

野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース（為替ヘッジなし 年2回決算型）

野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース

運用報告書(全体版)

第15期（決算日2023年10月16日）

作成対象期間（2023年4月18日～2023年10月16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。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2016年4月22日から2026年4月16日までです。	
運用方針	円建ての外国投資信託であるPIMCOパミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCOパミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。	
主な投資対象	野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース	PIMCOパミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）受益証券および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	PIMCOパミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）	PIMCOパミューダ・インカム・ファンド（M）受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を実質的な主要投資対象とします。
主な投資制限	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	株式への投資は行ないません。
	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等および基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 配	達 配 金 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
11期(2021年10月18日)	12,857	10	6.3	0.0	—	98.4	31,997
12期(2022年4月18日)	13,182	10	2.6	0.0	—	99.1	35,400
13期(2022年10月17日)	14,394	10	9.3	0.0	—	98.7	44,796
14期(2023年4月17日)	13,726	10	△ 4.6	0.0	—	98.8	57,474
15期(2023年10月16日)	15,301	10	11.5	0.0	—	98.6	73,169

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*当ファンドはマザーファンド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。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2023年4月17日	円	円	%	%	%	%
	13,726	—	—	0.0	—	98.8
4月末	13,769	0.3	—	0.0	—	98.8
5月末	14,266	3.9	—	0.0	—	99.1
6月末	14,944	8.9	—	0.0	—	99.1
7月末	14,712	7.2	—	0.0	—	99.3
8月末	15,209	10.8	—	0.0	—	99.6
9月末	15,356	11.9	—	0.0	—	98.8
(期末) 2023年10月16日	15,311	11.5	—	0.0	—	98.6

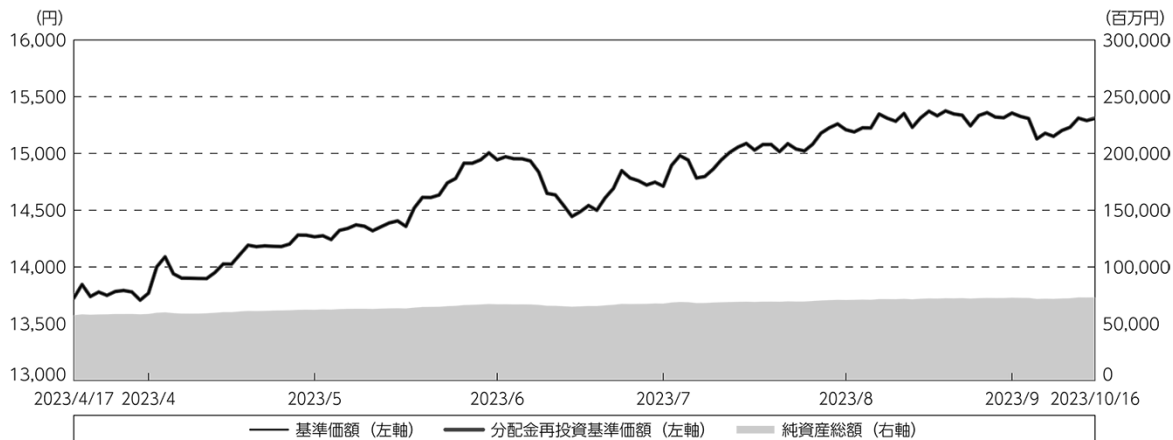
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンド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。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：13,726円

期末：15,301円 (既払分配金(税込み)：10円)

騰落率：11.5% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2023年4月17日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

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

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

実質的に投資している債券等および派生商品等からのインカムゲイン(利息収入)

実質的に投資している債券等および派生商品等からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)

円/米ドルの為替変動

○投資環境

米国債は、当作成期間では利回りは上昇（価格は下落）となりました。当作成期首から2023年6月頃にかけて、堅調な米景気を示す経済指標を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めが継続するとの見方が市場で広がり米国債の利回りが上昇しました。その後も、7月の米PPI（生産者物価指数）の上昇率が市場予想を上回りインフレ圧力の根強さが意識されたことや、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において2024年の政策金利見通しが引き上げられ、FRBの金融引き締めが長期化するとの観測が広がったことで、利回りは上昇基調で推移し、当作成期間で利回りは上昇となりました。

新興国債券は、当作成期間では下落しました（米ドルベース）。2023年6月頃には、同月のFOMCでの利上げ見送り観測が強まる中で米国株式市場が上昇するなど、良好なセンチメント（市場心理）を背景に上昇しました。その後は、8月に中国の大手不動産企業の発行するドル建て社債で利払い不履行が発生したことや、中国の主要な経済指標の悪化を受けて中国景気に対する懸念が高まったこと、9月のFOMCで政策金利の据え置きが決定されたものの高金利政策の長期化が示唆され、米景気への悪影響に対する懸念が高まるなどして米国株式市場が下落する中、新興国債券市場も下落し、当作成期間では下落となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース】

【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）】 受益証券および【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）】 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN（USD）】

PIMCO バミューダ・インカム・ファンド（M）を通じて世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を主要投資対象とし、インカムゲインの最大化と長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行ないました。

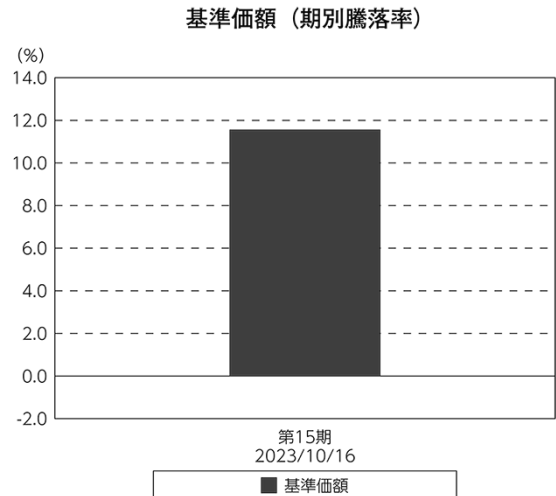
【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第15期
	2023年4月18日～ 2023年10月16日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.065%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,840

(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

【野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース】

【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN (USD)】 受益証券および【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN (USD)】 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

【PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN (USD)】

世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を主要投資対象とし、インカムゲインの最大化と長期的な値上がり益の獲得を図ることを目的としたポートフォリオを維持して運用を行ないます。

国ごとの経済状況およびそれに伴う金融政策の方向性を踏まえ、次のような戦略を実行しています。

金利戦略については、保有するリスク性資産の価格変動の影響を和らげる適切な金利リスク量を見極め、市場環境に応じて機動的に調整しています。2023年9月はFRBによる金融引き締め長期化観測に伴う米国の金利上昇にあわせて、米国の金利リスクを積み増しました。一方、今後の金融緩和政策修正の可能性などから日本の金利リスクは引き続きショート（売り持ち）としています。そのほか、金利上昇に対する耐性を確保するために、非政府系住宅ローン担保証券などの変動利付債をポートフォリオに組み入れています。

セクター戦略については、リスクオフ時に底堅い値動きが期待できる米政府関連債や米政府系住宅ローン担保証券について、資産間の相対的な魅力度等を加味しながら全体で高位の組み入れを維持しています。一方、ハイイールド社債やバンクローンについては組み入れを抑制しつつも厳選した銘柄に投資しています。また、長年にわたる住宅価格の上昇から恩恵を受ける非政府系住宅ローン担保証券への投資を継続しています。利回りが相対的に高い新興国債券については、メキシコや南アフリカ等への投資を継続しています。

【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日銀によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年4月18日～2023年10月16日)

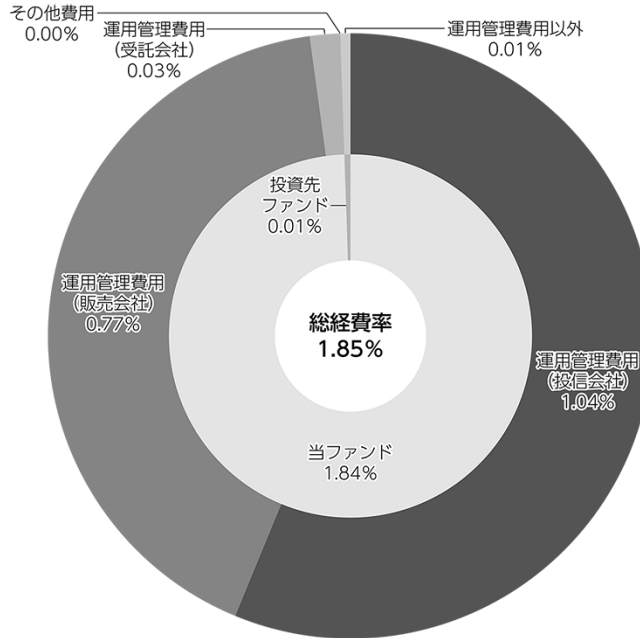
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	135	0.919	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(76)	(0.520)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(56)	(0.383)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	135	0.920	
期中の平均基準価額は、14,709円です。			

- * 期中の費用（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。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 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。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.85%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.85
①当ファンドの費用の比率	1.84
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01

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

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

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

(注) 当ファンドの費用は、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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

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

(注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社所知りうる情報をもとに作成しています。

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

○売買及び取引の状況

(2023年4月18日～2023年10月16日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN (USD)	1,312,877	11,642,831	188,509	1,692,465

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年4月18日～2023年10月16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10月16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		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
	PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN (USD)	6,760,190	7,884,558	72,159,474	98.6
	合 計	6,760,190	7,884,558	72,159,474	98.6

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘柄		期首(前期末)	当期末	
		口数	口数	評価額
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	0	0	0.997

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、口数・評価額が単位未満の場合は小数で記載。

○投資信託財産の構成

(2023年10月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 72,159,474	% 97.0
野村マネーポートフォリオ マザーファンド	0.997	0.0
コール・ローン等、その他	2,224,557	3.0
投資信託財産総額	74,384,031	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月16日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	74,384,031,997
コール・ローン等	2,214,177,816
投資信託受益証券(評価額)	72,159,474,816
野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額)	997
未収入金	10,378,368
(B) 負債	1,214,393,931
未払金	377,043,018
未払収益分配金	47,820,200
未払解約金	177,067,671
未払信託報酬	611,732,398
未払利息	2,453
その他未払費用	728,191
(C) 純資産総額(A-B)	73,169,638,066
元本	47,820,200,272
次期繰越損益金	25,349,437,794
(D) 受益権総口数	47,820,200,272口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,301円

(注) 期首元本額は41,871,520,472円、期中追加設定元本額は10,802,327,617円、期中一部解約元本額は4,853,647,817円、1口当たり純資産額は1.5301円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額197,000,935円。

○損益の状況 (2023年4月18日～2023年10月16日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,136,430,856
受取配当金	2,136,736,520
支払利息	△ 305,664
(B) 有価証券売買損益	5,084,271,420
売買益	5,448,442,146
売買損	△ 364,170,726
(C) 信託報酬等	△ 612,460,589
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,608,241,687
(E) 前期繰越損益金	4,116,227,831
(F) 追加信託差損益金	14,672,788,476
(配当等相当額)	(22,037,221,327)
(売買損益相当額)	(△ 7,364,432,851)
(G) 計(D+E+F)	25,397,257,994
(H) 収益分配金	△ 47,820,200
次期繰越損益金(G+H)	25,349,437,794
追加信託差損益金	14,672,788,476
(配当等相当額)	(22,037,221,327)
(売買損益相当額)	(△ 7,364,432,851)
分配準備積立金	10,676,649,318

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2023年4月18日～2023年10月16日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年4月18日～ 2023年10月16日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,955,203,768円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,646,813,371円
c. 信託約款に定める収益調整金	22,037,221,327円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,122,452,379円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	32,761,690,845円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,850円
g. 分配金	47,820,200円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	10円
----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN(JPY)/N(USD)

2022年10月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	英領バミューダ諸島籍円建て外国投資信託
運 用 方 針	PIMCO バミューダ・インカム・ファンド(M) 受益証券への投資を通じて、世界各国(新興国を含みます。)の債券等(国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権(バンクローン)等)および派生商品等に実質的に投資を行ない、インカムゲインの最大化と長期的な値上がり益の獲得を目指します。
投 資 対 象	世界各国(新興国を含みます。)の債券等(国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権(バンクローン)等)および派生商品等
管 理 会 社 投 資 顧 問 会 社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 会 社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ(バミューダ)リミテッド
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 受 託 銀 行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名 義 書 換 事 務 受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ) エス・シー・エー

* 作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA

運用計算書

2022年10月31日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:	
受取利息(外国税額控除後)	\$ 3,963
受取配当(外国税額控除後)	0
雑収入	0
収益合計	3,963
費用:	
投資顧問報酬	0
投資顧問報酬 - W (USD)	188
運用報酬 - M (JPY 投資顧問)	547
運用報酬 - M (USD 投資顧問)	332
運用報酬 - P (JPY)	241
運用報酬 - R (USD)	93 ⁽¹⁾
運用報酬 - T (JPY)	5,769
運用報酬 - U (USD)	83 ⁽²⁾
運用報酬 - U2 (JPY)	214 ⁽³⁾
運用報酬 - X (JPY)	30
管理報酬	0
管理報酬 - R (USD)	29 ⁽¹⁾
管理報酬 - W (USD)	58
分配支払手数料 - M (JPY 投資顧問)	474
分配支払手数料 - M (USD 投資顧問)	288
分配支払手数料 - P (JPY)	241
代理店報酬 - M (JPY 投資顧問)	37
代理店報酬 - M (USD 投資顧問)	22
支払利息	133
雑費用	12
費用合計	8,791
純投資損益	(4,828)
当期実現損益:	
投資有価証券	0
関連投資	440,185
上場金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	(2,074,947)
外貨通貨	(2,481)
当期実現損益	(1,637,243)

当期末実現評価損益:

投資有価証券	(1)
関連投資	(1,752,599)
上場金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	(4,806)
外貨建資産および負債	(100)
当期末実現評価損益	(1,757,506)
当期実現および未実現評価損益	(3,394,749)

運用の結果による純資産の増減額	\$ (3,399,577)
外国税	\$ 0

※金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

⁽¹⁾ 2022年1月21日(設定日)から2022年10月31日までの期間

⁽²⁾ 2021年11月1日から2022年2月10日(終了日)までの期間

⁽³⁾ 2022年2月3日(設定日)から2022年10月31日までの期間

(単位:千 1口単位を除く)

期末純資産総額

N(JPY)	\$ 3,982,904
N(USD)	2,040,050

期末現在発行済受益証券数

N(JPY)	81,285
N(USD)	33,012

期末1口当たり純資産価格

N(JPY)	\$ 49.00
N(USD)	61.80

※PIMCO バミューダ・インカム・ファンド(M)の期末純資産額は9,594,439千米ドル。

組入資産の明細

(金額の単位は千*、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

	2022年10月31日	
	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 4.7%		
短期金融商品 4.7%		
定期預金 4.7%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	\$ 72,714	\$ 72,714
Bank of Nova Scotia		
2.580% due 11/01/2022	5,987	5,987
Brown Brothers Harriman & Co.		
2.580% due 11/01/2022	39	39
Citibank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	60,870	60,870
DBS Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	37,928	37,928
JPMorgan Chase Bank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	81,160	81,160
Royal Bank of Canada		
2.580% due 11/01/2022	80,362	80,362
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
2.580% due 11/01/2022	61,645	61,645
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	62,794	62,794
		463,499
米財務省証券 0.0%		
2.552% due 11/10/2022 (a)	2,825	2,823
米国財務省キャッシュ・マネジメント・ビル 0.0%		
3.278% due 01/10/2023 (a)	1,720	1,707
短期金融商品合計		468,029
(取得原価 \$468,031)		
投資有価証券合計		468,029
(取得原価 \$468,031)		

口数
(単位:千)

評価額
(単位:千)

関連投資 95.8%		
その他の投資会社 95.8%		
PIMCO パミューダ・インカム・ファンド(M)		
(取得原価 \$9,636,026)	682,263	9,497,093
関連投資合計		9,497,093
(取得原価 \$9,636,026)		
投資合計 100.5%		\$ 9,965,122
(取得原価 \$10,104,057)		
金融デリバティブ商品 (2.0%)		(197,302)
(取得原価またはプレミアム \$0)		
その他の資産および負債 1.5%		148,384
純資産 100.0%		\$ 9,916,204

投資有価証券明細表に対する注記(金額単位:千米ドル)

(a) クーポンは最終利回りである。

◎店頭金融デリバティブ商品

2022年10月31日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益	
				資産	負債
BPS	11/2022	JPY 106,684	\$ 728	\$ 10	\$ 0
BPS	11/2022	899,743	6,163	109	0
BPS	11/2022	\$ 1,379	JPY 201,334	0	(25)
BPS	11/2022	0	0	0	0
BPS	11/2022	933	136,228	0	(16)
MBC	11/2022	JPY 844,346	\$ 5,725	44	0
MBC	11/2022	38,092	258	2	0
MYI	11/2022	1,072,662	7,218	0	0
MYI	11/2022	\$ 253	JPY 37,641	0	0
				\$ 165	\$ (41)

- F (JPY)クラス、J (JPY)クラス、M (JPY 投資顧問)、N (JPY)クラス、P (JPY)クラス、Q (JPY)クラス、R (JPY)クラス、S (JPY)クラス、T (JPY)クラス、U2 (JPY)クラス、X (JPY)クラス、Y (JPY)クラス、Z (JPY)クラス外国為替先渡し契約

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益			
						資産	負債		
BOA	11/2022	JPY	874,671	\$	5,984	\$	99	\$	-
BOA	11/2022	\$	2,687	JPY	399,465		1		0
CBK	11/2022	JPY	10,974,574	\$	75,552		1,716		0
CBK	11/2022	\$	11,727	JPY	1,750,671		52		0
JPM	11/2022	JPY	210,644,904	\$	1,435,595		18,400		0
JPM	12/2022	\$	1,435,595	JPY	209,941,463		0		(18,442)
MBC	11/2022	JPY	253,278,894	\$	1,723,284		19,251		0
MBC	11/2022	\$	2,456,288	JPY	354,314,651		0		(72,498)
MBC	12/2022		1,439,739		211,607,321		0		(11,341)
MYI	11/2022	JPY	93,706	\$	630		0		0
MYI	11/2022	\$	1,013,884	JPY	146,309,231		0		(29,532)
RBC	11/2022		398,620		57,546,962		0		(11,450)
RBC	12/2022	JPY	334,137	\$	2,275		20		0
SCX	11/2022		65,277,116		438,841		0		0
SCX	12/2022	\$	438,481	JPY	65,010,795		0		0
SOG	11/2022	JPY	221,942,790	\$	1,496,893		3,686		0
SOG	12/2022	\$	1,496,893	JPY	221,204,896		0		(3,709)
SSB	11/2022	JPY	57,631,197	\$	387,413		0		(323)
SSB	12/2022	\$	387,413	JPY	57,440,745		325		0
TOR	11/2022	JPY	134,818,267	\$	912,952		5,909		0
TOR	12/2022	\$	912,952	JPY	134,369,643		0		(5,926)
UAG	11/2022		2,901,337		417,318,500		0		(93,664)
						\$	49,459	\$	(246,885)
外国為替先渡し契約合計						\$	49,624	\$	(246,926)

PIMCO バミューダ・インカム・ファンド(M)

組入資産の明細

(金額の単位は千*、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

			2022年10月31日	
	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 127.5%				
バンクローン 6.0%				
AAdvantage Loyalty IP Ltd.				
8.993% due 04/20/2028	\$ 10,503	\$ 10,419		
Air Canada				
6.421% due 08/11/2028	1,435	1,404		
AmSurg LLC				
1.000% due 04/29/2027 (b)	2,415	2,376		
12.119% due 04/29/2027	13,285	13,069		
15.744% due 04/28/2028	34,672	31,378		
Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC				
4.989% due 02/12/2027	6,984	6,827		
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV				
5.424% due 06/01/2024	391	387		
Azalea TopCo, Inc.				
7.254% due 07/24/2026	827	774		
Caesars Resort Collection LLC				
6.504% due 12/23/2024	13,214	13,089		
7.254% due 07/21/2025	4,578	4,544		
Carnival Corp.				
3.975% due 06/30/2025	EUR 11,380	10,746		
5.877% due 06/30/2025	\$ 24,287	22,861		
6.127% due 10/18/2028	7,949	7,311		
Cengage Learning, Inc.				
7.814% due 07/14/2026	18,276	16,228		
Charter Communications Operating LLC				
5.510% due 02/01/2027	5,387	5,302		
Coherent Corp.				
5.878% due 07/02/2029	4,777	4,663		
Commscope, Inc.				
7.004% due 04/06/2026	3,880	3,710		
DIRECTV Financing LLC				
8.754% due 08/02/2027	7,881	7,530		
Hilton Worldwide Finance LLC				
5.336% due 06/22/2026	9,745	9,588		
iHeartCommunications, Inc.				
6.754% due 05/01/2026	132,910	125,863		
Instant Brands Holdings, Inc.				
7.076% due 04/12/2028	2,663	1,819		
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7.445% due 02/01/2029	18,343	17,724		
Iqvia, Inc.				
3.193% due 03/07/2024	EUR 3,900	3,821		
Lealand Finance Co. BV				
3.000-4.754% due 06/30/2025	\$ 594	318		
6.754% due 06/28/2024			261	170
LifePoint Health, Inc.				
8.165% due 11/16/2025			1,038	922
Lumen Technologies, Inc.				
6.004% due 03/15/2027			1,158	1,081
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
5.504% due 08/29/2025			456	442
PetSmart LLC				
7.500% due 02/11/2028			2,666	2,572
Poseidon Bidco				
6.443% due 07/14/2028	EUR 39,600			37,182
Pug LLC				
7.254% due 02/12/2027	\$ 788			680
Redstone HoldCo 2 LP				
9.108% due 04/27/2028			3,000	2,170
Sequa Mezzanine Holdings LLC				
9.760% due 11/28/2023			4,900	4,900
Serta Simmons Bedding LLC				
7.743-7.827% due 11/08/2023			188	20
Sigma Holdco BV				
3.738% due 07/02/2025	EUR 3,670			3,053
SkyMiles IP Ltd.				
7.993% due 10/20/2027	\$ 15,150			15,311
Softbank vision Fund II				
5.000% due 12/21/2025			42,246	40,493
Sotera Health Holdings LLC				
7.165% due 12/11/2026			3,362	3,068
SS&C Technologies Holdings, Inc.				
5.504% due 04/16/2025			3,247	3,187
Sunshine Luxembourg VII Sarl				
7.424% due 10/01/2026			4,021	3,836
Syniverse Holdings LLC				
10.553% due 05/13/2027			23,288	20,039
TransDigm, Inc.				
5.924% due 08/22/2024			792	781
5.924% due 05/30/2025			2,271	2,223
5.924% due 12/09/2025			26,146	25,576
U.S. Renal Care, Inc.				
8.813-9.313% due 06/26/2026			3,750	2,349
Uber Technologies, Inc.				
6.570% due 04/04/2025			5,546	5,507
6.570% due 02/25/2027			9,843	9,806
United Airlines, Inc.				
8.108% due 04/21/2028			6,802	6,658

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)	
Deutsche Bank AG						
1.375% due 02/17/2032	8,500	5,854		7,200	6,696	
1.750% due 11/19/2030	6,200	4,620		7,875% due 06/27/2029	GBP 4,000	4,141
3.035% due 05/28/2032	\$ 700	493		MPT Operating Partnership LP		
3.547% due 09/18/2031	7,400	5,515		3.692% due 06/05/2028	2,400	1,939
3.961% due 11/26/2025	3,756	3,469		Nationwide Building Society		
EPR Properties				3.960% due 07/18/2030	\$ 5,600	4,701
4.750% due 12/15/2026	256	221		4.302% due 03/08/2029	12,500	10,899
4.950% due 04/15/2028	1,132	930		NatWest Group PLC		
Fairfax Financial Holdings Ltd.				4.445% due 05/08/2030	17,600	15,041
4.625% due 04/29/2030	1,142	1,007		4.600% due 06/28/2031 (d)(e)	6,200	4,019
4.850% due 04/17/2028	1,370	1,262		5.076% due 01/27/2030	16,500	14,713
First-Citizens Bank & Trust Co.				6.000% due 12/29/2025 (d)(e)	14,000	12,494
2.969% due 09/27/2025	2,800	2,639		8.000% due 08/10/2025 (d)(e)	12,660	11,962
G City Europe Ltd.				New Metro Global Ltd.		
4.250% due 09/11/2025	EUR 400	335		4.500% due 05/02/2026	1,000	141
Gaci First Investment Co.				4.625% due 10/15/2025	200	31
5.250% due 10/13/2032	\$ 1,900	1,860		4.800% due 12/15/2024	1,400	369
5.375% due 10/13/2122	1,900	1,588		6.800% due 08/05/2023	600	281
GLP Capital LP				Omega Healthcare Investors, Inc.		
5.250% due 06/01/2025	650	628		3.625% due 10/01/2029	1,682	1,340
5.300% due 01/15/2029	3,142	2,837		OneMain Finance Corp.		
Goodman U.S. Finance Three LLC				5.625% due 03/15/2023	29,772	29,808
3.700% due 03/15/2028	2,324	2,073		6.125% due 03/15/2024	2,027	1,983
HSBC Holdings PLC				Park Aerospace Holdings Ltd.		
2.848% due 06/04/2031	3,300	2,454		4.500% due 03/15/2023	9,522	9,479
3.973% due 05/22/2030	14,100	11,636		5.500% due 02/15/2024	575	562
6.000% due 09/29/2023 (d)(e)	EUR 6,600	6,433		Preferred Term Securities XVIII Ltd.		
6.500% due 03/23/2028 (d)(e)	\$ 4,400	3,583		3.673% due 09/23/2035	79	79
Huarong Finance 2017 Co. Ltd.				Preferred Term Securities XXIV Ltd.		
4.750% due 04/27/2027	2,400	1,731		3.593% due 03/22/2037	770	709
4.950% due 11/07/2047	700	357		3.673% due 03/22/2037	4,830	4,160
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.				Preferred Term Securities XXV Ltd.		
3.375% due 02/24/2030	700	426		3.583% due 06/22/2037	21,092	19,194
3.625% due 09/30/2030	2,000	1,230		Preferred Term Securities XXVI Ltd.		
3.875% due 11/13/2029	1,125	691		3.593% due 09/22/2037	27,451	24,982
4.500% due 05/29/2029	3,300	2,199		Santander Holdings USA, Inc.		
Huarong Finance II Co. Ltd.				4.500% due 07/17/2025	2,124	2,032
4.625% due 06/03/2026	517	391		Santander UK Group Holdings PLC		
InCaps Funding I Ltd.				3.823% due 11/03/2028	3,400	2,889
5.082% due 06/01/2033	10,807	10,213		6.750% due 06/24/2024 (d)(e)	GBP 16,610	18,371
ING Groep NV				Seazen Group Ltd.		
5.750% due 11/16/2026 (d)(e)	6,200	5,302		6.000% due 08/12/2024	\$ 700	168
Intesa Sanpaolo SpA (d)(e)				Societe Generale S.A.		
5.500% due 03/01/2028	EUR 500	392		7.375% due 10/04/2023 (d)(e)	6,800	6,232
5.875% due 09/01/2031	500	382		Sunac China Holdings Ltd.		
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				7.000% due 07/09/2025 (c)	800	48
3.250% due 11/12/2025	1,400	1,034		Svenska Handelsbanken AB		
Lloyds Banking Group PLC (d)(e)				4.750% due 03/01/2031 (d)(e)	6,600	5,107
4.947% due 06/27/2025	2,011	1,850		Tesco Property Finance 2 PLC		
7.500% due 06/27/2024	\$ 2,700	2,581		6.052% due 10/13/2039	GBP 3,544	3,873

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Tesco Property Finance 6 PLC					
5.411% due 07/13/2044	2,496	2,530		1,183	809
TP ICAP Finance PLC				1,667	1,269
5.250% due 05/29/2026	2,900	2,995		8,092	6,068
U.S. Capital Funding VI Ltd.				5,310	4,573
4.189% due 07/10/2043	\$ 23,533	18,738		12,473	10,507
UniCredit Spa				20,074	16,585
7.830% due 12/04/2023	72,590	72,327	Caesars Entertainment, Inc.		
Unique Pub Finance Co. PLC			6.250% due 07/01/2025	3,190	3,117
7.395% due 03/28/2024	GBP 994	1,146	Carnival Corp.		
Uniti Group LP			4.000% due 08/01/2028	8,210	6,630
6.500% due 02/15/2029	\$ 2,280	1,641	Carvana Co.		
7.875% due 02/15/2025	19,582	19,415	5.500% due 04/15/2027	21,762	10,400
VICI Properties LP			10.250% due 05/01/2030	35,100	21,124
3.500% due 02/15/2025	4,784	4,454	Community Health Systems, Inc.		
3.750% due 02/15/2027	4,300	3,777	4.750% due 02/15/2031	22,100	14,837
4.125% due 08/15/2030	5,684	4,702	5.625% due 03/15/2027	37,147	29,677
4.250% due 12/01/2026	3,600	3,284	8.000% due 03/15/2026	11,418	9,870
4.625% due 12/01/2029	3,600	3,139	CoStar Group, Inc.		
Voyager Aviation Holdings LLC			2.800% due 07/15/2030	2,000	1,579
8.500% due 05/09/2026	4,421	3,686	CVS Pass-Through Trust		
		<u>705,488</u>	5.773% due 01/10/2033	139	133
			7.507% due 01/10/2032	560	578
			8.353% due 07/10/2031	560	597
			Delta Air Lines, Inc.		
			7.000% due 05/01/2025	1,290	1,308
			Energy Transfer LP		
			4.950% due 05/15/2028	424	393
			Exela Intermediate LLC		
			11.500% due 07/15/2026	639	176
			Expedia Group, Inc.		
			4.625% due 08/01/2027	1,500	1,405
			6.250% due 05/01/2025	2,247	2,244
			Ford Foundation		
			2.815% due 06/01/2070	2,070	1,132
			Ford Motor Credit Co. LLC		
			1.051% due 11/15/2023	EUR 200	194
			1.744% due 07/19/2024	10,300	9,664
			2.330% due 11/25/2025	2,450	2,212
			2.700% due 08/10/2026	\$ 1,200	1,041
			3.021% due 03/06/2024	EUR 9,400	9,093
			3.250% due 09/15/2025	26,548	24,699
			3.350% due 11/01/2022	\$ 12,100	12,100
			3.375% due 11/13/2025	5,500	5,000
			4.389% due 01/08/2026	1,864	1,724
			4.535% due 03/06/2025	GBP 18,765	20,001
			4.687% due 06/09/2025	\$ 1,700	1,614
			5.125% due 06/16/2025	2,700	2,609
			5.584% due 03/18/2024	1,639	1,617
			Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC		
			6.500% due 10/01/2025	5,475	5,266

工業 5.6%

AA Bond Co. Ltd.

5.500% due 07/31/2027 GBP 855 846

Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust

4.800% due 08/15/2027 \$ 3,605 3,377

Amdocs Ltd.

2.538% due 06/15/2030 5,300 4,161

American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust

3.700% due 10/01/2026 2,015 1,704

American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust

3.375% due 05/01/2027 1,497 1,241

American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust

3.350% due 10/15/2029 363 308

American Airlines, Inc.

5.500% due 04/20/2026 3,982 3,799

5.750% due 04/20/2029 1,883 1,717

Atlantia Spa

1.875% due 02/12/2028 EUR 10,200 8,013

Boeing Co.

5.150% due 05/01/2030 \$ 476 440

5.705% due 05/01/2040 15,535 13,506

5.805% due 05/01/2050 12,129 10,453

5.930% due 05/01/2060 18,015 15,271

British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust

3.300% due 12/15/2032 90 76

Broadcom, Inc.

2.450% due 02/15/2031 10,500 7,891

3.137% due 11/15/2035 8,450 5,874

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.750% due 08/15/2029	\$ 12,389	9,755	NPC Ukrenerg		
Altice France S.A.			6.875% due 11/09/2028 (h)	1,200	215
8.125% due 02/01/2027	2,744	2,516	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.		
Charter Communications Operating LLC			6.720% due 12/01/2022	20	20
3.900% due 06/01/2052	10,000	6,211	Pacific Gas & Electric Co.		
3.950% due 06/30/2062	3,500	2,055	2.100% due 08/01/2027	1,910	1,572
4.400% due 12/01/2061	9,500	6,041	2.500% due 02/01/2031	2,600	1,946
4.800% due 03/01/2050	3,818	2,709	2.950% due 03/01/2026	8,630	7,643
Constellation Oil Services Holding S.A.			3.000% due 06/15/2028	11,288	9,298
3.000% due 12/31/2026 (f)	377	282	3.150% due 01/01/2026	15,753	14,202
Directv Financing LLC			3.250% due 06/15/2023	8,640	8,506
5.875% due 08/15/2027	7,200	6,498	3.250% due 06/01/2031	3,800	2,962
DISH DBS Corp.			3.300% due 03/15/2027	3,838	3,311
5.250% due 12/01/2026	11,110	9,673	3.300% due 12/01/2027	14,666	12,450
5.750% due 12/01/2028	11,110	8,978	3.300% due 08/01/2040	1,542	1,004
Enel Finance America LLC			3.400% due 08/15/2024	6,570	6,251
7.100% due 10/14/2027	6,000	5,986	3.450% due 07/01/2025	12,102	11,254
Enel Finance International NV			3.500% due 06/15/2025	8,068	7,510
7.500% due 10/14/2032	4,700	4,714	3.500% due 08/01/2050	4,660	2,851
7.750% due 10/14/2052	3,000	2,881	3.750% due 02/15/2024	10,188	9,882
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			3.750% due 07/01/2028	13,613	11,630
2.250% due 11/22/2024	EUR 100	62	3.750% due 08/15/2042	418	266
2.949% due 01/24/2024	450	278	3.850% due 11/15/2023	1,830	1,789
4.950% due 03/23/2027	\$ 1,800	963	3.950% due 12/01/2047	2,500	1,617
4.950% due 02/06/2028	1,000	545	4.000% due 12/01/2046	3,144	2,005
5.150% due 02/11/2026	5,700	3,550	4.200% due 03/01/2029	9,900	8,600
7.288% due 08/16/2037	500	282	4.250% due 08/01/2023	3,735	3,698
8.625% due 04/28/2034	2,372	1,340	4.250% due 03/15/2046	5,219	3,483
Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC			4.300% due 03/15/2045	3,000	2,026
1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	18,868	4.400% due 03/01/2032	7,300	6,119
2.950% due 04/15/2025	5,000	2,842	4.450% due 04/15/2042	4,333	3,062
2.950% due 01/27/2029	\$ 23,200	13,579	4.500% due 07/01/2040	39,210	29,308
iHeartCommunications, Inc.			4.500% due 12/15/2041	743	507
4.750% due 01/15/2028	36,300	31,726	4.550% due 07/01/2030	50,195	44,022
6.375% due 05/01/2026	6,808	6,503	4.600% due 06/15/2043	1,794	1,289
8.375% due 05/01/2027	6,911	6,220	4.650% due 08/01/2028	100	88
Intelsat Jackson Holdings S.A.			4.750% due 02/15/2044	2,707	1,958
6.500% due 03/15/2030	70,143	64,550	4.950% due 07/01/2050	25,950	19,397
Netflix, Inc.			5.250% due 03/01/2052	7,300	5,630
3.625% due 05/15/2027	EUR 3,900	3,761	Petrobras Global Finance BV		
3.625% due 06/15/2030	18,776	16,893	6.250% due 12/14/2026	GBP 6,234	6,833
3.875% due 11/15/2029	8,217	7,566	6.625% due 01/16/2034	2,900	2,801
4.625% due 05/15/2029	7,600	7,343	Petroleos de Venezuela S.A. (c)		
4.875% due 04/15/2028	\$ 200	190	5.375% due 04/12/2027	\$ 11,932	283
4.875% due 06/15/2030	2,900	2,689	5.500% due 04/12/2037	10,372	236
5.375% due 11/15/2029	1,280	1,219	6.000% due 05/16/2024	8,283	217
5.875% due 11/15/2028	300	298	6.000% due 11/15/2026	13,183	300
6.375% due 05/15/2029	1,500	1,532	9.000% due 11/17/2022	400	9
Noble Finance Co.			9.750% due 05/17/2035	4,730	112
11.000% due 02/15/2028 (f)	2,086	2,263	Petroleos Mexicanos		
			2.750% due 04/21/2027	EUR 1,200	883

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.950% due 01/28/2031	\$ 22,485	16,245
6.700% due 02/16/2032	79,356	60,145
6.950% due 01/28/2060	6,116	3,681
7.690% due 01/23/2050	1,570	1,026
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC		
4.263% due 06/01/2036	3,600	3,245
4.377% due 06/01/2039	3,990	3,479
4.451% due 12/01/2047	20,700	17,233
4.674% due 12/01/2051	3,600	3,096
Prosus NV		
1.985% due 07/13/2033	EUR 5,600	3,340
2.085% due 01/19/2030	4,200	2,934
3.061% due 07/13/2031	\$ 11,900	8,004
4.193% due 01/19/2032	5,600	3,989
4.987% due 01/19/2052	4,700	2,925
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1		
9.250% due 07/06/2024	1,184	1,199
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3		
9.750% due 01/06/2027	554	573
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1		
8.200% due 04/06/2028	2,383	2,398
Southern California Edison Co.		
4.875% due 03/01/2049	346	279
Sprint Capital Corp.		
8.750% due 03/15/2032	2,200	2,585
Sprint Communications LLC		
6.000% due 11/15/2022	3,934	3,940
Sprint Corp.		
7.125% due 06/15/2024	8,766	8,874
7.625% due 02/15/2025	1,100	1,132
7.625% due 03/01/2026	839	877
7.875% due 09/15/2023	46,749	47,578
Sprint Spectrum Co. LLC		
4.738% due 03/20/2025	2,425	2,392
5.152% due 03/20/2028	2,758	2,685
System Energy Resources, Inc.		
2.140% due 12/09/2025	6,100	5,475
T-Mobile USA, Inc.		
3.375% due 04/15/2029	5,983	5,188
3.500% due 04/15/2031	3,000	2,527
Topaz Solar Farms LLC		
4.875% due 09/30/2039	5,450	4,610
5.750% due 09/30/2039	7,731	7,363
Transocean Phoenix 2 Ltd.		
7.750% due 10/15/2024	840	836
Transocean, Inc.		
7.500% due 01/15/2026	1,228	1,040
8.000% due 02/01/2027	2,983	2,423
United Group BV		
4.875% due 07/01/2024	EUR 565	535

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Valaris Ltd.		
8.250% due 04/30/2028 (f)	\$ 2,483	2,446
Viasat, Inc.		
5.625% due 09/15/2025	3,363	3,109
6.500% due 07/15/2028	2,700	2,261
Windstream Escrow LLC		
7.750% due 08/15/2028	11,607	10,076
		777,725
社債・約束手形合計		2,020,932
(取得原価 \$2,522,029)		

転換社債等 0.4%

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Multiplan Corp.		
6.000% due 10/15/2027 (d)	5,700	3,933
Nationwide Building Society		
10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	9,571
Stichting AK Rabobank Certificaten		
6.500% due 03/29/2170 (e)	EUR 30,963	28,971

転換社債等合計

(取得原価 \$67,887)

42,475**地方債・約束手形 0.2%**

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010		
6.630% due 02/01/2035	\$ 655	654
6.725% due 04/01/2035	310	310
7.350% due 07/01/2035	506	519
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015		
7.750% due 01/01/2042	130	131
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017		
7.045% due 01/01/2029	275	274
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2021		
4.000% due 07/01/2037	2,082	1,661
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022		
0.000% due 11/01/2043	13,426	6,142
Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021		
2.246% due 06/01/2029	1,600	1,305
3.000% due 06/01/2046	710	644
Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (c)		
6.050% due 07/01/2032	800	604
6.125% due 07/01/2040	3,000	2,265

地方債・約束手形合計

(取得原価 \$14,672)

14,509**米国政府機関債 28.5%**

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Fannie Mae		
2.614% due 05/25/2048 (g)	2,241	281
3.000% due 04/01/2037	667	615
3.000% due 09/01/2049	194	167

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.000% due 03/01/2050	18,419	15,817	6.000% due 10/01/2047	8	8
3.000% due 10/01/2051	1,378	1,174	6.500% due 01/01/2037	2	2
3.000% due 12/01/2051	210	179	6.500% due 10/01/2037	3	3
3.000% due 02/01/2052	10,966	9,361	7.000% due 09/01/2031	30	30
3.000% due 03/01/2052	25,128	21,428	7.000% due 05/01/2037	1	1
3.000% due 04/01/2052	27,202	23,152	Fannie Mae, TBA (h)		
3.000% due 05/01/2052	3,554	3,030	2.500% due 11/01/2052	47,000	38,482
3.000% due 06/01/2052	9,382	8,001	2.500% due 12/01/2052	99,000	81,061
3.000% due 07/01/2052	7,483	6,393	3.000% due 12/01/2052	243,350	206,886
3.000% due 08/01/2052	3,667	3,126	3.500% due 12/01/2052	862,411	757,936
3.500% due 08/01/2042	20	18	4.000% due 11/01/2052	55,000	50,006
3.500% due 09/01/2047	182	165	4.000% due 12/01/2052	107,150	97,375
3.500% due 03/01/2048	56	50	4.500% due 12/01/2052	36,200	33,940
3.500% due 04/01/2051	729	653	Freddie Mac		
4.000% due 07/01/2040	7	6	3.000% due 05/01/2037	1,902	1,753
4.000% due 12/01/2041	55	50	3.000% due 11/01/2046	63	54
4.000% due 07/01/2042	75	67	3.000% due 12/01/2047	1,956	1,692
4.000% due 08/01/2042	8	7	3.000% due 03/01/2048	111	96
4.000% due 09/01/2042	98	89	3.000% due 04/01/2052	154	132
4.000% due 11/01/2045	98	92	3.000% due 07/01/2052	164	140
4.000% due 03/01/2047	31	29	3.138% due 06/15/2042 (g)	33	4
4.000% due 04/01/2047	242	227	3.500% due 10/01/2039	122	110
4.000% due 08/01/2047	4,110	3,834	3.500% due 10/01/2047	2,126	1,914
4.000% due 10/01/2047	257	239	3.500% due 12/01/2047	724	651
4.000% due 12/01/2047	82	76	3.500% due 03/01/2048	2,588	2,325
4.000% due 01/01/2048	52	48	3.500% due 04/01/2048	933	840
4.000% due 02/01/2048	586	546	3.500% due 10/01/2048	1,039	931
4.000% due 07/01/2048	6,869	6,338	3.500% due 12/01/2048	2,503	2,251
4.000% due 08/01/2048	4,053	3,744	3.500% due 03/01/2049	1,595	1,427
4.000% due 09/01/2048	1,153	1,075	3.500% due 05/01/2051	82	73
4.500% due 05/01/2033	15	14	4.000% due 09/01/2033	1	1
4.500% due 05/01/2035	6	6	4.000% due 04/01/2047	328	307
4.500% due 02/01/2038	1	1	4.000% due 05/01/2047	319	298
4.500% due 01/01/2041	177	164	4.000% due 08/01/2047	570	532
4.750% due 06/01/2033	172	163	4.000% due 08/01/2048	673	624
5.000% due 10/01/2035	64	63	4.000% due 09/01/2048	276	255
5.000% due 12/01/2035	148	142	4.000% due 12/01/2048	10,622	9,840
5.000% due 10/01/2036	6	6	4.000% due 02/01/2049	4,039	3,742
5.000% due 05/01/2038	2	2	4.000% due 03/01/2049	315	292
5.000% due 11/01/2039	7	7	5.000% due 06/01/2034	75	75
5.500% due 07/01/2033	23	23	5.000% due 08/01/2035	42	41
5.500% due 06/01/2035	699	682	5.000% due 01/01/2037	3	3
5.500% due 04/01/2036	1	1	5.000% due 01/01/2038	1	1
5.500% due 11/01/2036	2	2	5.500% due 01/01/2035	273	271
5.500% due 03/01/2037	11	11	5.500% due 05/01/2037	2	2
5.500% due 09/01/2037	5	4	5.500% due 06/01/2037	205	203
5.500% due 02/01/2038	3	3	5.750% due 05/01/2037	186	186
5.500% due 04/01/2038	13	13	6.000% due 07/01/2037	44	44
6.000% due 08/01/2031	22	21	Ginnie Mae		
6.000% due 06/01/2032	1	1	4.000% due 06/20/2041	2	1
6.000% due 09/01/2039	373	368	4.000% due 04/20/2047	1,622	1,520

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
4.000% due 05/20/2047	30,018	28,145	0.375% due 07/15/2023	77,060	76,440
4.000% due 06/20/2047	14,337	13,442	0.375% due 01/15/2027	5,694	5,383
4.000% due 07/20/2047	12,474	11,696	0.375% due 07/15/2027	1,526	1,441
4.000% due 02/20/2048	8,496	7,981	0.500% due 04/15/2024	26,903	26,344
4.000% due 05/20/2049	29,604	27,562	0.625% due 01/15/2024	20,195	19,866
4.000% due 02/20/2050	360	337	0.625% due 07/15/2032	87,868	80,541
4.000% due 07/20/2050	179	166	0.625% due 02/15/2043	2,834	2,238
4.000% due 08/20/2050	27	25	0.750% due 07/15/2028	33,456	31,853
4.000% due 09/20/2050	2,159	2,009	0.750% due 02/15/2042	6,685	5,498
4.000% due 10/20/2050	67,643	62,916	0.750% due 02/15/2045	18,237	14,515
4.500% due 01/20/2040	79	76	0.875% due 01/15/2029	61,077	58,186
4.500% due 03/20/2040	8	7	0.875% due 02/15/2047	21,349	17,173
5.000% due 08/20/2030	191	188	1.000% due 02/15/2046	11,500	9,605
5.000% due 05/20/2040	276	270	1.000% due 02/15/2048	24,981	20,566
5.000% due 04/20/2041	7	7	1.000% due 02/15/2049	63,333	52,238
5.500% due 05/20/2038	7	7	1.375% due 02/15/2044	3,304	3,014
5.500% due 06/20/2038	40	40	2.125% due 02/15/2040	3,426	3,586
5.500% due 07/20/2038	35	34	2.125% due 02/15/2041	1,893	1,978
5.500% due 08/20/2038	279	280	U.S. Treasury Bonds		
5.500% due 09/20/2038	75	75	2.250% due 08/15/2046	100	68
5.500% due 10/20/2038	15	15	2.750% due 08/15/2047	2,830	2,124
5.500% due 01/20/2039	11	10	3.000% due 08/15/2048	155	123
5.500% due 02/20/2039	43	43	3.000% due 02/15/2049	77	62
5.500% due 09/20/2039	54	54	3.125% due 05/15/2048	180	146
5.500% due 10/20/2039	9	9	U.S. Treasury Notes		
5.500% due 11/20/2039	220	220	1.625% due 02/15/2026	2,200	2,013
5.500% due 12/20/2039	25	24	2.000% due 02/15/2025	11,021	10,430
5.500% due 01/20/2040	194	190	2.000% due 08/15/2025	1,400	1,310
5.500% due 06/20/2040	245	252	2.000% due 11/15/2026	800	731
5.500% due 07/20/2040	486	478	2.250% due 11/15/2024	12,300	11,766
Ginnie Mae, TBA (h)			2.250% due 02/15/2027	28,000	25,740
2.000% due 11/01/2052	19,000	15,613	2.375% due 05/15/2029	32,200	28,832
2.500% due 11/01/2052	46,200	39,162	2.625% due 02/15/2029	5,000	4,555
3.000% due 11/01/2052	133,720	116,451	2.750% due 08/15/2032	150,100	134,340
3.000% due 12/01/2052	366,280	318,878	2.875% due 05/15/2032	290	263
3.500% due 11/01/2052	85,700	76,721			
4.000% due 11/01/2052	646,158	595,566	国庫債券合計		952,776
4.500% due 11/01/2052	4,000	3,792	(取得原価 \$1,070,454)		
米国政府機関債合計		2,732,876			
(取得原価 \$2,778,773)					
国庫債券 9.9%					
Treasury Inflation					
Protected Securities (i)					
0.125% due 07/15/2024	64,736	63,127	モーゲージ担保証券 37.3%		
0.125% due 10/15/2024	37,979	36,871	Accredited Mortgage Loan Trust		
0.125% due 07/15/2030	52,802	47,150	4.531% due 07/25/2035	9,806	9,553
0.125% due 01/15/2031	1,934	1,714	5.281% due 07/25/2035 (c)	715	600
0.125% due 07/15/2031	7,337	6,471	ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
0.250% due 07/15/2029	142,835	130,385	3.741% due 08/25/2036	3,949	3,723
0.250% due 02/15/2050	21,151	14,090	4.381% due 01/25/2035	927	834
			4.411% due 02/25/2034	3,077	3,003
			4.486% due 08/25/2035	4,857	4,707
			Adjustable Rate Mortgage Trust		
			4.536% due 08/25/2035	3,475	3,179

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
AFC Home Equity Loan Trust			BCAP LLC Trust		
4.396% due 06/25/2029	1,685	1,065	4.578% due 04/26/2037	2,854	1,551
Alternative Loan Trust			5.468% due 04/26/2036	4,966	2,780
2.721% due 08/25/2035 (c)	417	345	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
3.623% due 08/25/2035 (c)	466	418	3.889% due 11/25/2034	194	186
3.679% due 09/20/2046	711	677	Bear Stearns Alternative-A Trust		
3.757% due 09/25/2034	992	896	3.926% due 04/25/2037	6,239	5,395
3.909% due 03/20/2046	5,629	4,413	4.006% due 11/25/2046	7,446	5,656
3.926% due 07/25/2046	59	276	Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
3.946% due 07/25/2036	5,013	4,830	3.014% due 05/25/2036 (g)	8,798	274
3.966% due 08/25/2046 (c)	9,125	7,337	3.826% due 02/25/2037	2,728	5,322
3.986% due 05/25/2036	13,102	11,058	3.886% due 06/25/2047	6,300	5,936
4.086% due 12/25/2046	14,983	12,123	3.986% due 05/25/2036 (c)	8,798	3,108
4.126% due 07/25/2036	20,327	17,524	4.126% due 04/25/2036	5,026	4,994
4.129% due 12/20/2035	5,472	4,796	4.186% due 02/25/2036 (c)	2,543	2,532
4.186% due 01/25/2036	3,183	2,709	4.231% due 12/25/2035	713	711
5.500% due 06/25/2035	4,775	3,851	4.606% due 06/25/2034	4,740	4,599
5.500% due 08/25/2035 (c)	54	46	4.636% due 11/25/2035 (c)	3,116	2,770
5.500% due 02/25/2036 (c)	15	10	4.636% due 08/25/2037	16,968	15,068
6.000% due 07/25/2037 (c)	24,656	13,144	4.666% due 12/25/2035	9,270	7,617
7.000% due 10/25/2037	29,569	11,237	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
Ameriquest Mortgage Securities Trust			5.500% due 11/25/2033	4,076	3,645
4.096% due 04/25/2036	2,220	2,200	Bear Stearns Mortgage Funding Trust		
4.201% due 03/25/2036	27,500	24,984	3.986% due 02/25/2037 (c)	5,216	4,574
<i>Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</i>			Benchmark Mortgage Trust		
4.058% due 09/25/2032	167	174	3.509% due 09/15/2048	47,290	42,964
5.341% due 10/25/2034	9,913	9,213	3.899% due 03/15/2062	9,775	7,396
Argent Mortgage Loan Trust			BHP Trust		
4.066% due 05/25/2035	20,545	18,224	5.183% due 08/15/2036	10,500	9,864
Argent Securities Trust			BHP Trust 2019-BXHP		
3.946% due 04/25/2036	7,821	2,564	5.980% due 08/15/2036	33,656	31,477
<i>Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</i>			BSST Mortgage Trust		
4.258% due 09/25/2033	3,275	3,148	6.226% due 02/15/2037	11,000	10,209
4.351% due 10/25/2035	36,400	31,894	6.876% due 02/15/2037	24,700	22,811
Asset-Backed Funding Certificates Trust			7.876% due 02/15/2037	7,500	6,886
3.806% due 10/25/2036	10,129	8,287	BX Trust		
4.246% due 03/25/2035	13,129	12,529	5.058% due 10/15/2036	16,400	15,169
4.321% due 06/25/2035	7,965	7,605	5.299% due 10/15/2036	7,150	6,647
<i>Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust</i>			5.307% due 10/15/2036	25,610	23,263
4.051% due 05/25/2036 (c)	37,847	34,858	7.787% due 07/15/2034	6,800	6,551
Atrium Hotel Portfolio Trust			Canterbury Finance No.1 PLC		
4.842% due 06/15/2035	18,395	17,329	2.465% due 05/16/2056	GBP 16,366	18,809
Austin Fairmont Hotel Trust			Capitalsource Real Estate Loan Trust		
5.212% due 09/15/2032	3,000	2,839	4.559% due 01/20/2037	\$ 11,122	10,055
Banc of America Alternative Loan Trust			4.659% due 01/20/2037	4,800	4,026
3.921% due 01/25/2023	58	48	4.759% due 01/20/2037	2,700	1,781
6.000% due 07/25/2046 (c)	1,531	1,265	<i>CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage</i>		
Banc of America Funding Trust			6.040% due 01/25/2039 (c)	657	600
2.765% due 06/20/2036	4,196	3,366	Centex Home Equity Loan Trust		
3.104% due 02/20/2035	1,345	1,158	4.231% due 03/25/2035	3,661	3,593
3.547% due 01/20/2047 (c)	86	79			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Chase Mortgage Finance Trust			3.562% due 06/25/2050	45,723	38,011
3.067% due 12/25/2035 (c)	4,087	3,494	3.592% due 01/25/2058	19,089	15,473
ChaseFlex Trust			3.687% due 06/01/2050	43,560	43,645
3.886% due 07/25/2037	906	849	3.951% due 04/25/2058	30,646	28,823
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			4.162% due 07/15/2032	5,200	4,902
3.946% due 03/25/2035	275	261	4.412% due 07/15/2032	4,000	3,735
CIT Mortgage Loan Trust			4.612% due 07/15/2032	2,400	2,217
4.936% due 10/25/2037	3,488	3,464	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
5.086% due 10/25/2037	28,585	26,870	7.480% due 03/25/2046	4,266	3,425
Citigroup Commercial Mortgage Trust			CWABS Asset-Backed Certificates Trust		
0.283% due 03/10/2047 (g)	25,400	85	3.726% due 06/25/2035 (c)	1,577	1,411
Citigroup Mortgage Loan Trust			3.726% due 06/25/2037	13,597	12,372
3.244% due 08/25/2036	15,928	6,599	3.726% due 07/25/2037 (c)	5,642	5,521
3.291% due 08/25/2036	4,085	3,865	3.736% due 04/25/2047 (c)	591	590
3.643% due 07/25/2037 (c)	2,752	2,387	3.766% due 11/25/2047	3,747	4,091
3.746% due 12/25/2036	10,148	5,769	3.806% due 08/25/2037	25,800	21,540
3.866% due 12/25/2036	2,870	2,792	3.816% due 05/25/2037 (c)	12,639	11,777
4.406% due 09/25/2037	13,629	11,184	3.816% due 10/25/2047	8,007	7,871
7.250% due 05/25/2036 (c)	9,326	4,866	3.836% due 02/25/2036	1,176	1,118
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			3.846% due 09/25/2046	5,600	5,278
4.621% due 05/25/2035	10,698	10,013	4.006% due 01/25/2045	1,494	1,481
Commercial Mortgage Trust			4.066% due 05/25/2036	9,800	8,062
0.177% due 04/10/2047 (g)	33,000	71	4.066% due 03/25/2037	29,856	27,748
3.633% due 02/10/2037	10,000	8,866	4.066% due 03/25/2047 (c)	26,535	22,676
6.563% due 12/15/2038	8,575	8,021	4.090% due 12/25/2034	4	4
Conseco Finance Corp.			4.111% due 08/25/2036	2,400	2,275
6.920% due 12/01/2030	1,202	1,209	4.186% due 06/25/2036	1,830	1,811
7.500% due 03/01/2030	47,279	20,106	4.246% due 04/25/2036	134	134
7.600% due 04/15/2026	4,963	1,468	4.286% due 03/25/2036 (c)	1,655	1,471
Countrywide Asset-Backed Certificates			4.666% due 05/25/2036 (c)	2,182	1,598
4.076% due 08/26/2033	219	210	4.681% due 06/25/2035	8,400	7,850
5.461% due 05/25/2035 (c)	4,282	4,166	5.161% due 11/25/2034	6,720	6,632
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			5.536% due 08/25/2035	3,000	2,806
3.160% due 06/25/2034	1	1	5.633% due 06/25/2035	8,644	7,015
3.411% due 03/25/2037 (c)	3,708	3,175	CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust		
3.573% due 10/20/2035 (c)	4,532	4,091	5.161% due 03/25/2035	5,500	5,295
3.638% due 11/25/2034	8	7	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust		
3.638% due 11/25/2037	4,696	4,243	3.662% due 03/15/2030	319	321
5.500% due 11/25/2035 (c)	6,050	3,437	DBGS Mortgage Trust		
6.000% due 07/25/2036	17,730	10,084	6.063% due 10/15/2036	15,000	13,494
6.000% due 11/25/2037	3,719	2,127	Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust		
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			3.906% due 03/25/2037	9,717	5,282
6.036% due 01/25/2033	1,206	1,094	3.916% due 08/25/2037 (c)	20,298	17,099
Credit Suisse Mortgage Capital			4.086% due 09/25/2047	12,504	10,505
3.000% due 01/29/2036	544	527	Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust		
3.000% due 06/27/2037	1,462	1,441	3.344% due 10/25/2035 (c)	9,297	8,166
3.254% due 11/27/2036	11,043	12,537	Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.		
8.810% due 10/26/2036	142	119	3.687% due 11/27/2036	1,560	1,538
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
0.000% due 01/25/2058	22	22	3.670% due 10/19/2036 (c)	7,566	6,370
0.000% due 04/25/2058 (g)	1	1	4.080% due 10/19/2045 (c)	524	540

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
4.140% due 09/19/2045	5,029	3,210	4.231% due 11/25/2035 (c)	6,223	5,394
Dragon Finance BV			GSMSC Resecuritization Trust		
3.425% due 07/13/2023	GBP 42	47	3.264% due 09/26/2036	3,896	2,571
Ellington Loan Acquisition Trust			5.270% due 04/26/2037	44,351	12,702
4.686% due 05/25/2037	\$ 1,199	1,148	GSR Mortgage Loan Trust		
EMC Mortgage Loan Trust			3.114% due 03/25/2037 (g)	7,645	850
4.636% due 04/25/2042 (c)	6,336	6,234	3.886% due 03/25/2037	7,645	1,066
Encore Credit Receivables Trust			HarborView Mortgage Loan Trust		
4.516% due 11/25/2035	6,510	6,069	3.720% due 12/19/2036 (c)	852	773
Eurosail-UK PLC			4.040% due 02/19/2036	10,220	6,832
2.994% due 09/13/2045	GBP 4,277	4,522	4.120% due 08/19/2045	7,922	6,040
3.174% due 06/13/2045	7,502	8,576	Hawaii Hotel Trust		
Extended Stay America Trust			5.062% due 05/15/2038	2,000	1,885
6.263% due 07/15/2038	\$ 15,619	14,772	5.572% due 05/15/2038	12,500	11,663
FBR Securitization Trust			Home Equity Asset Trust		
4.261% due 10/25/2035	20,476	16,975	4.066% due 10/25/2036	23,475	14,259
4.351% due 09/25/2035	7,500	7,210	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust		
First Franklin Mortgage Loan Trust			3.726% due 11/25/2036	12,718	11,271
3.896% due 11/25/2036	59,328	48,481	3.826% due 04/25/2037	13,304	8,939
3.906% due 04/25/2036	4,548	4,382	3.946% due 06/25/2036	2,268	2,173
4.276% due 01/25/2036	24,773	22,503	4.576% due 08/25/2035	5,221	5,105
4.291% due 05/25/2036	991	987	HPLY Trust		
4.441% due 04/25/2035	3,265	3,094	5.412% due 11/15/2036	4,675	4,393
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (c)			5.762% due 11/15/2036	26,212	24,505
1.414% due 05/25/2035 (g)	1,263	45	HSI Asset Securitization Corp. Trust		
4.086% due 05/25/2035	1,263	778	3.961% due 05/25/2037	7,197	6,783
Fontainebleau Miami Beach Trust			Impac CMB Trust		
3.963% due 12/10/2036	33,098	30,218	4.266% due 01/25/2035	8,673	8,121
Fremont Home Loan Trust			Impac Secured Assets Corp.		
3.866% due 02/25/2037	7,291	5,564	4.146% due 03/25/2036 (c)	9,496	7,723
4.606% due 01/25/2035	6,493	5,493	Impac Secured Assets Trust		
Glen Securities Finance DAC			3.966% due 01/25/2037	2,319	1,979
2.312% due 10/28/2038	EUR 5,104	4,888	IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust		
3.312% due 10/28/2038	3,828	3,609	6.500% due 10/25/2037	8,443	4,701
4.112% due 10/28/2038	1,871	1,768	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust		
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			3.233% due 06/25/2037 (c)	8,451	5,879
5.456% due 03/10/2051	\$ 11,955	10,197	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
GreenPoint Mortgage Funding Trust			3.028% due 07/25/2037	19,688	16,877
4.146% due 11/25/2045	52	39	3.067% due 03/25/2036 (c)	4,133	3,166
Grifonas Finance No.1 PLC			3.119% due 04/25/2037 (c)	6,885	5,810
1.264% due 08/28/2039	EUR 629	577	3.244% due 04/25/2037	13,614	11,244
GS Mortgage Securities Corporation Trust			3.694% due 11/25/2036 (c)	11,119	7,774
3.419% due 10/10/2032	\$ 3,300	3,294	3.946% due 02/25/2037 (c)	22,247	20,193
4.591% due 10/10/2032	8,215	7,807	3.966% due 10/25/2036	5,035	2,338
GSAA Home Equity Trust			INTOWN Mortgage Trust		
6.500% due 11/25/2037 (c)	20	9	7.061% due 08/15/2039	11,495	11,212
GSAMP Trust			IXIS Real Estate Capital Trust		
3.726% due 03/25/2047	3,737	3,381	4.351% due 12/25/2035	1,930	1,924
3.746% due 01/25/2037	17,397	10,437	Jefferies Resecuritization Trust		
3.906% due 05/25/2046	27	27	7.981% due 06/25/2047 (c)	481	390
4.106% due 06/25/2036	12,650	12,077			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
JPMorgan Alternative Loan Trust			Mastr Asset-Backed Securities Trust		
2.905% due 03/25/2036 (c)	307	256	3.806% due 11/25/2036	26	15
4.146% due 04/25/2047	1,683	1,595	4.141% due 01/25/2036	7,500	6,672
5.730% due 03/25/2036 (c)	72	69	4.736% due 08/25/2037	15,101	12,413
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			Mastr Specialized Loan Trust		
4.262% due 12/15/2036	3,700	3,576	4.306% due 02/25/2036	5,342	4,147
5.337% due 05/15/2047	197	182	MBRT		
5.512% due 09/15/2029	1,740	1,621	5.062% due 11/15/2036	6,435	6,167
5.928% due 11/15/2038	16,193	14,801	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust		
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			6.586% due 10/25/2037	13,033	12,145
3.856% due 08/25/2036	8,600	7,760	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
3.856% due 06/25/2037	34,606	32,426	2.845% due 02/25/2033	8	8
3.866% due 06/25/2037 (c)	22,826	19,350	3.866% due 05/25/2037	20,107	11,076
3.991% due 05/25/2036	9,836	9,490	4.306% due 07/25/2034	4,854	4,221
4.021% due 05/25/2036	17,725	16,685	4.381% due 09/25/2035	1,385	1,346
JPMorgan Mortgage Trust (c)			4.666% due 10/25/2035	830	812
3.295% due 01/25/2037	438	357	Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust		
3.886% due 10/25/2035	4,004	2,929	3.836% due 07/25/2036	5,076	4,282
JPMorgan Resecuritization Trust			3.846% due 02/25/2037	7,620	3,644
3.225% due 02/26/2037	2,174	1,987	3.886% due 07/25/2036	45,517	18,409
Kentmere No.2 PLC			4.066% due 06/25/2036	20,749	18,302
0.000% due 01/28/2042 GBP	9,500	3,409	4.086% due 07/25/2036	45,294	18,369
0.870% due 01/28/2042	2,439	2,276	4.126% due 03/25/2036	4,555	4,367
2.985% due 01/28/2042	54,421	59,356	4.321% due 07/25/2035	5,965	5,751
3.585% due 01/28/2042	5,693	6,121	4.586% due 03/25/2033	75	73
3.935% due 01/28/2042	4,066	4,360	4.586% due 07/25/2037	345	334
4.385% due 01/28/2042	2,439	2,609	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
5.185% due 01/28/2042	1,626	1,741	0.774% due 11/15/2052 (g)	132,167	3,646
7.185% due 01/28/2042	3,252	3,345	Morgan Stanley Capital I Trust		
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			2.428% due 04/05/2042	13,500	10,198
1.300% due 06/15/2045 EUR	3,120	2,944	5.062% due 08/15/2033	2,619	2,556
Legacy Mortgage Asset Trust			5.790% due 12/15/2023	21,942	20,312
0.000% due 09/25/2059 (g) \$	621,026	3,092	6.489% due 12/15/2023	40,574	37,162
0.000% due 09/25/2059	18,314	5,964	Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust		
3.000% due 09/25/2059	107,358	100,159	4.126% due 02/25/2036 (c)	18,209	17,982
4.040% due 09/25/2059	129,610	94,743	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
5.382% due 01/28/2070	33,490	33,407	4.096% due 02/25/2036	14,415	13,278
Lehman XS Trust			Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust		
3.786% due 02/25/2037 (c)	13,119	11,256	4.046% due 07/25/2036	10,169	4,363
3.966% due 09/25/2036	5,858	4,627	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
3.966% due 12/25/2036	11,465	8,775	2.982% due 11/25/2037	1,247	923
4.106% due 02/25/2047	22,721	20,159	6.000% due 12/25/2035 (c)	481	199
5.286% due 10/25/2037	13,965	12,686	Morgan Stanley Reremic Trust		
6.500% due 06/25/2046	4,809	3,783	3.404% due 11/26/2036	6,042	5,270
Long Beach Mortgage Loan Trust			Mortgage Loan Trust		
3.966% due 02/25/2036	5,414	4,396	5.370% due 03/25/2034	3,310	2,983
3.966% due 03/25/2046	33,650	12,211	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust		
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			3.790% due 11/15/2032	1,400	1,262
6.836% due 03/25/2032	861	862	3.821% due 02/15/2039	2,900	2,542
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			5.471% due 02/15/2033	3,204	3,189
2.691% due 04/25/2034	1	1			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
New York Mortgage Trust					
4.126% due 04/25/2035	623	590			
Newgate Funding PLC					
2.903% due 12/15/2050	GBP 18,103	19,644			
<i>Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</i>					
5.034% due 05/25/2035 (c)	\$ 2,890	1,462			
<i>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</i>					
4.351% due 05/25/2035	7,329	7,116			
5.745% due 10/25/2036 (c)	21,971	5,648			
Nomura Resecuritization Trust					
1.931% due 03/26/2037	5,987	5,348			
NovaStar Mortgage Funding Trust					
3.786% due 09/25/2037	18,680	17,949			
3.906% due 05/25/2036	5,904	5,727			
3.906% due 10/25/2036	5,502	3,076			
4.306% due 10/25/2035	1,341	1,319			
NYO Commercial Mortgage Trust					
5.408% due 11/15/2038	30,000	27,559			
5.958% due 11/15/2038	14,400	12,906			
<i>Optium Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates</i>					
4.336% due 07/25/2035	7,965	7,845			
Option One Mortgage Loan Trust					
3.686% due 02/25/2037	15,375	7,894			
3.706% due 03/25/2037	8,563	8,044			
3.726% due 03/25/2037	36,689	31,460			
<i>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</i>					
4.321% due 09/25/2035	3,107	2,974			
4.366% due 09/25/2035 (c)	25,075	21,044			
<i>People's Financial Realty Mortgage Securities Trust</i>					
3.746% due 09/25/2036	26,527	5,363			
<i>Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust (c)</i>					
3.622% due 07/25/2035	9,601	6,963			
3.896% due 11/25/2036	15,163	12,154			
Precise Mortgage Funding PLC					
0.000% due 12/12/2055	GBP 0	1,130			
PRET LLC					
1.843% due 09/25/2051	\$ 42,432	38,399			
Quest Trust					
5.011% due 03/25/2035	2,667	2,644			
RAAC Trust					
4.291% due 02/25/2036 (c)	9,049	8,328			
4.336% due 06/25/2047	21,346	16,791			
RBSGC Mortgage Loan Trust					
6.000% due 01/25/2037 (c)	2	2			
Real Estate Asset Liquidity Trust					
2.419% due 06/12/2054	CAD 5,647	4,040			
Renaissance Home Equity Loan Trust					
4.306% due 11/25/2034	\$ 53	45			
4.586% due 09/25/2037	37	31			
5.612% due 04/25/2037	10,124	3,114			
5.675% due 06/25/2037 (c)	3,910	1,207			
Residential Accredited Securities Corporation Trust					
3.806% due 02/25/2037	22,285	21,082			
3.886% due 01/25/2037	35,930	26,406			
4.081% due 04/25/2036	7,681	7,540			
4.201% due 03/25/2036	5,500	5,037			
4.561% due 09/25/2035	6,582	6,382			
5.161% due 04/25/2034	1,204	1,078			
Residential Asset Mortgage Products Trust					
3.936% due 10/25/2036	16,691	15,347			
4.186% due 02/25/2036	1,793	1,767			
4.261% due 11/25/2035	10,786	10,472			
4.266% due 12/25/2035	10,537	9,485			
4.336% due 09/25/2035	8,801	8,560			
RESIMAC Bastille Trust					
4.073% due 09/05/2057	1,612	1,612			
Saxon Asset Securities Trust					
2.472% due 03/25/2035 (c)	506	490			
5.336% due 12/25/2037	3,000	2,779			
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
4.126% due 03/25/2036	5,085	4,500			
4.411% due 10/25/2035	10,136	8,950			
4.636% due 03/25/2035	6,663	6,391			
Sequoia Mortgage Trust					
3.889% due 05/20/2035	1,334	1,144			
4.009% due 06/20/2034	26	23			
Sestante Finance Srl					
1.722% due 07/23/2046	EUR 9,116	8,373			
SFO Commercial Mortgage Trust					
5.812% due 05/15/2038	\$ 885	792			
6.312% due 05/15/2038	22,000	19,666			
SG Mortgage Securities Trust					
3.946% due 02/25/2036	4,822	2,792			
4.046% due 07/25/2036	8,218	1,900			
Shamrock Residential DAC					
1.793% due 12/24/2059	EUR 12,335	11,838			
Soundview Home Loan Trust					
4.006% due 06/25/2036 (c)	\$ 7,737	6,348			
4.051% due 06/25/2036 (c)	46,197	38,888			
4.066% due 07/25/2036	24,020	20,998			
4.561% due 03/25/2036	8,102	6,960			
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust					
4.561% due 12/25/2035	830	804			
SREIT Trust					
4.857% due 10/15/2038	24,605	23,162			
5.205% due 10/15/2038	20,425	18,843			
Stratton Mortgage Funding PLC					
3.546% due 09/25/2051	GBP 2,000	2,231			
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
2.771% due 05/25/2035 (c)	\$ 56	43			
3.133% due 06/25/2037	2,004	1,830			
3.810% due 07/25/2035 (c)	2,194	1,162			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.906% due 10/25/2035	4,271	3,912			
4.561% due 08/25/2035	9,770	8,747			
Structured Asset Investment Loan Trust					
3.736% due 06/25/2036	6,701	6,423			
4.306% due 04/25/2035	4,464	4,381			
4.386% due 02/25/2034	14,796	14,296			
4.786% due 12/25/2034	2,867	2,823			
Structured Asset Mortgage Investments II Trust					
4.006% due 09/25/2047 (c)	21,264	22,853			
4.026% due 05/25/2036	9,948	7,658			
4.155% due 04/19/2035	1,655	1,548			
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
4.140% due 09/19/2032	20	19			
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust					
3.716% due 05/25/2036	6,031	5,827			
3.836% due 05/25/2036	3,750	3,064			
3.846% due 04/25/2036	51	51			
3.896% due 07/25/2036	17,559	17,049			
3.906% due 10/25/2036	2,804	1,925			
4.086% due 04/25/2031	8,945	8,768			
4.516% due 11/25/2035	9,825	9,781			
Summerhill Residential					
0.000% due 03/24/2059	EUR 5	4			
1.793% due 03/24/2059	147,216	144,290			
2.193% due 03/24/2059	22,011	21,535			
2.743% due 03/24/2059	17,746	17,350			
3.343% due 03/24/2059	14,202	13,785			
4.593% due 03/24/2059	8,521	8,256			
5.943% due 03/24/2059	4,256	4,123			
6.500% due 03/24/2059	6,568	5,512			
6.943% due 03/24/2059	4,256	4,125			
7.000% due 03/24/2059	35,506	27,651			
Sutherland Commercial Mortgage Loans					
3.192% due 05/25/2037	\$ 50	50			
Taurus UK DAC					
2.637% due 06/22/2029	GBP 5,417	6,119			
Terwin Mortgage Trust					
4.966% due 03/25/2035	\$ 2,943	2,712			
Tharaldson Hotel Portfolio Trust					
5.499% due 11/11/2034	4,718	4,428			
Towd Point Mortgage Trust					
3.750% due 09/25/2062	104,988	97,533			
Trinidad Mortgage Securities PLC					
3.110% due 01/24/2059	GBP 5,042	5,746			
Truman Capital Mortgage Loan Trust					
3.846% due 03/25/2036	\$ 849	838			
Verus Securitization Trust					
4.474% due 04/25/2067	32,656	30,704			
Wachovia Mortgage Loan Trust					
4.276% due 10/25/2035	3,180	2,781			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4.306% due 01/25/2045	412	370			
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC					
0.000% due 12/21/2049	GBP 0	272			
3.040% due 12/21/2049	27,586	31,734			
3.798% due 12/21/2049	4,921	5,658			
4.240% due 12/21/2049	2,460	2,827			
4.740% due 12/21/2049	1,406	1,615			
5.240% due 12/21/2049	1,406	1,614			
6.670% due 12/21/2049	0	3,395			
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMLT Trust (c)					
2.221% due 10/25/2046	\$ 10,743	8,696			
5.500% due 11/25/2035	62	54			
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
4.006% due 03/25/2037	794	769			
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates					
4.186% due 04/25/2034	3,873	3,657			
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust					
4.464% due 10/25/2036 (c)	174	159			
WFRBS Commercial Mortgage Trust					
0.423% due 03/15/2047 (g)	8,800	50			
モーゲージ担保証券合計					3,574,196
(取得原価 \$3,974,104)					
資産担保証券 4.1%					
AASET Trust					
3.967% due 05/16/2042	153	118			
ALESCO Preferred Funding XI Ltd.					
4.054% due 12/23/2036	5,000	4,306			
American Homes 4 Rent Trust					
6.231% due 10/17/2036	1,150	1,131			
Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.					
5.226% due 05/15/2037	3,146	3,061			
Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion					
2.909% due 02/28/2032	EUR 2,000	1,928			
BlueMountain CLO XXII Ltd.					
5.159% due 07/15/2031	\$ 3,900	3,779			
BPCRE Ltd.					
5.816% due 01/16/2037	13,800	13,672			
6.516% due 01/16/2037	3,468	3,441			
7.216% due 01/16/2037	13,516	13,133			
Cairn CLO III DAC					
2.688% due 10/20/2028	EUR 2,270	2,216			
Cairn CLO VI DAC					
0.935% due 07/25/2029	1,584	1,548			
Castlelake Aircraft Securitization Trust					
4.125% due 06/15/2043	\$ 1,461	1,281			
Cologix Canadian Issuer LP					
4.940% due 01/25/2052	CAD 1,800	1,217			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
FAB CBO BV					
1.826% due 08/20/2080 (c)	EUR	80			
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.					
5.000% due 03/12/2038	CAD	8,464			
Goodgreen					
3.930% due 10/15/2053	\$	4,635			
Harley Marine Financing LLC					
6.682% due 05/15/2043		4,913			
Humboldt Americas LLC					
0.000% due 11/30/2022	COP	62,570,000			
Jubilee CLO DAC					
2.128% due 07/12/2028	EUR	87			
KKR CLO 18 Ltd.					
5.134% due 07/18/2030	\$	1,792			
LoanCore Issuer Ltd.					
4.712% due 07/15/2036		2,350			
4.712% due 11/15/2038		19,100			
METAL LLC					
4.581% due 10/15/2042		11,855			
MF1 LLC					
5.617% due 06/19/2037		22,100			
6.102% due 09/17/2037		9,600			
6.117% due 06/19/2037		8,236			
MMcapS Funding XVII Ltd.					
3.432% due 12/01/2035		544			
National Collegiate Student Loan Trust					
2.824% due 10/25/2033		4,462			
Navient Private Education Loan Trust					
4.312% due 11/15/2068		1,550			
5.562% due 12/15/2045		3,003			
Nelnet Student Loan Trust					
4.386% due 09/25/2065		2,798			
Rockford Tower Europe CLO DAC					
2.060% due 12/20/2031	EUR	12,800			
Sapphire Aviation Finance I Ltd.					
4.250% due 03/15/2040	\$	17,848			
Saranac CLO III Ltd.					
5.202% due 06/22/2030		26,301			
SMB Private Education Loan Trust					
0.000% due 02/16/2055		3			
3.940% due 02/16/2055		25,092			
4.241% due 02/16/2055		25,092			
4.550% due 02/16/2055		8,414			
4.950% due 02/16/2055		2,185			
5.950% due 02/16/2055		3,907			
Sound Point CLO XV Ltd.					
5.225% due 01/23/2029		1,568			
Taberna Preferred Funding I Ltd.					
4.218% due 07/05/2035		3,362			
Theorem Funding Trust					
6.060% due 12/15/2028		8,372			
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.					
4.212% due 05/17/2032		472			
TICP CLO III-2 Ltd.					
5.083% due 04/20/2028		10,405			
Tropic CDO V Ltd.					
4.399% due 07/15/2036		10,258			
TRTX Issuer Ltd.					
4.441% due 02/15/2039		4,500			
TruPS Financials Note Securitization Ltd.					
4.844% due 03/30/2039		19,698			
5.097% due 09/20/2039		3,631			
Upstart Pass-Through Trust					
3.800% due 04/20/2030		27,081			
Upstart Securitization Trust					
5.500% due 06/20/2032		11,653			
Venture XVII CLO Ltd.					
4.959% due 04/15/2027		25,095			
Venture XXI CLO Ltd.					
4.959% due 07/15/2027		212			
資産担保証券合計					397,273
(取得原価 \$427,456)					
ソブリン債 6.2%					
Abu Dhabi Government International Bond					
3.875% due 04/16/2050		2,600			
Argentina Government International Bond					
0.500% due 07/09/2030		78,827			
1.000% due 07/09/2029		4,943			
1.500% due 07/09/2035		51,459			
1.500% due 07/09/2046		1,035			
3.500% due 07/09/2041		44,349			
3.875% due 01/09/2038		25,740			
Argentina Treasury Bond BONCER (i)					
1.400% due 03/25/2023	ARS	591,348			
1.450% due 08/13/2023		289,924			
Argentine Bonos del Tesoro					
15.500% due 10/17/2026		49,200			
Asian Development Bank					
4.700% due 03/12/2024	MXN	18,100			
Australia Government Bond					
1.750% due 06/21/2051	AUD	38,100			
Autonomous City of Buenos Aires Argentina					
69.966% due 02/22/2028	ARS	76,810			
72.219% due 03/29/2024		62,559			
Colombia Government International Bond					
4.000% due 02/26/2024	\$	1,600			
International Finance Corp.					
8.000% due 10/09/2023	IDR	12,600,000			
Israel Government International Bond					
3.800% due 05/13/2060	\$	17,000			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
4.500% due 04/03/2120	3,800	2,906
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER		
0.000% due 05/19/2023	ARS 2,281,600	10,433
Peru Government International Bond		
5.350% due 08/12/2040	PEN 749	134
5.400% due 08/12/2034	862	168
5.940% due 02/12/2029	38,611	8,704
6.150% due 08/12/2032	32,985	7,080
6.350% due 08/12/2028	32,430	7,582
6.950% due 08/12/2031	327	76
8.200% due 08/12/2026	80,750	20,935
Provincia de Buenos Aires		
72.723% due 04/12/2025	ARS 399,853	1,197
Romania Government International Bond		
1.750% due 07/13/2030	EUR 21,200	14,151
2.125% due 03/07/2028	9,200	7,165
2.875% due 04/13/2042	15,000	7,852
Russia Government International Bond		
4.250% due 06/23/2027	\$ 28,400	14,200
4.375% due 03/21/2029	200	90
4.750% due 05/27/2026	23,800	11,900
4.875% due 09/16/2023	2,200	1,606
5.100% due 03/28/2035	3,200	1,408
5.250% due 06/23/2047	82,400	39,552
5.625% due 04/04/2042	37,000	18,500
5.875% due 09/16/2043	13,200	6,864
7.150% due 11/12/2025	RUB 4,002,466	32,435
7.500% due 03/31/2030	\$ 4,748	3,466
7.950% due 10/07/2026	RUB 1,564,954	12,682
12.750% due 06/24/2028	\$ 4,012	2,739
14.730% due 04/24/2024	RUB 5,057,901	40,988
Serbia Government International Bond		
1.650% due 03/03/2033	EUR 4,900	2,877
3.125% due 05/15/2027	4,434	3,744
South Africa Government International Bond		
8.000% due 01/31/2030	ZAR 61,300	2,865
8.250% due 03/31/2032	73,300	3,285
8.750% due 02/28/2048	34,700	1,427
8.875% due 02/28/2035	52,400	2,328
10.500% due 12/21/2026	2,153,900	122,824
State Agency of Roads of Ukraine		
6.250% due 06/24/2030 (h)	\$ 1,200	181
Turkey Government International Bond		
4.250% due 03/13/2025	34,000	30,894
5.250% due 03/13/2030	29,000	21,743
6.125% due 10/24/2028	10,100	8,445
7.625% due 04/26/2029	30,900	27,407
Turkiye Ithracat Kredi Bankasi A/S		
8.250% due 01/24/2024	3,000	2,959
Ukraine Government International Bond		
4.375% due 01/27/2032 (h)	EUR 1,658	262

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
7.750% due 09/01/2025	\$ 4,390	951
United Kingdom Gilt		
1.250% due 07/31/2051	GBP 180	120
1.500% due 07/22/2047	80	59
1.750% due 01/22/2049	160	125
3.250% due 01/22/2044	150	158
3.500% due 01/22/2045	140	153
Venezuela Government International Bond (c)		
6.000% due 12/09/2049	\$ 3,367	219
7.000% due 03/31/2038	1,883	141
7.650% due 04/21/2025	5,349	401
7.750% due 04/13/2024	1,200	78
8.250% due 10/13/2024	5,991	434
9.000% due 05/07/2023	3,161	205
9.250% due 09/15/2027	4,274	321
9.250% due 05/07/2028	6,512	488
11.750% due 10/21/2026	680	51
11.950% due 08/05/2031	6,000	450

ソブリン債合計
(取得原価 \$860,427)

596,820

株

普通株式 1.3%

Cairo Mezz PLC	847,444	96
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	7,568
Constellation Oil Services Holding S.A.	421,249	46
Credit Suisse Group AG	601,156	2,492
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.	10,169,333	10,040
iHeartMedia, Inc. Class A	1,246,745	10,323
iHeartMedia, Inc. Class B	967,427	7,209
Intelsat S.A.	963,915	26,990
National Bank of Greece S.A.	102,570	372
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	151,112	27,423
Noble Corp. PLC	768,399	27,693
Stearns Holdings LLC	110,747	0
Voyager Aviation Holdings LLC	616	0
Westmoreland Mining Holdings LLC	8,912	98

普通株式合計
(取得原価 \$176,368)

120,350

商業用不動産持分 0.3%

CBL & Associates Properties, Inc.	6	172
Uniti Group, Inc.	110	850
VICI Properties, Inc.	760	24,350

商業用不動産持分合計
(取得原価 \$6,351)

25,372

株	評価額 (単位:千)	
株式リンク債 0.0%		
Intelsat Jackson Holdings S.A.		
12/31/2049	210	1,040
株式リンク債合計		1,040
(取得原価 \$0)		
ワラント 0.0%		
Intelsat S.A.		
02/17/2027	26	91
Sequa Corp.		
12/31/2049	10	8
Stearns Holdings LLC		
12/31/2049	1	0
Windstream Services LLC		
09/21/2055	226	3,732
ワラント合計		3,831
(取得原価 \$22,629)		
優先証券 0.0%		
Cayenne Aviation LLC		
9.500%	3,693	1,057
Sequa Corp.		
15.000%	1,418	1,828
優先証券合計		2,885
(取得原価 \$2,292)		
	額面金額 (単位:千)	
短期金融商品 11.0%		
コマーシャル・ペーパー 4.0%		
Federal Home Loan Bank		
3.060% due 01/03/2023	\$ 104,700	104,703
3.060% due 01/04/2023		77,700
3.070% due 01/06/2023		98,700
3.070% due 01/10/2023		98,600
		379,713
レポ契約 6.2%		
		597,100
定期預金 0.6%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
1.410% due 11/01/2022	GBP 276	318
1.620% due 11/01/2022	AUD 1,199	767
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,180	5,180
Bank of Nova Scotia		
2.580% due 11/01/2022		427

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
2.810% due 11/01/2022	CAD 164	120
BNP Paribas Bank		
(0.240%) due 11/01/2022	CHF 1	1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1,602	1,583
0.420% due 11/01/2022	DKK 3	0
1.290% due 11/01/2022	NOK 562	54
1.620% due 11/01/2022	AUD 81	52
2.050% due 11/01/2022	NZD 509	296
5.150% due 11/01/2022	ZAR 8,091	440
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 132	1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1	1
0.850% due 11/01/2022	SEK 1	0
2.580% due 11/01/2022	\$ 3	3
Citibank N.A.		
2.580% due 11/01/2022		4,337
DBS Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022		2,702
HSBC Bank PLC		
0.310% due 11/01/2022	EUR 558	551
JPMorgan Chase Bank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,782	5,782
MUFG Bank Ltd.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 251,387	1,691
Royal Bank of Canada		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,725	5,725
2.810% due 11/01/2022	CAD 129	94
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 2	0
0.310% due 11/01/2022	EUR 12,088	11,947
1.410% due 11/01/2022	GBP 222	256
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,392	4,392
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 44,520	300
1.410% due 11/01/2022	GBP 1,469	1,691
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,474	4,474
		53,185
米国財務省証券 0.3%		
2.759% due 11/25/2022 (k)		13,900
2.901% due 12/01/2022 (j)		13,300
		27,132
短期金融商品合計		1,057,130
(取得原価 \$1,057,127)		
投資有価証券合計 (a) 126.3%		\$ 12,119,648
(取得原価 \$13,587,614)		
金融デリバティブ商品 (1.5%)		(148,626)
(取得原価またはプレミアム \$(32,050))		

	評価額 (単位:千)
その他の資産および負債 (24.8%)	(2,376,583)
純資産 100.0%	\$ 9,594,439

投資有価証券明細表に対する注記

- (a) 2022年10月31日現在の地域別投資有価証券の配分は、米国が純資産の99.6%、英国が純資産の5.2%、その他の国が純資産の21.5%である。
- (b) この金額の全部または一部は未実行ローン・コミットメントである。未実行部分の金利は実行時に決定される。未実行ローン・コ

ミットメントに関する追加情報は財務書類に対する注記4、有価証券およびその他の投資を参照のこと。

- (c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
- (d) 偶発転換証券
- (e) 永久債：記載の日付（該当する場合）は次回の償還日である。
- (f) 現物払い有価証券
- (g) 有価証券はインタレスト・オンリー（「IO」）またはIOストリップである。
- (h) 発行日前取引（When-Issued 取引）証券
- (i) 証券の元本がインフレ率に応じて調整される。
- (j) クーボンは最終利回りである。
- (k) クーボンは加重平均最終利回りである。

●制限付証券

2022年10月31日現在

単位:千

発行体	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	純資産に占める 市場価格の割合
Constellation Oil Services Holding S.A.	N/A	N/A	06/10/2022	\$ 46	\$ 46	0.00%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/21/2021	717	493	0.01%
Intelsat S.A. Neiman Marcus Group Ltd. LLC	N/A	N/A	08/02/2018	75,855	26,990	0.28%
Westmoreland Mining Holdings LLC	N/A	N/A	09/25/2020	4,866	27,423	0.28%
WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL	N/A	N/A	03/26/2019	44	98	0.00%
	6.768%	02/09/2023	05/16/2018	40,918	40,899	0.43%
制限付証券合計				\$ 122,446	\$ 95,949	1.00%

◎借入およびその他の金融取引

2022年10月31日現在

●レボ契約

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	元本金額	担保	受入担保 評価額	レボ契約 評価額	単位:千 レボ契約に 係る未収金 ⁽¹⁾
BPS	2.990%	10/31/2022	11/01/2022	\$ 294,000	U.S. Treasury Notes 1.875% due 08/31/2024			
					U.S. Treasury Notes 2.250% due 11/15/2024	\$ (299,866)	\$ 294,000	\$ 294,024
JPS	3.060%	11/01/2022	11/02/2022	303,100	U.S. Treasury Bonds 2.000% due 02/15/2050	(308,258)	303,100	303,126
レボ契約合計						\$ (608,124)	\$ 597,100	\$ 597,150

●リバース・レボ取引

単位:千

取引相手	借入金利 ⁽³⁾	借入日	満期日	借入額 ⁽³⁾	リバース・レボ取引に係る未払金
JML	0.500%	10/14/2022	TBD ⁽²⁾	(123)	(122)
リバース・レボ取引合計				\$	(122)

●担保付借入として会計処理される取引

単位:千

	取引の契約上の残存期間				合計
	翌日物および継続	30日以下	31-90日	90日超	
リバース・レポ取引					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
リバース・レポ取引合計	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
借入合計	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
リバース・レポ取引に係る未払金				\$	(122)

(1) 経過利息を含む。

(2) 無期限リバース・レポ契約

(3) 2022年10月31日に終了した期間の借入平均残高は\$10,260で、加重平均金利は(0.531%)であった。平均借入には、期中に保有されていた場合、セール・バイバック取引およびリバース・レポ契約が含まれる可能性がある。

◎上場金融デリバティブ商品

2022年10月31日現在

●売建オプション

取引所先物契約に係るオプション

単位:千(契約数を除く)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム (受取額)	市場価格
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	\$ 98.000	12/15/2023	417	\$ (339)	\$ (120)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.500	12/15/2023	417	(390)	(1,346)
売建オプション合計				\$ (729)	\$ (1,466)

●先物契約

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現 評価損益	変動証拠金	
					資産	負債
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2024	409	\$ 1,891	\$ 87	\$ 0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2025	212	836	24	0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2026	229	842	14	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2024	266	1,113	47	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2025	216	814	16	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2024	354	1,541	71	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2025	193	742	14	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2026	215	780	13	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2024	247	1,002	34	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2025	175	648	11	0
Australia Government 10-Year Bond December Futures	Short	12/2022	693	351	0	(324)
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2022	131	(584)	0	(33)
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2022	2,870	(11,748)	0	(919)
U.S. Treasury 20-Year Bond December Futures	Short	12/2022	712	10,773	256	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note December Futures	Long	12/2022	3	(28)	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures	Short	12/2022	32	704	36	0
先物契約合計				\$ 9,677	\$ 623	\$ (1,277)

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)ープロテクションの売り⁽¹⁾

単位:千

参照債務	受取 固定金利	満期日	2022/10/31時点の 信用スプレッド ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
Airbus SE	1.000%	06/20/2028	1.325%	EUR 600	\$ (9)	\$ (23)	\$ 0	\$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2022	0.772%	\$ 9,200	14	3	1	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2023	0.827%	5,800	13	12	0	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2024	1.088%	18,700	(4)	(5)	0	(4)
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2025	1.144%	200	(1)	(3)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	1.184%	400	(2)	(8)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.268%	4,300	(42)	(11)	0	(3)
Bank of America Corp.	1.000%	12/20/2022	0.459%	10,400	19	(56)	0	(2)
Barclays Bank PLC	1.000%	12/20/2022	0.735%	EUR 11,500	17	(59)	0	(1)
Boeing Co.	1.000%	12/20/2024	1.265%	\$ 4,300	(18)	21	1	0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2025	1.383%	5,200	(42)	31	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2025	1.463%	3,100	(37)	13	1	0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2026	1.522%	8,400	(133)	(27)	1	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	1.567%	1,200	(24)	(18)	0	(6)
Boeing Co.	1.000%	06/20/2027	1.642%	5,400	(134)	56	0	0
Bombardier, Inc.	5.000%	06/20/2024	3.444%	900	26	58	0	(18)
Bombardier, Inc.	5.000%	12/20/2024	3.705%	300	9	5	0	(25)
Ford Motor Co.	5.000%	12/20/2022	1.571%	1,300	14	(47)	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2022	1.531%	100	1	(11)	0	(8)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2024	2.628%	700	30	3	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2024	2.784%	5,500	272	(207)	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2025	2.961%	1,100	60	10	0	(4)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2025	3.082%	8,400	493	166	0	(3)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2026	3.226%	100	6	2	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2027	3.471%	100	6	1	0	(1)
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.512%	17,200	114	30	0	(90)
General Motors Co.	5.000%	12/20/2026	1.906%	1,300	154	(61)	0	(2)
Hess Corp.	1.000%	12/20/2026	1.026%	3,200	1	37	0	(2)
Morgan Stanley	1.000%	12/20/2022	0.516%	2,400	5	(12)	0	(12)
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2022	1.448%	EUR 23,370	13	(408)	5	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2025	2.758%	20,000	(833)	410	1	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2026	3.397%	5,200	(393)	16	13	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2026	3.611%	28,100	(2,583)	(1,242)	75	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2026	1.200%	\$ 2,500	(16)	(72)	0	(15)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.274%	5,400	(54)	(23)	0	(5)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2027	1.334%	5,000	(68)	(9)	0	(2)
					\$ (3,126)	\$ (1,428)	\$ 98	\$ (209)

クレジットデフォルトスワップ(クレジット・インデックス)ープロテクションの売り⁽¹⁾

単位:千

インデックス/ トランシェ	受取 固定金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現 評価損益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.EM-28 Index	1.000%	12/20/2022	\$ 29,325	\$ 29	\$ 455	\$ 0	\$ (1,452)
CDX.EM-29 Index	1.000%	06/20/2023	52,275	(136)	1,235	0	(2,990)
CDX.EM-30 Index	1.000%	12/20/2023	35,445	(254)	847	0	(1,821)
CDX.EM-31 Index	1.000%	06/20/2024	19,350	(194)	557	0	(848)
CDX.EM-32 Index	1.000%	12/20/2024	8,670	(134)	231	0	(470)
CDX.EM-34 Index	1.000%	12/20/2025	46,828	(3,099)	(1,409)	0	(2,210)
CDX.EM-35 Index	1.000%	06/20/2026	92	(5)	(2)	0	(5)
CDX.EM-36 Index	1.000%	12/20/2026	142,140	(8,376)	(2,270)	0	(9,444)
CDX.EM-37 Index	1.000%	06/20/2027	1,372	(99)	14	0	(14)
CDX.EM-38 Index	1.000%	12/20/2027	52,700	(4,306)	70	0	(195)
CDX.HY-34 Index	5.000%	06/20/2025	3,094	73	(37)	259	0
CDX.HY-35 Index	5.000%	12/20/2025	990	28	(59)	0	(1,483)
CDX.HY-36 Index	5.000%	06/20/2026	59,499	1,658	(3,943)	0	(1,503)
CDX.HY-37 Index	5.000%	12/20/2026	13,068	346	(383)	715	0
CDX.HY-38 Index	5.000%	06/20/2027	207,504	2,763	6,570	0	(2,749)
CDX.HY-39 Index	5.000%	12/20/2027	412,200	(725)	13,687	0	(2,623)
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2026	300	3	(4)	0	(6)
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2027	111,500	962	511	112	0
CDX.IG-39 Index	1.000%	12/20/2027	186,500	1,039	982	0	(212)
iTraxx Asia ex-Japan IG Series 38 Index	1.000%	12/20/2027	40,400	(2,222)	(771)	0	(124)
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index	5.000%	12/20/2027	EUR 12,900	(202)	247	0	(9)
iTraxx Europe Series 33 Index	1.000%	06/20/2025	16,540	88	(292)	0	(1)
iTraxx Europe Series 37 Index	1.000%	06/20/2027	106,800	(237)	(596)	0	(10)
iTraxx Europe Series 38 Index	1.000%	12/20/2027	35,150	(185)	191	0	(9)
			\$	(13,185)	\$ 15,831	\$ 1,086	\$ (28,178)

金利スワップ

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払 ⁽⁵⁾	3-Month USD-LIBOR	1.270%	11/04/2023	\$ 890,600	\$ (33,085)	\$ (16,566)	\$ 51	\$ 0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.000%	01/26/2024	26,500	(1,225)	(1,225)	0	(2)
支払 ⁽⁵⁾	3-Month USD-LIBOR	1.700%	03/06/2024	59,600	(1,976)	(1,976)	0	(42)
受取	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/18/2024	62,500	2,602	5,305	115	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/16/2025	62,600	4,970	4,970	113	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/18/2025	62,600	4,967	4,967	113	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.000%	06/20/2025	117,800	7,369	9,789	5,696	0
受取	3-Month USD-LIBOR	0.928%	05/06/2026	25,800	3,019	3,019	51	0
受取	3-Month USD-LIBOR	0.940%	06/08/2026	35,000	4,100	4,100	72	0
受取	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2026	251,400	33,694	29,844	535	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.030%	06/17/2026	43,000	4,918	4,918	96	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.010%	06/24/2026	39,800	4,577	4,577	85	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/15/2026	3,300	386	457	7	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.740%	12/16/2026	15,800	1,535	1,535	42	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.380%	01/04/2027	37,200	(4,162)	(4,162)	0	(96)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/11/2027	21,300	(2,219)	(2,219)	0	(46)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/12/2027	13,400	(1,395)	(1,395)	1,376	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.425%	01/18/2027	25,400	(2,807)	(2,807)	0	(53)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.443%	01/18/2027	27,300	(2,997)	(2,997)	0	(64)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.350%	01/20/2027	19,000	2,159	2,159	38	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.418%	01/20/2027	12,700	(1,407)	(1,407)	0	(25)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/20/2027	84,500	(8,905)	(8,609)	0	(175)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.560%	02/05/2027	28,000	3,140	3,140	59	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.580%	02/16/2027	26,400	(2,946)	(2,946)	0	(57)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.450%	02/17/2027	62,000	7,251	7,251	136	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.700%	02/17/2027	248,100	(26,478)	(25,534)	0	(537)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.420%	02/24/2027	46,300	5,470	5,470	64	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.650%	02/24/2027	154,200	(16,767)	(16,204)	0	(174)
支払	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/20/2027	259,700	(19,995)	(36,453)	0	(5,180)
支払	3-Month USD-LIBOR	2.490%	01/09/2028	190,500	(14,750)	(26,747)	23,869	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.280%	03/24/2028	73,200	(10,642)	(10,642)	0	(191)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.235%	05/12/2028	13,100	1,952	1,952	34	0
支払	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2028	366,282	(69,256)	(48,720)	0	(1,804)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.500%	12/15/2028	29,662	(4,285)	(4,953)	0	(90)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.500%	01/12/2029	14,850	2,151	2,151	0	(2,103)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.700%	01/12/2029	54,000	(7,201)	(6,991)	6,855	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.518%	01/20/2029	7,600	(1,096)	(1,096)	0	(21)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/20/2029	10,600	(1,461)	(1,461)	0	(29)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/26/2029	12,700	(1,749)	(1,749)	0	(36)
支払	3-Month USD-LIBOR	3.000%	06/19/2029	275,100	(17,133)	(48,950)	0	(6,856)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/23/2030	14,000	2,048	2,048	45	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.870%	01/23/2030	14,000	1,940	1,940	44	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.610%	02/28/2030	14,100	2,291	2,291	49	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.430%	03/17/2030	31,300	5,469	5,469	107	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/17/2030	9,500	1,790	1,595	30	0
受取	3-Month USD-LIBOR	0.678%	07/29/2030	12,400	2,911	2,911	38	0
受取	3-Month USD-LIBOR	0.674%	08/05/2030	12,000	2,821	2,821	37	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.000%	12/16/2030	7,588	1,640	1,587	25	0
支払	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	13,609	(3,341)	(2,089)	0	(97)
受取	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	335,400	82,108	55,541	1,387	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.450%	07/16/2031	23,600	4,534	4,534	77	0

変動金利 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
受取	3-Month USD-LIBOR	1.370%	07/19/2031	10,500	2,085	2,085	34	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.360%	07/20/2031	15,700	3,128	3,128	52	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.405%	09/07/2031	25,500	5,180	5,180	0	(4,940)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.500%	10/05/2031	15,500	(3,042)	(3,042)	0	(54)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/15/2031	15,400	(2,982)	(2,982)	0	(51)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/22/2031	10,300	(1,997)	(1,997)	0	(35)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.545%	10/26/2031	10,300	(1,990)	(1,990)	0	(35)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.735%	01/12/2032	10,100	(1,800)	(1,800)	1,763	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.655%	01/24/2032	12,700	(2,350)	(2,350)	0	(42)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.768%	02/02/2032	9,600	(1,749)	(1,749)	0	(35)
支払	3-Month USD-LIBOR	2.000%	02/18/2032	23,000	(3,795)	(3,795)	0	(84)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2032	12,800	2,634	2,212	144	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.500%	06/20/2048	7,900	1,673	2,768	148	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.910%	10/17/2049	11,400	3,647	3,653	56	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.895%	10/18/2049	11,400	3,679	3,644	62	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.000%	01/15/2050	8,800	2,642	2,836	53	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.625%	01/16/2050	22,500	8,221	6,724	130	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/22/2050	47,500	16,323	14,566	280	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.625%	02/03/2050	42,500	15,813	12,989	247	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.875%	02/07/2050	2,700	888	868	16	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/17/2050	1,200	469	591	16	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.215%	10/13/2050	14,900	(6,610)	(6,610)	0	(81)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.144%	11/04/2050	9,000	(4,111)	(4,111)	0	(50)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/16/2050	128,700	56,255	43,073	720	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.485%	01/13/2051	13,900	(5,478)	(5,478)	0	(78)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.595%	01/13/2051	14,700	(5,506)	(5,506)	0	(84)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.523%	01/19/2051	8,900	(3,450)	(3,450)	0	(50)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/21/2051	10,400	(3,980)	(3,980)	0	(58)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.590%	02/09/2051	98,800	(37,752)	(37,752)	0	(560)
受取	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/16/2051	386,100	169,197	103,740	2,428	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.945%	06/23/2051	22,200	6,985	6,985	136	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.785%	08/12/2051	13,100	4,574	4,574	76	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.815%	01/24/2052	2,500	(846)	(846)	0	(14)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.867%	01/26/2052	2,500	(822)	(822)	0	(14)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	ZAR 305,500	(9)	252	0	(1)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2024	7,700	(5)	20	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.850%	01/07/2026	50,200	(249)	(249)	0	(6)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.848%	01/11/2026	148,000	(736)	(698)	0	(19)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.915%	02/01/2026	113,400	(570)	(544)	0	(14)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.065%	02/09/2026	57,500	(276)	(282)	0	(7)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.970%	03/10/2026	7,000	23	23	1	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	1,400	0	(5)	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	09/19/2028	626,200	(1,480)	(1,833)	0	(129)
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	06/18/2024	AUD 28,000	289	(2,997)	17	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2024	39,200	(431)	(3,440)	27	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	12/17/2024	41,400	183	(4,433)	31	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	38,850	(345)	(3,937)	33	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.750%	06/17/2026	3,870	(117)	(397)	3	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.000%	03/21/2027	313,890	(9,622)	(37,946)	577	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.453%)	12/29/2023	EUR 4,300	164	164	14	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.425%)	06/28/2024	4,200	219	219	17	0
支払	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	21,000	(771)	(771)	0	(86)
受取	6-Month EURIBOR	(0.395%)	12/30/2024	1,900	132	132	10	0

変動金利 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
受取	6-Month EURIBOR	(0.363%)	06/30/2025	3,500	287	287	21	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.329%)	12/30/2025	2,300	224	224	16	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.294%)	06/30/2026	1,100	120	120	8	0
支払	6-Month EURIBOR	0.700%	04/11/2027	42,300	(3,703)	(3,703)	0	(324)
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027	63,000	(5,678)	(5,678)	0	(484)
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027	63,000	(5,684)	(5,684)	0	(493)
支払	6-Month EURIBOR	1.000%	05/13/2027	85,900	(6,351)	(6,351)	0	(688)
支払	6-Month EURIBOR	1.000%	05/18/2027	41,200	(3,060)	(3,060)	0	(335)
受取	6-Month EURIBOR	(0.150%)	03/18/2030	123,000	25,299	21,738	1,365	0
受取	6-Month EURIBOR	0.150%	06/17/2030	26,800	5,078	5,097	320	0
支払	6-Month EURIBOR	2.000%	09/21/2032	194,130	(16,717)	(19,530)	0	(2,775)
受取 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	1.750%	03/15/2033	241,200	27,271	2,755	3,476	0
受取	6-Month EURIBOR	0.250%	03/18/2050	37,600	16,505	13,493	584	0
支払	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.176%	04/27/2027	¥ 3,890,000	(35)	(35)	5	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	(0.020%)	09/20/2028	67,650,000	10,497	8,911	0	(220)
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.000%	03/15/2029	75,360,000	13,062	12,318	0	(145)
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.400%	06/15/2032	6,300,000	511	502	0	(20)
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042	3,350,000	1,990	968	0	(110)
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.711%	04/27/2042	1,020,000	347	347	0	(36)
支払	BRL-CDI-Compounded	5.830%	01/02/2023	BRL 165,400	(551)	(555)	0	(6)
支払	BRL-CDI-Compounded	5.836%	01/02/2023	128,800	(425)	(425)	0	(5)
支払	BRL-CDI-Compounded	5.855%	01/02/2023	42,900	(137)	(137)	0	(2)
受取	BRL-CDI-Compounded	12.670%	01/02/2023	BRL 13,200	8	8	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.690%	01/02/2023	8,800	5	5	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.740%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.750%	01/02/2023	10,900	5	5	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.760%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.900%	01/02/2023	46,500	12	12	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.930%	01/02/2023	5,800	1	1	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.939%	01/02/2023	23,200	5	5	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.946%	01/02/2023	58,300	12	12	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.960%	01/02/2023	46,500	9	9	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.970%	01/02/2023	76,300	14	14	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.140%	01/02/2025	4,400	(13)	(13)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.160%	01/02/2025	2,900	(9)	(9)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/02/2025	3,600	(8)	(8)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.000%	01/02/2025	9,800	3	3	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.080%	01/02/2025	16,300	9	9	6	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.140%	01/02/2025	8,200	7	7	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.145%	01/02/2025	8,000	7	7	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.160%	01/02/2025	16,400	14	14	6	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.220%	01/04/2027	5,300	(10)	(10)	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.245%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.260%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.700%	01/04/2027	1,400	1	1	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.715%	01/04/2027	5,900	4	4	4	0

変動金利 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	BRL-CDI-Compounded	11.870%	01/04/2027	14,100	22	22	9	0
支払	IBMEXID	7.880%	12/27/2022	MXN 780,300	(180)	(1,753)	0	(495)
支払	IBMEXID	7.640%	01/03/2023	31,200	(8)	(63)	0	(17)
支払	IBMEXID	7.645%	01/03/2023	49,400	(13)	(100)	0	(27)
支払	IBMEXID	7.745%	01/05/2023	33,200	(9)	(73)	0	(19)
支払	IBMEXID	7.805%	02/06/2023	76,600	(30)	(193)	0	(35)
支払	IBMEXID	7.820%	02/06/2023	37,700	(15)	(96)	0	(17)
支払	IBMEXID	6.350%	09/01/2023	39,100	(71)	(68)	0	(4)
受取	IBMEXID	8.675%	04/03/2024	851,700	1,060	1,060	64	0
受取	IBMEXID	8.660%	04/04/2024	352,700	442	442	0	(2)
受取	IBMEXID	8.750%	04/05/2024	265,800	317	317	0	(1)
支払	IBMEXID	5.980%	08/26/2024	11,300	(41)	(30)	0	(1)
支払	IBMEXID	7.670%	03/05/2025	662,400	(1,588)	(3,527)	0	(361)
支払	IBMEXID	7.710%	03/07/2025	435,800	(1,024)	(2,353)	0	(240)
支払	IBMEXID	7.715%	03/07/2025	433,300	(1,016)	(2,342)	0	(239)
支払	IBMEXID	7.570%	03/18/2025	612,000	(1,563)	(3,107)	0	(357)
支払	IBMEXID	5.160%	06/06/2025	39,200	(209)	(209)	4	0
支払	IBMEXID	5.950%	01/30/2026	104,300	(531)	(365)	0	(12)
受取	IBMEXID	8.410%	03/31/2027	102,000	174	174	7	0
受取	IBMEXID	8.730%	04/06/2027	108,200	121	121	8	0
受取	IBMEXID	7.495%	01/14/2032	52,800	298	82	7	0
受取	IBMEXID	7.498%	01/15/2032	218,400	1,231	335	29	0
受取	IBMEXID	8.732%	03/30/2032	54,100	95	95	6	0
受取	IBMEXID	8.701%	03/31/2032	127,000	236	236	14	0
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	2.450%	12/20/2024	\$ 428,400	7,067	7,097	310	0
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	2.350%	01/17/2025	214,000	3,597	3,574	123	0
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	1.600%	01/16/2026	167,700	7,043	4,909	161	0
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	2.300%	01/17/2026	120,700	3,552	3,526	118	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.620%	04/18/2027	26,900	(2,682)	(2,682)	0	(53)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.783%	04/22/2027	20,100	(1,860)	(1,860)	0	(40)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.788%	05/03/2027	20,600	(1,921)	(1,921)	0	(41)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	51,050	(6,742)	(5,892)	0	(102)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	68,850	9,089	6,794	134	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.850%	08/30/2027	24,600	(1,258)	(1,258)	0	(52)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/07/2027	12,500	(529)	(529)	0	(27)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.955%	10/04/2027	25,100	(1,186)	(1,186)	0	(54)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.618%	02/09/2029	4,800	(600)	(600)	0	(12)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	6,100	(1,054)	(889)	0	(16)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	97,910	16,882	12,514	257	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2029	59,920	(7,531)	(3,814)	8	(131)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/08/2029	12,400	(619)	(619)	0	(36)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.100%	09/09/2029	12,400	(581)	(581)	0	(36)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.650%	02/08/2032	16,100	(2,658)	(2,658)	0	(59)

変動金利 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.730%	02/24/2032	15,200	(2,426)	(2,426)	0	(40)	
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.765%	03/16/2032	5,300	(839)	(839)	0	(19)	
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.385%	06/08/2032	10,400	1,172	1,172	37	0	
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	55,640	(11,615)	(6,902)	0	(187)	
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	45,970	9,556	7,800	711	0	
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2032	78,300	(13,027)	(8,752)	0	(273)	
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/06/2032	18,800	(1,153)	(1,153)	0	(71)	
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052	96,100	29,365	20,305	559	0	
受取 ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2033	GBP 75,300	12,646	756	576	0	
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.096%	02/14/2052	5,500	(2,546)	(2,546)	0	(1)	
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.060%	02/21/2052	2,500	(1,178)	(1,178)	0	0	
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.101%	02/21/2052	2,500	(1,155)	(1,155)	0	0	
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.175%	02/28/2052	5,200	(2,322)	(2,322)	0	0	
受取 ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2053	5,500	1,483	(202)	6	0	
受取	UK Retail Price Index	0.000%	09/15/2031	34,900	(4,293)	(4,113)	540	0	
受取	UK Retail Price Index	0.000%	10/15/2031	46,300	(4,995)	(4,935)	719	0	
受取	UK Retail Price Index	0.000%	11/15/2031	23,300	(2,178)	(1,926)	380	0	
						\$ 227,206	\$ (11,119)	\$ 58,955	\$ (32,925)
スワップ契約合計						\$ 210,895	\$ 3,284	\$ 60,139	\$ (61,312)

- (1) ファンドがプロテクションの売り手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に相当する金額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の引き渡しを受けるか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
- (2) インプライド・クレジット・スプレッドは、絶対値で表示され、期末時点の社債、米国地方債またはソブリン債に係るクレジットデフォルトスワップ契約の市場価格を決定する際に利用され、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの債務不履行の可能性またはリスクを表す。特定の参照法人のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買い/売りの原価を反映し、契約締結時に必要な前払金が含まれる可能性がある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。
- (3) 特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払う必要がある可能性のある、またはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性のある潜在的な最大金額。
- (4) クレジットデフォルトスワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合、クレジット・デリバティブの期待債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した絶対値での市場価格の上昇は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。
- (5) この金融商品は効力発生日が先日付である。

2022年10月31日現在

◎店頭金融デリバティブ商品

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益			
						資産	負債		
BOA	11/2022	\$	2,512	AUD	3,883	\$	0	\$	(29)
BOA	11/2022		118	CNH	849		0		(2)
BOA	11/2022		3,449	EUR	3,526		36		0
BOA	11/2022		985	PEN	3,842		0		(24)
BOA	11/2022	ZAR	57,968	\$	3,651		498		0
BOA	11/2022		12,585		730		46		0
BOA	12/2022	PEN	87,093		22,790		1,054		0
BOA	12/2022	\$	1,047	EUR	1,052		0		(5)
BOA	12/2022		3,096	GBP	2,684		0		(3)
BOA	12/2022		43,942	MXN	886,729		330		0
BOA	12/2022		73	PEN	278		0		(3)
BOA	01/2023	ZAR	38,083	\$	2,143		82		0
BOA	03/2023	TWD	231,566		7,865		632		0
BOA	03/2023	ZAR	95,583		5,413		261		0
BOA	05/2023	PEN	26,923		6,862		207		0
BPS	11/2022	AUD	2,912		1,835		0		(27)
BPS	11/2022	IDR	176,115,710		11,270		1		0
BPS	11/2022	\$	18,087	GBP	16,119		472		0
BPS	11/2022		19,114	IDR	285,197,517		0		(883)
BPS	11/2022		37,394	NOK	359,438		0		(2,807)
BPS	11/2022		1,840	PEN	7,138		0		(51)
BPS	11/2022		36,525	SEK	370,111		0		(3,002)
BPS	11/2022	ZAR	175,146	\$	10,906		1,381		0
BPS	12/2022	CNH	1,813		262		14		0
BPS	12/2022	EUR	10,646		10,612		68		0
BPS	12/2022	MXN	12,233		595		0		(15)
BPS	12/2022	\$	9,365	CLP	8,700,000		0		(217)
BPS	12/2022		262	CNY	1,811		0		(13)
BPS	12/2022		11,270	IDR	176,509,731		0		(5)
BPS	12/2022		1,532	PEN	6,078		0		(14)
BRC	11/2022		74,896	JPY	10,811,717		0		(2,156)
BRC	11/2022	ZAR	78,977	\$	4,921		626		0
CBK	11/2022	AUD	8,009		5,104		0		(18)
CBK	11/2022	BRL	293,224		55,697		0		(171)
CBK	11/2022	GBP	2,369		2,668		0		(60)
CBK	11/2022	PEN	9,258		2,325		4		0
CBK	11/2022	\$	1,156	AUD	1,780		0		(17)
CBK	11/2022		56,015	BRL	293,224		0		(147)
CBK	11/2022		13,868	COP	62,570,000		0		(1,083)
CBK	11/2022		1,105	EUR	1,135		17		0
CBK	11/2022		12,594	GBP	11,321		441		0
CBK	11/2022		23	IDR	345,000		0		(1)
CBK	11/2022		240	PEN	928		0		(7)
CBK	11/2022		545		2,120		0		(14)
CBK	11/2022	ZAR	246,179	\$	15,003		1,620		0
CBK	12/2022	CNH	708		102		6		0
CBK	12/2022	MXN	1,362,666		66,837		0		(1,337)
CBK	12/2022	PEN	83,233		19,846		0		(940)
CBK	12/2022	\$	8,906	CLP	8,087,236		0		(390)
CBK	12/2022		102	CNY	708		0		(5)
CBK	12/2022		2,625	PEN	10,257		0		(63)
CBK	12/2022		3,413		13,363		0		(83)
CBK	12/2022		7,121		27,834		0		(176)
CBK	01/2023		8,749	CLP	8,336,943		0		(26)
CBK	01/2023		1,726	PEN	6,931		0		(3)
CBK	01/2023		12,421		48,988		0		(228)
CBK	01/2023		1,957	ZAR	34,282		0		(103)
CBK	02/2023		11,135	BRL	60,092		92		0
DUB	12/2022	ZAR	107,612	\$	6,849		1,012		0
DUB	02/2023		33,493		2,006		197		0
GLM	11/2022	PEN	18,353		4,591		0		(1)

取引相手	決済月	未実現評価損益					
		受渡通貨	受取通貨	資産	負債		
GLM	11/2022	ZAR	63,724		3,970	504	0
GLM	12/2022	\$	151	CLP	136,490	0	(8)
GLM	12/2022		14,377	PEN	57,240	0	(82)
GLM	03/2023	MXN	1,037,938	\$	50,490	0	(459)
GLM	05/2023	\$	4,535	PEN	18,353	3	0
GLM	05/2023	ZAR	58,866	\$	3,522	361	0
JPM	11/2022	BRL	611,420		117,288	794	0
JPM	11/2022	\$	118,205	BRL	611,420	0	(1,711)
JPM	11/2022		336	CNH	2,408	0	(7)
JPM	11/2022		12,484	IDR	187,436,692	0	(490)
JPM	11/2022		13	INR	1,018	0	0
JPM	01/2023		115,808	BRL	611,420	0	(866)
JPM	02/2023		224,351	MXN	4,599,472	2,596	0
MBC	11/2022	AUD	2,188	\$	1,412	13	0
MBC	11/2022	CHF	1,482		1,580	97	0
MBC	11/2022	COP	62,570,000		12,597	0	(150)
MBC	11/2022	EUR	4,304		4,214	0	(40)
MBC	11/2022	GBP	50,318		54,817	0	(3,116)
MBC	11/2022	\$	1,417	AUD	2,188	0	(18)
MBC	11/2022		163	COP	800,585	0	0
MBC	11/2022		11,615	EUR	11,770	18	0
MBC	11/2022		38,798	GBP	35,120	1,637	0
MBC	11/2022		4,550	JPY	682,300	41	0
MBC	12/2022	CNH	915	\$	131	6	0
MBC	12/2022	COP	800,585		162	0	(1)
MBC	12/2022	\$	1,413	AUD	2,188	0	(13)
MBC	12/2022		131	CNY	913	0	(5)
MBC	12/2022		1,721	EUR	1,730	0	(8)
MBC	12/2022		2,250	GBP	1,945	0	(9)
MBC	01/2023	ZAR	24,365	\$	1,354	37	0
MBC	03/2023	TWD	332,849		11,311	914	0
MBC	05/2023	\$	304	CNH	2,041	0	(22)
MYI	11/2022	BRL	132,971	\$	25,165	0	(170)
MYI	11/2022	GBP	309,463		335,743	0	(20,558)
MYI	11/2022	IDR	174,972		12	1	0
MYI	11/2022	\$	22,210	AUD	34,198	0	(342)
MYI	11/2022		25,294	BRL	132,971	41	0
MYI	11/2022		18,343	EUR	18,810	248	0
MYI	11/2022		338,110	GBP	292,205	0	(1,680)
MYI	11/2022		10,082	IDR	149,149,809	0	(546)
MYI	11/2022		53,368	JPY	7,675,094	0	(1,731)
MYI	12/2022	CNH	412	\$	59	3	0
MYI	12/2022	GBP	292,205		338,373	1,667	0
MYI	12/2022	TWD	293,227		9,712	617	0
MYI	12/2022	\$	25,008	BRL	132,971	168	0
MYI	12/2022		59	CNY	411	0	(2)
MYI	01/2023	ZAR	9,917	\$	537	1	0
MYI	02/2023		677,547		37,034	439	0
MYI	03/2023	TWD	302,717		10,279	823	0
MYI	04/2023	ZAR	4,413		238	0	0
RBC	11/2022	\$	3,477	PEN	13,583	0	(78)
SCX	11/2022	CAD	124,031	\$	90,928	0	0
SCX	11/2022	CLP	154,813		168	4	0
SCX	11/2022	COP	63,370,585		14,910	1,961	0
SCX	11/2022	IDR	291,285,429		18,742	103	0
SCX	11/2022	\$	5,494	AUD	8,481	0	(70)
SCX	11/2022		33,178	CAD	45,592	246	0
SCX	11/2022		158	CLP	154,813	6	0
SCX	11/2022		8,340	GBP	7,385	162	0
SCX	11/2022		18,675	IDR	280,138,899	0	(749)
SCX	11/2022		12,127		181,931,834	0	(498)
SCX	11/2022		15,118	NOK	146,545	0	(1,016)
SCX	11/2022		12,521	SEK	128,305	0	(900)
SCX	11/2022		673	ZAR	12,119	0	(14)
SCX	12/2022	CNH	459	\$	66	3	0
SCX	12/2022	TWD	548,129		18,199	1,197	0

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
SCX	12/2022	\$	90,928	CAD	124,009	0	(1)
SCX	12/2022		66	CNY	458	0	(3)
SCX	12/2022		18,742	IDR	291,735,232	0	(122)
SCX	12/2022		199,734	JPY	29,589,031	0	(1)
SCX	12/2022		1,426	PEN	5,570	0	(36)
SCX	01/2023	CLP	154,813	\$	156	0	(6)
SCX	04/2023	ZAR	56,849		3,090	31	0
SOG	11/2022	CHF	3,477		3,674	195	0
SOG	11/2022	EUR	693,317		666,061	0	(19,180)
SOG	11/2022	\$	659,513	EUR	656,575	0	(10,588)
SOG	12/2022	EUR	656,575	\$	660,926	10,621	0
SOG	01/2023	ZAR	18,081		1,019	41	0
TOR	11/2022	\$	57,353	CAD	78,280	34	0
UAG	11/2022	AUD	44,269	\$	28,669	361	0
UAG	11/2022	\$	4,438	AUD	6,848	0	(59)
UAG	11/2022		5,637	EUR	5,805	100	0
UAG	11/2022		8,473	IDR	126,098,943	0	(411)
UAG	11/2022		72,172	JPY	10,373,569	0	(2,381)
UAG	11/2022	ZAR	135,711	\$	8,649	1,268	0
UAG	11/2022		64,863		3,970	445	0
UAG	12/2022	\$	28,692	AUD	44,269	0	(360)
UAG	12/2022		12,354	MXN	247,871	21	0
UAG	03/2023	ZAR	71,825	\$	4,019	150	0
外国為替先渡し契約合計						\$ 37,075	\$ (82,636)

● 買建オプション 金利スワップション

単位:千

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.243%	08/05/2024	52,000	\$ 702	\$ 219
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.243%	08/05/2024	52,000	702	1,566
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.110%	07/26/2032	10,500	1,701	770
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.110%	07/26/2032	15,300	2,479	2,537
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.053%	07/20/2023	154,200	925	104
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	431
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.590%	07/19/2024	109,300	1,503	609
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.400%	07/20/2027	12,100	1,597	815
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.170%	07/19/2032	12,100	1,919	923
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.053%	07/20/2023	154,200	925	2,331
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	2,128
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.590%	07/19/2024	109,300	1,503	2,794
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.400%	07/20/2027	13,600	1,795	2,399
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.170%	07/19/2032	13,600	2,157	2,188
買建オプション合計						\$ 20,220	\$ 19,814	

● 売建オプション
金利スワップション

単位:千

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.150%	12/01/2023	55,600	\$ (172)	\$ (39)
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	12/01/2023	55,600	(172)	(501)
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.550%	04/11/2023	12,800	(13)	0
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.700%	04/28/2023	69,500	(121)	(2)
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.100%	04/11/2023	12,800	(39)	(123)
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.250%	04/28/2023	69,500	(121)	(591)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(31)
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(211)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(42)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(55)
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.750%	12/14/2022	24,600	(189)	(13)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(512)
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(315)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	12/14/2022	24,600	(189)	(600)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(63)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(91)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(426)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(527)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.550%	04/05/2023	71,800	(134)	(1)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.550%	04/11/2023	95,400	(182)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.700%	04/24/2023	70,000	(75)	(2)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.700%	04/26/2023	65,600	(116)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	受取	0.550%	05/15/2023	63,400	(111)	(2)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD- LIBOR	受取	0.870%	11/02/2022	2,294,300	(4,567)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD- LIBOR	受取	1.270%	11/02/2022	383,600	(19)	0
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.765%	07/25/2023	67,000	(419)	(32)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(42)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(45)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.190%	10/23/2023	27,700	(193)	(47)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(49)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(38)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(33)

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.250%	11/17/2023	54,600	(198)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.150%	11/20/2023	54,500	(190)	(35)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.250%	12/07/2023	55,600	(174)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(127)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(66)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.100%	04/05/2023	71,800	(134)	(685)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.100%	04/11/2023	95,400	(182)	(918)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.250%	04/24/2023	70,000	(198)	(591)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.250%	04/26/2023	65,600	(116)	(557)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	支払	2.100%	05/15/2023	63,400	(111)	(624)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD- LIBOR	支払	1.270%	11/02/2022	1,910,700	(3,800)	(70,932)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.765%	07/25/2023	67,000	(419)	(1,180)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(512)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(390)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(359)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.190%	10/23/2023	27,700	(192)	(348)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(341)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(393)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(417)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(362)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(396)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	11/17/2023	54,600	(198)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	11/20/2023	54,500	(190)	(497)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	12/07/2023	55,600	(174)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(847)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(411)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.468%	07/25/2023	14,200	(339)	(900)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(44)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(45)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(41)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(71)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(70)

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.800%	12/15/2022	24,600	(200)	(17)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(69)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(68)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(1,017)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(1,010)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(454)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(772)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(801)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.700%	12/15/2022	24,600	(200)	(547)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(582)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(588)
							\$ (25,144)	\$ (93,711)

クレジットデフォルトスワップション

単位:千

取引相手	銘柄	プロテクション 買い/売り	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
BPS	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	14,800	\$ (18)	\$ (1)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	12,690	(16)	0
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	2.000%	12/21/2022	14,100	(35)	(4)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	12/21/2022	28,500	(35)	(10)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	12/21/2022	29,200	(43)	(9)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	11/16/2022	58,300	(66)	(3)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.500%	12/21/2022	58,300	(90)	(14)
GST	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	3.000%	03/15/2023	28,000	(50)	(12)
JPM	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	11/16/2022	30,500	(37)	(1)
JPM	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	15,590	(14)	(1)
MYC	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.600%	12/21/2022	15,500	(23)	(3)
						\$ (427)	\$ (58)

有価証券オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
JPM	Put - Fannie Mae**	\$ 99.406	11/07/2022	20,100	\$ (157)	\$ (1,128)
SAL	Put - Fannie Mae**	98.375	11/07/2022	14,000	(78)	(642)
SAL	Put - Fannie Mae**	98.406	11/07/2022	14,000	(79)	(646)
					\$ (314)	\$ (2,416)

金利キャップ付オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使レート	変動金利 インデックス	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	\$ (897)	\$ (1,720)
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	(897)	(383)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(2,469)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(264)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,350)	(2,289)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,351)	(610)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(3,180)
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(985)
						\$ (10,669)	\$ (11,900)
売建オプション合計						\$ (36,554)	\$ (108,085)

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)ープロテクションの買い⁽³⁾

単位:千

取引相手	参照債務	支払		2022/10/31時点の 信用スプレッド ⁽⁴⁾	想定元本 ⁽⁵⁾	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日					資産	負債
BOA	HSBC Holdings PLC	(1.000)%	06/20/2024	1.273%	EUR 200	\$ 3	\$ (3)	\$ 0	\$ 0

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－プロテクションの売り⁽⁴⁾

単位:千

取引相手	参照債務	受取 固定金利	満期日	2022/10/31時点の 信用スプレッド ⁽⁶⁾	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 2,700	\$ (89)	\$ 94	\$ 5	\$ 0
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	100	(7)	3	0	(4)
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	200	(18)	4	0	(14)
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	5,800	(654)	105	0	(549)
BPS	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	24,100	(1,080)	1,125	45	0
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	3,400	(163)	(144)	0	(307)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	700	(62)	(11)	0	(73)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(15)	6	0	(9)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2025	6.209%	400	(69)	22	0	(47)
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	7,100	(280)	294	14	0
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.672%	8,400	(433)	460	27	0
BRC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	4,800	(221)	(136)	0	(357)
BRC	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.469%	10,525	(24)	44	20	0
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	1,600	(108)	38	0	(70)
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	3,370	(300)	63	0	(237)
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	25,410	(3,166)	761	0	(2,405)
BYL	Banca Monte Dei Paschi Di Siena SpA	5.000%	12/20/2022	6.023%	EUR 400	(13)	14	1	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 6,100	(237)	249	12	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	21,800	(376)	226	0	(150)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.131%	400	1	(1)	0	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2024	2.134%	1,500	(15)	(9)	0	(24)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2024	2.298%	4,300	17	(123)	0	(106)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	5,900	(275)	(164)	0	(439)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	1,500	(54)	(77)	0	(131)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	400	(36)	8	0	(28)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,400	(146)	13	0	(133)
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.638%	400	(18)	(5)	0	(23)
DUB	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,700	(196)	35	0	(161)
FBF	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	800	(31)	32	1	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	10,000	(103)	122	19	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.255%	1,300	(42)	38	0	(4)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	16,700	(260)	144	0	(116)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2023	1.824%	4,700	(70)	33	0	(37)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	4,200	(156)	(223)	0	(379)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	1,900	(169)	(30)	0	(199)
GST	Equinix, Inc.	5.000%	06/20/2027	1.586%	3,800	531	20	551	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.378%	2,800	(54)	10	0	(44)
GST	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.532%	30,310	(230)	355	125	0
GST	Petrobras Global Finance BV	1.000%	12/20/2022	0.823%	2,200	(125)	128	3	0
GST	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.716%	11,600	(495)	379	0	(116)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	1,100	(100)	23	0	(77)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	12,000	(1,342)	206	0	(1,136)
JPM	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	400	(15)	(21)	0	(36)
JPM	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(14)	5	0	(9)
MBC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,300	(142)	19	0	(123)

取引相手	参照債務	受取		2022/10/31時点の		プレミアム 支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日	信用スプレッド ⁽⁶⁾	想定元本 ⁽⁶⁾			資産	負債
MYC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	13,800	(479)	505	26	0
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	4,500	(162)	(244)	0	(406)
MYC	Colombia Government International Bond South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	5,200	(464)	(83)	0	(547)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	900	(100)	36	0	(64)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	900	(101)	16	0	(85)
						\$ (12,760)	\$ 4,176	\$ 849	\$ (9,433)

クレジットデフォルトスワップ(クレジット・インデックス)ープロテクションの売り⁽⁴⁾

単位:千

取引相手	インデックス/ トランシェ	受取		想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価 ⁽⁷⁾		
		固定金利	満期日				資産	負債	
BOA	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	\$ 7,292	\$ (1,419)	\$ 1,347	\$ 0	\$ (72)	
BOA	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	62	(1)	2	1	0	
BOA	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	3,400	(106)	1	1	0	
DUB	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	5,440	(235)	237	2	0	
DUB	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,221	(421)	395	0	(26)	
DUB	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	66,100	(300)	(44)	0	(344)	
FBF	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	84	(2)	2	0	0	
FBF	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	2,900	(180)	181	1	0	
FBF	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,618	(513)	486	0	(27)	
FBF	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	79,000	(422)	(304)	0	(726)	
FBF	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	17,500	(123)	(122)	0	(245)	
GST	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	107	1	1	2	0	
GST	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	22,600	(628)	625	0	(3)	
GST	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	46,895	(1,600)	1,503	0	(97)	
GST	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	126,300	(1,397)	740	0	(657)	
GST	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	110,100	614	(1,623)	0	(1,009)	
GST	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	6,300	(7)	(115)	0	(122)	
GST	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	6,600	(56)	(159)	0	(215)	
JPS	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	4,173	(171)	163	0	(8)	
JPS	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	5,400	(101)	73	0	(28)	
JPS	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	28,300	(224)	(36)	0	(260)	
MEI	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	21	0	0	0	0	
MEI	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	1,166	(64)	64	0	0	
MEI	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	16,200	(870)	868	0	(2)	
MEI	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	15,499	(657)	625	0	(32)	
MYC	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	7	(1)	1	0	0	
MYC	CDX.HY-33 Index	5.000%	12/20/2024	78,427	13,071	(5,433)	7,638	0	
MYC	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	38	(1)	1	0	0	
MYC	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	10,432	(515)	493	0	(22)	
MYC	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	63,200	(1,929)	1,600	0	(329)	
MYC	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	60,700	(517)	(28)	0	(545)	
MYC	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	30,300	(12)	(605)	0	(617)	
MYC	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	13,200	(112)	(318)	0	(430)	
SAL	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	88,923	(557)	371	0	(186)	
SAL	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	93,105	(573)	89	0	(484)	
SAL	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	286,300	(1,597)	(1,031)	0	(2,628)	
SAL	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	102,000	(464)	(964)	0	(1,428)	
UAG	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	583	(26)	26	0	0	
UAG	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	1,600	(96)	95	0	(1)	
						\$ (2,211)	\$ (687)	\$ 7,645	\$ (10,543)

トータル・リターン・スワップ

単位:千

取引相手	参照組織に係るトータル・リターン・スワップの支払/受取	参照組織	株式数 または ユニット数	変動金利	想定元本	満期日	プレミアム 支払額 (受取額)	スワップ契約時価			
								未実現 評価損益	資産	負債	
BOA	受取	iBoxx USD Liquid High Yield Index	N/A	Secured Overnight Financing Rate Index	\$ 600	03/20/2023	\$ (1)	\$ 13	\$ 12	\$ 0	
JPM	受取	iBoxx USD Liquid High Yield Index	N/A	Secured Overnight Financing Rate Index	2,100	12/20/2022	(9)	(16)	0	(25)	
MYC	受取	iBoxx USD Liquid High Yield Index	N/A	Secured Overnight Financing Rate Index	2,100	12/20/2022	(9)	3	0	(6)	
							\$ (19)	\$ 0	\$ 12	\$ (31)	
スワップ契約合計							\$ (14,987)	\$ 3,486	\$ 8,506	\$ (20,007)	

** 発行日前取引証券に係るオプション

- (1) 想定元本は契約数を表す。
- (2) 原金融商品は効力発生日が先日付である。詳細情報は財務書類に対する注記の注記2「有価証券取引および投資収益」を参照。
- (3) ファンドがプロテクションの買い手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの売り手からスワップの想定元本に相当する金額を受け取り参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券を引き渡すか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。
- (4) ファンドがプロテクションの売り手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に相当する金額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の引き渡しを受けるか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
- (5) インプライド・クレジット・スプレッドは、絶対値で表示され、期末時点の社債、米国地方債またはソブリン債に係るクレジットデフォルトスワップ契約の市場価格を決定する際に利用され、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの債務不履行の可能性またはリスクを表す。特定の参照法人のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買い/売りの原価を反映し、契約締結時に必要な前払金が含まれる可能性がある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。
- (6) 特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払う必要がある可能性のある、またはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性のある潜在的な最大金額
- (7) クレジットデフォルトスワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合、クレジット・デリバティブの期待債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した絶対値での市場価格の上昇は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

運用計算書

2022年10月31日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:	
受取利息(外国税額控除後)	\$ 445,562
受取配当(外国税額控除後)	868
雑収入	11
収益合計	446,441
費用:	
投資顧問報酬	0
管理報酬	0
支払利息	417
雑費用	0
費用合計	417
純投資損益	446,024
当期実現損益:	
投資有価証券	(531,587)
関連投資	0
上場金融デリバティブ商品	193,654
店頭金融デリバティブ商品	271,858
外貨通貨	(3,334)
当期実現損益	(69,409)
当期末実現評価損益:	
投資有価証券	(1,632,829)
関連投資	0
上場金融デリバティブ商品	53,628
店頭金融デリバティブ商品	(146,457)
外貨建資産および負債	15,202
当期末実現評価損益	(1,710,456)
当期実現および未実現評価損益	(1,779,865)
運用の結果による純資産の増減額	\$ (1,333,841)
外国税	\$ 391

金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

野村マネーポートフォリオ マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2023年7月11日）

作成対象期間（2022年7月12日～2023年7月11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。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行いません。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
	円		%	%	%	百万円
11期(2019年7月11日)	10,058		△0.0	57.9	—	124
12期(2020年7月13日)	10,055		△0.0	62.0	—	37
13期(2021年7月12日)	10,048		△0.1	55.0	—	1,836
14期(2022年7月11日)	10,045		△0.0	52.2	—	38
15期(2023年7月11日)	10,042		△0.0	58.8	—	40

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドでは、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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

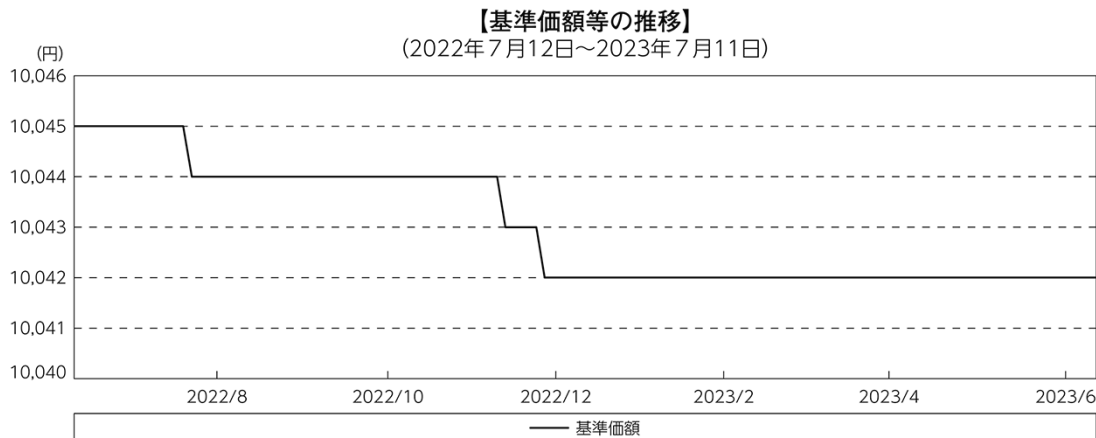
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2022年7月11日	円 10,045		% —	% 52.2	% —
7月末	10,045		0.0	52.3	—
8月末	10,044		△0.0	58.3	—
9月末	10,044		△0.0	57.0	—
10月末	10,044		△0.0	55.8	—
11月末	10,044		△0.0	61.2	—
12月末	10,042		△0.0	61.0	—
2023年1月末	10,042		△0.0	61.1	—
2月末	10,042		△0.0	61.1	—
3月末	10,042		△0.0	60.9	—
4月末	10,042		△0.0	56.7	—
5月末	10,042		△0.0	57.2	—
6月末	10,042		△0.0	58.8	—
(期末) 2023年7月11日	10,042		△0.0	58.8	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、消費や雇用環境など景気全般に持ち直しの動きが見られました。このような中、日銀は2022年12月の金融政策決定会合で、長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を一部見直し、長期金利の許容変動幅を±0.5%と、従来の±0.25%から拡大することを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね-0.1%～-0.2%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01%～-0.08%程度で推移しました。

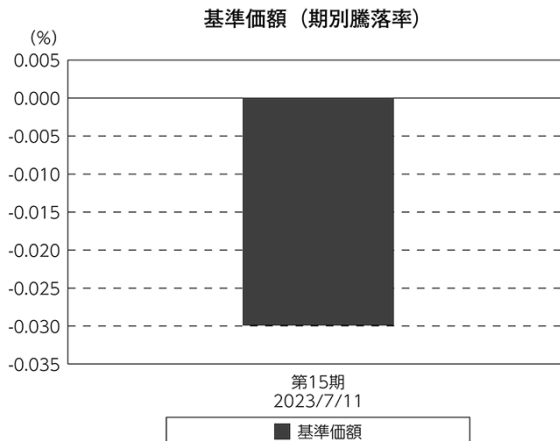
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、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。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日銀によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年7月12日～2023年7月11日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年7月12日～2023年7月11日)

公社債

		買付額	売付額
国内	特殊債券	千円 28,136	千円 — (24,000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年7月12日～2023年7月11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11日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率				
					5年以上	2年以上	2年未満		
特殊債券 (除く金融債)	千円 24,000 (24,000)	千円 24,008 (24,008)	% 58.8 (58.8)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 58.8 (58.8)		
合計	24,000 (24,000)	24,008 (24,008)	58.8 (58.8)	— (—)	— (—)	— (—)	58.8 (58.8)		

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
日本政策金融公庫債券 政府保証第26回	0.911	22,000	22,006	2023/7/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	0.835	2,000	2,002	2023/8/31
合計		24,000	24,008	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年7月11日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 24,008	% 58.8
コール・ローン等、その他	16,821	41.2
投資信託財産総額	40,829	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月11日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	40,829,856
コール・ローン等	16,755,726
公社債(評価額)	24,008,745
未収利息	65,385
(B) 負債	13
未払利息	13
(C) 純資産総額(A-B)	40,829,843
元本	40,660,592
次期繰越損益金	169,251
(D) 受益権総口数	40,660,592口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,042円

(注) 期首元本額は38,270,791円、期中追加設定元本額は4,879,161円、期中一部解約元本額は2,489,360円、1口当たり純資産額は1.0042円です。

○損益の状況 (2022年7月12日~2023年7月11日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	182,439
受取利息	188,437
支払利息	△ 5,998
(B) 有価証券売買損益	△194,449
売買損	△194,449
(C) 当期損益金(A+B)	△ 12,010
(D) 前期繰越損益金	171,062
(E) 追加信託差損益金	20,839
(F) 解約差損益金	△ 10,640
(G) 計(C+D+E+F)	169,251
次期繰越損益金(G)	169,251

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
財形給付金ファンド	34,251,580
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	1,003,293
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	998,495
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	997,887
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	997,001
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	997,000
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)毎月分配型	996,337
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	100,755
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	99,927
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	99,898
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,985
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)年2回決算型	9,978
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,978

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ブラックロック世界REITファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,955
野村ブラックロック世界REITファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,955
NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50連動型上場投信	9,938
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Eコース	9,937
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Fコース	9,937
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド(為替ヘッジあり)	9,936
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,935
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,935
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド(為替ヘッジなし)	4,974
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Cコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Dコース	994

○お知らせ

該当事項はございません。