

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／債券 | |
|--------|---|---|
| 信託期間 | 2025年9月24日まで（2010年9月27日設定） | |
| 運用方針 | ファンド・オブ・ファンズ方式により、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | 米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型） | US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス）受益証券およびマネー・プール マザーファンド受益証券 |
| | US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス） | 米ドル建のハイ・イールド債券 |
| | マネー・プール マザーファンド | わが国の公社債 |
| 運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> ・米ドル建のハイ・イールド債券に投資します。 ・高水準のインカムゲインの確保と、債券の値上がり益および為替差益の獲得を目指します。 | |
| 主な組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券、短期社債等およびコマースヤル・ペーパー以外の有価証券への投資は行いません。 ・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 | |
| 分配方針 | 毎月24日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、継続的に分配することをめざします。（ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わない場合もあります。） | |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）
米ドルコース（毎月決算型）

第149期（決算日：2023年4月24日）
 第150期（決算日：2023年5月24日）
 第151期（決算日：2023年6月26日）
 第152期（決算日：2023年7月24日）
 第153期（決算日：2023年8月24日）
 第154期（決算日：2023年9月25日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型）」は、去る9月25日に第154期の決算を行いましたので、法令に基づいて第149期～第154期の運用状況をまとめて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。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 (分配落) | 準 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-------------------|------------|---------|------------------|----------------|----------------|--------------------|--------------|
| | | 税 分 込 配 | み 期 金 騰 落 中 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 125期(2021年4月26日) | 8,036 | 40 | 1.4 | — | — | 98.0 | 2,637 |
| 126期(2021年5月24日) | 8,081 | 40 | 1.1 | — | — | 98.9 | 2,644 |
| 127期(2021年6月24日) | 8,311 | 40 | 3.3 | — | — | 99.4 | 2,677 |
| 128期(2021年7月26日) | 8,261 | 40 | △0.1 | — | — | 98.9 | 2,635 |
| 129期(2021年8月24日) | 8,150 | 40 | △0.9 | — | — | 98.0 | 2,595 |
| 130期(2021年9月24日) | 8,327 | 40 | 2.7 | — | — | 98.5 | 2,548 |
| 131期(2021年10月25日) | 8,517 | 40 | 2.8 | — | — | 98.0 | 2,526 |
| 132期(2021年11月24日) | 8,565 | 40 | 1.0 | — | — | 98.7 | 2,538 |
| 133期(2021年12月24日) | 8,577 | 40 | 0.6 | — | — | 98.0 | 2,490 |
| 134期(2022年1月24日) | 8,377 | 40 | △1.9 | — | — | 98.9 | 2,367 |
| 135期(2022年2月24日) | 8,239 | 40 | △1.2 | — | — | 99.5 | 2,328 |
| 136期(2022年3月24日) | 8,567 | 40 | 4.5 | — | — | 98.5 | 2,375 |
| 137期(2022年4月25日) | 8,878 | 40 | 4.1 | — | — | 98.5 | 2,477 |
| 138期(2022年5月24日) | 8,485 | 40 | △4.0 | — | — | 98.5 | 2,379 |
| 139期(2022年6月24日) | 8,679 | 40 | 2.8 | — | — | 98.5 | 2,411 |
| 140期(2022年7月25日) | 9,000 | 40 | 4.2 | — | — | 99.0 | 2,500 |
| 141期(2022年8月24日) | 9,044 | 40 | 0.9 | — | — | 98.9 | 2,529 |
| 142期(2022年9月26日) | 9,073 | 40 | 0.8 | — | — | 98.6 | 2,559 |
| 143期(2022年10月24日) | 9,220 | 40 | 2.1 | — | — | 99.0 | 2,606 |
| 144期(2022年11月24日) | 9,079 | 40 | △1.1 | — | — | 98.4 | 2,698 |
| 145期(2022年12月26日) | 8,541 | 40 | △5.5 | — | — | 98.7 | 2,542 |
| 146期(2023年1月24日) | 8,533 | 40 | 0.4 | — | — | 99.0 | 2,546 |
| 147期(2023年2月24日) | 8,591 | 40 | 1.1 | — | — | 98.8 | 2,540 |
| 148期(2023年3月24日) | 8,252 | 40 | △3.5 | — | — | 99.0 | 2,521 |
| 149期(2023年4月24日) | 8,541 | 40 | 4.0 | — | — | 98.8 | 2,588 |
| 150期(2023年5月24日) | 8,717 | 40 | 2.5 | — | — | 96.4 | 2,627 |
| 151期(2023年6月26日) | 9,041 | 40 | 4.2 | — | — | 99.1 | 2,625 |
| 152期(2023年7月24日) | 9,033 | 40 | 0.4 | — | — | 99.2 | 2,528 |
| 153期(2023年8月24日) | 9,153 | 40 | 1.8 | — | — | 97.8 | 2,564 |
| 154期(2023年9月25日) | 9,336 | 40 | 2.4 | — | — | 98.5 | 2,544 |

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 | 投 資 信 託 組 入 比 | 投 資 信 託 券 率 |
|-------|-------------|-------|-------|---|---------|-----|---------|-----|---------------|-------------|
| | | | 騰 落 率 | 率 | | | | | | |
| 第149期 | (期 首) | 円 | % | % | % | % | % | % | % | |
| | 2023年 3月24日 | 8,252 | — | — | — | — | — | — | 99.0 | |
| | 3月末 | 8,413 | 2.0 | — | — | — | — | — | 98.0 | |
| 第150期 | (期 末) | | | | | | | | | |
| | 2023年 4月24日 | 8,541 | — | — | — | — | — | — | 98.8 | |
| | 4月末 | 8,540 | △0.0 | — | — | — | — | — | 99.1 | |
| 第151期 | (期 首) | | | | | | | | | |
| | 2023年 5月24日 | 8,757 | 2.5 | — | — | — | — | — | 96.4 | |
| | 5月末 | 8,717 | — | — | — | — | — | — | 96.4 | |
| 第152期 | (期 末) | | | | | | | | | |
| | 2023年 6月26日 | 9,081 | 4.2 | — | — | — | — | — | 99.1 | |
| | 6月末 | 9,041 | — | — | — | — | — | — | 99.1 | |
| 第153期 | (期 首) | | | | | | | | | |
| | 2023年 7月24日 | 9,073 | 0.4 | — | — | — | — | — | 99.2 | |
| | 7月末 | 9,150 | 1.2 | — | — | — | — | — | 98.0 | |
| 第154期 | (期 末) | | | | | | | | | |
| | 2023年 8月24日 | 9,033 | — | — | — | — | — | — | 99.2 | |
| | 8月末 | 9,193 | 1.8 | — | — | — | — | — | 97.8 | |
| 第155期 | (期 首) | | | | | | | | | |
| | 2023年 9月25日 | 9,376 | 2.4 | — | — | — | — | — | 98.5 | |
| | 9月末 | 9,310 | 1.7 | — | — | — | — | — | 97.7 | |

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第149期～第154期：2023年3月25日～2023年9月25日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|--------|--------|
| 第149期首 | 8,252円 |
| 第154期末 | 9,336円 |
| 既払分配金 | 240円 |
| 騰落率 | 16.2% |

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ16.2%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

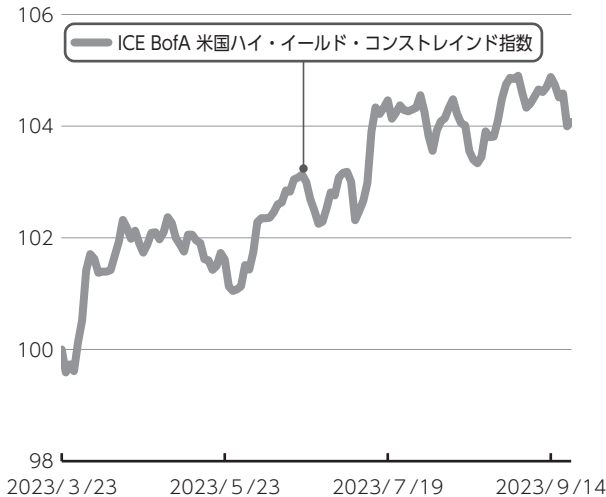
上昇要因

米国ハイ・イールド債券市況が上昇したこと。
債券利子収入を享受したこと。
米ドルが対円で上昇したこと。

第149期～第154期：2023年3月25日～2023年9月25日

投資環境について

米国ハイ・イールド債券市況の推移（当作成期首を100として指数化）



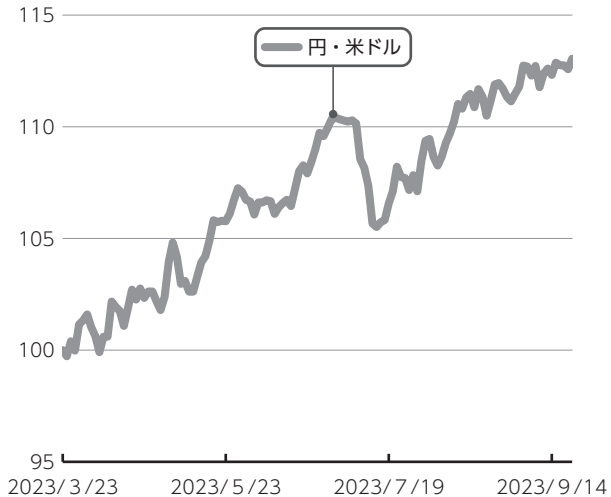
▶ 米国ハイ・イールド債券市況
期間を通してみると米国ハイ・イールド
債券市場は上昇しました。

米国の良好な企業決算等を背景に投資家心理が改善した局面等でスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと等がプラスとなり、同市場は上昇しました。

（注）現地日付ベースで記載しております。

（注）ICE BofA 米国ハイ・イールド・コンストレインド指数とは、ICE Data Indices, LLCが算出する米国のハイイールド債券の値動きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJ国際投信は許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。

為替市況の推移 （当作成期首を100として指数化、対円）



（注）現地日付ベースで記載しております。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

米国の金融引き締め長期化観測を背景に、日米金利差が拡大したこと等から、米ドルは対円で上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.042%となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型）

当期間を通じて、主要投資対象とする円建の外国投資信託であるUS・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス）受益証券を高位に組み入れ、マネー・プール マザーファンド受益証券への投資も行いました。

▶ US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス）

主として米ドル建のハイ・イールド債券に投資を行いました。

2023年8月末時点において、国・地域別では、引き続き米国を高位の組み入れとし、格付け別ではBB格やB格が高位の組み入れとなりました。信用格付別組入比率は、BBB格以上3.9%、BB格45.2%、B格34.0%、CCC格9.6%、CC格以下1.1%となりました。個別銘柄選択においては、セクター別ではメディアやエネルギー等を高位の組み入れとしました。セクター別組入比率上位3セクターは、メディア14.4%、エネルギー11.9%、ヘルスケア10.8%となりました。

※比率はUS・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの純資産総額に対する割合です。

※格付けはS & P社とMoody's社のうち高いものをS & P社の表示方法をもって表記しています。ただし、S & P社とMoody's社のいずれも無格付の場合は、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクが判断した格付けを用いています。（格付けのデータ出所：Bloomberg、J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク）

※セクターは原則としてICE Data Indices, LLCのセクター分類に準じて表示しておりますが、一部J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インクの判断に基づく分類を採用しています。

▶ マネー・プール マザーファンド

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項目 | 第149期 2023年3月25日～ 2023年4月24日 | 第150期 2023年4月25日～ 2023年5月24日 | 第151期 2023年5月25日～ 2023年6月26日 | 第152期 2023年6月27日～ 2023年7月24日 | 第153期 2023年7月25日～ 2023年8月24日 | 第154期 2023年8月25日～ 2023年9月25日 |
|--------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 40 (0.466%) | 40 (0.457%) | 40 (0.440%) | 40 (0.441%) | 40 (0.435%) | 40 (0.427%) |
| 当期の収益 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,641 | 1,660 | 1,681 | 1,700 | 1,722 | 1,746 |

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

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

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

▶ 米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型）

引き続き、円建の外国投資信託であるUS・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス）受益証券に投資を行います。また、マネー・プール マザーファンド受益証券への投資も行います。

▶ US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス）

米国ハイ・イールド債券市場では、魅力的な利回り水準や、発行量が低水準にとどまっていることなどがサポート材料になるとみております。企業の収益動向は全体として底堅く推移している一方、個別銘柄ごとのばらつきもみられています。そのような環境下、同市場においては銘柄選択の重要性が一層高まっていくものと考えられます。

引き続き、主として米ドル建のハイ・イールド債券に投資を行います。

運用に際しては、ボトムアップ戦略による個別銘柄選択を重視します。徹底的なボトムアップ戦略により個別銘柄の評価を行った後、相対的な比較を行いポートフォリオを構築します。

セクター別では、市場対比で、インフレ圧力の緩和により財務状況の改善が期待される自動車セクターを選好する方針です。一方で、個人の信用リスク動向の影響を受けやすい金融サービスセクターについては投資を控えめとする方針です。

▶ マネー・プール マザーファンド

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2023年3月25日～2023年9月25日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第149期～第154期 | | 項目の概要 |
|-----------|-------------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 48 | 0.544 | (a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数) |
| （投信会社） | (20) | (0.222) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| （販売会社） | (27) | (0.305) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (1) | (0.017) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) その他費用 | 0 | 0.002 | (b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数 |
| （監査費用） | (0) | (0.002) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| 合計 | 48 | 0.546 | |

作成期中の平均基準価額は、8,910円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

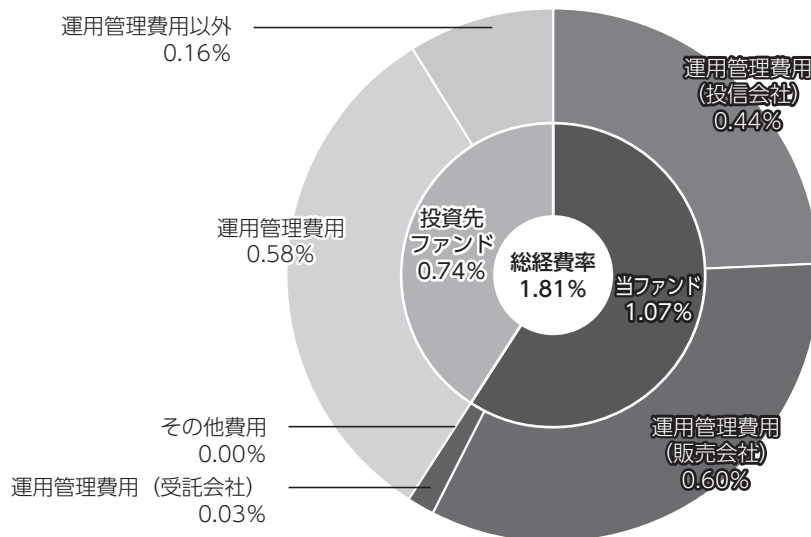
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.81%**です。



| | | |
|----------------------|-----|------|
| 総経費率 (①+②+③) | (%) | 1.81 |
| ①当ファンドの費用の比率 | (%) | 1.07 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | (%) | 0.58 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | (%) | 0.16 |

(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 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) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

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

○売買及び取引の状況

(2023年3月25日～2023年9月25日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 第149期～第154期 | | | |
|----|------------------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (USDクラス) | 千口 84,937 | 千円 111,110 | 千口 297,007 | 千円 390,480 |

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年3月25日～2023年9月25日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2023年9月25日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄 | | 第148期末 | | 第154期末 | | |
|----|------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (USDクラス) | 千口 2,040,929 | 千円 1,828,859 | 千口 2,507,366 | 千円 2,507,366 | % 98.5 |
| 合計 | | 2,040,929 | 1,828,859 | 2,507,366 | 2,507,366 | 98.5 |

(注) 比率は米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

| 銘柄 | | 第148期末 | | 第154期末 | |
|----|-----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 評価額 |
| | マネー・プール マザーファンド | 千口 119 | 千円 119 | 千口 119 | 千円 120 |

○投資信託財産の構成

(2023年9月25日現在)

| 項 目 | 第154期末 | |
|-----------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 2,507,366 | % 97.9 |
| マネー・プール マザーファンド | 120 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 53,109 | 2.1 |
| 投資信託財産総額 | 2,560,595 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第149期末 | 第150期末 | 第151期末 | 第152期末 | 第153期末 | 第154期末 |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2023年4月24日現在 | 2023年5月24日現在 | 2023年6月26日現在 | 2023年7月24日現在 | 2023年8月24日現在 | 2023年9月25日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,603,784,699 | 2,643,005,773 | 2,655,854,759 | 2,566,404,006 | 2,582,266,915 | 2,560,595,073 |
| コール・ローン等 | 45,849,308 | 67,586,667 | 53,376,589 | 57,605,486 | 73,106,905 | 53,108,624 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 2,557,815,103 | 2,532,168,830 | 2,602,357,894 | 2,508,678,244 | 2,509,039,746 | 2,507,366,185 |
| マネー・プール マザーファンド(評価額) | 120,288 | 120,276 | 120,276 | 120,276 | 120,264 | 120,264 |
| 未収入金 | — | 43,130,000 | — | — | — | — |
| (B) 負債 | 15,025,925 | 15,228,951 | 30,466,536 | 37,584,505 | 17,385,362 | 15,741,908 |
| 未払収益分配金 | 12,123,744 | 12,058,441 | 11,614,897 | 11,198,492 | 11,209,261 | 10,903,608 |
| 未払解約金 | 548,358 | 855,310 | 16,303,300 | 24,260,264 | 3,842,606 | 2,383,058 |
| 未払信託報酬 | 2,344,242 | 2,305,677 | 2,537,858 | 2,116,979 | 2,323,857 | 2,445,200 |
| 未払利息 | 21 | 121 | 134 | 141 | 164 | 73 |
| その他未払費用 | 9,560 | 9,402 | 10,347 | 8,629 | 9,474 | 9,969 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,588,758,774 | 2,627,776,822 | 2,625,388,223 | 2,528,819,501 | 2,564,881,553 | 2,544,853,165 |
| 元本 | 3,030,936,048 | 3,014,610,304 | 2,903,724,418 | 2,799,623,211 | 2,802,315,301 | 2,725,902,007 |
| 次期繰越損益金 | △ 442,177,274 | △ 386,833,482 | △ 278,336,195 | △ 270,803,710 | △ 237,433,748 | △ 181,048,842 |
| (D) 受益権総口数 | 3,030,936,048口 | 3,014,610,304口 | 2,903,724,418口 | 2,799,623,211口 | 2,802,315,301口 | 2,725,902,007口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8.541円 | 8.717円 | 9.041円 | 9.033円 | 9.153円 | 9.336円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第149期 | 第150期 | 第151期 | 第152期 | 第153期 | 第154期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2023年3月25日～ 2023年4月24日 | 2023年4月25日～ 2023年5月24日 | 2023年5月25日～ 2023年6月26日 | 2023年6月27日～ 2023年7月24日 | 2023年7月25日～ 2023年8月24日 | 2023年8月25日～ 2023年9月25日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 18,256,715 | 18,405,188 | 18,242,372 | 18,350,983 | 18,399,302 | 17,867,272 |
| 受取配当金 | 18,257,134 | 18,406,564 | 18,245,863 | 18,353,301 | 18,400,930 | 17,870,427 |
| 受取利息 | 37 | — | — | 78 | 3 | 91 |
| 支払利息 | △ 456 | △ 1,376 | △ 3,491 | △ 2,396 | △ 1,631 | △ 3,246 |
| (B) 有価証券売買損益 | 83,627,624 | 48,882,302 | 90,062,258 | △ 7,264,242 | 28,507,855 | 45,246,146 |
| 売買益 | 89,388,248 | 57,177,451 | 107,211,508 | 2,886,250 | 30,012,762 | 56,694,090 |
| 売買損 | △ 5,760,624 | △ 8,295,149 | △ 17,149,250 | △ 10,150,492 | △ 1,504,907 | △ 11,447,944 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,353,802 | △ 2,315,079 | △ 2,548,205 | △ 2,125,608 | △ 2,333,331 | △ 2,455,169 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 99,530,537 | 64,972,411 | 105,756,425 | 8,961,133 | 44,573,826 | 60,658,249 |
| (E) 前期繰越損益金 | △109,227,556 | △ 21,631,014 | 29,978,795 | 118,870,031 | 115,982,663 | 144,608,823 |
| (F) 追加信託差損益金 | △420,356,511 | △418,116,438 | △402,456,518 | △387,436,382 | △386,780,976 | △375,412,306 |
| (配当等相当額) | (301,781,965) | (300,835,773) | (290,802,416) | (281,741,470) | (283,369,881) | (276,584,198) |
| (売買損益相当額) | (△722,138,476) | (△718,952,211) | (△693,258,934) | (△669,177,852) | (△670,150,857) | (△651,996,504) |
| (G) 計(D+E+F) | △430,053,530 | △374,775,041 | △266,721,298 | △259,605,218 | △226,224,487 | △170,145,234 |
| (H) 収益分配金 | △ 12,123,744 | △ 12,058,441 | △ 11,614,897 | △ 11,198,492 | △ 11,209,261 | △ 10,903,608 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △442,177,274 | △386,833,482 | △278,336,195 | △270,803,710 | △237,433,748 | △181,048,842 |
| 追加信託差損益金 | △420,356,511 | △418,116,438 | △402,456,518 | △387,436,382 | △386,780,976 | △375,412,306 |
| (配当等相当額) | (301,781,965) | (300,835,773) | (290,802,416) | (281,741,470) | (283,369,881) | (276,584,198) |
| (売買損益相当額) | (△722,138,476) | (△718,952,211) | (△693,258,934) | (△669,177,852) | (△670,150,857) | (△651,996,504) |
| 分配準備積立金 | 195,703,434 | 199,715,172 | 197,587,557 | 194,256,481 | 199,448,776 | 199,389,384 |
| 繰越損益金 | △217,524,197 | △168,432,216 | △ 73,467,234 | △ 77,623,809 | △ 50,101,548 | △ 5,025,920 |

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

①作成期首（前作成期末）元本額 3,055,695,748円

 作成期中追加設定元本額 84,441,521円

 作成期中一部解約元本額 414,235,262円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9336円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は181,048,842円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2023年3月25日～ 2023年4月24日 | 2023年4月25日～ 2023年5月24日 | 2023年5月25日～ 2023年6月26日 | 2023年6月27日～ 2023年7月24日 | 2023年7月25日～ 2023年8月24日 | 2023年8月25日～ 2023年9月25日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 17,834,914円 | 17,772,011円 | 17,813,253円 | 16,225,375円 | 17,484,170円 | 17,172,214円 |
| 費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円 | —円 | —円 | —円 | —円 | —円 |
| 収益調整金額 | 301,781,965円 | 300,835,773円 | 290,802,416円 | 281,741,470円 | 283,369,881円 | 276,584,198円 |
| 分配準備積立金額 | 189,992,264円 | 194,001,602円 | 191,389,201円 | 189,229,598円 | 193,173,867円 | 193,120,778円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 509,609,143円 | 512,609,386円 | 500,004,870円 | 487,196,443円 | 494,027,918円 | 486,877,190円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 1,681円 | 1,700円 | 1,721円 | 1,740円 | 1,762円 | 1,786円 |
| 1万口当たり分配金額 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 |
| 収益分配金金額 | 12,123,744円 | 12,058,441円 | 11,614,897円 | 11,198,492円 | 11,209,261円 | 10,903,608円 |

○分配金のお知らせ

| | 第149期 | 第150期 | 第151期 | 第152期 | 第153期 | 第154期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 |

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

〈参考〉投資する投資信託証券およびその概要

当ファンドは、米国ハイ・イールド債オープン（通貨選択型）米ドルコース（毎月決算型）が投資対象とする円建の外国投資信託証券です。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|---|
| 名 称 | US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（USDクラス） |
| 運 用 方 針 | <p>1. 米ドル建^{*1}のハイ・イールド債券^{*2}を中心に投資を行います。</p> <p>*1 米国以外の発行企業が米ドル建で発行する社債を含みます。</p> <p>*2 ハイ・イールド債券とは、原則として、格付機関による格付けが、BB格相当以下の社債をいいます。</p> <p>2. 資金動向や市況動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用ができない場合があります。</p> |
| 投 資 顧 問 会 社 | J. P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク [*] |
| 信 託 期 限 | 無期限 |
| 設 定 日 | 2010年9月27日 |
| 会 計 年 度 末 | 毎年5月末 |
| 収 益 分 配 | 原則として、毎月分配を行います。 |

※ J. P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク（所在地：米国ニューヨーク）は、1984年4月に米国において設立された運用会社であり、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門である「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループに所属しています。

US・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2022年5月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

投資収益

| | | |
|---------------|----|------------------|
| 受取利息（外国税額控除後） | \$ | 6,796,512 |
| 受取配当金 | | 2,063,347 |
| その他収益 | | 14,102 |
| 投資収益合計 | | 8,873,961 |

費用

| | | |
|--------------|--|------------------|
| 運用受託報酬 | | 812,015 |
| 会計処理および管理手数料 | | 146,163 |
| 保管費用 | | 131,505 |
| 専門家報酬 | | 60,700 |
| 名義書換事務代行手数料 | | 28,597 |
| 受託者報酬 | | 4,290 |
| 登録手数料 | | 2,311 |
| 費用合計 | | 1,185,581 |

投資純利益 7,688,380

実現および未実現損益：

実現純損益：

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| 投資有価証券 | | 13,343,596 |
| 外国通貨取引および為替予約取引 | | (7,874,683) |
| 実現純損益 | | 5,468,913 |

未実現評価損益の純変動：

| | | |
|--------------------|--|---------------------|
| 投資有価証券 | | (21,925,106) |
| 外国通貨取引および為替予約取引 | | (2,356,719) |
| 未実現評価損益の純変動 | | (24,281,825) |

実現および未実現損益（純額） (18,812,912)

運用による純資産の増減（純額） \$ (11,124,532)

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

2. 純資産変動計算書

(2022年5月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

運用による純資産の増減額：

| | | |
|---------------------|----|---------------------|
| 投資純利益 | \$ | 7,688,380 |
| 実現純損失 | | 5,468,913 |
| 未実現評価損益の純変動 | | (24,281,825) |
| 運用による純資産の増減額 | | (11,124,532) |

| | | |
|-----------------------|--|--------------|
| 分配額 | | (14,424,771) |
| ファンドユニットの取引による純資産の増減額 | | (29,595,570) |
| 純資産の増減額 | | (55,144,873) |

純資産

| | | |
|----|----|-------------|
| 期首 | | 185,674,584 |
| 期末 | \$ | 130,529,711 |

| | USHYF AUDクラス | USHYF BRLクラス | USHYF JPYクラス |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| ファンドユニット取引 | | | |
| ユニット数 | | | |
| 発行 | - | - | 88,516,223 |
| 買戻し | 99,856,631 | 687,227,011 | 60,011,603 |
| 償還 | (668,890,849) | (1,491,263,875) | (289,232,096) |
| ユニット増減数 | (569,034,218) | (804,036,864) | (140,704,270) |

| | | | | | | |
|-------------------------|-----------|--------------------|-----------|--------------------|-----------|--------------------|
| 金額 | | | | | | |
| 発行 | \$ | - | \$ | - | \$ | 658,347 |
| 買戻し | | 733,664 | | 2,089,859 | | 426,175 |
| 償還 | | (4,903,920) | | (4,595,823) | | (2,110,304) |
| ファンドユニット取引による増減額 | \$ | (4,170,256) | \$ | (2,505,964) | \$ | (1,025,782) |

| | USHYF Non-hedgeクラス | USHYF TRYクラス | USHYF USDクラス |
|-------------------|------------------------|----------------------|----------------------|
| ファンドユニット取引 | | | |
| ユニット数 | | | |
| 発行 | 1,389,423,657 | - | - |
| 買戻し | 333,030,100 | 4,686,882,046 | 87,869,433 |
| 償還 | (3,430,551,450) | (5,517,615,294) | (457,790,020) |
| ユニット増減数 | (1,708,097,693) | (830,733,248) | (369,920,587) |

| | | | | | | |
|-------------------------|-----------|---------------------|-----------|--------------------|-----------|--------------------|
| 金額 | | | | | | |
| 発行 | \$ | 12,776,080 | \$ | - | \$ | - |
| 買戻し | | 3,060,015 | | 7,161,822 | | 953,236 |
| 償還 | | (31,395,011) | | (9,416,589) | | (5,033,121) |
| ファンドユニット取引による増減額 | \$ | (15,558,916) | \$ | (2,254,767) | \$ | (4,079,885) |

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

3. 投資明細表

(2022年5月31日現在)

(米ドルで表示)

| | 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-----|-----------|---|------------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) | |
| | | CANADA (4.5%) | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (4.5%) | |
| | | 1011778 BC ULC / New Red Finance, Inc. | |
| USD | 87,000 | 3.50% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | \$ 79,770 |
| USD | 108,000 | 3.88% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 101,925 |
| | | ATS Automation Tooling Systems, Inc. | |
| USD | 165,000 | 4.13% due 12/15/28 ^{(a),(b)} | 147,312 |
| | | Bausch Health Cos, Inc. | |
| USD | 272,000 | 4.88% due 06/01/28 ^{(a),(b)} | 233,668 |
| USD | 595,000 | 5.00% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | 355,557 |
| USD | 700,000 | 5.50% due 11/01/25 ^{(a),(b)} | 660,037 |
| USD | 310,000 | 6.25% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | 192,662 |
| USD | 35,000 | 7.00% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 23,887 |
| USD | 1,229,000 | 9.00% due 12/15/25 ^{(a),(b)} | 1,044,281 |
| | | Baytex Energy Corp. | |
| USD | 270,000 | 8.75% due 04/01/27 ^{(a),(b)} | 283,500 |
| | | Bombardier, Inc. | |
| USD | 74,000 | 7.13% due 06/15/26 ^{(a),(b)} | 67,604 |
| USD | 203,000 | 7.50% due 03/15/25 ^{(a),(b)} | 195,026 |
| | | Clarios Global LP | |
| USD | 108,000 | 6.75% due 05/15/25 ^{(a),(b)} | 108,672 |
| | | Garda World Security Corp. | |
| USD | 217,000 | 6.00% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 179,170 |
| USD | 275,000 | 9.50% due 11/01/27 ^{(a),(b)} | 258,565 |
| | | GFL Environmental, Inc. | |
| USD | 268,000 | 3.75% due 08/01/25 ^{(a),(b)} | 260,295 |
| USD | 167,000 | 4.00% due 08/01/28 ^{(a),(b)} | 150,225 |
| USD | 121,000 | 4.38% due 08/15/29 ^{(a),(b)} | 107,992 |
| USD | 153,000 | 4.75% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 139,380 |
| | | Masonite International Corp. | |
| USD | 176,000 | 5.38% due 02/01/28 ^{(a),(b)} | 175,947 |
| | | MEG Energy Corp. | |
| USD | 285,000 | 7.13% due 02/01/27 ^{(a),(b)} | 298,281 |
| | | NOVA Chemicals Corp. | |
| USD | 190,000 | 4.25% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | 168,670 |
| USD | 425,000 | 5.25% due 06/01/27 ^{(a),(b)} | 413,385 |
| | | Precision Drilling Corp. | |
| USD | 27,000 | 6.88% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 26,055 |
| USD | 110,000 | 7.13% due 01/15/26 ^{(a),(b)} | 109,970 |
| | | Superior Plus LP / Superior General Partner, Inc. | |
| USD | 92,000 | 4.50% due 03/15/29 ^{(a),(b)} | 85,905 |
| | | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | 5,867,741 |
| | | TOTAL CANADA (Cost \$6,666,874) | 5,867,741 |
| | | FRANCE (0.8%) | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (0.8%) | |
| | | Altice France S.A. | |
| USD | 364,000 | 5.13% due 07/15/29 ^{(a),(b)} | 317,726 |
| USD | 203,000 | 5.50% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 176,103 |
| USD | 510,000 | 8.13% due 02/01/27 ^{(a),(b)} | 510,724 |
| | | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | 1,004,553 |
| | | TOTAL FRANCE (Cost \$1,077,000) | 1,004,553 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|------|---|------------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | LUXEMBOURG (2.7%) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (2.7%) | |
| USD | 248,000 Altice Financing S.A. 5.75% due 08/15/29 ^{(a),(b)} | \$ 221,960 |
| USD | 400,000 Altice France Holding S.A. 10.50% due 05/15/27 ^{(a),(b)} | 393,092 |
| USD | 120,000 Endo Luxembourg Finance Co. I sarl / Endo US, Inc. 6.13% due 04/01/29 ^{(a),(b)} | 91,241 |
| USD | 858,000 Intelsat Jackson Holdings S.A. 5.50% due 08/01/23 ^{(a),(b),(c)} | — ^(a) |
| USD | 1,784,000 6.50% due 03/15/30 ^{(a),(b)} | 1,663,580 |
| USD | 784,000 8.50% due 10/15/24 ^{(a),(b),(c)} | — ^(a) |
| USD | 1,000,000 9.75% due 07/15/25 ^{(a),(b),(c)} | — ^(a) |
| USD | 690,000 Mallinckrodt International Finance S.A. / Mallinckrodt CB LLC 5.50% due 04/15/25 ^{(a),(b),(c)} | 272,550 |
| USD | 490,000 5.63% due 10/15/23 ^{(a),(b),(c)} | 193,550 |
| USD | 690,000 Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance, Inc. 5.38% due 09/01/25 ^{(a),(b)} | 656,328 |
| | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | 3,492,301 |
| | TOTAL LUXEMBOURG (Cost \$4,360,916) | 3,492,301 |
| | MULTINATIONAL (1.9%) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (1.9%) | |
| USD | 400,000 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp. / Atlas Luxco 4 sarl 4.63% due 06/01/28 ^{(a),(b)} | 355,906 |
| USD | 328,000 American Airlines, Inc. / AAdvantage Loyalty IP, Ltd. 5.50% due 04/20/26 ^(b) | 324,428 |
| USD | 284,375 5.75% due 04/20/29 ^(b) | 274,777 |
| USD | 440,000 Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc. 5.25% due 08/15/27 ^{(a),(b)} | 367,400 |
| USD | 150,000 Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 4.75% due 06/15/27 ^{(a),(b)} | 142,875 |
| USD | 317,000 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co. 6.25% due 05/15/26 ^{(a),(b)} | 317,987 |
| USD | 190,000 8.50% due 05/15/27 ^{(a),(b)} | 189,364 |
| USD | 279,000 Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco, Inc. 9.50% due 07/31/27 ^{(a),(b)} | 66,960 |
| USD | 195,000 Venator Finance sarl / Venator Materials LLC 5.75% due 07/15/25 ^{(a),(b)} | 168,675 |
| USD | 250,000 9.50% due 07/01/25 ^{(a),(b)} | 257,500 |
| | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | 2,465,872 |
| | TOTAL MULTINATIONAL (Cost \$2,706,169) | 2,465,872 |
| | NETHERLANDS (0.7%) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (0.7%) | |
| USD | 407,000 Sensata Technologies BV 4.00% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 387,667 |
| USD | 265,000 Trivium Packaging Finance BV 5.50% due 08/15/26 ^{(a),(b)} | 263,348 |
| USD | 200,000 8.50% due 08/15/27 ^{(a),(b)} | 196,887 |
| | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | 847,902 |
| | TOTAL NETHERLANDS (Cost \$852,759) | 847,902 |

(2022年5月31日現在)

| | 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-----|---------|--|----------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | | SPAIN (0.1%) | |
| | | CORPORATE BOND & NOTE (0.1%) | |
| USD | 200,000 | Grifols Escrow Issuer S.A. 4.75% due 10/15/28 ^{(a),(b)} | \$ 182,750 |
| | | TOTAL CORPORATE BOND & NOTE | 182,750 |
| | | TOTAL SPAIN (Cost \$200,000) | 182,750 |
| | | UNITED STATES (72.2%) | |
| | | CONVERTIBLE BOND & NOTE (0.4%) | |
| USD | 735,000 | DISH Network Corp. 3.38% due 08/15/26 | 554,069 |
| | | TOTAL CONVERTIBLE BOND & NOTE | 554,069 |
| | | CONVERTIBLE PREFERRED STOCK (0.1%) | |
| USD | 22* | Gulfport Energy Corp. 10.00% due 07/01/22 ^{(a),(d),(e)} | 149,226 |
| | | TOTAL CONVERTIBLE PREFERRED STOCK | 149,226 |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) | |
| USD | 200,000 | 180 Medical, Inc. 3.88% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 181,989 |
| USD | 195,000 | Acadia Healthcare Co., Inc. 5.50% due 07/01/28 ^{(a),(b)} | 192,806 |
| USD | 275,000 | ACCO Brands Corp. 4.25% due 03/15/29 ^{(a),(b)} | 235,812 |
| USD | 536,000 | ACI Worldwide, Inc. 5.75% due 08/15/26 ^{(a),(b)} | 534,660 |
| USD | 255,000 | Adient Global Holdings, Ltd. 4.88% due 08/15/26 ^{(a),(b)} | 237,201 |
| USD | 228,000 | ADT Security Corp. 4.13% due 08/01/29 ^{(a),(b)} | 202,897 |
| USD | 672,000 | 4.88% due 07/15/32 ^(b) | 583,736 |
| USD | 145,000 | Ahead DB Holdings LLC 6.63% due 05/01/28 ^{(a),(b)} | 123,716 |
| USD | 132,000 | AHP Health Partners, Inc. 5.75% due 07/15/29 ^{(a),(b)} | 103,290 |
| USD | 593,000 | Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons LP / Albertsons LLC 4.63% due 01/15/27 ^{(a),(b)} | 576,061 |
| USD | 138,000 | 4.88% due 02/15/30 ^{(a),(b)} | 128,673 |
| USD | 20,000 | 5.88% due 02/15/28 ^{(a),(b)} | 19,592 |
| USD | 88,000 | Allegheny Technologies, Inc. 4.88% due 10/01/29 ^(a) | 79,255 |
| USD | 197,000 | 5.88% due 12/01/27 ^(a) | 190,046 |
| USD | 161,000 | Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp. 6.63% due 07/15/26 ^{(a),(b)} | 159,560 |
| USD | 95,000 | Allison Transmission, Inc. 3.75% due 01/30/31 ^{(a),(b)} | 81,344 |
| USD | 176,000 | 4.75% due 10/01/27 ^{(a),(b)} | 168,342 |
| USD | 286,000 | 5.88% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 286,572 |
| USD | 116,000 | American Axle & Manufacturing, Inc. 5.00% due 10/01/29 ^(a) | 103,065 |
| USD | 60,000 | 6.50% due 04/01/27 ^(a) | 57,000 |
| USD | 157,000 | 6.88% due 07/01/28 ^(a) | 150,274 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|------|---|------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp. | |
| USD | 177,000 5.38% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | \$ 177,465 |
| USD | 15,000 5.75% due 03/01/27 ^{(a),(b)} | 15,038 |
| USD | 130,000 5.75% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 130,000 |
| USD | 299,000 7.88% due 05/15/26 ^{(a),(b)} | 316,300 |
| | Antero Resources Corp. | |
| USD | 79,000 5.38% due 03/01/30 ^{(a),(b)} | 80,124 |
| USD | 42,000 7.63% due 02/01/29 ^{(a),(b)} | 45,526 |
| USD | 99,000 8.38% due 07/15/26 ^{(a),(b)} | 107,662 |
| | API Escrow Corp. | |
| USD | 109,000 4.75% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 95,920 |
| | APi Group DE, Inc. | |
| USD | 135,000 4.13% due 07/15/29 ^{(a),(b)} | 116,269 |
| | Aramark Services, Inc. | |
| USD | 263,000 5.00% due 02/01/28 ^{(a),(b)} | 256,162 |
| | Arches Buyer, Inc. | |
| USD | 98,000 4.25% due 06/01/28 ^{(a),(b)} | 89,462 |
| USD | 75,000 6.13% due 12/01/28 ^{(a),(b)} | 62,972 |
| | Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp. | |
| USD | 142,000 6.25% due 04/01/28 ^{(a),(b)} | 138,450 |
| | Arconic Corp. | |
| USD | 165,000 6.00% due 05/15/25 ^{(a),(b)} | 168,712 |
| USD | 263,000 6.13% due 02/15/28 ^{(a),(b)} | 257,858 |
| | Asbury Automotive Group, Inc. | |
| USD | 98,000 4.63% due 11/15/29 ^{(a),(b)} | 90,345 |
| | Avantor Funding, Inc. | |
| USD | 436,000 4.63% due 07/15/28 ^{(a),(b)} | 424,459 |
| | Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance, Inc. | |
| USD | 154,000 5.38% due 03/01/29 ^{(a),(b)} | 140,910 |
| USD | 220,000 5.75% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | 213,026 |
| | Axalta Coating Systems LLC | |
| USD | 337,000 3.38% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | 296,322 |
| | Bath & Body Works, Inc. | |
| USD | 138,000 6.75% due 07/01/36 | 123,165 |
| USD | 18,000 9.38% due 07/01/25 ^(b) | 19,417 |
| | Bausch Health Americas, Inc. | |
| USD | 528,000 8.50% due 01/31/27 ^{(a),(b)} | 419,443 |
| USD | 405,000 9.25% due 04/01/26 ^{(a),(b)} | 339,410 |
| | Black Knight InfoServ LLC | |
| USD | 142,000 3.63% due 09/01/28 ^{(a),(b)} | 133,125 |
| | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp. | |
| USD | 114,000 7.63% due 12/15/25 ^{(a),(b)} | 115,140 |
| | Boyer USA, Inc. | |
| USD | 152,000 4.75% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | 141,360 |
| | Buckeye Partners LP | |
| USD | 146,000 4.13% due 03/01/25 ^{(a),(b)} | 143,525 |
| USD | 40,000 4.13% due 12/01/27 ^(a) | 37,200 |
| USD | 275,000 4.50% due 03/01/28 ^{(a),(b)} | 256,019 |

(2022年5月31日現在)

| | 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-----|-----------|---|------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| USD | 173,000 | Builders FirstSource, Inc. 4.25% due 02/01/32 ^{(a),(b)} | \$ 154,268 |
| USD | 179,000 | BWX Technologies, Inc. 4.13% due 06/30/28 ^{(a),(b)} | 161,981 |
| USD | 33,000 | 4.13% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 29,535 |
| USD | 135,000 | Caesars Entertainment, Inc. 4.63% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 115,182 |
| USD | 50,000 | 8.13% due 07/01/27 ^{(a),(b)} | 50,860 |
| USD | 111,000 | Calpine Corp. 4.63% due 02/01/29 ^{(a),(b)} | 96,570 |
| USD | 170,000 | 5.00% due 02/01/31 ^{(a),(b)} | 151,511 |
| USD | 174,000 | Carnival Corp. 4.00% due 08/01/28 ^{(a),(b)} | 157,748 |
| USD | 110,000 | 5.75% due 03/01/27 ^{(a),(b)} | 97,589 |
| USD | 186,000 | 6.00% due 05/01/29 ^{(a),(b)} | 157,170 |
| USD | 90,000 | 10.50% due 02/01/26 ^{(a),(b)} | 96,885 |
| USD | 176,000 | Carpenter Technology Corp. 6.38% due 07/15/28 ^(a) | 172,412 |
| USD | 1,300,000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp. 4.25% due 02/01/31 ^{(a),(b)} | 1,146,860 |
| USD | 270,000 | 4.25% due 01/15/34 ^{(a),(b)} | 223,659 |
| USD | 225,000 | 4.75% due 03/01/30 ^{(a),(b)} | 207,562 |
| USD | 75,000 | 4.75% due 02/01/32 ^{(a),(b)} | 66,750 |
| USD | 413,000 | 5.00% due 02/01/28 ^{(a),(b)} | 400,129 |
| USD | 1,929,000 | 5.13% due 05/01/27 ^{(a),(b)} | 1,901,222 |
| USD | 705,000 | 5.38% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 684,830 |
| USD | 261,000 | CD&R Smokey Buyer, Inc. 6.75% due 07/15/25 ^{(a),(b)} | 266,771 |
| USD | 223,000 | CDK Global, Inc. 5.25% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | 223,000 |
| USD | 80,000 | Cedar Fair LP 5.25% due 07/15/29 ^(a) | 77,182 |
| USD | 185,000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co. / Magnum Management Corp. / Millennium Op 5.50% due 05/01/25 ^{(a),(b)} | 187,814 |
| USD | 329,000 | Centene Corp. 4.25% due 12/15/27 ^(a) | 327,355 |
| USD | 1,104,000 | 4.63% due 12/15/29 ^(a) | 1,088,036 |
| USD | 175,000 | Central Garden & Pet Co. 4.13% due 10/15/30 ^(a) | 154,875 |
| USD | 500,000 | 5.13% due 02/01/28 ^(a) | 477,500 |
| USD | 310,000 | Chemours Co. 5.75% due 11/15/28 ^{(a),(b)} | 306,047 |
| USD | 500,000 | Cheniere Energy Partners LP 4.50% due 10/01/29 ^(a) | 487,780 |
| USD | 77,000 | Chesapeake Energy Corp. 5.50% due 02/01/26 ^{(a),(b)} | 78,160 |
| USD | 395,000 | 6.75% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 416,330 |

(2022年5月31日現在)

| | 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-----|---------|--|------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| | | CHS/Community Health Systems, Inc. | |
| USD | 125,000 | 4.75% due 02/15/31 ^{(a),(b)} | \$ 100,844 |
| USD | 60,000 | 5.25% due 05/15/30 ^{(a),(b)} | 51,685 |
| USD | 219,000 | 5.63% due 03/15/27 ^{(a),(b)} | 204,007 |
| USD | 198,000 | 6.00% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 179,416 |
| USD | 161,000 | 6.13% due 04/01/30 ^{(a),(b)} | 117,256 |
| USD | 85,000 | 8.00% due 03/15/26 ^{(a),(b)} | 85,172 |
| | | Cinemark USA, Inc. | |
| USD | 115,000 | 5.25% due 07/15/28 ^{(a),(b)} | 103,337 |
| USD | 125,000 | 8.75% due 05/01/25 ^{(a),(b)} | 128,762 |
| | | Citigroup, Inc. | |
| USD | 75,000 | 5.95% due 05/15/25 ^{(a),(d),(f)} | 73,616 |
| | | Clarivate Science Holdings Corp. | |
| USD | 140,000 | 3.88% due 07/01/28 ^{(a),(b)} | 126,973 |
| USD | 158,000 | 4.88% due 07/01/29 ^{(a),(b)} | 141,489 |
| | | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. | |
| USD | 671,000 | 5.13% due 08/15/27 ^{(a),(b)} | 616,582 |
| USD | 507,000 | 7.50% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 409,813 |
| | | Cleveland-Cliffs, Inc. | |
| USD | 230,000 | 4.63% due 03/01/29 ^{(a),(b)} | 213,721 |
| USD | 79,000 | 4.88% due 03/01/31 ^{(a),(b)} | 74,503 |
| | | CNX Midstream Partners LP | |
| USD | 44,000 | 4.75% due 04/15/30 ^{(a),(b)} | 39,236 |
| | | CNX Resources Corp. | |
| USD | 121,000 | 6.00% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 120,195 |
| | | Coinbase Global, Inc. | |
| USD | 68,000 | 3.38% due 10/01/28 ^{(a),(b)} | 49,707 |
| USD | 68,000 | 3.63% due 10/01/31 ^{(a),(b)} | 45,900 |
| | | CommScope Technologies LLC | |
| USD | 366,000 | 6.00% due 06/15/25 ^{(a),(b)} | 340,948 |
| | | CommScope, Inc. | |
| USD | 255,000 | 4.75% due 09/01/29 ^{(a),(b)} | 225,753 |
| USD | 395,000 | 6.00% due 03/01/26 ^{(a),(b)} | 386,112 |
| USD | 455,000 | 8.25% due 03/01/27 ^{(a),(b)} | 400,286 |
| | | Comstock Resources, Inc. | |
| USD | 296,000 | 6.75% due 03/01/29 ^{(a),(b)} | 295,584 |
| | | Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions, Inc. | |
| USD | 250,000 | 6.00% due 11/01/29 ^{(a),(b)} | 221,250 |
| | | Constellation Merger Sub, Inc. | |
| USD | 115,000 | 8.50% due 09/15/25 ^{(a),(b)} | 103,500 |
| | | Cooper-Standard Automotive, Inc. | |
| USD | 780,000 | 5.63% due 11/15/26 ^{(a),(b)} | 390,000 |
| USD | 320,000 | 13.00% due 06/01/24 ^{(a),(b)} | 321,741 |
| | | CoreCivic, Inc. | |
| USD | 241,000 | 8.25% due 04/15/26 ^(a) | 248,056 |
| | | Coty, Inc. | |
| USD | 213,000 | 5.00% due 04/15/26 ^{(a),(b)} | 203,732 |
| | | Coty, Inc. / HFC Prestige Products, Inc. / HFC Prestige International US LLC | |
| USD | 120,000 | 4.75% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 106,056 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|---------------|--|------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| USD 325,000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp. 5.63% due 05/01/27 ^{(a),(b)} | \$ 313,560 |
| USD 234,000 | 8.00% due 04/01/29 ^{(a),(b)} | 239,850 |
| USD 269,000 | CSC Holdings LLC 4.50% due 11/15/31 ^{(a),(b)} | 230,667 |
| USD 895,000 | 6.50% due 02/01/29 ^{(a),(b)} | 881,289 |
| USD 512,000 | DaVita, Inc. 3.75% due 02/15/31 ^{(a),(b)} | 419,620 |
| USD 240,000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co. 5.38% due 08/15/26 ^{(a),(b)} | 79,200 |
| USD 531,000 | Directv Financing LLC / Directv Financing Co.-Obligor, Inc. 5.88% due 08/15/27 ^{(a),(b)} | 500,733 |
| USD 13,000 | DISH DBS Corp. 5.00% due 03/15/23 | 12,740 |
| USD 740,000 | 5.25% due 12/01/26 ^{(a),(b)} | 626,077 |
| USD 150,000 | 5.75% due 12/01/28 ^{(a),(b)} | 122,434 |
| USD 28,000 | 5.88% due 07/15/22 | 28,004 |
| USD 1,790,000 | 5.88% due 11/15/24 | 1,646,084 |
| USD 495,000 | 7.75% due 07/01/26 | 423,225 |
| USD 270,000 | Dornoch Debt Merger Sub, Inc. 6.63% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 215,325 |
| USD 180,000 | DT Midstream, Inc. 4.13% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 168,547 |
| USD 90,000 | 4.38% due 06/15/31 ^{(a),(b)} | 83,700 |
| USD 62,000 | Dun & Bradstreet Corp. 5.00% due 12/15/29 ^{(a),(b)} | 56,381 |
| USD 112,000 | Edgewell Personal Care Co. 4.13% due 04/01/29 ^{(a),(b)} | 101,706 |
| USD 290,000 | 5.50% due 06/01/28 ^{(a),(b)} | 282,045 |
| USD 205,000 | Element Solutions, Inc. 3.88% due 09/01/28 ^{(a),(b)} | 183,475 |
| USD 213,000 | Emergent BioSolutions, Inc. 3.88% due 08/15/28 ^{(a),(b)} | 168,383 |
| USD 253,000 | Encino Acquisition Partners Holdings LLC 8.50% due 05/01/28 ^{(a),(b)} | 253,000 |
| USD 125,000 | Encompass Health Corp. 4.50% due 02/01/28 ^(a) | 116,208 |
| USD 455,000 | 4.75% due 02/01/30 ^(a) | 416,325 |
| USD 146,000 | Endeavor Energy Resources LP / EER Finance, Inc. 6.63% due 07/15/25 ^{(a),(b)} | 150,951 |
| USD 16,000 | Energizer Holdings, Inc. 4.38% due 03/31/29 ^{(a),(b)} | 13,529 |
| USD 338,000 | 4.75% due 06/15/28 ^{(a),(b)} | 298,285 |
| USD 91,000 | 6.50% due 12/31/27 ^{(a),(b)} | 85,889 |
| USD 145,000 | EnLink Midstream LLC 5.38% due 06/01/29 ^(a) | 140,760 |
| USD 270,000 | EnLink Midstream Partners LP 4.85% due 07/15/26 ^(a) | 271,494 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 | |
|------|--|---|------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | | |
| USD | 200,000 | EnPro Industries, Inc. 5.75% due 10/15/26 ^(a) | \$ 200,000 |
| USD | 269,000 | Entegris Escrow Corp. 4.75% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 255,830 |
| USD | 134,000 | Entegris, Inc. 3.63% due 05/01/29 ^{(a),(b)} | 118,473 |
| USD | 85,000 | Envision Healthcare Corp. 4.38% due 04/15/28 ^{(a),(b)} | 79,262 |
| USD | 1,145,000 | Envision Healthcare Corp. 8.75% due 10/15/26 ^{(a),(b)} | 343,500 |
| USD | 235,000 | EQM Midstream Partners LP 4.13% due 12/01/26 ^(a) | 220,195 |
| USD | 189,000 | 4.50% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 167,603 |
| USD | 189,000 | 4.75% due 01/15/31 ^{(a),(b)} | 163,957 |
| USD | 145,000 | 6.00% due 07/01/25 ^{(a),(b)} | 146,450 |
| USD | 145,000 | 6.50% due 07/01/27 ^{(a),(b)} | 145,000 |
| USD | 110,000 | 7.50% due 06/01/27 ^{(a),(b)} | 110,000 |
| USD | 88,000 | 7.50% due 06/01/30 ^{(a),(b)} | 88,000 |
| USD | 99,000 | EQT Corp. 3.13% due 05/15/26 ^{(a),(b)} | 93,332 |
| USD | 263,000 | First Student Bidco, Inc. / First Transit Parent, Inc. 4.00% due 07/31/29 ^{(a),(b)} | 233,307 |
| USD | 411,000 | Ford Motor Credit Co, LLC 4.00% due 11/13/30 ^(a) | 369,900 |
| USD | 320,000 | 4.13% due 08/17/27 ^(a) | 303,200 |
| USD | 340,000 | 4.27% due 01/09/27 ^(a) | 326,340 |
| USD | 500,000 | 4.54% due 08/01/26 ^(a) | 490,680 |
| USD | 710,000 | 4.69% due 06/09/25 ^(a) | 700,145 |
| USD | 347,000 | Frontier Communications Holdings LLC 5.00% due 05/01/28 ^{(a),(b)} | 322,795 |
| USD | 194,000 | 5.88% due 10/15/27 ^{(a),(b)} | 190,120 |
| USD | 120,327 | 5.88% due 11/01/29 ^(a) | 101,528 |
| USD | 74,000 | 6.00% due 01/15/30 ^{(a),(b)} | 62,834 |
| USD | 20,000 | 8.75% due 05/15/30 ^{(a),(b)} | 21,085 |
| USD | 88,000 | Gannett Holdings LLC 6.00% due 11/01/26 ^{(a),(b)} | 79,860 |
| USD | 51,000 | Gartner, Inc. 3.63% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 46,537 |
| USD | 270,000 | 4.50% due 07/01/28 ^{(a),(b)} | 262,561 |
| USD | 330,000 | GCI LLC 4.75% due 10/15/28 ^{(a),(b)} | 298,551 |
| USD | 50,000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp. 6.25% due 05/15/26 ^(a) | 46,375 |
| USD | 25,000 | 6.50% due 10/01/25 ^(a) | 24,155 |
| USD | 261,000 | 7.75% due 02/01/28 ^(a) | 251,391 |
| USD | 203,000 | Geo Group, Inc. 5.88% due 10/15/24 ^(a) | 184,815 |
| USD | 125,000 | Glatfelter Corp. 4.75% due 11/15/29 ^{(a),(b)} | 89,880 |
| USD | 184,000 | Global Infrastructure Solutions, Inc. 5.63% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 154,341 |
| USD | 120,000 | 7.50% due 04/15/32 ^{(a),(b)} | 101,700 |

(2022年5月31日現在)

| | 元本金額 | 銘柄名 | | 公正価値 |
|-----|---------|--|----|------------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | | |
| | | UNITED STATES (72.2%) (continued) | | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | | |
| | | Goodyear Tire & Rubber Co. | | |
| USD | 114,000 | 5.00% due 07/15/29 ^(a) | \$ | 104,389 |
| USD | 162,000 | 5.25% due 04/30/31 ^(a) | | 147,622 |
| USD | 151,000 | 5.25% due 07/15/31 ^(a) | | 137,410 |
| USD | 82,000 | Graham Packaging Co., Inc. 7.13% due 08/15/28 ^{(a),(b)} | | 67,253 |
| USD | 152,000 | Gray Escrow II, Inc. 5.38% due 11/15/31 ^{(a),(b)} | | 138,429 |
| USD | 138,000 | Gray Television, Inc. 4.75% due 10/15/30 ^{(a),(b)} | | 121,251 |
| USD | 222,000 | 7.00% due 05/15/27 ^{(a),(b)} | | 224,220 |
| USD | 485,000 | Griffon Corp. 5.75% due 03/01/28 ^(a) | | 468,025 |
| USD | 228,750 | Gulfport Energy Corp. 8.00% due 05/17/26 ^{(a),(b)} | | 236,329 |
| USD | 245,000 | Gulfport Energy Operating Corp. 6.00% due 10/15/24 ^{(a),(b),(c)} | | 25 |
| USD | 100,000 | 6.38% due 05/15/25 ^{(a),(b),(c)} | | 10 |
| USD | 585,000 | 6.38% due 01/15/26 ^{(a),(b),(c)} | | 59 |
| USD | 160,000 | 6.63% due 05/01/23 ^{(a),(b),(c)} | | 16 |
| USD | 580,000 | HCA, Inc. 5.88% due 02/15/26 ^(a) | | 609,000 |
| USD | 50,000 | HealthEquity, Inc. 4.50% due 10/01/29 ^{(a),(b)} | | 46,625 |
| USD | 615,000 | Herc Holdings, Inc. 5.50% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | | 616,537 |
| USD | 117,000 | Hertz Corp. 4.63% due 12/01/26 ^{(a),(b)} | | 107,095 |
| USD | 97,000 | 5.00% due 12/01/29 ^{(a),(b)} | | 85,117 |
| USD | 563,000 | 5.50% due 10/15/24 ^{(a),(b),(c)} | | 2,815 |
| USD | 175,000 | 6.00% due 01/15/28 ^{(a),(b),(c)} | | 10,500 |
| USD | 510,000 | 7.13% due 08/01/26 ^{(a),(b),(c)} | | 30,600 |
| USD | 390,000 | Hess Midstream Operations LP 5.63% due 02/15/26 ^{(a),(b)} | | 398,190 |
| USD | 705,000 | High Ridge Brands Co. 8.88% due 03/15/25 ^{(a),(b),(c)} | | — ^(a) |
| USD | 71,000 | Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co. 6.00% due 04/15/30 ^{(a),(b)} | | 69,047 |
| USD | 5,000 | 6.25% due 11/01/28 ^{(a),(b)} | | 5,037 |
| USD | 60,000 | 6.25% due 04/15/32 ^{(a),(b)} | | 58,490 |
| USD | 89,000 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3.75% due 05/01/29 ^{(a),(b)} | | 81,502 |
| USD | 226,000 | 5.75% due 05/01/28 ^{(a),(b)} | | 230,237 |
| USD | 80,000 | Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp. 6.38% due 04/15/27 ^{(a),(b)} | | 79,906 |
| USD | 445,000 | Hologic, Inc. 3.25% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | | 400,500 |
| USD | 460,000 | iHeartCommunications, Inc. 5.25% due 08/15/27 ^{(a),(b)} | | 432,552 |
| USD | 117,120 | 6.38% due 05/01/26 ^(a) | | 115,392 |
| USD | 400,092 | 8.38% due 05/01/27 ^(a) | | 375,286 |

(2022年5月31日現在)

| | 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-----|---------|--|------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| | | II-VI, Inc. | |
| USD | 115,000 | 5.00% due 12/15/29 ^{(a),(b)} | \$ 107,813 |
| | | Imola Merger Corp. | |
| USD | 621,000 | 4.75% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | 582,964 |
| | | IQVIA, Inc. | |
| USD | 485,000 | 5.00% due 10/15/26 ^{(a),(b)} | 483,600 |
| | | IRB Holding Corp. | |
| USD | 125,000 | 7.00% due 06/15/25 ^{(a),(b)} | 126,254 |
| | | Iron Mountain, Inc. | |
| USD | 264,000 | 4.50% due 02/15/31 ^{(a),(b)} | 236,835 |
| USD | 250,000 | 5.00% due 07/15/28 ^{(a),(b)} | 243,159 |
| | | JELD-WEN, Inc. | |
| USD | 240,000 | 4.63% due 12/15/25 ^{(a),(b)} | 221,400 |
| USD | 85,000 | 4.88% due 12/15/27 ^{(a),(b)} | 77,456 |
| USD | 130,000 | 6.25% due 05/15/25 ^{(a),(b)} | 130,650 |
| | | LABL, Inc. | |
| USD | 290,000 | 6.75% due 07/15/26 ^{(a),(b)} | 279,850 |
| USD | 350,000 | 10.50% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | 337,045 |
| | | Lamb Weston Holdings, Inc. | |
| USD | 244,000 | 4.13% due 01/31/30 ^{(a),(b)} | 226,005 |
| USD | 65,000 | 4.88% due 05/15/28 ^{(a),(b)} | 64,154 |
| | | Level 3 Financing, Inc. | |
| USD | 335,000 | 4.63% due 09/15/27 ^{(a),(b)} | 308,619 |
| | | Live Nation Entertainment, Inc. | |
| USD | 705,000 | 4.75% due 10/15/27 ^{(a),(b)} | 673,275 |
| USD | 385,000 | 6.50% due 05/15/27 ^{(a),(b)} | 398,498 |
| | | Lumen Technologies, Inc. | |
| USD | 350,000 | 4.00% due 02/15/27 ^{(a),(b)} | 322,000 |
| USD | 100,000 | 4.50% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 82,168 |
| USD | 450,000 | 5.13% due 12/15/26 ^{(a),(b)} | 416,250 |
| USD | 228,000 | 5.38% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 195,510 |
| | | Macy's Retail Holdings LLC | |
| USD | 36,000 | 5.88% due 03/15/30 ^{(a),(b)} | 32,850 |
| | | Madison IAQ LLC | |
| USD | 215,000 | 4.13% due 06/30/28 ^{(a),(b)} | 197,262 |
| USD | 350,000 | 5.88% due 06/30/29 ^{(a),(b)} | 273,875 |
| | | Marriott Ownership Resorts, Inc. | |
| USD | 35,000 | 4.50% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 31,096 |
| USD | 118,000 | 6.13% due 09/15/25 ^{(a),(b)} | 119,873 |
| | | MasTec, Inc. | |
| USD | 341,000 | 4.50% due 08/15/28 ^{(a),(b)} | 325,125 |
| | | Mattel, Inc. | |
| USD | 115,000 | 5.88% due 12/15/27 ^{(a),(b)} | 117,013 |
| | | Mauser Packaging Solutions Holding Co. | |
| USD | 781,000 | 5.50% due 04/15/24 ^{(a),(b)} | 771,394 |
| USD | 545,000 | 7.25% due 04/15/25 ^{(a),(b)} | 526,742 |
| | | McGraw-Hill Education, Inc. | |
| USD | 175,000 | 5.75% due 08/01/28 ^{(a),(b)} | 159,597 |
| | | MGM Resorts International | |
| USD | 391,000 | 5.75% due 06/15/25 ^(a) | 389,045 |
| USD | 155,000 | 6.75% due 05/01/25 ^(a) | 157,480 |

(2022年5月31日現在)

| | <u>元本金額</u> | <u>銘柄名</u> | | <u>公正価値</u> |
|-----|-------------|--|----|-------------|
| | | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | | |
| | | UNITED STATES (72.2%) (continued) | | |
| | | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | | |
| USD | 365,000 | Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets, Ltd. 6.50% due 06/20/27 ^{(a),(b)} | \$ | 370,512 |
| USD | 130,000 | Millennium Escrow Corp. 6.63% due 08/01/26 ^{(a),(b)} | | 114,359 |
| USD | 70,000 | Minerva Merger Sub, Inc. 6.50% due 02/15/30 ^{(a),(b)} | | 64,225 |
| USD | 57,000 | MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp. 5.50% due 02/01/30 ^{(a),(b)} | | 48,456 |
| USD | 365,000 | Mozart Debt Merger Sub, Inc. 3.88% due 04/01/29 ^{(a),(b)} | | 329,413 |
| USD | 284,000 | 5.25% due 10/01/29 ^{(a),(b)} | | 251,400 |
| USD | 120,000 | Nabors Industries, Inc. 5.75% due 02/01/25 ^(a) | | 115,595 |
| USD | 128,000 | Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5.13% due 12/15/30 ^{(a),(b)} | | 114,586 |
| USD | 201,000 | 5.50% due 08/15/28 ^{(a),(b)} | | 189,698 |
| USD | 210,000 | 5.75% due 11/15/31 ^{(a),(b)} | | 192,675 |
| USD | 65,000 | 6.00% due 01/15/27 ^{(a),(b)} | | 63,044 |
| USD | 380,000 | NCR Corp. 5.75% due 09/01/27 ^{(a),(b)} | | 368,022 |
| USD | 550,000 | 6.13% due 09/01/29 ^{(a),(b)} | | 522,678 |
| USD | 69,000 | NESCO Holdings II, Inc. 5.50% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | | 62,273 |
| USD | 159,000 | News Corp. 3.88% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | | 147,081 |
| USD | 1,050,000 | Nexstar Media, Inc. 5.63% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | | 1,047,407 |
| USD | 178,000 | NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp. 7.50% due 02/01/26 ^{(a),(b)} | | 166,794 |
| USD | 379,000 | NMG Holding Co., Inc. / Neiman Marcus Group LLC 7.13% due 04/01/26 ^{(a),(b)} | | 375,813 |
| USD | 142,000 | Novelis Corp. 3.25% due 11/15/26 ^{(a),(b)} | | 130,261 |
| USD | 70,000 | 3.88% due 08/15/31 ^{(a),(b)} | | 61,075 |
| USD | 295,000 | 4.75% due 01/30/30 ^{(a),(b)} | | 279,881 |
| USD | 130,000 | NRG Energy, Inc. 3.38% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | | 115,692 |
| USD | 136,000 | 3.88% due 02/15/32 ^{(a),(b)} | | 119,680 |
| USD | 395,000 | 5.25% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | | 385,220 |
| USD | 67,000 | 6.63% due 01/15/27 ^(a) | | 68,764 |
| USD | 20,000 | NuStar Logistics LP 5.63% due 04/28/27 ^(a) | | 20,060 |
| USD | 465,000 | 6.00% due 06/01/26 ^(a) | | 468,892 |
| USD | 90,000 | Oasis Petroleum, Inc. 6.38% due 06/01/26 ^{(a),(b)} | | 90,450 |
| USD | 129,000 | Occidental Petroleum Corp. 5.50% due 12/01/25 ^(a) | | 133,515 |
| USD | 283,000 | 8.50% due 07/15/27 ^(a) | | 328,280 |
| USD | 330,000 | 8.88% due 07/15/30 ^(a) | | 412,170 |
| USD | 200,000 | Olympus Water US Holding Corp. 4.25% due 10/01/28 ^{(a),(b)} | | 182,176 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-------------|---|------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| USD 216,000 | ON Semiconductor Corp. 3.88% due 09/01/28 ^{(a),(b)} | \$ 204,900 |
| USD 68,000 | OneMain Finance Corp. 3.50% due 01/15/27 ^(a) | 60,839 |
| USD 87,000 | 4.00% due 09/15/30 ^(a) | 73,880 |
| USD 210,000 | 5.38% due 11/15/29 ^(a) | 194,051 |
| USD 202,000 | 6.63% due 01/15/28 ^(a) | 202,253 |
| USD 227,000 | Organon & Co. / Organon Foreign Debt Co.-Issuer BV 4.13% due 04/30/28 ^{(a),(b)} | 217,643 |
| USD 266,000 | 5.13% due 04/30/31 ^{(a),(b)} | 255,726 |
| USD 115,000 | Owens & Minor, Inc. 4.50% due 03/31/29 ^{(a),(b)} | 103,931 |
| USD 79,000 | 6.63% due 04/01/30 ^{(a),(b)} | 78,111 |
| USD 554,000 | Par Pharmaceutical, Inc. 7.50% due 04/01/27 ^{(a),(b)} | 433,505 |
| USD 169,000 | PBF Holding Co. LLC / PBF Finance Corp. 9.25% due 05/15/25 ^{(a),(b)} | 175,760 |
| USD 225,000 | Performance Food Group, Inc. 4.25% due 08/01/29 ^{(a),(b)} | 199,904 |
| USD 220,000 | 5.50% due 10/15/27 ^{(a),(b)} | 216,379 |
| USD 250,000 | PetSmart, Inc. / PetSmart Finance Corp. 4.75% due 02/15/28 ^{(a),(b)} | 230,000 |
| USD 208,000 | PG&E Corp. 5.00% due 07/01/28 ^(a) | 196,552 |
| USD 112,000 | PGT Innovations, Inc. 4.38% due 10/01/29 ^{(a),(b)} | 100,179 |
| USD 635,000 | Photo Holdings Merger Sub, Inc. 8.50% due 10/01/26 ^{(a),(b)} | 539,693 |
| USD 190,000 | Pike Corp. 5.50% due 09/01/28 ^{(a),(b)} | 160,691 |
| USD 157,000 | Plantronics, Inc. 4.75% due 03/01/29 ^{(a),(b)} | 159,357 |
| USD 165,000 | Post Holdings, Inc. 4.63% due 04/15/30 ^{(a),(b)} | 148,010 |
| USD 185,000 | 5.50% due 12/15/29 ^{(a),(b)} | 176,154 |
| USD 185,000 | 5.63% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 183,384 |
| USD 123,000 | 5.75% due 03/01/27 ^{(a),(b)} | 125,369 |
| USD 175,000 | Presidio Holdings, Inc. 4.88% due 02/01/27 ^{(a),(b)} | 170,986 |
| USD 130,000 | Prestige Brands, Inc. 5.13% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 124,800 |
| USD 291,000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance, Inc. 3.38% due 08/31/27 ^{(a),(b)} | 260,445 |
| USD 95,000 | 5.75% due 04/15/26 ^(b) | 93,957 |
| USD 285,000 | Radiology Partners, Inc. 9.25% due 02/01/28 ^{(a),(b)} | 232,710 |
| USD 455,000 | Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp. 7.25% due 04/01/25 ^{(a),(b)} | 437,231 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|---------------|---|------------------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| USD 57,000 | Range Resources Corp. 4.75% due 02/15/30 ^{(a),(b)} | \$ 55,749 |
| USD 190,000 | 4.88% due 05/15/25 ^(a) | 193,325 |
| USD 100,000 | 8.25% due 01/15/29 ^(a) | 108,273 |
| USD 255,000 | Realogy Group LLC / Realogy Co.-Issuer Corp. 5.25% due 04/15/30 ^{(a),(b)} | 221,765 |
| USD 289,524 | Reichhold Industries, Inc. 9.00% due 05/01/18 ^{(b),(c),(e)} | — ^(a) |
| USD 379,000 | RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp. 4.50% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | 353,599 |
| USD 425,000 | 4.75% due 10/15/27 ^(a) | 408,179 |
| USD 761,000 | Rite Aid Corp. 8.00% due 11/15/26 ^{(a),(b)} | 630,523 |
| USD 80,000 | Rockcliff Energy II LLC 5.50% due 10/15/29 ^{(a),(b)} | 75,600 |
| USD 151,000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co.-Issuer, Inc. 2.88% due 10/15/26 ^{(a),(b)} | 135,071 |
| USD 25,000 | 4.00% due 10/15/33 ^{(a),(b)} | 20,500 |
| USD 55,000 | Royal Caribbean Cruises, Ltd. 9.13% due 06/15/23 ^{(a),(b)} | 56,100 |
| USD 100,000 | 10.88% due 06/01/23 ^{(a),(b)} | 104,006 |
| USD 121,000 | 11.50% due 06/01/25 ^{(a),(b)} | 131,160 |
| USD 108,000 | RP Escrow Issuer LLC 5.25% due 12/15/25 ^{(a),(b)} | 98,440 |
| USD 135,000 | Sabre GBLB, Inc. 7.38% due 09/01/25 ^{(a),(b)} | 133,313 |
| USD 204,000 | Scotts Miracle-Gro Co. 4.00% due 04/01/31 ^(a) | 170,219 |
| USD 177,000 | 4.38% due 02/01/32 ^(a) | 146,025 |
| USD 98,000 | 4.50% due 10/15/29 ^(a) | 87,957 |
| USD 106,000 | 5.25% due 12/15/26 ^(a) | 102,290 |
| USD 76,000 | Scripps Escrow II, Inc. 3.88% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 68,772 |
| USD 74,000 | 5.38% due 01/15/31 ^{(a),(b)} | 64,834 |
| USD 140,000 | Scripps Escrow, Inc. 5.88% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | 132,527 |
| USD 28,000 | Service Corp. International/US 3.38% due 08/15/30 ^(a) | 24,500 |
| USD 39,000 | 4.00% due 05/15/31 ^(a) | 36,258 |
| USD 290,000 | Sinclair Television Group, Inc. 5.13% due 02/15/27 ^{(a),(b)} | 254,646 |
| USD 120,000 | Sirius XM Radio, Inc. 4.00% due 07/15/28 ^{(a),(b)} | 111,282 |
| USD 1,390,000 | 5.00% due 08/01/27 ^{(a),(b)} | 1,381,313 |
| USD 235,000 | 5.50% due 07/01/29 ^{(a),(b)} | 233,424 |
| USD 490,000 | Six Flags Entertainment Corp. 4.88% due 07/31/24 ^{(a),(b)} | 481,508 |
| USD 10,000 | 5.50% due 04/15/27 ^{(a),(b)} | 9,744 |
| USD 174,000 | Six Flags Theme Parks, Inc. 7.00% due 07/01/25 ^{(a),(b)} | 180,090 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|-------------|--|-----------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| | SM Energy Co. | |
| USD 53,000 | 6.50% due 07/15/28 ^(a) | \$ 52,638 |
| USD 46,000 | 6.63% due 01/15/27 ^(a) | 46,231 |
| | Sonic Automotive, Inc. | |
| USD 151,000 | 4.63% due 11/15/29 ^{(a),(b)} | 134,142 |
| | Southwestern Energy Co. | |
| USD 45,000 | 4.75% due 02/01/32 ^(a) | 43,978 |
| USD 235,000 | 5.38% due 03/15/30 ^(a) | 237,938 |
| USD 260,000 | 7.75% due 10/01/27 ^(a) | 274,244 |
| | Spectrum Brands, Inc. | |
| USD 88,000 | 3.88% due 03/15/31 ^{(a),(b)} | 75,240 |
| USD 345,000 | 5.00% due 10/01/29 ^{(a),(b)} | 323,438 |
| USD 273,000 | 5.50% due 07/15/30 ^{(a),(b)} | 252,361 |
| USD 30,000 | 5.75% due 07/15/25 ^(a) | 30,000 |
| | Spirit AeroSystems, Inc. | |
| USD 286,000 | 7.50% due 04/15/25 ^{(a),(b)} | 288,292 |
| | Sprint Capital Corp. | |
| USD 498,000 | 8.75% due 03/15/32 | 646,904 |
| | SRS Distribution, Inc. | |
| USD 136,000 | 4.63% due 07/01/28 ^{(a),(b)} | 125,120 |
| USD 175,000 | 6.00% due 12/01/29 ^{(a),(b)} | 150,754 |
| USD 112,000 | 6.13% due 07/01/29 ^{(a),(b)} | 96,040 |
| | SS&C Technologies, Inc. | |
| USD 315,000 | 5.50% due 09/30/27 ^{(a),(b)} | 314,795 |
| | Stagwell Global LLC | |
| USD 148,000 | 5.63% due 08/15/29 ^{(a),(b)} | 133,940 |
| | Standard Industries, Inc./NJ | |
| USD 690,000 | 4.75% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | 654,486 |
| | Staples, Inc. | |
| USD 675,000 | 7.50% due 04/15/26 ^{(a),(b)} | 623,430 |
| USD 440,000 | 10.75% due 04/15/27 ^{(a),(b)} | 360,800 |
| | Station Casinos LLC | |
| USD 335,000 | 4.50% due 02/15/28 ^{(a),(b)} | 303,149 |
| | Stericycle, Inc. | |
| USD 204,000 | 3.88% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 185,212 |
| | Stevens Holding Co., Inc. | |
| USD 65,000 | 6.13% due 10/01/26 ^{(a),(b)} | 64,513 |
| | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp. | |
| USD 115,000 | 5.25% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 108,589 |
| | Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp. | |
| USD 109,000 | 8.50% due 10/15/26 ^{(a),(b)} | 104,713 |
| | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp. | |
| USD 126,000 | 4.50% due 05/15/29 ^(a) | 117,306 |
| USD 320,000 | 4.50% due 04/30/30 ^{(a),(b)} | 291,200 |
| | Synaptics, Inc. | |
| USD 92,000 | 4.00% due 06/15/29 ^{(a),(b)} | 82,800 |
| | Syneos Health, Inc. | |
| USD 49,000 | 3.63% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 43,110 |

(2022年5月31日現在)

| 元本金額 | 銘柄名 | 公正価値 |
|---------------|--|-----------|
| | FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | |
| | UNITED STATES (72.2%) (continued) | |
| | CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | |
| | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp. | |
| USD 70,000 | 5.50% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | \$ 64,956 |
| USD 190,000 | 6.00% due 03/01/27 ^{(a),(b)} | 185,317 |
| USD 113,000 | 6.00% due 12/31/30 ^{(a),(b)} | 101,762 |
| USD 366,000 | 7.50% due 10/01/25 ^{(a),(b)} | 376,980 |
| | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp. | |
| USD 335,000 | 5.00% due 01/15/28 ^(a) | 328,066 |
| USD 270,000 | 6.50% due 07/15/27 ^(a) | 280,125 |
| USD 375,000 | 6.88% due 01/15/29 ^(a) | 394,253 |
| | Tempur Sealy International, Inc. | |
| USD 99,000 | 3.88% due 10/15/31 ^{(a),(b)} | 82,576 |
| USD 371,000 | 4.00% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 323,989 |
| | Tenet Healthcare Corp. | |
| USD 182,000 | 4.25% due 06/01/29 ^{(a),(b)} | 170,980 |
| USD 26,000 | 4.63% due 06/15/28 ^{(a),(b)} | 25,017 |
| USD 1,304,000 | 4.88% due 01/01/26 ^{(a),(b)} | 1,301,079 |
| USD 610,000 | 5.13% due 11/01/27 ^{(a),(b)} | 605,352 |
| USD 492,000 | 6.25% due 02/01/27 ^{(a),(b)} | 492,025 |
| | Tenneco, Inc. | |
| USD 214,000 | 5.00% due 07/15/26 ^(a) | 200,625 |
| USD 160,000 | 5.13% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 156,788 |
| USD 126,000 | 7.88% due 01/15/29 ^{(a),(b)} | 126,210 |
| | Terex Corp. | |
| USD 190,000 | 5.00% due 05/15/29 ^{(a),(b)} | 176,852 |
| | TK Elevator US Newco, Inc. | |
| USD 280,000 | 5.25% due 07/15/27 ^{(a),(b)} | 273,000 |
| | T-Mobile USA, Inc. | |
| USD 510,000 | 4.75% due 02/01/28 ^(a) | 511,556 |
| | TransDigm, Inc. | |
| USD 110,000 | 6.25% due 03/15/26 ^{(a),(b)} | 111,899 |
| | TriMas Corp. | |
| USD 212,000 | 4.13% due 04/15/29 ^{(a),(b)} | 190,800 |
| | TripAdvisor, Inc. | |
| USD 21,000 | 7.00% due 07/15/25 ^{(a),(b)} | 21,726 |
| | Triton Water Holdings, Inc. | |
| USD 349,000 | 6.25% due 04/01/29 ^{(a),(b)} | 272,775 |
| | Triumph Group, Inc. | |
| USD 80,000 | 6.25% due 09/15/24 ^{(a),(b)} | 76,349 |
| USD 28,000 | 8.88% due 06/01/24 ^{(a),(b)} | 29,015 |
| | Uber Technologies, Inc. | |
| USD 204,000 | 4.50% due 08/15/29 ^{(a),(b)} | 184,503 |
| | United Airlines, Inc. | |
| USD 256,000 | 4.38% due 04/15/26 ^{(a),(b)} | 247,051 |
| | United Rentals North America, Inc. | |
| USD 70,000 | 4.88% due 01/15/28 ^(a) | 69,825 |
| USD 250,000 | 5.50% due 05/15/27 ^(a) | 251,875 |
| | United States Cellular Corp. | |
| USD 400,000 | 6.70% due 12/15/33 | 399,600 |
| | United States Steel Corp. | |
| USD 158,000 | 6.88% due 03/01/29 ^(a) | 158,000 |

(2022年5月31日現在)

| <u>元本金額</u> | | <u>銘柄名</u> | <u>公正価値</u> | |
|---|---------|--|-------------|--------------------|
| FIXED INCOME SECURITIES (82.9%) (continued) | | | | |
| UNITED STATES (72.2%) (continued) | | | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES (71.7%) (continued) | | | | |
| USD | 71,000 | Univision Communications, Inc. 4.50% due 05/01/29 ^{(a),(b)} | \$ | 65,054 |
| USD | 102,000 | US Foods, Inc. 4.63% due 06/01/30 ^{(a),(b)} | | 93,636 |
| USD | 138,000 | Vail Resorts, Inc. 6.25% due 05/15/25 ^{(a),(b)} | | 141,741 |
| USD | 207,000 | VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc. 3.88% due 02/15/29 ^{(a),(b)} | | 185,819 |
| USD | 330,000 | 4.25% due 12/01/26 ^{(a),(b)} | | 313,375 |
| USD | 205,000 | 4.50% due 09/01/26 ^{(a),(b)} | | 195,650 |
| USD | 165,000 | 4.50% due 01/15/28 ^{(a),(b)} | | 153,872 |
| USD | 259,000 | 4.63% due 06/15/25 ^{(a),(b)} | | 252,838 |
| USD | 180,000 | 4.63% due 12/01/29 ^{(a),(b)} | | 169,200 |
| USD | 155,000 | 5.63% due 05/01/24 ^{(a),(b)} | | 156,705 |
| USD | 261,000 | 5.75% due 02/01/27 ^{(a),(b)} | | 260,154 |
| USD | 290,000 | Vista Outdoor, Inc. 4.50% due 03/15/29 ^{(a),(b)} | | 249,400 |
| USD | 106,000 | Vistra Operations Co. LLC 4.38% due 05/01/29 ^{(a),(b)} | | 98,858 |
| USD | 35,000 | 5.00% due 07/31/27 ^{(a),(b)} | | 34,241 |
| USD | 410,000 | 5.63% due 02/15/27 ^{(a),(b)} | | 410,205 |
| USD | 154,000 | Wabash National Corp. 4.50% due 10/15/28 ^{(a),(b)} | | 125,510 |
| USD | 686,000 | Wesco Aircraft Holdings, Inc. 9.00% due 11/15/26 ^{(a),(b)} | | 363,580 |
| USD | 95,000 | 13.13% due 11/15/27 ^{(a),(b)} | | 34,675 |
| USD | 352,000 | WESCO Distribution, Inc. 7.13% due 06/15/25 ^{(a),(b)} | | 365,464 |
| USD | 352,000 | 7.25% due 06/15/28 ^{(a),(b)} | | 369,621 |
| USD | 100,000 | White Capital Buyer LLC 6.88% due 10/15/28 ^{(a),(b)} | | 89,000 |
| USD | 200,000 | WMG Acquisition Corp. 3.75% due 12/01/29 ^{(a),(b)} | | 183,776 |
| USD | 86,000 | WR Grace Holdings LLC 5.63% due 08/15/29 ^{(a),(b)} | | 70,520 |
| USD | 132,000 | Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp. 5.50% due 03/01/25 ^{(a),(b)} | | 128,774 |
| USD | 275,000 | Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp. 5.13% due 10/01/29 ^{(a),(b)} | | 243,925 |
| USD | 206,000 | Yum! Brands, Inc. 4.63% due 01/31/32 ^(a) | | 192,225 |
| TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | | | | 93,584,639 |
| TOTAL UNITED STATES (Cost \$102,670,292) | | | | 94,287,934 |
| TOTAL FIXED INCOME SECURITIES (Cost \$118,534,010) | | | | 108,149,053 |
| EQUITY-LINKED NOTES (1.3%) | | | | |
| UNITED STATES (1.3%) | | | | |
| 581 | | Claire's Stores, Inc. | | 1,496,075 |
| 209,568 | | MYT Holding LLC Class B | | 207,891 |
| TOTAL UNITED STATES | | | | 1,703,966 |
| TOTAL EQUITY-LINKED NOTES (Cost \$958,293) | | | | 1,703,966 |

(2022年5月31日現在)

| 株数 | 銘柄名 | 公正価値 |
|----------------|--|-------------------------------------|
| | COMMON STOCKS (3.4%) | |
| | LUXEMBOURG (0.5%) | |
| 25,099 | Intelsat S.A. ^(b) | \$ 731,008 |
| | TOTAL LUXEMBOURG (Cost \$2,049,183) | 731,008 |
| | UNITED STATES (2.9%) | |
| 896 | Battalion Oil Corp. | 14,363 |
| 803 | Claire's Stores, Inc. | 271,013 |
| 22,495 | EP Energy Corp. | 168,713 |
| 10,323 | Frontier Communications Parent, Inc. | 267,675 |
| 5,575 | Gulfport Energy Corp. | 539,381 |
| 7,364 | iHeartMedia, Inc. Class A | 86,895 |
| 23,784 | International Oncology Care | 239,981 |
| 352 | Neiman Marcus Group, Inc. | 65,120 |
| 1,946 | NMG Parent LLC | 330,820 |
| 4,425 | Oasis Petroleum, Inc. | 702,380 |
| 34,385 | VICI Properties, Inc. | 1,060,777 |
| | TOTAL UNITED STATES (Cost \$4,060,771) | 3,747,118 |
| | TOTAL COMMON STOCKS (Cost \$6,109,954) | 4,478,126 |
| | PREFERRED STOCKS (0.5%) | |
| | UNITED STATES (0.5%) | |
| 28 | Gulfport Energy Corp. | 189,924 |
| 361,731 | MYT Holding LLC | 396,095 |
| | TOTAL UNITED STATES | 586,019 |
| | TOTAL PREFERRED STOCKS (Cost \$932,990) | 586,019 |
| | WARRANT (0.2%) | |
| | UNITED STATES (0.2%) | |
| USD 4,922 | NMG Parent LLC due 9/25/27 | 270,710 |
| | TOTAL UNITED STATES | 270,710 |
| | TOTAL WARRANT (Cost \$0) | 270,710 |
| | RIGHTS (0.0%)^(a) | |
| | LUXEMBOURG (0.0%)^(a) | |
| USD 2,628 | Intelsat Jackson Holdings S.A. Class Ser. A | — ^(a) |
| USD 2,628 | Intelsat Jackson Holdings S.A. Class Ser. B | — ^(a) |
| | TOTAL LUXEMBOURG | —^(a) |
| | TOTAL RIGHTS | —^(a) |
| 元本金額 | 銘柄名 | 純資産比率 公正価値 |
| | SHORT-TERM INVESTMENT (12.0%) | |
| | UNITED STATES (12.0%) | |
| | TIME DEPOSIT (12.0%) | |
| USD 15,680,111 | JPMorgan Chase & Co. 0.40% due 06/01/22 | \$ 15,680,111 |
| | TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$15,680,111) | 15,680,111 |
| | TOTAL UNITED STATES (Cost \$15,680,111) | 15,680,111 |
| | TOTAL SHORT-TERM INVESTMENT (Cost \$15,680,111) | |
| | TOTAL INVESTMENTS (Cost \$142,215,358) | 100.3% \$ 130,867,985 |
| | LIABILITIES IN EXCESS OF CASH AND OTHER ASSETS | (0.3) (338,274) |
| | NET ASSETS | 100.0% \$ 130,529,711 |

(2022年5月31日現在)

- (a) Callable security.
 (b) 144A Security - Security exempt from registration under Rule 144A of the Securities Act of 1933. These securities may be resold in transactions exempt from registration, typically to qualified institutional buyers. Unless otherwise indicated, these securities are not considered illiquid.
 (c) Defaulted security.
 (d) Investment is perpetual and, thus, does not have a predetermined maturity date. The date shown reflects the next call date.
 (e) PIK - Payment-in kind security. Income may be paid in cash or additional notes, at the discretion of the issuer.
 (f) Variable or floating rate security as of May 31, 2022.
 † A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than 0.05%.
 ± A zero balance may reflect amounts rounding to less than one.
 * Represents shares in case of convertible preferred stocks.

USHYF AUDクラスにおける為替予約取引

| 取得 | 取引相手 | 契約額 | 決済日 | 売却 | 契約額 | 未実現 評価益 | 未実現 評価損 | 未実現 評価損益 (純額) |
|-----|---------------|------------|------------|-----|------------|------------|--------------|---------------------|
| AUD | Citibank N.A. | 20,604,100 | 06/02/2022 | USD | 15,313,215 | \$ - | \$ (526,683) | \$ (526,683) |
| AUD | Citibank N.A. | 1,078,308 | 06/02/2022 | USD | 761,294 | 12,554 | - | 12,554 |
| AUD | Citibank N.A. | 19,534,815 | 07/05/2022 | USD | 13,773,733 | 253,197 | - | 253,197 |
| AUD | Citibank N.A. | 425,680 | 07/05/2022 | USD | 304,626 | 1,032 | - | 1,032 |
| USD | Citibank N.A. | 682,760 | 06/02/2022 | AUD | 915,999 | 25,393 | - | 25,393 |
| USD | Citibank N.A. | 398,388 | 06/02/2022 | AUD | 570,275 | - | (10,870) | (10,870) |
| USD | Citibank N.A. | 458,334 | 06/02/2022 | AUD | 649,150 | - | (7,529) | (7,529) |
| USD | Citibank N.A. | 13,773,733 | 06/02/2022 | AUD | 19,546,984 | - | (254,159) | (254,159) |
| USD | Citibank N.A. | 675,165 | 07/05/2022 | AUD | 954,503 | - | (10,214) | (10,214) |
| | | | | | | \$ 292,176 | \$ (809,455) | \$ (517,279) |

USHYF BRLクラスにおける為替予約取引

| 取得 | 取引相手 | 契約額 | 決済日 | 売却 | 契約額 | 未実現 評価益 | 未実現 評価損 | 未実現 評価損益 (純額) |
|-----|---------------|------------|------------|-----|------------|------------|--------------|---------------------|
| BRL | Citibank N.A. | 91,218,623 | 06/02/2022 | USD | 19,333,772 | \$ - | \$ (140,156) | \$ (140,156) |
| BRL | Citibank N.A. | 85,033,948 | 07/05/2022 | USD | 17,369,205 | 350,022 | - | 350,022 |
| USD | Citibank N.A. | 529,706 | 06/02/2022 | BRL | 2,512,820 | 975 | - | 975 |
| USD | Citibank N.A. | 710,252 | 06/02/2022 | BRL | 3,671,856 | - | (62,356) | (62,356) |
| USD | Citibank N.A. | 17,521,469 | 06/02/2022 | BRL | 85,033,948 | - | (370,809) | (370,809) |
| | | | | | | \$ 350,997 | \$ (573,321) | \$ (222,324) |

USHYF JPYクラスにおける為替予約取引

| 取得 | 取引相手 | 契約額 | 決済日 | 売却 | 契約額 | 未実現 評価益 | 未実現 評価損 | 未実現 評価損益 (純額) |
|-----|---------------|---------------|------------|-----|---------------|------------|--------------|---------------------|
| JPY | Citibank N.A. | 1,101,363,380 | 06/02/2022 | USD | 8,620,493 | \$ - | \$ (65,217) | \$ (65,217) |
| JPY | Citibank N.A. | 1,024,206,984 | 07/05/2022 | USD | 8,084,550 | - | (117,352) | (117,352) |
| JPY | Citibank N.A. | 27,385,798 | 07/05/2022 | USD | 213,256 | - | (225) | (225) |
| USD | Citibank N.A. | 306,925 | 06/02/2022 | JPY | 39,205,820 | 2,378 | - | 2,378 |
| USD | Citibank N.A. | 229,018 | 06/02/2022 | JPY | 29,899,892 | - | (3,241) | (3,241) |
| USD | Citibank N.A. | 8,084,550 | 06/02/2022 | JPY | 1,025,692,739 | 117,076 | - | 117,076 |
| USD | Citibank N.A. | 51,630 | 06/02/2022 | JPY | 6,564,929 | 634 | - | 634 |
| | | | | | | \$ 120,088 | \$ (186,035) | \$ (65,947) |

USHYF TRYクラスにおける為替予約取引

| 取得 | 取引相手 | 契約額 | 決済日 | 売却 | 契約額 | 未実現 評価益 | 未実現 評価損 | 未実現 評価損益 (純額) |
|-----|---------------|-------------|------------|-----|-------------|------------|----------------|---------------------|
| TRY | Citibank N.A. | 250,868,449 | 06/02/2022 | USD | 16,641,733 | \$ - | \$ (1,347,907) | \$ (1,347,907) |
| TRY | Citibank N.A. | 5,366,867 | 06/02/2022 | USD | 334,086 | - | (6,903) | (6,903) |
| TRY | Citibank N.A. | 21,316,309 | 06/02/2022 | USD | 1,299,382 | 135 | - | 135 |
| TRY | Citibank N.A. | 273,227,073 | 07/05/2022 | USD | 16,084,224 | - | (127,306) | (127,306) |
| TRY | Citibank N.A. | 5,451,604 | 07/05/2022 | USD | 323,372 | - | (4,990) | (4,990) |
| USD | Citibank N.A. | 16,084,224 | 06/02/2022 | TRY | 263,736,080 | 5,942 | - | 5,942 |
| USD | Citibank N.A. | 891,595 | 06/02/2022 | TRY | 13,815,545 | 49,351 | - | 49,351 |
| USD | Citibank N.A. | 1,598,631 | 07/05/2022 | TRY | 27,544,816 | - | (10,032) | (10,032) |
| | | | | | | \$ 55,428 | \$ (1,497,138) | \$ (1,441,710) |

(2022年5月31日現在)

デリバティブ取引の額

| 取引相手 | デリバティブ 資産の額 | デリバティブ 負債の額 | 受取担保金* | 差入 担保金* | 純額** |
|---------------------------------|----------------|----------------|--------|------------|----------------|
| 店頭デリバティブ 為替予約取引 | | | | | |
| Citibank N.A. | \$ 818,689 | \$ (3,065,949) | \$ - | \$ 450,000 | \$ (1,797,260) |
| マスターネットティング契約の対象と なるデリバティブ合計 | \$ 818,689 | \$ (3,065,949) | \$ - | \$ 450,000 | \$ (1,797,260) |
| 資産及び負債における 店頭デリバティブ合計 | \$ 818,689 | \$ (3,065,949) | | | |

* Actual collateral received or pledged, if any, may be more than disclosed in the table above.

** Net represents the receivable/(payable) that would be due from/(to) the counterparty in an event of default. Netting is allowed across transactions traded under the same legal agreement with the same legal entity.

通貨略称

| | | |
|-----|---|----------------------|
| AUD | - | Australian Dollar |
| BRL | - | Brazilian Real |
| JPY | - | Japanese Yen |
| TRY | - | Turkish Lira |
| USD | - | United States Dollar |

マネー・プール マザーファンド

《第28期》決算日2023年7月14日

[計算期間：2023年1月17日～2023年7月14日]

「マネー・プール マザーファンド」は、7月14日に第28期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第28期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|------------------------------------|
| 運用方針 | わが国の公社債に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。 |
| 主要運用対象 | わが国の公社債 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資は行いません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券率 | 債先物比率 | 純総資産額 |
|-----------------|--------|-----|------|-------|-----|-------|-------|
| | | 期騰 | 落中率 | | | | |
| | 円 | | % | % | % | 百万円 | |
| 24期(2021年7月14日) | 10,040 | | △0.0 | — | — | 141 | |
| 25期(2022年1月14日) | 10,040 | | 0.0 | — | — | 52 | |
| 26期(2022年7月14日) | 10,039 | | △0.0 | — | — | 48 | |
| 27期(2023年1月16日) | 10,036 | | △0.0 | — | — | 47 | |
| 28期(2023年7月14日) | 10,035 | | △0.0 | — | — | 141 | |

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券率 | 債先物比率 | 債券率 |
|------------|--------|-----|------|-------|-----|-------|-----|
| | | 騰 | 落率 | | | | |
| (期首) | 円 | | % | % | % | % | |
| 2023年1月16日 | 10,036 | | — | — | — | — | |
| 1月末 | 10,036 | | 0.0 | — | — | — | |
| 2月末 | 10,036 | | 0.0 | — | — | — | |
| 3月末 | 10,036 | | 0.0 | — | — | — | |
| 4月末 | 10,036 | | 0.0 | — | — | — | |
| 5月末 | 10,035 | | △0.0 | — | — | — | |
| 6月末 | 10,035 | | △0.0 | — | — | — | |
| (期末) | | | | | | | |
| 2023年7月14日 | 10,035 | | △0.0 | — | — | — | |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

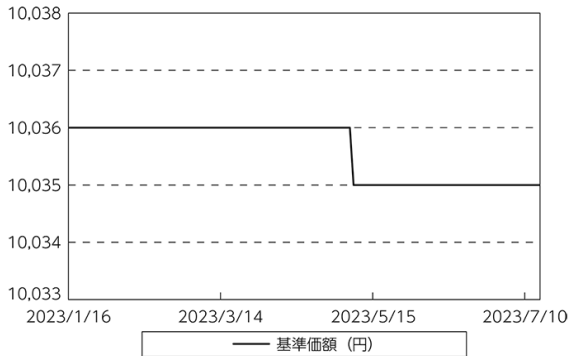
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.01%の下落となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の変動要因

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.021%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

○今後の運用方針

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2023年1月17日～2023年7月14日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2023年1月17日～2023年7月14日)

その他有価証券

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------------|-----------------|-----------------|
| 国内 | コマーシャル・ペーパー | 千円 3,299,998 | 千円 3,199,998 |

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月17日～2023年7月14日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2023年7月14日現在)

国内その他有価証券

| 区分 | 当期末 | |
|-------------|--------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 99,999 | % 70.5 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2023年7月14日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|--------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| その他有価証券 | 千円 99,999 | % 70.5 |
| コール・ローン等、その他 | 41,871 | 29.5 |
| 投資信託財産総額 | 141,870 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月14日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 141,870,583 |
| コール・ローン等 | 41,870,607 |
| 其他有価証券(評価額) | 99,999,976 |
| (B) 負債 | 73 |
| 未払解約金 | 46 |
| 未払利息 | 27 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 141,870,510 |
| 元本 | 141,379,662 |
| 次期繰越損益金 | 490,848 |
| (D) 受益権総口数 | 141,379,662口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,035円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 46,862,606円
 期中追加設定元本額 102,139,688円
 期中一部解約元本額 7,622,632円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0035円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

| | |
|--|--------------|
| マネー・プール・ファンドVI | 126,218,465円 |
| 世界投資適格債オープン(為替ヘッジあり)(毎月決算型) | 5,154,901円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) マネー・プール・ファンドX(年2回決算型) | 2,250,924円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) マネー・プール・ファンドIX(1年決算型) | 1,898,016円 |
| トレンド・アロケーション・オープン | 997,308円 |
| 米国エネルギーMLPオープン(毎月決算型) 為替ヘッジあり | 996,215円 |
| 米国エネルギーMLPオープン(毎月決算型) 為替ヘッジなし | 996,215円 |
| 米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月決算型) | 769,078円 |
| 米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(毎月決算型) | 220,146円 |
| 米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 円コース(毎月決算型) | 125,062円 |
| 米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 米ドルコース(毎月決算型) | 119,857円 |
| 国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) インド・ルピーコース(毎月決算型) | 99,602円 |
| 国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) 為替ヘッジなしコース(毎月決算型) | 99,602円 |
| 国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) インドネシア・ルピアコース(毎月決算型) | 99,602円 |
| 国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) 円コース(毎月決算型) | 99,602円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(1年決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(1年決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) メキシコ・ペソコース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 円コース(1年決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 米ドルコース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 米ドルコース(1年決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) インドネシア・ルピアコース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) メキシコ・ペソコース(1年決算型) | 99,592円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) 円コース(毎月決算型) | 99,592円 |
| 米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) トルコ・リラコース(毎月決算型) | 19,961円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) インドネシア・ルピアコース(1年決算型) | 9,986円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) ロシア・ルーブルコース(毎月決算型) | 9,986円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン(通貨選択型) ロシア・ルーブルコース(1年決算型) | 9,986円 |

○損益の状況 (2023年1月17日~2023年7月14日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|----------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 10,111 |
| 受取利息 | 265 |
| 支払利息 | △ 10,376 |
| (B) 当期損益金(A) | △ 10,111 |
| (C) 前期繰越損益金 | 169,816 |
| (D) 追加信託差損益金 | 357,984 |
| (E) 解約差損益金 | △ 26,841 |
| (F) 計(B+C+D+E) | 490,848 |
| 次期繰越損益金(F) | 490,848 |

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

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

| | |
|--|--------------|
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 中国元コース (毎月決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 南アフリカ・ランドコース (1年決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 中国元コース (1年決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) トルコ・リラコース (毎月決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) トルコ・リラコース (1年決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 南アフリカ・ランドコース (毎月決算型) | 9,960円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ユーロコース (1年決算型) | 9,959円 |
| 国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ユーロコース (毎月決算型) | 9,959円 |
| 欧州アクティブ株式オープン (為替ヘッジなし) | 4,979円 |
| 欧州アクティブ株式オープン (為替ヘッジあり) | 4,979円 |
| 合計 | 141,379,662円 |

[お 知 ら せ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。