

## 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 組入比率	純資産
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	複合インデックス	期中 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・サービスズ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 組入比率
		騰落率	複合インデックス	騰 落 率	
(期 首) 2022年10月20日	円 19,238	% -	198.23	% -	% 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) 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。

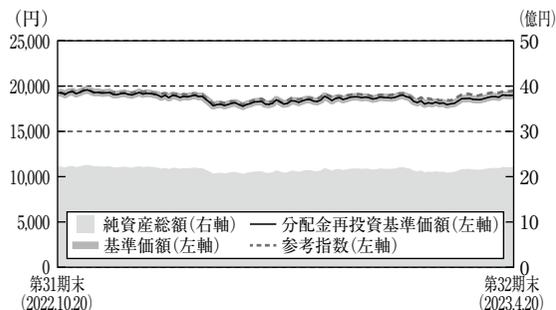
(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスLLCの登録商標です。

(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 :  $\Delta 1.2\%$  (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、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。

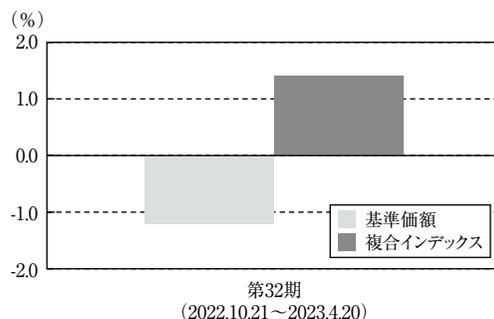
### ■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

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 ～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 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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	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	

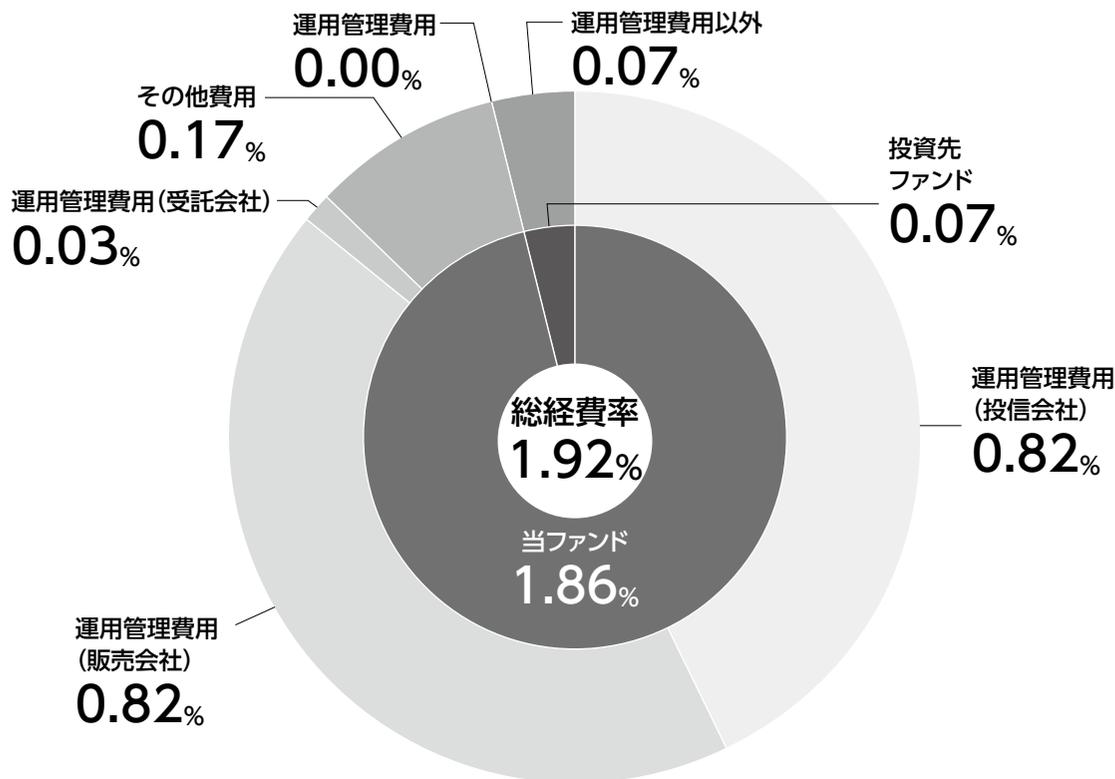
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(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 お よ び 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・ アロケーション・ファンド 米ドル
<b>期首純資産</b>	<b>18,768,461,196</b>
<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>	<b>311,235,073</b>
<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>	<b>280,205,573</b>
<b>純利益</b>	<b>31,029,500</b>
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>	<b>54,460,589</b>
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>	<b>( 3,488,064,341)</b>
<b>運用成績による純資産の減少</b>	<b>( 3,402,574,252)</b>
<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>	<b>( 258,901,556)</b>
配当金宣言額	( 10,173,670)
<b>期末純資産</b>	<b>15,096,811,718</b>

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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<b>ファンド</b>			
1,474,946	<b>アイルランド</b> 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> 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> 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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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
		<hr/>	<hr/>
		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
		<hr/>	<hr/>
		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
		<hr/>	<hr/>
		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
		<hr/>	<hr/>
		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
		<hr/>	<hr/>
		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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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
		5,128,706,375	33.96
普通/優先株式およびワラント合計		7,737,158,963	51.24
	<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
		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
		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
	<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
		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
	<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
		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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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		6,824,648,948	45.20
	<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		25,175,703	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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
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) (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) (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 (米ドル)	未実現評価益／(損) (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) (米ドル)	時価 (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 (米ドル)	時価 (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 (米ドル)	時価 (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 (米ドル)	時価 (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 ／ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
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 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 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	16/9/2022	(3,463,842)	160,425
241	プット	SPDR S&P 500 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 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 ETF Trust	Exchange Traded	USD 410	30/9/2022	1,265,284	2,195,856
7,328	プット	SPDR S&P 500 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 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 /ブット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
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 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 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 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 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 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 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 /ブット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(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 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 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 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 ETF Trust	Exchange Traded	USD 390	30/9/2022	(3,436,087)	(5,389,744)
(1,326)	ブット	SPDR S&P 500 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 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 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 ／ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(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 ETF Trust	Exchange Traded	USD 450	18/11/2022	79,994	(56,700)
(450)	プット	SPDR S&P 500 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 Moet Hennessy 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 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 ／ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(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 Resources	Morgan Stanley	USD 320	16/9/2022	1,205,913	(6,443)
(190,622)	プット	Pioneer Natural 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) (米ドル)	時価 (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) (米ドル)	時価 (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) (米ドル)	時価 (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) (米ドル)	時価 (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) (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) (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) (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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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。 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・ デュレーション・ボンド・ファンド 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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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	Altice Financing 5% 15/1/2028	295,742	0.02
EUR 460,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.208% 4/6/2026	431,072	0.03

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

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

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
	<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 (米ドル)	純資産比率 (%)
<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) (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 (米ドル)	未実現評価益／(損) (米ドル)
(262)	EUR	Euro BOBL	2022年9月	32,297,551	387,927
(2)	EUR	Euro Bund	2022年9月	296,568	5,562
(107)	EUR	Euro Schatz	2022年9月	11,631,630	63,157
(24)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年9月	25,854,398	(71,971)
(8)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年12月	1,090,250	6,673
(275)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	32,205,078	145,790
(3)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	351,328	1,484
(237)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年12月	29,732,391	151,588
(86)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年12月	12,956,438	(36,969)
3,165	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	659,482,144	(849,877)
(8)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	1,666,937	2,898
(1,397)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	154,925,116	430,780
(126)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	13,973,203	45,477
合計				976,463,032	282,519

## スワップ 2022年8月31日現在

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

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

## 事後通告証券契約 2022年8月31日現在

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