD 1,033,000 | Roche 2.607% 13/12/2051   | 744,811     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | Roper Technologies 1.75% 15/2/2031  | 811,849     | 0.01         |
| USD 226,000   | Ryder System 2.5% 1/9/2024  | 218,805     | 0.00         |
| USD 1,025,000 | S&P Global 1.25% 15/8/2030  | 822,480     | 0.01         |
| USD 1,578,000 | S&P Global 2.3% 15/8/2060   | 967,057     | 0.01         |
| USD 3,241,000 | S&P Global 2.45% 1/3/2027   | 3,035,613   | 0.02         |
| USD 2,250,000 | Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025  | 2,225,599   | 0.01         |

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

| 保有高             | 銘柄  | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------------|---|-------------|--------------|
|                 | <b>米国(続き)</b>   |             |              |
| USD 1,033,000   | Salesforce 2.9% 15/7/2051                                 | 778,313     | 0.01         |
| USD 1,481,000   | Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024                  | 1,331,370   | 0.01         |
| USD 2,023,000   | Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023                   | 1,974,447   | 0.01         |
| USD 1,723,000   | Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025                   | 1,509,847   | 0.01         |
| USD 3,378,000   | Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025                   | 3,257,758   | 0.02         |
| USD 1,025,000   | Sherwin-Williams 2.2% 15/3/2032                           | 835,261     | 0.01         |
| USD 3,180,000   | Sherwin-Williams 2.9% 15/3/2052                           | 2,164,820   | 0.01         |
| USD 1,980,000   | Sherwin-Williams 4.05% 8/8/2024                           | 1,977,764   | 0.01         |
| USD 1,330,000   | Sherwin-Williams 4.25% 8/8/2025                           | 1,331,154   | 0.01         |
| USD 132,000     | Simon Property 3.375% 1/10/2024                           | 130,651     | 0.00         |
| USD 1,060,000   | SK Battery America 2.125% 26/1/2026                       | 945,260     | 0.01         |
| USD 8,806,544   | SLM Private Education Loan Trust 2010-C 7.141% 15/10/2041 | 9,610,236   | 0.06         |
| USD 8,880,000   | SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053   | 8,115,986   | 0.06         |
| USD 2,600,000   | SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053   | 2,444,936   | 0.02         |
| USD 795,000     | Sprint 7.125% 15/6/2024                                   | 824,232     | 0.01         |
| USD 2,957,000   | Sprint 7.875% 15/9/2023                                   | 3,047,372   | 0.02         |
| USD 324,000     | Steel Dynamics 5% 15/12/2026                              | 323,903     | 0.00         |
| USD 526,000     | Stem 0.5% 1/12/2028                                       | 425,078     | 0.00         |
| USD 3,435,000   | Talen Energy Supply 6.625% 15/1/2028                      | 3,491,574   | 0.02         |
| USD 2,500,000   | Talen Energy Supply 7.25% 15/5/2027                       | 2,571,875   | 0.02         |
| USD 2,354,000   | Talen Energy Supply 7.625% 1/6/2028                       | 2,423,328   | 0.02         |
| USD 7,133,000   | Tap Rock Resources 7% 1/10/2026                           | 6,766,114   | 0.04         |
| USD 2,000       | Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028                         | 1,821       | 0.00         |
| USD 3,466,000   | Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030                         | 3,314,189   | 0.02         |
| USD 1,737,000   | Texas Instruments 4.1% 16/8/2052                          | 1,674,869   | 0.01         |
| USD 71,000      | Thermo Fisher Scientific 1.215% 18/10/2024                | 67,198      | 0.00         |
| USD 1,675,000   | Thermo Fisher Scientific 2.8% 15/10/2041                  | 1,314,283   | 0.01         |
| USD 1,025,000   | T-Mobile USA 2.25% 15/11/2031                             | 828,750     | 0.01         |
| USD 4,734,000   | T-Mobile USA 3.375% 15/4/2029                             | 4,281,619   | 0.03         |
| USD 5,376,000   | T-Mobile USA 3.5% 15/4/2025                               | 5,251,525   | 0.03         |
| USD 383,000     | Toyota Motor Credit 1.8% 13/2/2025                        | 364,621     | 0.00         |
| USD 1,025,000   | Toyota Motor Credit 1.9% 12/9/2031                        | 851,165     | 0.01         |
| USD 227,000     | Toyota Motor Credit 3.05% 22/3/2027                       | 218,191     | 0.00         |
| USD 529,000     | Truist Bank 3.3% 15/5/2026                                | 509,887     | 0.00         |
| USD 610,000     | Truist Bank 3.8% 30/10/2026                               | 596,754     | 0.00         |
| USD 2,520,000   | Truist Financial 1.267% 2/3/2027                          | 2,268,053   | 0.02         |
| USD 3,113,000   | Truist Financial 4.26% 28/7/2026                          | 3,111,730   | 0.02         |
| USD 2,668,000   | Truist Financial 4.916% 28/7/2033                         | 2,580,421   | 0.02         |
| USD 150,000     | TWDC Enterprises 18 3.15% 17/9/2025                       | 146,778     | 0.00         |
| USD 632,000     | UDR 2.1% 1/8/2032   | 489,485     | 0.00         |
| USD 1,578,000   | Union Pacific 3.5% 14/2/2053                              | 1,300,819   | 0.01         |
| USD 150,000,000 | United States Cash Management Bill 0% 8/11/2022           | 149,272,755 | 0.99         |
| USD 125,000,000 | United States Cash Management Bill 0% 15/11/2022          | 124,306,510 | 0.82         |
| USD 335,000,000 | United States Cash Management Bill 0% 22/11/2022          | 332,872,603 | 2.20         |
| USD 65,000,000  | United States Treasury Bill 0% 1/9/2022                   | 65,000,000  | 0.43         |
| USD 243,750,000 | United States Treasury Bill 0% 6/9/2022                   | 243,680,751 | 1.61         |
| USD 185,000,000 | United States Treasury Bill 0% 8/9/2022                   | 184,928,046 | 1.22         |
| USD 249,800,000 | United States Treasury Bill 0% 13/9/2022                  | 249,618,230 | 1.65         |
| USD 390,000,000 | United States Treasury Bill 0% 15/9/2022                  | 389,668,305 | 2.58         |
| USD 150,000,000 | United States Treasury Bill 0% 20/9/2022                  | 149,828,037 | 0.99         |
| USD 168,000,000 | United States Treasury Bill 0.00% 22/9/2022               | 167,795,425 | 1.12         |
| USD 230,000,000 | United States Treasury Bill 0% 27/9/2022                  | 229,620,436 | 1.52         |
| USD 60,000,000  | United States Treasury Bill 0% 4/10/2022                  | 59,873,115  | 0.40         |



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

| 保有高             | 銘柄   | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------------|--|-------------|--------------|
|                 | <b>米国(続き)</b>  |             |              |
| USD 80,000,000  | United States Treasury Bill 0% 6/10/2022                         | 79,824,896  | 0.53         |
| USD 157,000,000 | United States Treasury Bill 0% 11/10/2022                        | 156,582,053 | 1.04         |
| USD 175,000,000 | United States Treasury Bill 0% 18/10/2022                        | 174,432,360 | 1.16         |
| USD 183,000,000 | United States Treasury Bill 0% 25/10/2022                        | 182,290,417 | 1.21         |
| USD 100,000,000 | United States Treasury Bill 0% 27/10/2022                        | 99,605,258  | 0.66         |
| USD 115,000,000 | United States Treasury Bill 0% 3/11/2022                         | 114,469,036 | 0.76         |
| USD 195,000,000 | United States Treasury Bill 0% 10/11/2022                        | 194,009,301 | 1.29         |
| USD 275,000,000 | United States Treasury Bill 0% 17/11/2022                        | 273,406,215 | 1.81         |
| USD 22,332,000  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027  | 22,909,702  | 0.15         |
| USD 92,053,700  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024    | 107,322,415 | 0.71         |
| USD 34,864,200  | United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041                 | 26,189,688  | 0.17         |
| USD 48,658,700  | United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2032                | 43,735,808  | 0.29         |
| USD 112,171,700 | United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/2/2052                 | 90,718,862  | 0.60         |
| USD 22,961,000  | United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042                | 19,231,631  | 0.13         |
| USD 902,869,600 | United States Treasury Note/Bond 2.75% 30/4/2027                 | 880,967,961 | 5.84         |
| USD 78,920,000  | United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2032                | 77,323,103  | 0.51         |
| USD 55,520,200  | United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042                 | 53,603,018  | 0.35         |
| USD 1,033,000   | UnitedHealth 2.9% 15/5/2050                                      | 770,472     | 0.01         |
| USD 319,000     | UnitedHealth 3.1% 15/3/2026                                      | 312,416     | 0.00         |
| USD 2,762,000   | UnitedHealth 6.875% 15/2/2038                                    | 3,394,345   | 0.02         |
| USD 1,190,000   | Univision Communications 7.375% 30/6/2030                        | 1,179,552   | 0.01         |
| USD 355,843     | Upstart Pass-Through Trust Series 2020-ST5 2% 20/7/2027          | 335,579     | 0.00         |
| USD 1,711,000   | US Bancorp 2.215% 27/1/2028                                      | 1,567,085   | 0.01         |
| USD 194,000     | US Bancorp 3.1% 27/4/2026  | 187,160     | 0.00         |
| USD 3,274,000   | US Bancorp 3.9% 26/4/2028  | 3,227,886   | 0.02         |
| USD 7,939,000   | US Bancorp 4.548% 22/7/2028                                      | 7,999,415   | 0.05         |
| USD 2,999,000   | US Bancorp 4.967% 22/7/2033                                      | 2,971,773   | 0.02         |
| USD 2,381,000   | USB Capital IX 3.532% 15/10/2170                                 | 1,801,531   | 0.01         |
| USD 1,025,000   | Verizon Communications 1.68% 30/10/2030                          | 823,818     | 0.01         |
| USD 3,215,000   | Verizon Communications 2.625% 15/8/2026                          | 3,038,167   | 0.02         |
| USD 614,000     | Verizon Communications 2.875% 20/11/2050                         | 428,014     | 0.00         |
| USD 7,329,000   | Verizon Communications 2.987% 30/10/2056                         | 5,011,936   | 0.03         |
| USD 1,025,000   | Visa 1.1% 15/2/2031  | 824,702     | 0.01         |
| USD 2,742,000   | Visa 2% 15/8/2050  | 1,816,739   | 0.01         |
| USD 7,002,000   | Vistra Operations 5.625% 15/2/2027                               | 6,765,297   | 0.04         |
| USD 6,248,000   | VMware 1.8% 15/8/2028  | 5,225,940   | 0.03         |
| USD 1,025,000   | VMware 2.2% 15/8/2031  | 805,448     | 0.01         |
| USD 1,350,000   | VNDO Trust 2016-350P 4.033% 10/1/2035                            | 1,195,477   | 0.01         |
| USD 1,033,000   | Walmart 2.65% 22/9/2051  | 786,981     | 0.00         |
| USD 3,341,000   | Walt Disney 2.2% 13/1/2028                                       | 3,059,493   | 0.02         |
| USD 1,033,000   | Walt Disney 2.75% 1/9/2049                                       | 753,236     | 0.01         |
| USD 587,000     | Walt Disney 6.55% 15/3/2033                                      | 679,913     | 0.00         |
| USD 1,025,000   | Waste Management 1.5% 15/3/2031                                  | 816,187     | 0.01         |
| USD 3,121,000   | Waste Management 3.15% 15/11/2027                                | 2,984,043   | 0.02         |
| USD 3,735,000   | Wells Fargo 2.164% 11/2/2026                                     | 3,516,424   | 0.02         |
| USD 4,725,000   | Wells Fargo 3.526% 24/3/2028                                     | 4,470,981   | 0.03         |
| USD 9,060,000   | Wells Fargo 4.54% 15/8/2026                                      | 9,025,189   | 0.06         |
| USD 5,264,000   | Wells Fargo 4.897% 25/7/2033                                     | 5,223,681   | 0.03         |
| USD 2,000,000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 3.872% 15/5/2048  | 1,932,781   | 0.01         |
| USD 796,545     | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3.903% 15/7/2050  | 712,499     | 0.00         |
| USD 1,318,000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.874% 15/6/2036 | 1,227,364   | 0.01         |
| USD 3,225,000   | Welltower 2.7% 15/2/2027   | 2,998,587   | 0.02         |
| USD 3,681,000   | Welltower 4.5% 15/1/2024   | 3,695,307   | 0.02         |

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

| 保有高   | 銘柄  | 時価<br>(米ドル)           | 純資産比率<br>(%) |
|---|---|-----------------------|--------------|
|   | <b>米国(続き)</b>   |                       |              |
| USD 1,635,000   | Western Digital 4.75% 15/2/2026                       | 1,575,551             | 0.01         |
| USD 6,196,000   | Workday 3.5% 1/4/2027                                 | 5,936,794             | 0.04         |
| USD 2,360,000   | Workday 3.7% 1/4/2029                                 | 2,231,468             | 0.01         |
| USD 1,732,000   | WRKCo 3.75% 15/3/2025                                 | 1,704,324             | 0.01         |
| USD 1,156,000   | WRKCo 4.65% 15/3/2026                                 | 1,163,012             | 0.01         |
| USD 124,000   | WRKCo 4.9% 15/3/2029                                  | 124,504               | 0.00         |
| USD 2,056,000   | Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025 | 1,965,850             | 0.01         |
| USD 5,147,000   | Xerox 5% 15/8/2025                                    | 4,781,743             | 0.03         |
| USD 3,285,000   | Xerox 5.5% 15/8/2028                                  | 2,867,524             | 0.02         |
|   |   | <u>5,869,536,884</u>  | <u>38.87</u> |
| 債券合計  |   | <u>6,824,648,948</u>  | <u>45.20</u> |
|   | <b>コマーシャル・ペーパー</b>                                    |                       |              |
|   | <b>米国</b>   |                       |              |
| USD 8,545,000   | General Motors Financial 0% 13/2/2023                 | 8,389,812             | 0.06         |
| USD 8,545,000   | General Motors Financial 0% 14/2/2023                 | 8,388,643             | 0.05         |
| USD 8,555,000   | General Motors Financial 0% 15/2/2023                 | 8,397,248             | 0.06         |
|   |   | <u>25,175,703</u>     | <u>0.17</u>  |
| コマーシャル・ペーパー合計   |   | <u>25,175,703</u>     | <u>0.17</u>  |
| 公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている<br>譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計 |   | <u>14,663,690,181</u> | <u>97.12</u> |

## その他の譲渡可能な有価証券

| 保有高                   | 銘柄                         | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|-----------------------|----------------------------|-------------|--------------|
| <b>普通／優先株式およびワラント</b> |                            |             |              |
|                       | <b>オーストラリア</b>             |             |              |
| 9,488,465             | Quintis Pty                | 520,235     | 0.00         |
|                       | <b>ケイマン諸島</b>              |             |              |
| 609                   | Marco Polo Investment      | —           | 0.00         |
|                       | <b>インド</b>                 |             |              |
| 2,463                 | Think & Learn Pvt          | 9,398,612   | 0.06         |
| 3,482                 | Think & Learn Pvt          | 13,287,035  | 0.09         |
|                       |                            | 22,685,647  | 0.15         |
|                       | <b>英国</b>                  |             |              |
| 413,408               | 10X Future Technologies    | 6,766,656   | 0.05         |
| 107,909               | Lookout                    | 971,181     | 0.01         |
| 1,919,121             | Lookout Series F           | 17,272,089  | 0.12         |
| 24,103                | Neon Payments              | 12,296,387  | 0.08         |
| 652,238               | NMC Health                 | —           | 0.00         |
|                       |                            | 37,306,313  | 0.26         |
|                       | <b>米国</b>                  |             |              |
| 63,622                | Aiven                      | 7,455,862   | 0.05         |
| 21,376                | Breeze Aviation            | 7,674,412   | 0.05         |
| 190,437               | ByteDance                  | 30,536,521  | 0.20         |
| 26,463                | Caresyntax                 | 1,771,962   | 0.01         |
| 488,757               | Databricks                 | 30,918,768  | 0.21         |
| 136,950               | Databricks                 | 8,663,457   | 0.06         |
| 1,209,710             | Deep Instinct              | 6,266,298   | 0.04         |
| 24,969                | Epic Games                 | 23,221,170  | 0.15         |
| 941,683               | eXo Imaging                | 4,256,407   | 0.03         |
| 420,195               | Fanatics                   | 28,127,853  | 0.19         |
| 157,436               | Farmer' s Business Network | 8,507,841   | 0.06         |
| 23,814                | Farmer' s Business Network | 1,286,909   | 0.01         |
| 25,662                | FLYR (Wts 31/12/2049       | 371,329     | 0.01         |
| 235,953               | GM Cruise                  | 4,978,608   | 0.03         |
| 6,145,462             | Included Health            | 10,262,922  | 0.07         |
| 3,924,026             | JumpCloud                  | 19,266,968  | 0.13         |
| 258,097               | JumpCloud                  | 1,267,256   | 0.01         |
| 592,242               | Lessen                     | 5,448,627   | 0.03         |
| 760,471               | Loadsmart                  | 12,502,143  | 0.08         |
| 95,378                | Loadsmart                  | 1,568,014   | 0.01         |
| 231,287               | Mountain Digital           | 3,351,349   | 0.02         |
| 561,098               | Mythic                     | 3,125,316   | 0.02         |
| 4,980                 | NCB Warrant                | —           | 0.00         |
| 750,669               | Noodle                     | 4,346,373   | 0.03         |
| 129,448               | Psiquantum                 | 3,313,869   | 0.02         |
| 261,161               | Relativity Space           | 4,823,644   | 0.03         |
| 3,662                 | Salt Pay                   | 4,810,513   | 0.03         |
| 134,315               | SambaNova Systems          | 10,205,254  | 0.07         |
| 46,362                | SambaNova Systems          | 3,522,585   | 0.02         |
| 167,805               | Snorkel AI                 | 1,656,235   | 0.01         |
| 46,853                | Snorkel AI                 | 462,439     | 0.00         |
| 1,121,246             | Ursa Major Technologies    | 6,133,216   | 0.04         |
| 1,197,196             | Verge Alalytics            | 5,890,204   | 0.04         |
| 337,227               | Zero Mass Water            | 12,278,435  | 0.08         |
| 24,317                | Zero Mass Water            | 996,024     | 0.01         |
|                       |                            | 279,268,783 | 1.85         |

## その他の譲渡可能な有価証券(続き)

| 保有高              | 銘柄                                   | 時価<br>(米ドル)    | 純資産比率<br>(%) |
|------------------|--------------------------------------|----------------|--------------|
| 普通/優先株式およびワラント合計 |                                      | 339,780,978    | 2.26         |
| <b>債券</b>        |                                      |                |              |
|                  | <b>オーストラリア</b>                       |                |              |
| USD 19,413,818   | Quintis Australia Pty 7.5% 1/10/2026 | 19,413,818     | 0.13         |
| USD 17,943,829   | Quintis Australia Pty 0% 1/10/2028   | 17,943,829     | 0.12         |
|                  |                                      | 37,357,647     | 0.25         |
|                  | <b>ケイマン諸島</b>                        |                |              |
| CNY 103,700,000  | Fresh Express Delivery 0% 18/10/2010 | -              | 0.00         |
|                  | <b>インド</b>                           |                |              |
| USD 19,051,000   | REI Agro 5.5% 13/11/2014             | 2              | 0.00         |
|                  | <b>米国</b>                            |                |              |
| USD 2,090,000    | Calpine Escrow 0% 31/12/2049         | -              | 0.00         |
| USD 4,766,000    | FLYR 10% 20/1/2027                   | 4,426,661      | 0.03         |
| USD 9,079,000    | FLYR 8% 20/7/2023                    | 9,401,304      | 0.06         |
|                  |                                      | 13,827,965     | 0.09         |
| 債券合計             |                                      | 51,185,614     | 0.34         |
| その他の譲渡可能な有価証券合計  |                                      | 390,966,592    | 2.60         |
| 投資有価証券合計         |                                      | 15,054,656,773 | 99.72        |
| その他の純資産          |                                      | 42,154,945     | 0.28         |
| 純資産合計(米ドル)       |                                      | 15,096,811,718 | 100.00       |

\* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

## 未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

| 通貨      | 買予約             | 通貨  | 売予約            | 取引相手            | 期日         | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|---------|-----------------|-----|----------------|-----------------|------------|---------------------|
| AUD     | 70,573,919      | USD | 48,620,187     | Deutsche Bank   | 15/9/2022  | (241,825)           |
| AUD     | 47,016,830      | USD | 32,491,460     | JP Morgan       | 20/10/2022 | (245,714)           |
| AUD     | 245,202,255     | USD | 172,276,407    | Barclays        | 18/11/2022 | (4,039,174)         |
| BRL     | 281,353,778     | USD | 55,831,917     | Goldman Sachs   | 15/9/2022  | (1,659,839)         |
| CAD     | 40,017,464      | USD | 30,945,533     | Deutsche Bank   | 15/9/2022  | (476,952)           |
| CAD     | 108,607,331     | USD | 84,026,880     | Deutsche Bank   | 20/10/2022 | (1,351,815)         |
| CHF     | 219,303,867     | USD | 232,586,412    | JP Morgan       | 18/11/2022 | (7,224,101)         |
| CNH     | 176,229,876     | USD | 26,008,769     | UBS             | 15/9/2022  | (461,278)           |
| DKK     | 81,144,917      | USD | 11,722,517     | Morgan Stanley  | 15/9/2022  | (797,829)           |
| DKK     | 4,100,891       | USD | 592,741        | BNP Paribas     | 15/9/2022  | (40,630)            |
| EUR     | 531,533,525     | USD | 557,133,243    | HSBC Bank       | 15/9/2022  | (24,896,266)        |
| EUR     | 14,296,505      | USD | 15,044,713     | BNP Paribas     | 21/9/2022  | (723,396)           |
| EUR     | 36,212,898      | USD | 37,397,422     | JP Morgan       | 21/9/2022  | (1,121,675)         |
| EUR     | 70,915,603      | USD | 72,573,482     | Deutsche Bank   | 18/11/2022 | (1,251,526)         |
| EUR     | 23,354,265      | USD | 23,393,944     | Bank of America | 21/9/2022  | 853                 |
| GBP     | 27,260,276      | EUR | 31,279,971     | Citigroup       | 15/9/2022  | 331,750             |
| GBP     | 41,577,301      | USD | 50,276,278     | JP Morgan       | 18/11/2022 | (1,939,470)         |
| IDR     | 250,461,694,266 | USD | 16,539,767     | HSBC Bank       | 19/10/2022 | 298,025             |
| JPY     | 3,220,026,057   | USD | 24,184,810     | State Street    | 15/9/2022  | (961,930)           |
| JPY     | 92,380,298,781  | USD | 688,665,157    | Morgan Stanley  | 15/9/2022  | (22,416,946)        |
| JPY     | 9,986,133,119   | USD | 75,738,303     | JP Morgan       | 21/9/2022  | (3,682,804)         |
| JPY     | 13,764,936,287  | EUR | 97,665,741     | JP Morgan       | 20/10/2022 | 1,542,379           |
| JPY     | 26,475,058,037  | USD | 198,273,694    | JP Morgan       | 18/11/2022 | (6,204,375)         |
| KRW     | 78,081,218,487  | USD | 58,949,464     | UBS             | 23/11/2022 | (685,702)           |
| MXN     | 703,957,826     | USD | 33,935,897     | HSBC Bank       | 15/9/2022  | 894,388             |
| MXN     | 37,646,712      | USD | 1,813,304      | Morgan Stanley  | 20/10/2022 | 36,433              |
| MXN     | 767,640,906     | USD | 36,968,484     | Deutsche Bank   | 20/10/2022 | 748,848             |
| NOK     | 673,042,078     | CHF | 65,615,533     | UBS             | 18/11/2022 | 246,520             |
| NZD     | 14,141,546      | USD | 8,791,192      | Deutsche Bank   | 15/9/2022  | (127,739)           |
| PLN     | 35,211,957      | USD | 8,095,177      | Barclays        | 15/9/2022  | (658,338)           |
| SEK     | 230,969,802     | USD | 22,708,885     | Citigroup       | 15/9/2022  | (1,048,980)         |
| USD     | 36,814,880      | BRL | 182,292,562    | HSBC Bank       | 2/9/2022   | 1,598,651           |
| USD     | 69,653,098      | INR | 5,489,360,695  | Citigroup       | 15/9/2022  | 690,776             |
| USD     | 37,678,902      | EUR | 35,842,378     | State Street    | 15/9/2022  | 1,789,089           |
| USD     | 2,255,068       | EUR | 2,145,649      | Deutsche Bank   | 15/9/2022  | 106,580             |
| USD     | 62,403,159      | SEK | 634,518,749    | UBS             | 15/9/2022  | 2,899,207           |
| USD     | 23,631,366      | EUR | 22,423,451     | Barclays        | 21/9/2022  | 1,168,998           |
| USD     | 16,319,224      | EUR | 15,359,880     | BNP Paribas     | 21/9/2022  | 932,686             |
| USD     | 98,499,547      | JPY | 13,237,561,952 | Barclays        | 15/9/2022  | 3,030,036           |
| USD     | 114,899,481     | EUR | 112,140,518    | Bank of America | 21/9/2022  | 2,564,338           |
| USD     | 14,288,924      | EUR | 14,272,938     | Morgan Stanley  | 21/9/2022  | (8,785)             |
| USD     | 46,760,057      | CNH | 316,970,167    | JP Morgan       | 21/9/2022  | 807,354             |
| USD     | 181,221,260     | AUD | 262,728,302    | JP Morgan       | 20/10/2022 | 1,033,225           |
| USD     | 35,924,831      | NOK | 355,768,865    | Deutsche Bank   | 20/10/2022 | 168,872             |
| USD     | 68,929,384      | HKD | 539,903,185    | Deutsche Bank   | 20/10/2022 | 73,143              |
| USD     | 101,905,081     | CNH | 686,830,057    | Deutsche Bank   | 20/10/2022 | 2,291,590           |
| USD     | 22,916,722      | EUR | 22,410,066     | JP Morgan       | 21/9/2022  | 467,763             |
| USD     | 68,767,837      | HKD | 538,370,968    | JP Morgan       | 18/11/2022 | 74,759              |
| USD     | 34,155,395      | BRL | 176,829,312    | Goldman Sachs   | 2/12/2022  | 748,632             |
| ZAR     | 1,352,270       | USD | 83,191         | Morgan Stanley  | 15/9/2022  | (4,023)             |
| ZAR     | 128,798,802     | USD | 7,921,286      | HSBC Bank       | 15/9/2022  | (380,852)           |
| 未実現純評価損 |                 |     |                |                 |            | (58,107,069)        |

## 未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

| 通貨   | 買予約           | 通貨  | 売予約           | 取引相手       | 期日        | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|--|---------------|-----|---------------|------------|-----------|---------------------|
| <b>ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス</b>                       |               |     |               |            |           |                     |
| AUD  | 297,224,309   | USD | 207,481,530   | BNY Mellon | 15/9/2022 | (3,733,721)         |
| USD  | 11,704,187    | AUD | 16,950,001    | BNY Mellon | 15/9/2022 | 84,959              |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (3,648,762)         |
| <b>ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス</b>                   |               |     |               |            |           |                     |
| CHF  | 30,478,947    | USD | 31,929,048    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (773,596)           |
| USD  | 1,660,122     | CHF | 1,595,314     | BNY Mellon | 15/9/2022 | 29,410              |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (744,186)           |
| <b>ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス</b>                |               |     |               |            |           |                     |
| CNY  | 174,392,431   | USD | 25,802,182    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (520,997)           |
| USD  | 1,993,675     | CNY | 13,665,289    | BNY Mellon | 15/9/2022 | 12,659              |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (508,338)           |
| <b>ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス</b>                       |               |     |               |            |           |                     |
| EUR  | 1,969,908,422 | USD | 2,012,882,209 | BNY Mellon | 15/9/2022 | (40,330,757)        |
| USD  | 109,468,504   | EUR | 108,874,193   | BNY Mellon | 15/9/2022 | 449,822             |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (39,880,935)        |
| <b>ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス</b>                      |               |     |               |            |           |                     |
| GBP  | 119,831,361   | USD | 145,166,238   | BNY Mellon | 15/9/2022 | (6,023,202)         |
| USD  | 8,240,026     | GBP | 6,962,708     | BNY Mellon | 15/9/2022 | 155,276             |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (5,867,926)         |
| <b>ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス</b>                      |               |     |               |            |           |                     |
| HKD  | 207,134,142   | USD | 26,414,125    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (15,155)            |
| USD  | 1,921,652     | HKD | 15,072,826    | BNY Mellon | 15/9/2022 | 638                 |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (14,517)            |
| <b>ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス</b>                       |               |     |               |            |           |                     |
| JPY  | 4,238,172,867 | USD | 31,519,214    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (952,429)           |
| USD  | 1,764,997     | JPY | 242,006,336   | BNY Mellon | 15/9/2022 | 19,622              |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (932,807)           |
| <b>ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス</b>                 |               |     |               |            |           |                     |
| PLN  | 46,740,325    | USD | 10,094,230    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (223,066)           |
| USD  | 611,677       | PLN | 2,909,258     | BNY Mellon | 15/9/2022 | (2,770)             |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (225,836)           |
| <b>ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス</b>                 |               |     |               |            |           |                     |
| SGD  | 93,983,575    | USD | 68,198,281    | BNY Mellon | 15/9/2022 | (934,613)           |
| USD  | 3,576,876     | SGD | 4,979,975     | BNY Mellon | 15/9/2022 | 12,727              |
| 未実現純評価損  |               |     |               |            |           | (921,886)           |
| 未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 6,603,989,075米ドル) |               |     |               |            |           | (110,852,262)       |

## 未決済上場先物取引 2022年8月31日現在

| 契約数     | 通貨  | 契約／摘要                         | 満期日      | 基礎となるエクスポージャー<br>(米ドル) | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|---------|-----|-------------------------------|----------|------------------------|---------------------|
| 18      | EUR | Euro BOBL                     | 2022年9月  | 2,218,916              | 20,709              |
| 1,063   | EUR | Euro Bund                     | 2022年9月  | 157,625,752            | (7,217,704)         |
| (163)   | EUR | Euro BUXL                     | 2022年9月  | 27,095,751             | 1,087,679           |
| (1,027) | EUR | Euro Schatz                   | 2022年9月  | 111,641,906            | (653,936)           |
| 264     | EUR | Euro-BTP                      | 2022年9月  | 31,698,933             | (278,820)           |
| (34)    | JPY | Nikkei 225 (Yen)              | 2022年9月  | 3,432,945              | 15,309              |
| (145)   | JPY | Japanese 10 Year Bond (OSE)   | 2022年9月  | 156,203,652            | (369,979)           |
| 87      | CAD | S&P/TSX 60 Index              | 2022年9月  | 15,534,983             | (142,291)           |
| 39      | EUR | Dax Index                     | 2022年9月  | 12,619,986             | (357,491)           |
| (1,461) | EUR | EURO STOXX 50 Index           | 2022年9月  | 51,902,465             | (1,128,869)         |
| 60      | GBP | FTSE 100 Index                | 2022年9月  | 5,087,657              | 94,812              |
| 71      | EUR | FTSE MIB Market Index         | 2022年9月  | 7,722,801              | (19,533)            |
| 366     | USD | MSCI Emerging Markets Index   | 2022年9月  | 18,104,190             | (259,860)           |
| (1,173) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Index       | 2022年9月  | 292,211,895            | (21,042,443)        |
| 130     | USD | Russell 2000 E-Mini Index     | 2022年9月  | 12,058,150             | 905,755             |
| 436     | USD | S&P 500 E-Mini Index          | 2022年9月  | 87,216,350             | (3,303,542)         |
| 482     | USD | US Ultra 10 Year Note         | 2022年12月 | 60,468,406             | (407,660)           |
| 854     | USD | US Ultra Bond (CBT)           | 2022年12月 | 128,660,437            | 1,545,664           |
| (198)   | GBP | Long Gilt                     | 2022年12月 | 24,890,272             | 402,490             |
| 4,933   | USD | US Treasury 2 Year Note (CBT) | 2022年12月 | 1,027,875,329          | (867,548)           |
| (623)   | USD | US Treasury 5 Year Note (CBT) | 2022年12月 | 69,089,726             | 210,021             |
| 合計      |     |                               |          | 2,303,360,502          | (31,767,237)        |

## スワップ 2022年8月31日現在

| 種類  | 想定金額             | 摘要  | 取引相手            | 満期日        | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-----|------------------|---|-----------------|------------|---------------------|-------------|
| CDS | EUR (2,813,508)  | ファンドはITRAXX.XO.34.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る   | Bank of America | 20/12/2025 | (370,189)           | 4,710       |
| CDS | EUR (34,550,000) | ファンドはITRAXX.XO.35.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る   | Bank of America | 20/6/2026  | (4,846,937)         | (316,857)   |
| CDS | USD 70,511,631   | ファンドはCDX.NA.IG.37.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う   | Bank of America | 20/12/2026 | 1,007,333           | (430,091)   |
| CDS | USD 5,283,878    | ファンドはBombardierに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う        | Barclays        | 20/6/2023  | (317,004)           | (77,783)    |
| CDS | USD 305,000      | ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う      | Barclays        | 20/6/2024  | 5,518               | 42,388      |
| CDS | USD 985,000      | ファンドはBorgwarnerに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う        | BNP Paribas     | 20/6/2027  | (6,360)             | 7,694       |
| CDS | USD 550,000      | ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う | Citibank        | 20/6/2027  | (14,946)            | (40,407)    |
| CDS | USD 1,155,000    | ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う | Citibank        | 20/6/2027  | (56,219)            | (84,855)    |
| CDS | USD (33,871,714) | ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る   | Credit Suisse   | 20/12/2024 | (482,968)           | 155,105     |

## ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド

## スワップ 2022年8月31日現在(続き)

| 種類  | 想定金額              | 摘要  | 取引相手           | 満期日        | 未実現評価益/損<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-----|-------------------|---|----------------|------------|-------------------|-------------|
| CDS | USD 310,000       | ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う                    | Goldman Sachs  | 20/6/2024  | 5,576             | 43,082      |
| CDS | USD (258,090,985) | ファンドはCDX.NA.HY.37.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る                 | Goldman Sachs  | 20/12/2026 | (19,857,938)      | 650,467     |
| CDS | USD (442,638,788) | ファンドはCDX.NA.HY.38.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る                 | Goldman Sachs  | 20/6/2027  | (7,771,656)       | (4,537,140) |
| CDS | EUR 1,776,414     | ファンドはITRAXX.XO.37.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う                 | Goldman Sachs  | 20/6/2027  | 28,951            | 53,995      |
| CDS | USD 1,260,000     | ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う               | JP Morgan      | 20/6/2027  | 27,805            | (92,569)    |
| CDS | USD 710,000       | ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う               | JP Morgan      | 20/6/2027  | 9,329             | (52,162)    |
| CDS | USD 560,000       | ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う               | JP Morgan      | 20/6/2027  | (9,500)           | (41,142)    |
| CDS | EUR (36,694,838)  | ファンドはITRAXX.XO.36.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る                 | Morgan Stanley | 20/12/2026 | (5,129,269)       | (605,737)   |
| IFS | EUR 11,180,000    | ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.693%の固定金利を受け取る              | Goldman Sachs  | 16/8/2032  | 49,805            | 49,805      |
| IRS | USD 16,664,500    | ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.65%の固定金利を支払う                             | Goldman Sachs  | 2/5/2032   | 381,163           | 369,108     |
| IRS | USD 83,000,000    | ファンドは2.605%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う                            | Goldman Sachs  | 24/5/2032  | (2,160,676)       | (2,160,676) |
| IRS | USD 19,438,173    | ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.585%の固定金利を支払う                            | Goldman Sachs  | 26/5/2032  | 538,995           | 538,995     |
| IRS | USD 13,573,500    | ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.613%の固定金利を支払う                            | Goldman Sachs  | 2/5/2042   | 499,228           | 531,788     |
| IRS | USD 242,161,200   | ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.43%の固定金利を支払う                             | Goldman Sachs  | 2/5/2052   | 11,945,933        | 11,404,641  |
| IRS | BRL 198,073,301   | ファンドは9.385%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う                           | JP Morgan      | 2/1/2025   | (2,473,820)       | (2,473,820) |
| IRS | BRL 216,083,102   | ファンドは9.42%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う                            | JP Morgan      | 2/1/2025   | (2,658,222)       | (2,658,222) |
| IRS | BRL 215,286,626   | ファンドは9.54%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う                            | JP Morgan      | 2/1/2025   | (2,488,321)       | (2,488,321) |
| TRS | USD 10,000,000    | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Barclays       | 20/9/2022  | (296,879)         | (298,794)   |
| TRS | USD 8,115,000     | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Barclays       | 20/9/2022  | (185,664)         | (187,388)   |
| TRS | USD 14,976,000    | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Barclays       | 20/9/2022  | 258,937           | 254,587     |
| TRS | USD 15,000,000    | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Barclays       | 20/9/2022  | (148,505)         | (156,984)   |
| TRS | USD 19,094,000    | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Barclays       | 20/9/2022  | (890,489)         | (920,179)   |
| TRS | USD (613)         | ファンドはUSD 1H SOFR - 10bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0bpsを支払う             | BNP Paribas    | 2/9/2022   | 20,670            | 20,670      |
| TRS | USD (555)         | ファンドはUSD 1H SOFR - 12bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う               | BNP Paribas    | 2/9/2022   | 494               | 494         |



## スワップ 2022年8月31日現在(続き)

| 種類  | 想定金額           | 摘要  | 取引相手          | 満期日        | 未実現評価益/損<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-----|----------------|---|---------------|------------|-------------------|-------------|
| TRS | USD (15,080)   | ファンドはUSD 1H SOFR - 13bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う               | BNP Paribas   | 2/9/2022   | 13,421            | 13,421      |
| TRS | USD (13,737)   | ファンドはUSD 1H SOFR - 8bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う                | BNP Paribas   | 2/9/2022   | 12,226            | 12,226      |
| TRS | USD (6,869)    | ファンドはUSD 1H SOFR - 8bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0bpsを支払う              | BNP Paribas   | 2/9/2022   | 231,623           | 231,623     |
| TRS | USD 16,062,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (567,242)         | (570,074)   |
| TRS | USD 8,404,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (200,300)         | (202,085)   |
| TRS | USD 8,641,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (116,996)         | (119,000)   |
| TRS | USD 37,839,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | 1,024,954         | 1,024,243   |
| TRS | USD 8,000,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | 229,902           | 228,569     |
| TRS | USD 10,455,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | 103,405           | 100,503     |
| TRS | USD 9,265,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (313,017)         | (319,254)   |
| TRS | USD 18,703,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (620,048)         | (642,870)   |
| TRS | USD 30,954,000 | ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (167,570)         | (160,255)   |
| TRS | USD 52,614,000 | ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (164,449)         | (170,709)   |
| TRS | USD 10,000,100 | ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | 23,087            | 20,922      |
| TRS | USD 3,202,206  | ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (20,471)          | (21,783)    |
| TRS | USD 9,489,000  | ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う | BNP Paribas   | 20/9/2022  | (407,453)         | (420,960)   |
| TRS | USD (16,580)   | ファンドはUSD 1H SOFR - 25bpsを受け取り、Pitney Bowes + 0bpsを支払う                 | Citibank      | 27/12/2022 | 15,419            | 15,419      |
| TRS | USD 12,000,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | 83,836            | 81,000      |
| TRS | USD 18,018,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | 259,379           | 255,849     |
| TRS | USD 40,326,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (347,836)         | (358,869)   |
| TRS | USD 10,455,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (49,830)          | (52,691)    |
| TRS | USD 13,367,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (130,610)         | (134,492)   |
| TRS | USD 18,703,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (771,778)         | (797,770)   |
| TRS | USD 18,703,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (633,121)         | (656,513)   |
| TRS | USD 18,961,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (483,648)         | (507,989)   |
| TRS | USD 9,489,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (212,182)         | (231,762)   |
| TRS | USD 18,978,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (227,559)         | (266,719)   |
| TRS | USD 6,254,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Goldman Sachs | 20/9/2022  | (87,794)          | (101,875)   |
| TRS | USD 30,000     | ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う            | JP Morgan     | 16/9/2022  | (160,301)         | (160,301)   |

## ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド

## スワップ 2022年8月31日現在(続き)

| 種類  | 想定金額            | 摘要  | 取引相手           | 満期日        | 未実現評価益/損<br>(米ドル)   | 時価<br>(米ドル)        |
|---|-----------------|---|----------------|------------|---------------------|--------------------|
| TRS   | USD 7,000,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | JP Morgan      | 20/9/2022  | 186,473             | 185,908            |
| TRS   | USD 13,514,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | JP Morgan      | 20/9/2022  | (760)               | (3,517)            |
| TRS   | USD 13,367,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | JP Morgan      | 20/9/2022  | (109,119)           | (113,058)          |
| TRS   | USD 14,339,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | JP Morgan      | 20/9/2022  | (444,515)           | (468,248)          |
| TRS   | USD 83,557      | ファンドはJPMEMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 65bpsを支払う            | JP Morgan      | 15/11/2022 | (2,127,422)         | (2,127,422)        |
| TRS   | USD 82,443      | ファンドはJPMEMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 65bpsを支払う            | JP Morgan      | 16/11/2022 | (1,824,750)         | (1,824,750)        |
| TRS   | USD 148,572,000 | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | 4,637,342           | 4,600,352          |
| TRS   | USD 7,000,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | 271,762             | 271,034            |
| TRS   | USD 18,125,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (185,485)           | (193,302)          |
| TRS   | USD 7,621,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (157,630)           | (161,387)          |
| TRS   | USD 7,621,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (141,485)           | (145,242)          |
| TRS   | USD 32,426,000  | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (983,255)           | (1,005,084)        |
| TRS   | USD 9,489,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (419,206)           | (432,712)          |
| TRS   | USD 6,254,000   | ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う | Morgan Stanley | 20/9/2022  | (78,536)            | (92,618)           |
| 合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 2,219,961,372 米ドル) |                 |   |                |            | <u>(40,447,364)</u> | <u>(8,917,840)</u> |

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレ・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

## 買建オプション 2022年8月31日現在

| 契約数         | コール<br>／<br>プット | 摘要                          | 取引相手            | 行使価格       | 満期日        | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-------------|-----------------|-----------------------------|-----------------|------------|------------|---------------------|-------------|
| 94,878,937  | コール             | OTC EUR/USD                 | Bank of America | EUR 1.09   | 29/9/2022  | (101,742)           | 3,399       |
| 94,878,937  | プット             | OTC EUR/USD                 | Bank of America | EUR 1.005  | 29/9/2022  | 305,674             | 1,318,213   |
| 89,744,178  | コール             | OTC USD/CNH                 | Goldman Sachs   | USD 6.79   | 26/9/2022  | 780,634             | 1,508,998   |
| 73,285,792  | コール             | OTC USD/CNH                 | Goldman Sachs   | USD 6.8    | 27/10/2022 | 569,482             | 1,260,933   |
| 60,052,401  | プット             | OTC EUR/CHF                 | JP Morgan       | EUR 0.965  | 14/9/2022  | (318,946)           | 126,367     |
| 143,408,720 | コール             | OTC USD/CNH                 | JP Morgan       | USD 6.8    | 15/9/2022  | 746,118             | 2,134,458   |
| 110,295,965 | プット             | OTC USD/JPY                 | RBC             | USD 130    | 8/9/2022   | (1,389,987)         | 293         |
| 3,095       | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 400    | 2/9/2022   | (875,047)           | 1,159,078   |
| 2,105       | コール             | Alphabet                    | Exchange Traded | USD 115    | 16/9/2022  | (288,590)           | 321,013     |
| 1,710       | プット             | Apple                       | Exchange Traded | USD 140    | 16/9/2022  | (714,228)           | 50,445      |
| 1,540       | プット             | ConocoPhillips              | Exchange Traded | USD 75     | 16/9/2022  | (732,623)           | 10,010      |
| 941         | プット             | Dollar Tree                 | Exchange Traded | USD 145    | 16/9/2022  | 186,992             | 851,605     |
| 179         | コール             | Domino' s Pizza             | Exchange Traded | USD 400    | 16/9/2022  | (241,762)           | 39,380      |
| 557         | コール             | Eli Lilly                   | Exchange Traded | USD 330    | 16/9/2022  | (197,306)           | 96,361      |
| 1,007       | プット             | Exxon Mobil                 | Exchange Traded | USD 100    | 16/9/2022  | 100,889             | 662,103     |
| 1,173       | プット             | Ford Motor                  | Exchange Traded | USD 10     | 16/9/2022  | (36,540)            | 1,173       |
| 3,342       | コール             | General Motors              | Exchange Traded | USD 45     | 16/9/2022  | (644,101)           | 31,749      |
| 1,799       | コール             | General Motors              | Exchange Traded | USD 38     | 16/9/2022  | (316,474)           | 365,197     |
| 452         | コール             | HCA Healthcare              | Exchange Traded | USD 220    | 16/9/2022  | (260,908)           | 24,860      |
| 4,448       | プット             | Intel                       | Exchange Traded | USD 32.5   | 16/9/2022  | 261,413             | 529,312     |
| 215         | コール             | Intuit                      | Exchange Traded | USD 490    | 16/9/2022  | (376,837)           | 29,563      |
| 893         | コール             | Microsoft                   | Exchange Traded | USD 290    | 16/9/2022  | (640,039)           | 36,167      |
| 633         | コール             | Mosaic                      | Exchange Traded | USD 70     | 16/9/2022  | (371,363)           | 8,229       |
| 196         | プット             | Sherwin-Williams            | Exchange Traded | USD 240    | 16/9/2022  | (81,581)            | 158,760     |
| 7,130       | コール             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 430    | 16/9/2022  | (3,463,842)         | 160,425     |
| 241         | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 405    | 16/9/2022  | 205,667             | 270,643     |
| 216         | コール             | United Rentals              | Exchange Traded | USD 350    | 16/9/2022  | (156,325)           | 5,400       |
| 453         | コール             | Walt Disney                 | Exchange Traded | USD 125    | 16/9/2022  | (144,158)           | 10,872      |
| 1,414       | コール             | Western Digital             | Exchange Traded | USD 60     | 16/9/2022  | (57,362)            | 6,363       |
| 41          | プット             | US Treasury<br>10 Year Note | Exchange Traded | USD 116.5  | 23/9/2022  | 8,581               | 29,148      |
| 27          | プット             | Nasdaq-100 Index            | Exchange Traded | USD 900    | 30/9/2022  | 918,797             | 1,767,825   |
| 158         | プット             | Nasdaq-100 Index            | Exchange Traded | USD 100    | 30/9/2022  | 7,635,929           | 12,433,810  |
| 1,326       | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 410    | 30/9/2022  | 1,265,284           | 2,195,856   |
| 7,328       | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 415    | 30/9/2022  | 9,246,546           | 14,531,424  |
| 2,020       | プット             | Apple                       | Exchange Traded | USD 155    | 21/10/2022 | (255,993)           | 984,750     |
| 667         | プット             | Carnival                    | Exchange Traded | USD 5      | 21/10/2022 | (15,764)            | 5,670       |
| 190         | コール             | Eli Lilly                   | Exchange Traded | USD 330    | 21/10/2022 | (198,499)           | 113,525     |
| 2,343       | プット             | EQT                         | Exchange Traded | USD 30     | 21/10/2022 | (795,985)           | 76,148      |
| 543         | プット             | KB Home                     | Exchange Traded | USD 25     | 21/10/2022 | 3,881               | 39,368      |
| 650         | コール             | Microsoft                   | Exchange Traded | USD 290    | 21/10/2022 | (209,715)           | 198,250     |
| 208         | プット             | Sabre                       | Exchange Traded | USD 5      | 21/10/2022 | (11,314)            | 1,560       |
| 132         | プット             | Sabre                       | Exchange Traded | USD 6      | 21/10/2022 | (2,593)             | 2,838       |
| 2,956       | コール             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust   | Exchange Traded | USD 430    | 21/10/2022 | (1,432,859)         | 642,930     |
| 93          | コール             | Tesla                       | Exchange Traded | USD 316.67 | 21/10/2022 | (62,992)            | 90,908      |
| 579         | コール             | Tesla                       | Exchange Traded | USD 320    | 21/10/2022 | (439,505)           | 518,205     |
| 380         | コール             | Visa                        | Exchange Traded | USD 220    | 21/10/2022 | (64,881)            | 84,930      |
| 631         | コール             | Walt Disney                 | Exchange Traded | USD 130    | 21/10/2022 | (171,461)           | 53,951      |

## 買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

| 契約数                                       | コール<br>/ブット | 摘要                                  | 取引相手            | 行使価格        | 満期日        | 未実現評価益/損<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|---|-------------|-------------------------------------|-----------------|-------------|------------|-------------------|-------------|
| 541                                       | ブット         | Xerox Holdings                      | Exchange Traded | USD 15      | 21/10/2022 | 7,645             | 27,050      |
| 484                                       | ブット         | BHP                                 | Exchange Traded | GBP 21.83   | 18/11/2022 | 10,233            | 776,965     |
| 881                                       | コール         | Dynatrace                           | Exchange Traded | USD 45      | 18/11/2022 | (340,905)         | 149,770     |
| 654                                       | コール         | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 330     | 18/11/2022 | (11,268)          | 703,050     |
| 326                                       | コール         | Generac Holdings                    | Exchange Traded | USD 300     | 18/11/2022 | (491,839)         | 130,400     |
| 166                                       | ブット         | Rio Tinto                           | Exchange Traded | GBP 45.62   | 18/11/2022 | 127,711           | 457,684     |
| 1,803                                     | コール         | SPDR Gold Shares                    | Exchange Traded | USD 170     | 18/11/2022 | (200,546)         | 292,086     |
| 450                                       | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 395     | 18/11/2022 | 195,197           | 679,500     |
| 234                                       | コール         | Tesla                               | Exchange Traded | USD 320     | 18/11/2022 | (175,437)         | 342,225     |
| 574                                       | コール         | Western Digital                     | Exchange Traded | USD 65      | 18/11/2022 | (41,681)          | 8,036       |
| 778                                       | ブット         | Ally Financial                      | Exchange Traded | USD 20      | 16/12/2022 | (32,131)          | 13,615      |
| 3,531                                     | コール         | Commerzbank                         | Exchange Traded | EUR 9       | 16/12/2022 | (280,827)         | 40,624      |
| 662                                       | ブット         | Ford Motor                          | Exchange Traded | USD 8       | 16/12/2022 | (27,288)          | 4,965       |
| 452                                       | コール         | HCA Healthcare                      | Exchange Traded | USD 230     | 16/12/2022 | (220,228)         | 223,740     |
| 140                                       | コール         | LVMH Moët Hennessy<br>Louis Vuitton | Exchange Traded | EUR 640     | 16/12/2022 | 139,668           | 754,575     |
| 554                                       | コール         | SAP                                 | Exchange Traded | USD 100     | 16/12/2022 | (300,279)         | 73,405      |
| 1,533                                     | コール         | SPDR Gold Shares                    | Exchange Traded | USD 170     | 16/12/2022 | (194,276)         | 374,819     |
| 2,790                                     | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 350     | 16/12/2022 | (3,154,734)       | 1,795,365   |
| 794                                       | コール         | Abbott Laboratories                 | Exchange Traded | USD 125     | 20/1/2023  | (426,560)         | 55,580      |
| 143                                       | コール         | Adobe                               | Exchange Traded | USD 480     | 20/1/2023  | (396,543)         | 114,758     |
| 202                                       | コール         | Align Technology                    | Exchange Traded | USD 290     | 20/1/2023  | (473,017)         | 382,790     |
| 1,320                                     | コール         | Alphabet                            | Exchange Traded | USD 125     | 20/1/2023  | (579,709)         | 574,200     |
| 47  | コール         | Booking Holdings                    | Exchange Traded | USD 600     | 20/1/2023  | (751,423)         | 108,570     |
| 1,087                                     | ブット         | ConocoPhillips                      | Exchange Traded | USD 70      | 20/1/2023  | (599,186)         | 158,702     |
| 883                                       | コール         | Dynatrace                           | Exchange Traded | USD 45      | 20/1/2023  | (251,201)         | 240,618     |
| 279                                       | コール         | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 340     | 20/1/2023  | (229,784)         | 360,608     |
| 278                                       | コール         | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 320     | 20/1/2023  | 24,817            | 570,595     |
| 1,842                                     | ブット         | EQT                                 | Exchange Traded | USD 35      | 20/1/2023  | (616,571)         | 419,055     |
| 725                                       | ブット         | Exxon Mobil                         | Exchange Traded | USD 75      | 20/1/2023  | (293,429)         | 179,438     |
| 883                                       | コール         | Glencore                            | Exchange Traded | GBP 5.8     | 20/1/2023  | (369,664)         | 126,696     |
| 134                                       | コール         | Humana                              | Exchange Traded | USD 500     | 20/1/2023  | 88,504            | 377,880     |
| 148                                       | コール         | Intuit                              | Exchange Traded | USD 450     | 20/1/2023  | (8,070)           | 588,300     |
| 928                                       | コール         | Otis Worldwide                      | Exchange Traded | USD 85      | 20/1/2023  | (217,860)         | 111,360     |
| 323                                       | ブット         | Pioneer Natural<br>Resources        | Exchange Traded | USD 210     | 20/1/2023  | (323,720)         | 419,900     |
| 485                                       | コール         | salesforce.com                      | Exchange Traded | USD 210     | 20/1/2023  | (585,203)         | 118,340     |
| 485                                       | コール         | salesforce.com                      | Exchange Traded | USD 200     | 20/1/2023  | (487,916)         | 184,300     |
| 166                                       | コール         | ServiceNow                          | Exchange Traded | USD 550     | 20/1/2023  | (676,820)         | 252,320     |
| 2,042                                     | コール         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 430     | 20/1/2023  | (1,130,715)       | 1,912,333   |
| 634                                       | ブット         | Valero Energy                       | Exchange Traded | USD 90      | 20/1/2023  | (410,660)         | 267,865     |
| 619                                       | コール         | XPO Logistics                       | Exchange Traded | USD 57.5    | 20/1/2023  | (136,941)         | 287,835     |
| 1,781                                     | コール         | Nasdaq-100 Index                    | Goldman Sachs   | USD 707.725 | 16/9/2022  | (386,086)         | 2,324       |
| 53,489                                    | コール         | EssilorLuxottica                    | JP Morgan       | EUR 200     | 16/9/2022  | (587,124)         | 242         |
| 190,622                                   | コール         | Pioneer Natural<br>Resources        | Morgan Stanley  | USD 290     | 16/9/2022  | (3,061,612)       | 41,715      |
| 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,072,513,848米ドル) |             |                                     |                 |             |            | (10,712,913)      | 59,656,663  |

## 売建オプション 2022年8月31日現在

| 契約数           | コール<br>/ブット | 摘要                                  | 取引相手            | 行使価格      | 満期日        | 未実現評価益/(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|---------------|-------------|-------------------------------------|-----------------|-----------|------------|---------------------|-------------|
| (189,900,405) | ブット         | OTC EUR/USD                         | Bank of America | EUR 0.975 | 29/9/2022  | 93,049              | (761,356)   |
| (89,744,178)  | コール         | OTC USD/CNH                         | Goldman Sachs   | USD 6.99  | 26/9/2022  | 1,269               | (197,155)   |
| (73,285,792)  | コール         | OTC USD/CNH                         | Goldman Sachs   | USD 7.05  | 27/10/2022 | (31,588)            | (216,268)   |
| (73,285,792)  | コール         | OTC USD/CNH                         | Goldman Sachs   | USD 7.05  | 27/10/2022 | (92,415)            | (216,268)   |
| (60,052,401)  | ブット         | OTC EUR/CHF                         | JP Morgan       | EUR 0.94  | 14/9/2022  | 81,793              | (11,464)    |
| (143,408,720) | コール         | OTC USD/CNH                         | JP Morgan       | USD 7     | 15/9/2022  | 250,303             | (155,257)   |
| (110,295,965) | ブット         | OTC USD/JPY                         | RBC             | USD 125   | 8/9/2022   | 510,229             | -           |
| (12,496)      | ブット         | S&P 500 Index                       | Citibank        | USD 700   | 16/9/2022  | 1,832,442           | (141,926)   |
| (3,095)       | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 380   | 2/9/2022   | 811,709             | (26,308)    |
| (749)         | ブット         | Albemarle                           | Exchange Traded | USD 180   | 16/9/2022  | 601,757             | (26,215)    |
| (1,033)       | コール         | Alphabet                            | Exchange Traded | USD 125   | 16/9/2022  | 110,423             | (12,913)    |
| (1,331)       | コール         | Amazon.com                          | Exchange Traded | USD 150   | 16/9/2022  | 207,991             | (21,962)    |
| (1,599)       | コール         | Apple                               | Exchange Traded | USD 175   | 16/9/2022  | 125,543             | (35,978)    |
| (1,710)       | ブット         | Apple                               | Exchange Traded | USD 125   | 16/9/2022  | 253,537             | (9,405)     |
| (2,265)       | コール         | ConocoPhillips                      | Exchange Traded | USD 90    | 16/9/2022  | (3,599,619)         | (4,235,550) |
| (941)         | ブット         | Dollar Tree                         | Exchange Traded | USD 125   | 16/9/2022  | 164,102             | (73,398)    |
| (1,007)       | ブット         | Exxon Mobil                         | Exchange Traded | USD 90    | 16/9/2022  | 93,937              | (150,043)   |
| (3,342)       | コール         | General Motors                      | Exchange Traded | USD 52.5  | 16/9/2022  | 223,147             | (6,684)     |
| (3,342)       | ブット         | General Motors                      | Exchange Traded | USD 32    | 16/9/2022  | 562,366             | (25,065)    |
| (169)         | コール         | LVMH Moet Hennessy<br>Louis Vuitton | Exchange Traded | EUR 730   | 16/9/2022  | 103,280             | (17,837)    |
| (893)         | コール         | Microsoft                           | Exchange Traded | USD 310   | 16/9/2022  | 90,880              | (8,037)     |
| (399)         | コール         | NVIDIA                              | Exchange Traded | USD 215   | 16/9/2022  | 176,462             | (1,397)     |
| (122)         | コール         | ServiceNow                          | Exchange Traded | USD 520   | 16/9/2022  | 63,819              | (10,675)    |
| (121)         | コール         | ServiceNow                          | Exchange Traded | USD 560   | 16/9/2022  | 99,553              | (5,445)     |
| (424)         | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 385   | 16/9/2022  | (53,504)            | (148,824)   |
| (216)         | ブット         | United Rentals                      | Exchange Traded | USD 270   | 16/9/2022  | 57,332              | (68,580)    |
| (453)         | ブット         | Walt Disney                         | Exchange Traded | USD 110   | 16/9/2022  | (32,947)            | (79,502)    |
| (158)         | ブット         | Nasdaq-100 Index                    | Exchange Traded | USD 100   | 30/9/2022  | (2,789,860)         | (4,528,280) |
| (27)          | ブット         | Nasdaq-100 Index                    | Exchange Traded | USD 900   | 30/9/2022  | (317,081)           | (613,980)   |
| (7,328)       | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 390   | 30/9/2022  | (3,436,087)         | (5,389,744) |
| (1,326)       | ブット         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 385   | 30/9/2022  | (458,819)           | (783,003)   |
| (1,331)       | ブット         | Alphabet                            | Exchange Traded | USD 105   | 21/10/2022 | (116,109)           | (419,265)   |
| (1,330)       | コール         | Amazon.com                          | Exchange Traded | USD 160   | 21/10/2022 | 298,593             | (73,150)    |
| (1,149)       | ブット         | Amazon.com                          | Exchange Traded | USD 120   | 21/10/2022 | (82,999)            | (430,875)   |
| (2,020)       | ブット         | Apple                               | Exchange Traded | USD 135   | 21/10/2022 | 145,978             | (227,250)   |
| (917)         | ブット         | Apple                               | Exchange Traded | USD 150   | 21/10/2022 | (99,710)            | (318,657)   |
| (181)         | コール         | Costco Wholesale                    | Exchange Traded | USD 580   | 21/10/2022 | 98,690              | (81,903)    |
| (257)         | ブット         | Costco Wholesale                    | Exchange Traded | USD 490   | 21/10/2022 | (89,242)            | (276,275)   |
| (467)         | コール         | Crowdstrike Holdings                | Exchange Traded | USD 230   | 21/10/2022 | 82,357              | (184,465)   |
| (190)         | ブット         | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 260   | 21/10/2022 | 107,018             | (40,755)    |
| (2,343)       | コール         | EQT                                 | Exchange Traded | USD 42    | 21/10/2022 | (1,317,313)         | (1,745,535) |
| (451)         | ブット         | Home Depot                          | Exchange Traded | USD 280   | 21/10/2022 | (162,242)           | (352,907)   |
| (113)         | コール         | LVMH Moet Hennessy<br>Louis Vuitton | Exchange Traded | EUR 750   | 21/10/2022 | 78,187              | (47,537)    |
| (1,203)       | ブット         | Microsoft                           | Exchange Traded | USD 250   | 21/10/2022 | (242,989)           | (703,755)   |
| (145)         | コール         | Palo Alto Networks                  | Exchange Traded | USD 640   | 21/10/2022 | 36,245              | (100,775)   |
| (384)         | コール         | salesforce.com                      | Exchange Traded | USD 220   | 21/10/2022 | 104,482             | (5,760)     |
| (5,912)       | コール         | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 440   | 21/10/2022 | 1,801,751           | (555,728)   |

## 売建オプション 2022年8月31日現在(続き)

| 契約数     | コール<br>／<br>プット | 摘要                                  | 取引相手            | 行使価格       | 満期日        | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|---------|-----------------|-------------------------------------|-----------------|------------|------------|---------------------|-------------|
| (93)    | プット             | Tesla                               | Exchange Traded | USD 233.33 | 21/10/2022 | 11,239              | (74,865)    |
| (1,812) | プット             | Tesla                               | Exchange Traded | USD 240    | 21/10/2022 | (139,833)           | (1,725,930) |
| (289)   | コール             | Unitedhealth                        | Exchange Traded | USD 600    | 21/10/2022 | 96,637              | (47,107)    |
| (288)   | プット             | Unitedhealth                        | Exchange Traded | USD 480    | 21/10/2022 | (43,734)            | (212,400)   |
| (380)   | プット             | Visa                                | Exchange Traded | USD 185    | 21/10/2022 | (33,273)            | (118,750)   |
| (631)   | プット             | Walt Disney                         | Exchange Traded | USD 110    | 21/10/2022 | (110,257)           | (253,977)   |
| (1,229) | コール             | Abbott Laboratories                 | Exchange Traded | USD 120    | 18/11/2022 | 135,529             | (57,149)    |
| (810)   | プット             | Alcoa                               | Exchange Traded | USD 45     | 18/11/2022 | (113,217)           | (285,525)   |
| (810)   | コール             | Alcoa                               | Exchange Traded | USD 65     | 18/11/2022 | 113,257             | (133,245)   |
| (241)   | コール             | BHP                                 | Exchange Traded | GBP 26     | 18/11/2022 | 24,186              | (102,016)   |
| (484)   | プット             | BHP                                 | Exchange Traded | GBP 19.6   | 18/11/2022 | (10,100)            | (353,022)   |
| (2,305) | コール             | Boston Scientific                   | Exchange Traded | USD 45     | 18/11/2022 | 50,468              | (155,587)   |
| (881)   | プット             | Dynatrace                           | Exchange Traded | USD 35     | 18/11/2022 | 42,828              | (189,415)   |
| (761)   | コール             | Edwards Lifesciences                | Exchange Traded | USD 115    | 18/11/2022 | 171,426             | (43,758)    |
| (654)   | プット             | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 260    | 18/11/2022 | 41,700              | (244,596)   |
| (326)   | プット             | Generac Holdings                    | Exchange Traded | USD 220    | 18/11/2022 | (409,209)           | (704,160)   |
| (83)    | コール             | Rio Tinto                           | Exchange Traded | GBP 56     | 18/11/2022 | 24,595              | (68,401)    |
| (166)   | プット             | Rio Tinto                           | Exchange Traded | GBP 41.65  | 18/11/2022 | (67,002)            | (237,392)   |
| (1,803) | コール             | SPDR Gold Shares                    | Exchange Traded | USD 185    | 18/11/2022 | 55,477              | (63,105)    |
| (450)   | コール             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 450    | 18/11/2022 | 79,994              | (56,700)    |
| (450)   | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 350    | 18/11/2022 | (56,131)            | (199,575)   |
| (234)   | プット             | Tesla                               | Exchange Traded | USD 240    | 18/11/2022 | (58,443)            | (332,865)   |
| (3,531) | プット             | Commerzbank                         | Exchange Traded | EUR 7.2    | 16/12/2022 | (185,918)           | (365,616)   |
| (887)   | コール             | Dexcom                              | Exchange Traded | USD 110    | 16/12/2022 | 82,510              | (155,225)   |
| (452)   | プット             | HCA Healthcare                      | Exchange Traded | USD 160    | 16/12/2022 | 28,368              | (169,500)   |
| (140)   | プット             | LVMH Moët Hennessy<br>Louis Vuitton | Exchange Traded | EUR 520    | 16/12/2022 | 189,704             | (142,161)   |
| (554)   | プット             | SAP                                 | Exchange Traded | USD 80     | 16/12/2022 | 10,581              | (180,050)   |
| (1,533) | コール             | SPDR Gold Shares                    | Exchange Traded | USD 185    | 16/12/2022 | 59,432              | (105,777)   |
| (3,348) | プット             | SPDR S&P 500<br>ETF Trust           | Exchange Traded | USD 310    | 16/12/2022 | 2,049,816           | (858,762)   |
| (281)   | コール             | Unitedhealth                        | Exchange Traded | USD 600    | 16/12/2022 | 131,857             | (162,980)   |
| (794)   | プット             | Abbott Laboratories                 | Exchange Traded | USD 105    | 20/1/2023  | (134,775)           | (553,815)   |
| (834)   | コール             | Abbvie                              | Exchange Traded | USD 165    | 20/1/2023  | 217,893             | (72,141)    |
| (143)   | プット             | Adobe                               | Exchange Traded | USD 400    | 20/1/2023  | (157,938)           | (654,582)   |
| (202)   | プット             | Align Technology                    | Exchange Traded | USD 230    | 20/1/2023  | 39,865              | (479,750)   |
| (1,800) | プット             | Alphabet                            | Exchange Traded | USD 80     | 20/1/2023  | 184,043             | (229,500)   |
| (1,320) | プット             | Alphabet                            | Exchange Traded | USD 100    | 20/1/2023  | 146,187             | (613,800)   |
| (1,800) | プット             | Amazon.com                          | Exchange Traded | USD 80     | 20/1/2023  | 591,082             | (169,200)   |
| (47)    | プット             | Booking Holdings                    | Exchange Traded | USD 2,000  | 20/1/2023  | (443,121)           | (1,071,600) |
| (883)   | プット             | Dynatrace                           | Exchange Traded | USD 35     | 20/1/2023  | 111,063             | (262,692)   |
| (279)   | プット             | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 280    | 20/1/2023  | 76,380              | (364,792)   |
| (278)   | プット             | Eli Lilly                           | Exchange Traded | USD 260    | 20/1/2023  | 215,793             | (225,875)   |
| (1,842) | コール             | EQT                                 | Exchange Traded | USD 50     | 20/1/2023  | (409,363)           | (1,142,040) |
| (725)   | プット             | Exxon Mobil                         | Exchange Traded | USD 65     | 20/1/2023  | 144,466             | (85,913)    |
| (1,450) | コール             | Exxon Mobil                         | Exchange Traded | USD 95     | 20/1/2023  | (681,120)           | (1,250,625) |
| (883)   | プット             | Glencore                            | Exchange Traded | GBP 4.5    | 20/1/2023  | (73,343)            | (405,945)   |
| (134)   | プット             | Humana                              | Exchange Traded | USD 390    | 20/1/2023  | 198,144             | (81,070)    |
| (148)   | プット             | Intuit                              | Exchange Traded | USD 370    | 20/1/2023  | 197,608             | (266,400)   |
| (1,297) | コール             | Merck & Co                          | Exchange Traded | USD 100    | 20/1/2023  | 109,294             | (117,379)   |
| (738)   | プット             | Microsoft                           | Exchange Traded | USD 200    | 20/1/2023  | 313,837             | (226,935)   |
| (928)   | プット             | Otis Worldwide                      | Exchange Traded | USD 65     | 20/1/2023  | 50,746              | (183,280)   |

## 売建オプション 2022年8月31日現在(続き)

| 契約数                                     | コール<br>／<br>プット | 摘要                           | 取引相手            | 行使価格    | 満期日       | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル)  |
|---|-----------------|------------------------------|-----------------|---------|-----------|---------------------|--------------|
| (970)                                   | プット             | salesforce.com               | Exchange Traded | USD 160 | 20/1/2023 | (300,577)           | (1,418,625)  |
| (166)                                   | プット             | ServiceNow                   | Exchange Traded | USD 450 | 20/1/2023 | (114,926)           | (822,530)    |
| (1,268)                                 | コール             | Valero Energy                | Exchange Traded | USD 120 | 20/1/2023 | (661,698)           | (1,477,220)  |
| (634)                                   | プット             | Valero Energy                | Exchange Traded | USD 75  | 20/1/2023 | 204,946             | (120,143)    |
| (619)                                   | プット             | XPO Logistics                | Exchange Traded | USD 45  | 20/1/2023 | 75,760              | (171,772)    |
| (53,489)                                | プット             | EssilorLuxottica             | JP Morgan       | EUR 160 | 16/9/2022 | (119,670)           | (515,243)    |
| (53,489)                                | コール             | EssilorLuxottica             | JP Morgan       | EUR 225 | 16/9/2022 | 203,741             | (39)         |
| (190,622)                               | コール             | Pioneer Natural<br>Resources | Morgan Stanley  | USD 320 | 16/9/2022 | 1,205,913           | (6,443)      |
| (190,622)                               | プット             | Pioneer Natural<br>Resources | Morgan Stanley  | USD 230 | 16/9/2022 | 1,129,344           | (729,506)    |
| 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 620,876,366米ドル) |                 |                              |                 |         |           | 837,761             | (45,061,577) |

## ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド

## 買建スワップション 2022年8月31日現在

| 想定金額                                  | 摘要  | 取引相手           | 満期日        | 未実現評価益/(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|---------------------------------------|---|----------------|------------|---------------------|-------------|
| USD 6,530,000                         | ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。 | Goldman Sachs  | 21/9/2022  | (17,242)            | 40,940      |
| USD 48,408,122                        | ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.26%の固定金利を30/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年支払う。  | Morgan Stanley | 27/10/2022 | (352,571)           | 98,172      |
| 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 6,170,791米ドル) |   |                |            | (369,813)           | 139,112     |

## 売建スワップション 2022年8月31日現在

| 想定金額              | 摘要   | 取引相手            | 満期日        | 未実現評価益/(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-------------------|--|-----------------|------------|---------------------|-------------|
| USD (94,111,385)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/4/2024より毎年受け取り、3.45%の固定金利を20/10/2023より半年毎に支払う。 | Bank of America | 18/4/2023  | 6,909               | (1,416,526) |
| EUR (36,870,000)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。          | Barclays        | 19/10/2022 | (592,460)           | (914,337)   |
| USD (91,578,845)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.88%の固定金利を2/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/11/2023より毎年支払う。   | Citibank        | 31/10/2022 | (1,201,907)         | (1,870,433) |
| USD (92,146,546)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.75%の固定金利を9/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/5/2024より毎年支払う。   | Citibank        | 5/5/2023   | 562,317             | (985,745)   |
| USD (87,175,590)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.67%の固定金利を27/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/6/2024より毎年支払う。 | Citibank        | 23/6/2023  | 294,053             | (1,194,881) |
| EUR (173,854,406) | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を9/9/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を9/3/2023より半年毎に支払う。 | Goldman Sachs   | 7/9/2022   | (326,055)           | (771,206)   |
| USD (6,530,000)   | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。          | Goldman Sachs   | 21/9/2022  | 11,111              | (11,193)    |



## 売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

| 想定金額              | 摘要  | 取引相手           | 満期日        | 未実現評価益/(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル) |
|-------------------|---|----------------|------------|---------------------|-------------|
| USD (6,750,000)   | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。           | Goldman Sachs  | 21/9/2022  | (878)               | (11,570)    |
| USD (90,225,527)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を28/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/10/2023より毎年支払う。  | Goldman Sachs  | 26/10/2022 | (597,863)           | (1,166,284) |
| USD (92,209,963)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.92%の固定金利を4/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/11/2023より毎年支払う。    | Goldman Sachs  | 2/11/2022  | (1,007,634)         | (1,741,165) |
| USD (147,685,207) | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9%の固定金利を15/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/11/2023より毎年支払う。   | Goldman Sachs  | 10/11/2022 | (2,006,569)         | (3,055,353) |
| USD (86,084,902)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.2%の固定金利を28/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/11/2023より毎年支払う。   | Goldman Sachs  | 23/11/2022 | (17,032)            | (997,459)   |
| USD (287,809,126) | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.27%の固定金利を27/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年支払う。   | Goldman Sachs  | 23/3/2023  | (2,743,336)         | (5,155,177) |
| USD (93,288,523)  | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.28%の固定金利を28/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/3/2024より毎年支払う。   | Goldman Sachs  | 24/3/2023  | (858,504)           | (1,651,457) |
| USD (174,668,990) | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.57%の固定金利を15/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2024より毎年支払う。  | Goldman Sachs  | 11/5/2023  | 948,163             | (2,407,229) |
| USD (29,438,681)  | ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。 | JP Morgan      | 21/9/2022  | 120,775             | (15,038)    |
| USD (192,084,683) | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.91%の固定金利を6/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/10/2023より毎年支払う。    | Morgan Stanley | 4/10/2022  | (981,582)           | (2,460,634) |
| USD (179,336,523) | ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年受け取り、2.47%の固定金利を30/4/2023より半年毎に支払う。  | Morgan Stanley | 27/10/2022 | 338,140             | (24,845)    |

## 売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

| 想定金額                                    | 摘要   | 取引相手           | 満期日       | 未実現評価益/(損)<br>(米ドル) | 時価<br>(米ドル)  |
|---|--|----------------|-----------|---------------------|--------------|
| USD (186,190,113)                       | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.35%の固定金利を12/6/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/12/2023より毎年支払う。 | Morgan Stanley | 8/12/2022 | 244,101             | (1,752,788)  |
| USD (96,024,613)                        | ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.4%の固定金利を10/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/4/2024より毎年支払う。  | Morgan Stanley | 6/4/2023  | (385,294)           | (1,487,176)  |
| 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 865,706,667米ドル) |  |                |           | (8,193,545)         | (29,090,496) |

## 差金決済契約 2022年8月31日現在

| 保有高         | 銘柄                               | 取引相手      | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|-------------|----------------------------------|-----------|---------------------|
|             | <b>オーストラリア</b>                   |           |                     |
| (29,517)    | OZ Minerals                      | JP Morgan | 7,761               |
| (1,719,089) | AMP                              | JP Morgan | 1,106               |
| (696,789)   | Pilbara Minerals                 | JP Morgan | (319,021)           |
| (57,601)    | IDP Education                    | JP Morgan | (39,729)            |
| (154,255)   | Allkem                           | JP Morgan | (196,454)           |
|             |                                  |           | <u>(546,337)</u>    |
|             | <b>ブラジル</b>                      |           |                     |
| (129,573)   | Localiza Rent a Car              | JP Morgan | 55,624              |
| (3,450,982) | Magazine Luiza                   | JP Morgan | (765,980)           |
|             |                                  |           | <u>(710,356)</u>    |
|             | <b>カナダ</b>                       |           |                     |
| (37,591)    | Shaw Communications              | JP Morgan | 30,749              |
|             |                                  |           | <u>30,749</u>       |
|             | <b>中国</b>                        |           |                     |
| (834,000)   | China Sounthern Airlines         | JP Morgan | 3,075               |
| (511,000)   | Geely Automobile Holdings        | JP Morgan | 122,123             |
| (267,500)   | Longfor Group Holdings           | Citibank  | (11,672)            |
| (36,300)    | Sunny Optical Technology         | Citibank  | 20,507              |
| (2,454,932) | Country Garden Holdings          | JP Morgan | 62,365              |
| (2,962,600) | Xiaomi                           | JP Morgan | 55,211              |
| (352,000)   | Xinyi Solar Holdings             | Citibank  | 31,552              |
| (241,000)   | China Longyuan Power             | Citibank  | 38,821              |
| (418,600)   | Microport Scientific             | Citibank  | 106,960             |
| (778,500)   | Shandong Gold Mining             | JP Morgan | 27,632              |
| (1,007,666) | China Vanke                      | Citibank  | (77,200)            |
| (82,800)    | Fuyao Glass Industry             | JP Morgan | 2,013               |
| (27,500)    | Li Ning                          | JP Morgan | (9,778)             |
| (239,800)   | Zhuzhou CRRC Times Electric      | JP Morgan | (29,634)            |
| (40,946)    | Prosus                           | JP Morgan | (33,098)            |
| (104,400)   | Kuaishou Technology              | Citibank  | 76,788              |
| (88,760)    | Bilibili                         | Citibank  | (127,251)           |
|             |                                  |           | <u>258,414</u>      |
|             | <b>フィンランド</b>                    |           |                     |
| (18,002)    | Sampo                            | Citibank  | (10,265)            |
| (20,687)    | Orion                            | JP Morgan | 31,283              |
|             |                                  |           | <u>21,018</u>       |
|             | <b>フランス</b>                      |           |                     |
| (23,709)    | Pernod Ricard                    | JP Morgan | 290,426             |
| (47,265)    | Alstom                           | JP Morgan | 180,539             |
|             |                                  |           | <u>470,965</u>      |
|             | <b>ドイツ</b>                       |           |                     |
| (19,228)    | Beiersdorf                       | Citibank  | 37,675              |
| (28,208)    | Vonovia                          | JP Morgan | 118,689             |
| (36,924)    | Siemens Healthineers             | Citibank  | (43,697)            |
| (40,432)    | Delivery Hero                    | JP Morgan | 358,890             |
|             |                                  |           | <u>471,557</u>      |
|             | <b>香港</b>                        |           |                     |
| (363,500)   | CK Asset Holdings                | JP Morgan | 45,695              |
| (580,500)   | China Overseas Land & Investment | Citibank  | (95,758)            |
| (478,000)   | Techtronic Industries            | JP Morgan | (365,307)           |
|             |                                  |           | <u>(415,370)</u>    |
|             | <b>イタリア</b>                      |           |                     |
| (83,451)    | Leonardo                         | Citibank  | 34,844              |

## 差金決済契約 2022年8月31日現在(続き)

| 保有高         | 銘柄                    | 取引相手      | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|-------------|-----------------------|-----------|---------------------|
|             | <b>イタリア(続き)</b>       |           |                     |
| (4,554,156) | Telecom Italia        | JP Morgan | 81,620              |
| (63,713)    | Nexi                  | Citibank  | 16,525              |
|             |                       |           | <u>132,989</u>      |
|             | <b>日本</b>             |           |                     |
| (50,000)    | Hitachi Metals        | JP Morgan | (10,287)            |
| (38,300)    | Olympus               | JP Morgan | 24,190              |
| (136,000)   | Tokyo Electric Power  | JP Morgan | (38,409)            |
| (28,000)    | Open House            | Citibank  | 43,405              |
| (49,400)    | Money Forward         | Citibank  | 40,193              |
|             |                       |           | <u>59,092</u>       |
|             | <b>マカオ</b>            |           |                     |
| (88,000)    | Galaxy Entertainment  | JP Morgan | 29,025              |
|             |                       |           | <u>29,025</u>       |
|             | <b>オランダ</b>           |           |                     |
| (378,122)   | Aegon                 | JP Morgan | 7,629               |
| (110,973)   | Just Eat Takeaway.com | Citibank  | 241,757             |
|             |                       |           | <u>249,386</u>      |
|             | <b>ポーランド</b>          |           |                     |
| (65,089)    | CD Projekt            | JP Morgan | 123,594             |
| (160,698)   | InPost                | JP Morgan | 156,648             |
|             |                       |           | <u>280,242</u>      |
|             | <b>シンガポール</b>         |           |                     |
| (6,884)     | Sea                   | JP Morgan | 135,277             |
|             |                       |           | <u>135,277</u>      |
|             | <b>南アフリカ</b>          |           |                     |
| (6,076)     | Capitec Bank Holdings | JP Morgan | 17,497              |
|             |                       |           | <u>17,497</u>       |
|             | <b>韓国</b>             |           |                     |
| (25,043)    | Posco Chemical        | JP Morgan | (394,524)           |
| (25,073)    | Celltrion Healthcare  | Citibank  | 37,756              |
| (3,694)     | NCSoft                | Citibank  | (17,761)            |
| (14,900)    | Iljin Materials       | JP Morgan | 35,612              |
| (5,863)     | HYBE                  | Citibank  | 10,025              |
|             |                       |           | <u>(328,892)</u>    |
|             | <b>スペイン</b>           |           |                     |
| (23,830)    | Ferrovial             | Citibank  | 34,543              |
|             |                       |           | <u>34,543</u>       |
|             | <b>スウェーデン</b>         |           |                     |
| (274,055)   | Fastighets AB Balder  | Citibank  | 29,474              |
| (17,854)    | Sagax                 | Citibank  | 7,811               |
| (22,557)    | Sweco                 | Citibank  | 3,318               |
| (149,800)   | Swedish Match         | JP Morgan | 69,592              |
| (89,453)    | Electrolux            | Citibank  | 34,806              |
|             |                       |           | <u>145,001</u>      |
|             | <b>スイス</b>            |           |                     |
| (8,866)     | Adecco                | Citibank  | 288                 |
|             |                       |           | <u>288</u>          |
|             | <b>英国</b>             |           |                     |
| (245,684)   | BT                    | Citibank  | 24,386              |
| (101,293)   | Diageo                | JP Morgan | 268,934             |
| (114,673)   | Ocado                 | JP Morgan | 256,640             |
| (630,861)   | Rolls-Royce Holdings  | Citibank  | 30,542              |
| (116,213)   | Informa               | JP Morgan | 92,837              |
|             |                       |           | <u>673,339</u>      |

## 差金決済契約 2022年8月31日現在(続き)

| 保有高                                     | 銘柄  | 取引相手      | 未実現評価益／(損)<br>(米ドル) |
|---|---|-----------|---------------------|
|   | <b>米国</b>   |           |                     |
| (23,329)                                | Paccar  | JP Morgan | 96,895              |
| (31,343)                                | JM Smucker  | JP Morgan | (258,893)           |
| 1,241,004                               | iShares S&P Consumer Discretionary Sector UCITS ETF | JP Morgan | (822,165)           |
| (27,243)                                | International Business Machines                     | JP Morgan | 88,540              |
| (6,451)                                 | Take-Two Interactive Software                       | Citibank  | (3,660)             |
| (8,999)                                 | Quanta Services                                     | Citibank  | (9,089)             |
| (16,993)                                | Cognizant Technology Solutions                      | JP Morgan | 72,730              |
| (16,831)                                | Dollar Tree   | JP Morgan | 494,158             |
| (160,708)                               | DISH Network  | JP Morgan | 320,146             |
| (16,164)                                | PerkinElmer   | JP Morgan | 254,199             |
| (10,866)                                | Fiserv  | JP Morgan | 28,252              |
| (59,503)                                | Franklin Resources                                  | JP Morgan | 98,775              |
| (5,310)                                 | Teledyne Technologies                               | Citibank  | 77,062              |
| (13,446)                                | Lennar  | Citibank  | 45,179              |
| (1,604)                                 | Martin Marietta Materials                           | Citibank  | 19,473              |
| (4,721)                                 | Illumina  | Citibank  | (37,532)            |
| (16,570)                                | PPG Industries                                      | Citibank  | (11,102)            |
| (69,259)                                | Pultegroup  | Citibank  | 4,156               |
| (37,603)                                | Ross Stores   | JP Morgan | (34,263)            |
| (5,172)                                 | Westinghouse Air Brake Technologies                 | Citibank  | 11,689              |
| (13,659)                                | Carmax  | Citibank  | 4,781               |
| (74,785)                                | Las Vegas Sands                                     | Citibank  | (86,751)            |
| (10,866)                                | Broadridge Financial Solutions                      | JP Morgan | (63,349)            |
| (685)                                   | EPAM Systems  | Citibank  | (8,255)             |
| (164,019)                               | Norwegian Cruise Line Holdings                      | Citibank  | (154,178)           |
| (95,194)                                | Snap  | JP Morgan | 12,375              |
| (17,234)                                | Lamb Weston Holdings                                | Citibank  | 16,200              |
| (20,701)                                | STERIS  | JP Morgan | 233,119             |
| (104,097)                               | Paramount Global                                    | Citibank  | 48,931              |
| (4,912)                                 | Coinbase Global                                     | Citibank  | 11,494              |
| (105,106)                               | Viatis  | Citibank  | 64,115              |
| (11,101)                                | Caesars Entertainment                               | Citibank  | 8,215               |
| (23,329)                                | Marvell Technology                                  | JP Morgan | 184,086             |
| (6,372)                                 | Etsy  | Citibank  | (24,502)            |
| (86,460)                                | DXC Technology                                      | JP Morgan | 140,065             |
|   |   |           | 820,896             |
| 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 161,695,016米ドル) |   |           | 1,829,323           |

## 事後通告証券契約 2022年8月31日現在

| 保有高   | 銘柄                                 | 時価<br>(米ドル) | 純資産比率<br>(%) |
|---|------------------------------------|-------------|--------------|
|   | <b>米国</b>                          |             |              |
| USD 157,345,000                               | Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA | 156,782,615 | 1.04         |
| T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 156,782,615米ドル) |                                    | 156,782,615 | 1.04         |

## &lt;参考情報&gt;

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

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

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

| BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド |   |
|---------------------------------|---|
| 商品分類                            | ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)   |
| 投資目的および投資態度                     | 純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが5年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは3年以下を原則とします。<br>通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。   |
| 設定日                             | 2002年10月31日   |
| 存続期間                            | 無期限   |
| 主な投資制限                          | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・ 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。</li> </ul> |
| 管理報酬                            | ありません。(注)   |
| その他費用                           | 保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。  |
| 決算日                             | 年1回(原則として8月末日)に決算を行います。   |
| 収益分配方針                          | 分配を行いません。   |
| 申込手数料                           | ありません。  |
| 管理会社                            | ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー   |
| 投資顧問会社                          | ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク   |
| 保管会社                            | ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ   |

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

## ■損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドはBGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドのクラスX投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

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

## BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

\* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

## 未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

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

## 未決済上場先物取引 2022年8月31日現在

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

## スワップ 2022年8月31日現在

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

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

## 事後通告証券契約 2022年8月31日現在

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