

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年9月18日

【計算期間】 第30特定期間（自 2019年12月21日 至 2020年6月22日）

【ファンド名】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
（愛称：BR Win）

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03-6703-7940

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

（注）本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」（ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行ないます。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信／海外／債券に属しています。下記は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

<商品分類表>

単体型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単体型投信 追加型投信	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産（ ） 資産複合

<属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 不動産投信 その他資産 (投資信託証券(債券)) 資産複合 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回(毎月) 日々 その他	グローバル (日本を含む) 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり () なし

< 各分類および区分の定義 >

・ 商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	海外	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	債券	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

・ 属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券（債券））	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。ただし、当ファンドは、投資信託証券を通じて主として債券に投資する。
決算頻度による属性区分	年12回（毎月）	目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	グローバル（日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。

上記は、一般社団法人投資信託協会の定義を基に委託会社が作成したものを含みます。なお、上記以外の商品分類・属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

信託金の限度額は、5,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

- a. 主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。

主要投資対象ファンドの投資対象

<p>先進国の国債・政府機関債</p> <p>先進国の政府または政府機関等により発行される債券</p>	<p>エマージング諸国のソブリン債</p> <p>エマージング諸国の政府等により発行される債券</p>	<p>先進国の地方債</p> <p>先進国の地方自治体により発行される債券</p>
<p>資産担保証券 (ABS、MBS等)</p> <p>クレジットカード債権、自動車ローン、住宅ローン債権等を裏付けとして発行される債券</p>	<p>投資適格社債</p> <p>企業等により発行される債券のうち信用格付けが高い (BBB格以上)とされる債券</p>	<p>ハイ・イールド債</p> <p>信用格付が低く (BB格相当以下もしくは格付けされていない)、価格変動のリスクが大きい分、高い利回りが期待される債券</p>

主要投資対象ファンドにおいては、各セクターへの投資割合に制限を設けません。したがって、資産担保証券についても投資適格・非投資適格にかかわらず相当割合の投資を行なうことができます。また、投資する資産担保証券の中には収益率向上のためデリバティブ取引等を活用するものも含まれます。資産担保証券への投資に伴う「期限前償還リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、その他当ファンドにかかる投資リスクについては後述の投資リスクの記載の内容をご確認ください。主要投資対象ファンドの投資対象は今後変更となることがあります。

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

特定の市場指数にとらわれないアクティブかつフレキシブルな運用により、収益率の向上、インカム収入の獲得を目指します。

■柔軟性の高い運用

- ・セクター間の相関や各市場に対する連動性に配慮し、価格変動を抑え、魅力的な収益率やインカム収入の確保を目指します。
- ・償還年限、セクター、地域配分、通貨配分等に制約を設けず、運用チームの判断による柔軟な運用を目指します。

■リスクコントロール

- ・投資しているセクターにおけるリスクを様々な面からモニターします。デリバティブ取引等を利用し、リスクコントロールを行ないます。

※上記は主要投資対象ファンドにおける投資アプローチを説明するものです。将来変更される可能性があります。

- b. 投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。
- ・ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。)
 - ・ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)
- 投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

- c. 当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託

会社が決定します。通常、BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）への投資比率を高位に保ちます。

d．原則として、毎月分配を行いません。

毎月20日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行ない、分配金をお支払いします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

【イメージ図】



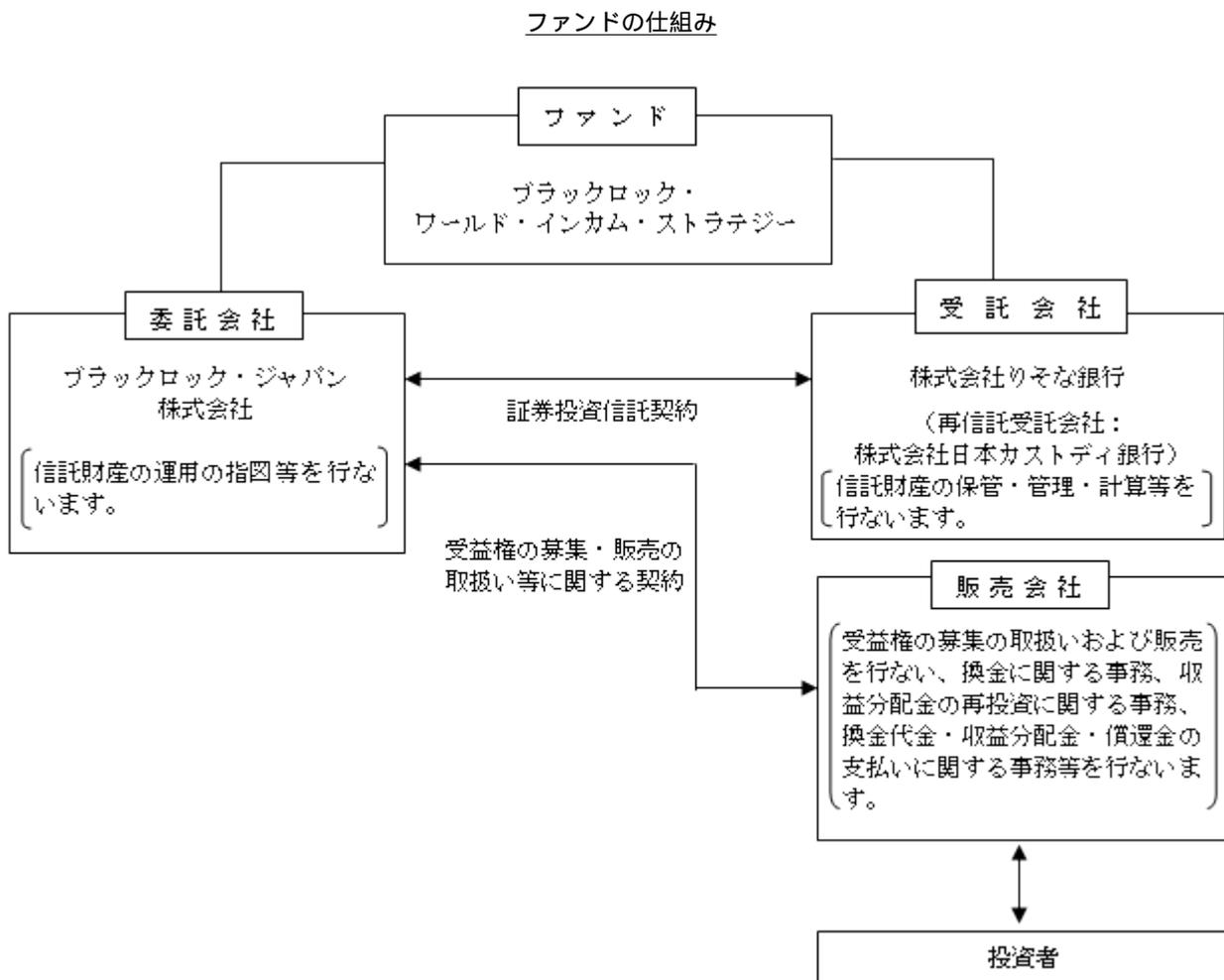
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

2005年7月7日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2006年10月1日	ファンド名称を変更 「メリルリンチ・ワールド・インカム・ストラテジー」から「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」へ変更
2007年1月4日	投資信託振替制度への移行
2009年12月2日	ファンドの委託会社としての業務をブラックロック・ジャパン株式会社からパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社（新社名：ブラックロック・ジャパン株式会社）に承継

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

委託会社が販売会社に委託する受益権の募集販売の取扱い、換金事務、投資者に対する収益分配金および換金代金の支払い、その他これらの業務に付随する業務等について規定しています。

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2020年6月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

1985年1月	メリルリンチ投資顧問株式会社 (後のメリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社)設立 1987年3月 証券投資顧問業者として登録 1987年6月 投資一任業務認可を取得 1997年12月 投資信託委託業務免許を取得
1988年3月	パークレイズ・デズート・ウェッド投資顧問株式会社 (後のパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社)設立 1988年6月 証券投資顧問業者として登録 1989年1月 投資一任業務認可を取得 1998年3月 投資信託委託業務免許を取得
1999年4月	野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社 (後のブラックロック・ジャパン株式会社)設立 1999年6月 証券投資顧問業者として登録 1999年8月 投資一任業務認可を取得
2006年10月	メリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」
2009年12月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」

c . 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	15,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。投資対象とする投資信託証券は別に定めるものとします。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決めます。通常、ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券への投資比率を高位に保ちます。

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

投資対象ファンドの選定にあたっては、上記の投資方針の他、当ファンドの運営上の効率性等を勘案します。

委託会社は、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行ないまたは行なうことがある場合、投資者の利益を害しないことを確保するため、売買執行管理規程等の社内規程により管理します。

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- a．有価証券
- b．金銭債権
- c．約束手形（手形割引市場において売買される手形に限ります。）

投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）および投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- a．国債証券
- b．短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、保険業法第61条の10第1項に規定する短期社債、資産の流動化に関する法律第2条第8項に関する特定短期社債、信用金庫法第54条の4第1項に規定する短期債および農林中央金庫法第62条の2第1項に規定する短期農林債をいいます。）
- c．コマーシャル・ペーパー
- d．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- e．外国法人が発行する譲渡性預金証書

投資対象とする金融商品

この信託の設定、換金、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

- a．預金
- b．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c．コール・ローン
- d．手形割引市場において売買される手形

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

- (a) BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	<p>ファンドはトータル・リターンを最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。</p> <p>また、ファンドは、投資適格、非投資適格に係わらず、資産担保証券（ABS、MBS）に純資産の100%を上限として投資を行なうことができます。</p> <p>なお、ファンドは中国の規制により許容される方法により、中国本土に流通する債券に純資産の20%を上限として投資することができます。</p>
設定日	2007年1月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・ 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	ありません。（注）
その他費用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として8月末日）に決算を行ないます。
収益分配方針	毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行ないます。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド（副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ

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

(b) B G F U Sダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

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

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

(3) 【運用体制】

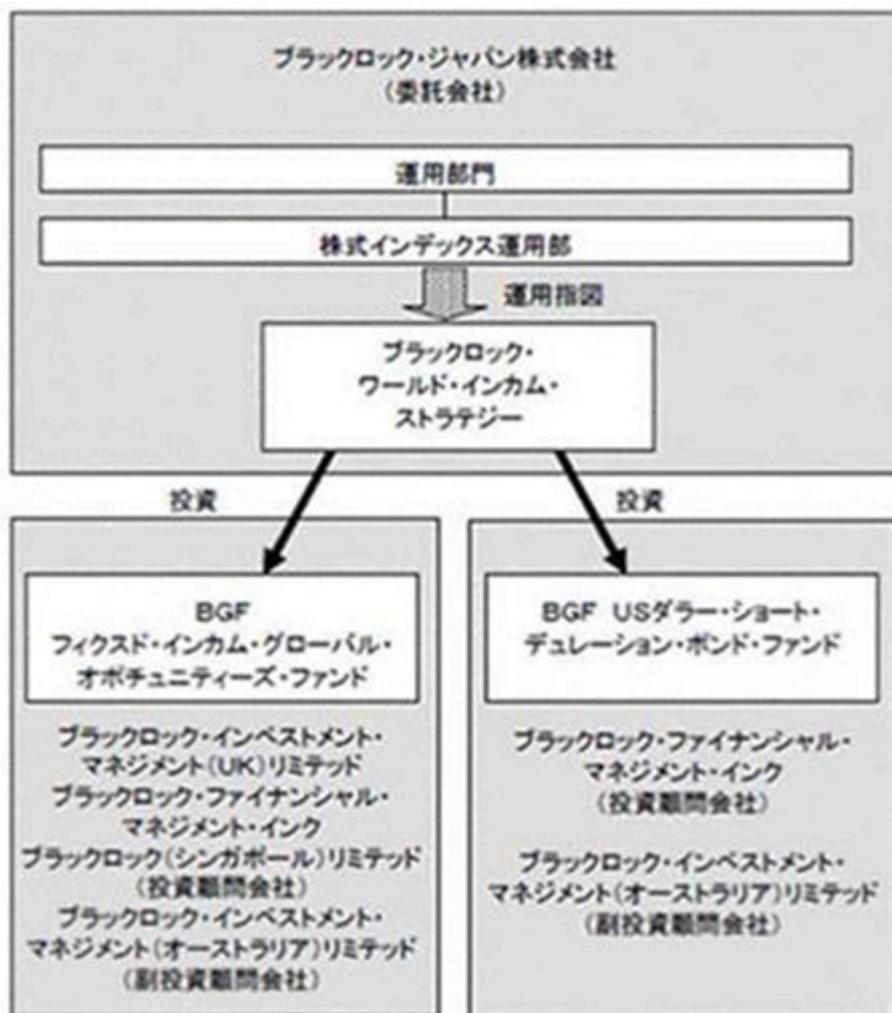
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

社内には内部監査を担当する部門、ファンドの運用状況やリスク状況等をモニターし関連部署にフィードバックする部門、或いは投資委員会等開催により、各ファンドの投資方針等にしながら運用が行なわれているか確認する組織、機能が確立しています。

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。

基本戦略は、週次で行なわれる2つのインベストメント・ストラテジー・ミーティング（投資戦略会議）が中核となっています。マーケット・アウトルック・ミーティングには全ての債券運用プロフェッショナルが参加し、各セクター・チームにて事前に開催するチーム・ミーティングによって導き出された見解を、各チームのリード・マネジャーが発表します。次に、全チームのリード・マネジャーおよびリスク・クオンツ分析部門の代表者が参加するポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングにおいて、セクター配分、ポートフォリオのリスク、投資テーマ等について議論を行ないます。

各ポートフォリオ・チームは、運用を担当するポートフォリオにとって適切と考える金利リスク、期限前償還リスク、利回りカーブ・リスク、信用リスク、流動性バイアス、およびセクター・アロケーションをそれぞれ独自に決定しますが、ポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングでは各ポートフォリオ・チームの投資アイデアを共有することを主な目的とします。

ファンダメンタル債券運用部門は、セクター・チームと協働して、ポートフォリオの投資目的およびガイドラインを遵守しつつ、銘柄選択、タイミング、売買執行において、チームのレラティブ・バリューによる見通しをポートフォリオに反映します。ファンダメンタル債券運用部門は投資方針を策定し、その投資方針に基づいてセクター・スペシャリストが売買を執行します。投資テーマについては、週次で開催されるミーティングで定期的に議論かつ継続的に議論され、必要に応じて修正されます。

ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約7.32兆ドル（約789兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

* 2020年6月末現在。(円換算レートは1ドル=107.885円を使用)

(4)【分配方針】

収益分配方針

月1回の毎決算時(原則として毎月20日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。

a. 分配対象額の範囲

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額とします。

b. 分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c. 留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。

収益の分配

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

(a) 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、諸費用(消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額(以下「消費税等相当額」といいます。))を含みます。以下同じ。)、信託報酬(消費税等相当額を含みます。以下同じ。)を控除した後、その残額を投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、諸費用および信託報酬を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越すものとします。

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として5営業日以内)に、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者にお支払いを開始します。収益分配金は販売会社の営業所等において支払います。

(b) 累積投資コースの場合

委託会社は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は累積投資契約^{*}に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売り付けを行ないます。

^{*} 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

b. 時効

投資者が、a.(a)に規定する支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



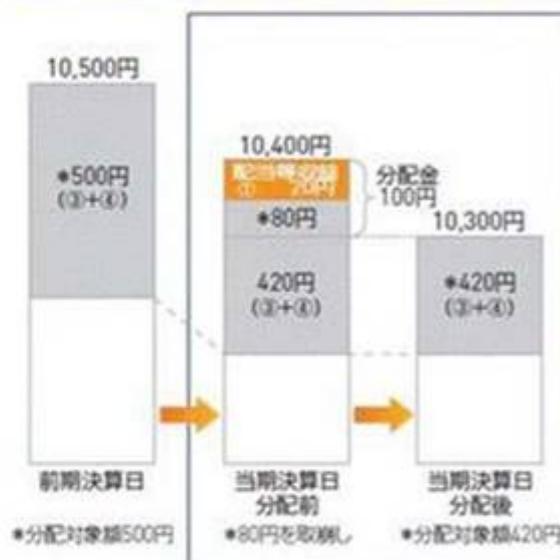
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

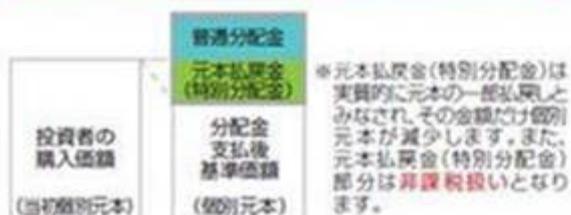


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

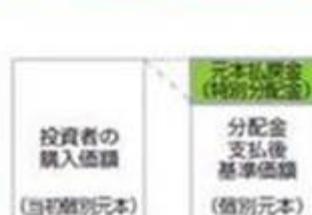
※ 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より計算期間中の基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

※ 普通分配金に対する課税については、後記「手続・手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。

(5) 【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

約款および定款等においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得される（販売会社および運用会社が一時取得する場合を含みます。）投資信託証券であることが記載されていない同一銘柄の投資信託証券への投資割合は信託財産の純資産総額の50%以内とします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により、特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- b. 換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行ないます。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組入れられている有価証券の値動きの他、為替変動による影響を受けます。これらの信託財産の運用によりに生じた損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。政治、経済、社会情勢等の影響により金利が上昇すれば債券の価格は下落し、金利が低下すれば債券の価格は上昇します。したがって、金利の変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

b．信用リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。投資した債券の発行体の財務状況により、債務不履行が生じることがあります。債務不履行が生じた場合には、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、債券の外部格付の変更により債券の価格が変動することがあり、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

当ファンドの投資対象ファンドは、信用格付が低い、または格付されていない公社債に純資産の相当部分を投資することができます。これらの種類の証券はより高い利回りを提供する可能性があるものの、格付が比較的高い証券に比べてより投機的であり、価格の変動がより激しく、債券投資の元本や金利収入を脅かすリスクも大きくなります。

c．期限前償還リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、MBS、CMBS、ABS等（資産担保証券）の期限前償還リスクを伴う債券へ投資することができます。一般的に金利が低下した場合、資産担保証券の期限前償還が増加することにより、事前に見込まれた収益をあげることができず、さらに利回りの低い証券に再投資せざるを得ない可能性があります。これらの要因が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

d．為替変動リスク

当ファンドは、外貨建ての投資信託証券を投資対象とします。当該投資信託証券に対して為替ヘッジを行いません。また、当ファンドの投資対象ファンドは、外貨建資産に投資を行いません。したがって、為替レートの変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

e．カンントリー・リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、エマージング（新興）市場の発行体が発行する公社債にも投資します。エマージング諸国の経済は、先進諸国に比べて不安定であり、その市場を取り巻く社会的・経済的環境はより不透明な場合が多く、エマージング諸国の政府は自国経済を規制または監督する上で大きな影響力を行使することがあります。したがって、主として先進国市場に投資する場合に比べて、投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、より大幅に公社債の価格が変動することが考えられ、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

f. デリバティブ取引のリスク

当ファンドの投資対象ファンドは、先物・オプション取引などのデリバティブ取引を用いることができます。また、当ファンドの主要投資対象ファンドが投資する資産担保証券においてデリバティブ取引が用いられることがあります。このような投資手法は現物資産への投資に代わって運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による影響から投資対象ファンドを守るために用いられます。デリバティブ取引を用いた結果、取引コストと投資元本を脅かすリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付を取り消す場合があります。

b. ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により受益権の口数が30億口を下回るようになった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年7月～2020年6月)



※上記グラフは、2015年7月～2020年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国国債…J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2015年7月～2020年6月)



※上記グラフは、2015年7月～2020年6月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<各指数について>

東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株)東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発、計算した株価指数です。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は日本を除く世界の主要先進国の株式を、また、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は新興国の株式を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

購入時手数料は、購入時の商品説明、販売に関する事務手続き等の役務の対価として販売会社にお支払いいただくものです。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.584%（税抜1.44%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.715% (税抜0.65%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.825% (税抜0.75%)	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、購入後の情報提供等
受託会社	年0.044% (税抜0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

委託会社および販売会社に対する信託報酬は、ファンドから委託会社に対して支弁されます。信託報酬の販売会社への配分は、ファンドから委託会社に支弁された後、委託会社より販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は、ファンドから受託会社に対して支弁されます。

(4)【その他の手数料等】

信託財産において換金代金等の支払資金に不足が生じるときに資金借入れの指図を行なった場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、投資者の負担とし、その都度、信託財産中から支弁します。

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます）および諸費用に係る消費税等相当額は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

- 1．受益権の管理事務に関連する費用
- 2．有価証券届出書、有価証券報告書等法定提出書類の作成、印刷および提出に係る費用
- 3．目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
- 4．信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
- 5．運用報告書の作成、印刷、交付および提出に係る費用
- 6．公告に係る費用ならびに信託約款の変更またはファンドの償還に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
- 7．この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、年0.11%（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

外貨建資産の保管等に要する費用^{*}等は、その都度、信託財産中より支弁します。

^{*} 海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用

投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用が別途投資対象ファンドから支払われます。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

日本の居住者（法人を含む。）である投資者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

個別元本方式について

- a．追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行なわれる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

換金時および償還時の課税について

- a．個人の投資者の場合
換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。
- b．法人の投資者の場合
換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。原則として、申告は不要です。

また、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除なし）と申告分離課税（20.315%（所得税15.315%、地方税5%））のいずれかを選択することができます。

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

換金時および償還時の差益（換金価額および償還価額から購入費用（購入時手数料および当該購入時手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）は、譲渡益として課税対象（譲渡所得等）となり、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

換金時および償還時に損失（譲渡損）が生じた場合には、確定申告することで、他の株式等の譲渡益、上場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得の金額（申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、換金時および償還時の差益（譲渡益）については、他の株式等の譲渡損と損益を相殺することができます。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、NISAの口座では、特定口座や一般口座で生じた配当所得および譲渡所得との損益通算はできません。非課税の対象となる金額、期間等を含めて詳しくは販売会社にお問い合わせください。

b．法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2020年6月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,617,914,794	99.12
内 ルクセンブルグ	1,617,914,794	99.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,431,269	0.88
純資産総額	1,632,346,063	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/ 地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドクラスJ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,461,042	1,095.71	1,600,887,252	1,095.71	1,600,887,252	98.07
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	10,034	1,695.82	17,016,730	1,696.90	17,027,542	1.04

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.12

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

2020年6月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第11特定期間	第58期(2010年7月20日)	11,953,075,578	11,984,914,441	0.7508	0.7528
	第59期(2010年8月20日)	11,308,909,494	11,339,059,482	0.7502	0.7522
	第60期(2010年9月21日)	10,792,419,166	10,821,365,833	0.7457	0.7477
	第61期(2010年10月20日)	9,719,515,608	9,733,187,683	0.7109	0.7119
	第62期(2010年11月22日)	8,197,751,787	8,209,183,400	0.7171	0.7181
	第63期(2010年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
第12特定期間	第64期(2011年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(2011年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(2011年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(2011年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(2011年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
第13特定期間	第70期(2011年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
第14特定期間	第76期(2012年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(2012年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(2012年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(2013年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第18特定期間	第100期(2014年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年6月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412
第19特定期間	第106期(2014年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954
第20特定期間	第112期(2015年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年6月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722
第22特定期間	第124期(2016年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
第23特定期間	第130期(2016年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
第27特定期間	第154期(2018年7月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年8月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年9月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596
第28特定期間	第160期(2019年1月21日)	1,573,860,687	1,577,219,906	0.9370	0.9390
	第161期(2019年2月20日)	1,607,828,729	1,611,202,149	0.9532	0.9552
	第162期(2019年3月20日)	1,652,695,868	1,656,126,642	0.9635	0.9655
	第163期(2019年4月22日)	1,797,871,043	1,801,571,397	0.9717	0.9737
	第164期(2019年5月20日)	1,785,780,207	1,789,524,700	0.9538	0.9558
	第165期(2019年6月20日)	1,821,290,712	1,825,152,093	0.9433	0.9453
第29特定期間	第166期(2019年7月22日)	1,836,069,064	1,839,933,710	0.9502	0.9522
	第167期(2019年8月20日)	1,805,072,782	1,808,919,672	0.9385	0.9405
	第168期(2019年9月20日)	1,827,834,682	1,831,684,936	0.9495	0.9515
	第169期(2019年10月21日)	1,756,210,870	1,759,896,442	0.9530	0.9550
	第170期(2019年11月20日)	1,778,667,655	1,782,397,419	0.9538	0.9558
	第171期(2019年12月20日)	1,761,494,563	1,765,148,656	0.9641	0.9661
第30特定期間	第172期(2020年1月20日)	1,784,825,600	1,788,480,365	0.9767	0.9787
	第173期(2020年2月20日)	1,802,381,006	1,806,010,696	0.9931	0.9951
	第174期(2020年3月23日)	1,574,240,198	1,577,749,073	0.8973	0.8993
	第175期(2020年4月20日)	1,595,635,917	1,599,094,529	0.9227	0.9247
	第176期(2020年5月20日)	1,602,094,600	1,605,555,871	0.9257	0.9277
	第177期(2020年6月22日)	1,617,172,884	1,620,637,956	0.9334	0.9354
	2019年6月末現在	1,829,092,391		0.9467	
	2019年7月末現在	1,841,473,432		0.9574	
	2019年8月末現在	1,807,739,267		0.9391	
	2019年9月末現在	1,827,857,717		0.9487	
	2019年10月末現在	1,765,834,498		0.9576	
	2019年11月末現在	1,792,659,978		0.9616	
	2019年12月末現在	1,767,231,903		0.9665	
	2020年1月末現在	1,772,348,586		0.9690	
	2020年2月末現在	1,707,468,853		0.9727	
	2020年3月末現在	1,544,424,525		0.8931	
	2020年4月末現在	1,582,687,743		0.9145	
	2020年5月末現在	1,613,269,075		0.9315	
	2020年6月末現在	1,632,346,063		0.9415	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第11特定期間	第58期	0.0020
	第59期	0.0020
	第60期	0.0020
	第61期	0.0010
	第62期	0.0010
	第63期	0.0010
第12特定期間	第64期	0.0010
	第65期	0.0010
	第66期	0.0010
	第67期	0.0010
	第68期	0.0010
	第69期	0.0010
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
	第111期	0.0020
第20特定期間	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020
第28特定期間	第160期	0.0020
	第161期	0.0020
	第162期	0.0020
	第163期	0.0020
	第164期	0.0020
	第165期	0.0020
第29特定期間	第166期	0.0020
	第167期	0.0020
	第168期	0.0020
	第169期	0.0020
	第170期	0.0020
	第171期	0.0020
第30特定期間	第172期	0.0020
	第173期	0.0020
	第174期	0.0020
	第175期	0.0020
	第176期	0.0020
	第177期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第11特定期間	第58期	2.1
	第59期	0.2
	第60期	0.3
	第61期	4.5
	第62期	1.0
	第63期	0.7
第12特定期間	第64期	1.5
	第65期	1.0
	第66期	2.3
	第67期	2.6
	第68期	0.8
	第69期	2.2
第13特定期間	第70期	1.8
	第71期	0.8
	第72期	0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	2.4
	第80期	3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	8.2
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	1.1
	第96期	1.1
	第97期	1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	0.1
	第101期	1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	0.7
	第105期	1.0
第19特定期間	第106期	0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	2.3
	第110期	10.9
	第111期	1.4
第20特定期間	第112期	1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	1.5
	第116期	1.4
	第117期	0.8

特定期間	計算期間	収益率(%)
第21特定期間	第118期	1.5
	第119期	0.9
	第120期	3.5
	第121期	0.3
	第122期	2.8
	第123期	1.9
第22特定期間	第124期	3.8
	第125期	4.7
	第126期	0.3
	第127期	2.0
	第128期	0.9
	第129期	4.8
第23特定期間	第130期	2.5
	第131期	4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
	第135期	5.9
第24特定期間	第136期	1.0
	第137期	1.6
	第138期	0.1
	第139期	3.0
	第140期	2.4
	第141期	0.8
第25特定期間	第142期	0.5
	第143期	2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	0.8
	第147期	1.2
第26特定期間	第148期	1.0
	第149期	3.6
	第150期	1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	1.0
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	1.8
	第156期	1.5
	第157期	0.2
	第158期	0.1
	第159期	0.4
第28特定期間	第160期	1.9
	第161期	1.9
	第162期	1.3
	第163期	1.1
	第164期	1.6
	第165期	0.9
第29特定期間	第166期	0.9
	第167期	1.0
	第168期	1.4
	第169期	0.6
	第170期	0.3
	第171期	1.3
第30特定期間	第172期	1.5
	第173期	1.9
	第174期	9.4
	第175期	3.1
	第176期	0.5
	第177期	1.0

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(4)【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第11特定期間	第58期	144,954,930	2,020,636,276	15,919,431,590
	第59期	79,936,100	924,373,465	15,074,994,225
	第60期	14,236,783	615,897,181	14,473,333,827
	第61期	31,216,474	832,474,826	13,672,075,475
	第62期	6,877,197	2,247,339,525	11,431,613,147
	第63期	14,242,171	822,197,553	10,623,657,765
第12特定期間	第64期	5,601,819	471,251,409	10,158,008,175
	第65期	5,496,284	597,974,968	9,565,529,491
	第66期	503,609,038	671,945,971	9,397,192,558
	第67期	5,663,077	789,922,129	8,612,933,506
	第68期	4,611,140	258,349,047	8,359,195,599
	第69期	4,949,469	324,990,364	8,039,154,704
第13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252		1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	第160期	79,034,742	40,341,196	1,679,609,992
	第161期	7,100,270		1,686,710,262
	第162期	29,344,531	667,493	1,715,387,300
	第163期	159,526,725	24,736,827	1,850,177,198
	第164期	22,070,503	932	1,872,246,769
	第165期	104,913,835	46,469,726	1,930,690,878
第29特定期間	第166期	1,653,449	21,324	1,932,323,003
	第167期	1,621,547	10,499,501	1,923,445,049
	第168期	1,772,570	90,572	1,925,127,047
	第169期	1,783,314	84,124,204	1,842,786,157
	第170期	22,483,380	387,455	1,864,882,082
	第171期	1,586,403	39,421,574	1,827,046,911
第30特定期間	第172期	1,501,915	1,166,200	1,827,382,626
	第173期	1,829,400	14,366,903	1,814,845,123
	第174期	1,408,185	61,815,586	1,754,437,722
	第175期	1,373,625	26,505,312	1,729,306,035
	第176期	1,339,736	9,784	1,730,635,987
	第177期	1,910,792	10,744	1,732,536,035

(参考情報)

運用実績

2020年6月末現在

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。
 ※ 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

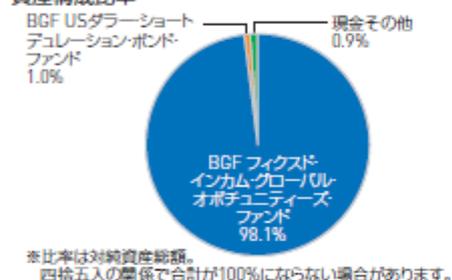
分配の推移

設定来累計		4,300
直近1年間累計		240円
第173期	2020年2月	20円
第174期	2020年3月	20円
第175期	2020年4月	20円
第176期	2020年5月	20円
第177期	2020年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



※ 比率は対純資産総額。四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

組入上位10銘柄*(%)

順位	銘柄名	比率
1	UMBS 30YR TBA(REG A)	4.5
2	TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	3.2
3	TREASURY NOTE 1.5 08/31/2021	1.6
4	TREASURY NOTE 1.5 09/30/2021	1.0
5	GNMA2 30YR TBA(REG C)	1.0
6	INDIA (REPUBLIC OF) 7.26 01/14/2029	0.9
7	FNMA 30YR 4.5% LTV > 90 2018	0.9
8	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 10/15/2024	0.8
9	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 01/15/2030	0.7
10	SPAIN (KINGDOM OF) 2.7 10/31/2048	0.7

債券種別構成比率*(%)

債券種別	比率
証券化商品	19.2
新興国債	17.7
投資適格社債	13.6
現金等	10.4
派生商品合計	10.0
ハイ・イールド債	9.7
国債	8.6
政府系モーゲージ	7.8
地方債	3.8

※ 主要投資対象ファンドはデリバティブ取引を活用するため、合計が100%を超える場合があります。

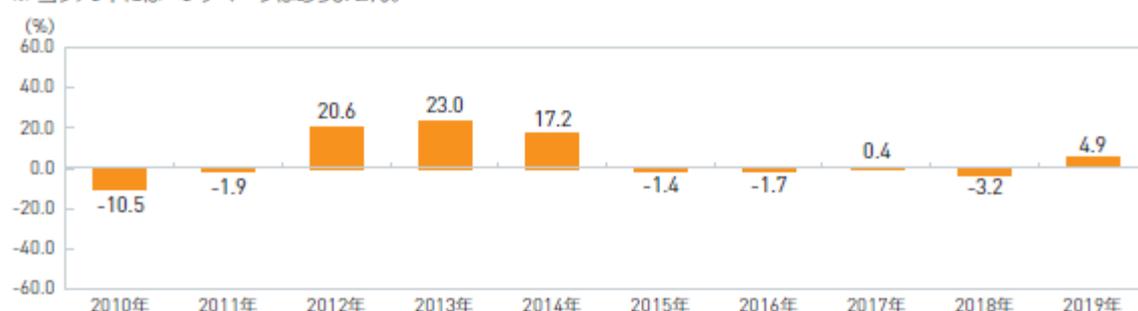
通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国・ドル	96.7
中国・人民元	2.4
ユーロ	1.2
メキシコ・ペソ	0.8
インドルピー	0.5
その他	1.4
台湾・ドル	-0.2
南アフリカ・ランド	-0.8
オフショア・人民元	-2.0

※ 当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の運用状況です。比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

※ ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。
 ※ 当ファンドにはベンチマークはありません。



※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。
 ※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

受益権の投資者は、販売会社と有価証券の取引に関する契約を締結します。販売会社は有価証券の取引にかかわる約款を投資者に交付し、投資者は当該約款に基づく取引口座の設定を申込み旨の申込書を提出します。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

「累積投資コース」を選択する投資者は、当該販売会社との間で「累積投資約款^{*}」にしたがって契約を締結します。

^{*} 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

取り扱いを行なうコースは各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

投資者は販売会社に、購入と同時にまたはあらかじめ当該投資者が受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該購入の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

(2) 申込期間

当ファンドの購入は、申込期間における販売会社の各営業日に、販売会社の本・支店、営業所等でお受けしています。なお、申込期間は、有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(3) 受付時間

購入の受付は、申込期間中の午後3時までに受付けたものを当日のお申込みとします。受付時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとします。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(4) 購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 購入単位

- ・一般コース : 1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース: 1万円以上1円単位

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社により上記と異なる購入単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(6) 購入価額

受益権の購入価額は、購入受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、購入価額には購入時手数料は含まれておりません。

(7) 購入時手数料

- a . 購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30% (税抜3.00%) を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

- b . 累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

受益権の投資者は、販売会社が定める日までに購入代金(購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料(消費税等相当額を含みます。))を加算した金額をいいます。)を販売会社に支払うものとします。

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、受益権の購入の受付を中止することおよび既に受付けた購入の受付を取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に以下の単位をもって換金の申込をすることができます。なお、販売会社により下記と異なる換金単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

- ・一般コース：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1口以上1口単位

投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております。ただし、受付時間は販売会社により異なる場合があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱とします。

(2) 換金不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(3) 換金価額

換金価額は、換金受付日の翌営業日の基準価額とします。なお手取額は、換金価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

当ファンドの換金価額等につきましては販売会社または下記にお問い合わせることにより知ることができます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

(4) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口の換金の申込には制限があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 換金代金の支払い

換金代金は原則として換金受付日から起算して5営業日目から販売会社においてお支払いします。

(6) 換金の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付を中止することおよび既に受付けた換金の受付を取り消すことができます。換金の受付が中止された場合には、投資者は当該受付中止以前に行なった当日の換金の申込を撤回できます。ただし、投資者がその換金の申込を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金を受付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

当ファンドにおいて基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当り）は委託会社の営業日に毎日算出されます。投資者は、販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

また、日々の基準価額（1万口当り）は翌日の日本経済新聞に掲載されております。ファンド名は「Win」と省略されて記載されております。

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

投資信託証券：金融商品取引所（海外取引所を含む）に上場されているものは、当該取引所における計算日の最終相場（海外取引所に上場されているものについては、計算日に知りうる直近の最終相場）で評価します。金融商品取引所に上場されていないものは、第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価格（原則として、計算日に知りうる直近の日の純資産価格）で評価します。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

計算期間は毎月21日から翌月20日までとすることを原則とします。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c．a．およびb．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d．c．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e．d．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、a．およびb．のファンドの償還を行いません。
- f．委託会社は、当ファンドの償還をしないこととしたときは、償還しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- g．d．～f．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、d．の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- h．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- i．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。
- j．i．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更d．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- k．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

信託約款の変更

- a. 委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- c. b. の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. c. の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託約款の変更を行ないません。
- e. 委託会社は、この信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa. ~ e. の規定にしたがいます。

運用報告書の作成

毎年6月および12月の決算時および償還時に、委託会社が期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「交付運用報告書」を作成し、購入いただいた販売会社からあらかじめお申し出いただいた方法にて知れている受益者にお届けいたします。

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

関係法人との契約の更改等に関する手続

「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は1年とし、委託会社、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様です。

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

投資者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

<一般コース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として5営業日以内）に毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。

投資者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

<累積投資コース>

受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。

販売会社は、累積投資契約に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

投資者は、委託会社の決定した償還金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日以内）に償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

投資者が、償還金について支払開始日から10年間支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属するものとし、

(3) 受益権の換金請求権

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を請求する権利を有します。

換金代金は、換金受付日から起算して、原則として5営業日目から投資者に支払います。

換金の請求を行なう投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該投資者の請求に係る当ファンドの換金を委託会社が行なうのと引き換えに、当該換金に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

(4) 反対者の買取請求権

ファンドの償還または信託約款の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた投資者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

投資者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2019年12月21日から2020年6月22日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2019年12月20日現在)	当特定期間末 (2020年6月22日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	877	6
金銭信託	16,341,659	19,784,584
投資証券	1,671,222,363	1,603,337,741
派生商品評価勘定	293,681	-
未収入金	107,843,265	-
流動資産合計	1,795,701,845	1,623,122,331
資産合計	1,795,701,845	1,623,122,331
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,654,093	3,465,072
未払解約金	28,076,741	-
未払受託者報酬	64,317	64,522
未払委託者報酬	2,251,333	2,258,541
その他未払費用	160,798	161,312
流動負債合計	34,207,282	5,949,447
負債合計	34,207,282	5,949,447
純資産の部		
元本等		
元本	1,827,046,911	1,732,536,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	65,552,348	115,363,151
(分配準備積立金)	201,897,694	188,226,660
元本等合計	1,761,494,563	1,617,172,884
純資産合計	1,761,494,563	1,617,172,884
負債純資産合計	1,795,701,845	1,623,122,331

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 2019年6月21日 至 2019年12月20日)	当特定期間 (自 2019年12月21日 至 2020年6月22日)
営業収益		
受取配当金	34,164,009	23,585,841
受取利息	9,146	2,617
有価証券売買等損益	16,042,630	6,610,792
為替差損益	27,098,585	33,561,343
営業収益合計	77,314,370	16,583,677
営業費用		
受託者報酬	393,203	371,459
委託者報酬	13,763,445	13,002,458
その他費用	1,348,736	1,238,389
営業費用合計	15,505,384	14,612,306
営業利益又は営業損失()	61,808,986	31,195,983
経常利益又は経常損失()	61,808,986	31,195,983
当期純利益又は当期純損失()	61,808,986	31,195,983
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	618,295	471,974
期首剰余金又は期首欠損金()	109,400,166	65,552,348
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,621,935	3,524,924
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,621,935	3,524,924
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,333,589	489,485
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,333,589	489,485
分配金	22,631,219	21,178,285
期末剰余金又は期末欠損金()	65,552,348	115,363,151

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における特定期間末日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における特定期間末日の対顧客先物売買取相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における特定期間末日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

受取配当金は原則として、投資証券の配当落ち日に予想配当金額を計上し、入金金額との差額についてはそれぞれ入金時に計上しております。

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(2) 特定期間末日の取扱い

当特定期間は当特定期間末が休業日であったため、2019年12月21日から2020年6月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (2019年12月20日現在)	当特定期間末 (2020年6月22日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,827,046,911口	1,732,536,035口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 65,552,348円	元本の欠損 115,363,151円
3 1口当たり純資産額	0.9641円	0.9334円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自 2019年6月21日 至 2019年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第166期計算期間(2019年6月21日～2019年7月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,040,573円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(211,589,122円)、分配準備積立金(212,882,078円)により、分配対象収益は429,511,773円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,864,646円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第167期計算期間(2019年7月23日～2019年8月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,744,361円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(210,795,938円)、分配準備積立金(212,895,796円)により、分配対象収益は427,436,095円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,846,890円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第168期計算期間(2019年8月21日～2019年9月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,134,241円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(211,176,833円)、分配準備積立金(212,783,257円)により、分配対象収益は429,094,331円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,850,254円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第169期計算期間(2019年9月21日～2019年10月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,242,442円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(202,335,221円)、分配準備積立金(204,721,164円)により、分配対象収益は411,298,827円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,685,572円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第170期計算期間(2019年10月22日～2019年11月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,954,615円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(207,326,273円)、分配準備積立金(205,234,937円)により、分配対象収益は416,515,825円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,729,764円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第171期計算期間(2019年11月21日～2019年12月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,431,614円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(203,291,476円)、分配準備積立金(201,120,173円)により、分配対象収益は408,843,263円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,654,093円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 2019年12月21日 至 2020年6月22日)
分配金の計算過程	<p>第172期計算期間(2019年12月21日～2020年1月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,217,387円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(203,494,870円)、分配準備積立金(201,768,928円)により、分配対象収益は409,481,185円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,654,765円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第173期計算期間(2020年1月21日～2020年2月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,551,784円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(202,299,901円)、分配準備積立金(200,742,314円)により、分配対象収益は407,593,999円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,629,690円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第174期計算期間(2020年2月21日～2020年3月23日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,512,876円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(195,718,596円)、分配準備積立金(194,800,409円)により、分配対象収益は392,031,881円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,508,875円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第175期計算期間(2020年3月24日～2020年4月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,693,319円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,064,994円)、分配準備積立金(189,892,456円)により、分配対象収益は386,650,769円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,458,612円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第176期計算期間(2020年4月21日～2020年5月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,724,746円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,360,783円)、分配準備積立金(190,126,089円)により、分配対象収益は386,211,618円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,461,271円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第177期計算期間(2020年5月21日～2020年6月22日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,303,341円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,783,018円)、分配準備積立金(189,388,391円)により、分配対象収益は385,474,750円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,465,072円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券は投資証券であります。

当ファンドの主な投資リスクとして、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「期限前償還リスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「デリバティブ取引のリスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は、外貨建有価証券の売買の決済等に伴い必要となる外貨の売買の為に、その受渡日までの数日間の為替予約を利用しております。なお、当ファンドは外貨建資産の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

ブラックロックソリューション・グリーンパッケージプロダクションチームが日次で計測し、運用部、その他の関係部署等にレポートをイントラネットで配信しております。また、運用ガイドラインのモニタリングはポートフォリオ・コンプライアンスチームが行っており、ガイドライン等を逸脱していた場合、関係部署へ報告され、適切な調整を行います。

(2) 信用リスクの管理

ファンダメンタル債券運用部により、国内債券の個別信用リスク及び銘柄間の相対価値については独自の定量・定性分析等を行っております。外国債券銘柄等については、社内のリサーチ・データベースによりグローバル・クレジット・チームとの情報・分析結果を共有しております。

(3) 取引先リスクの管理

リスク・クオンツ分析部は当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームと共に既存の承認済み取引先の信用悪化のモニタリングを行っており、取引先のデフォルトに対する取引先リスク、発行体リスクのファンドへの影響を分析しております。また、新規取引先の承認に際しては、リスク・クオンツ分析部が新規取引先申請の内容に問題がないかどうか確認を行い、当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームへ申請を行っております。

また、毎月開催される投資委員会では、リスク管理・運用分析手法等について審議を行っております。

金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (2019年12月20日現在)	当特定期間末 (2020年6月22日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (2019年12月20日現在)	当特定期間末 (2020年6月22日現在)
期首元本額	1,930,690,878円	1,827,046,911円
期中追加設定元本額	30,900,663円	9,363,653円
期中一部解約元本額	134,544,630円	103,874,529円

2 有価証券関係

前特定期間末(2019年12月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,517,082
合計	6,517,082

当特定期間末(2020年6月22日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	34,306,807
合計	34,306,807

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前特定期間末（2019年12月20日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	108,108,258	-	107,814,577	293,681
合計		108,108,258	-	107,814,577	293,681

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

1 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

当特定期間末(2020年6月22日現在)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポ チュニティーズ・ファンド クラスJ 投資 証券	1,461,042.410	14,858,801.300	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド クラスX 投資証券	10,034.470	157,942.550	
	アメリカドル 小計	1,471,076.880	15,016,743.850 (1,603,337,741)		
投資証券 合計				1,603,337,741 (1,603,337,741)	
合計				1,603,337,741 (1,603,337,741)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 1 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示してありま
す。

3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 2銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券」及び「ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」（以下、両者を併せて「同ファンド」という。）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)同ファンドは、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、同ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2019年8月31日に終了する計算期間(2018年9月1日から2019年8月31日まで)に係る財務書類であります。

(2)当該財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2019年8月31日現在の財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

純資産計算書 2019年8月31日現在

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		8,265,357,898	1,630,745,724
未実現評価益		148,266,201	10,744,336
投資有価証券 - 時価	2 (a)	8,413,624,099	1,641,490,060
銀行預金	2 (a)	1,332,980,372	110,211,531
ブローカーに対する債権	15	69,289,050	970,546
未収利息および未収配当金	2 (a)	88,377,882	8,672,529
売却投資有価証券未収金	2 (a)	4,706,945,761*	60,180,158*
販売投資証券未収金	2 (a)	13,245,739	1,555,035
以下に係る未実現評価益：			
差金決済契約	2 (c)	156,864	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	2,232,433,701	157,165,421
スワップの時価	2 (c)	-	1,528,748
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	120,403,779	-
その他の資産	2 (a, c)	10,358	-
資産合計		16,977,467,605	1,981,774,028
負債			
ブローカーに対する債務	15	24,077,485	1,836,728
未払収益分配金	2 (a)	2,753,117	161,305
購入投資有価証券未払金	2 (a)	7,002,212,503*	217,807,779*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	5,120,289	1,766,148
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	7,242,406	579,463
未決済先渡為替予約	2 (c)	4,646,745	1,623,911
スワップの時価	2 (c)	35,484,519	-
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	133,191,348	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	20,206,788	1,297,120
負債合計		7,234,935,200	225,072,454
純資産合計		9,742,532,405	1,756,701,574

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年 8月31日現在

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	通貨	2019年	2018年	2017年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	9,742,532,405	11,829,873,767	9,265,244,959
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	9.97	9.78	9.94
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.38	9.50	9.91
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	10.14	9.95	10.11
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	10.13	9.94	10.10
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.18	9.98	10.15
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.93	7.00	7.31
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.60	14.43	14.80
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	9.31	9.29	9.61
クラスA 中国人民幣元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	人民幣元	95.96	95.75	99.07
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	12.19	12.06	12.40
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	91.92	91.83	95.54
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.61	13.95	13.86
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	9.99	9.88	10.12
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.98	9.83	10.03
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,047	1,030	1,047
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	15.84	15.29	15.32
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	101.54	99.93	102.02
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	20.99	20.21	20.25
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.47	10.19	10.29
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	11.60	-	-
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.18	-	-
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	10.14	9.95	10.11
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.12	9.92	10.09
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.50	12.09	12.16
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.50	13.24	13.46
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	9.81	9.71	9.94
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.38	9.50	9.91
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.72	4.72	4.88
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.70	10.49	10.67
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.45	9.59	-
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.95	7.02	7.33

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年8月31日現在(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2019年	2018年	2017年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
クラスD無分配投資証券	米ドル	15.10	14.35	14.18
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.72	10.55	10.75
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.58	10.37	10.53
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.32	10.96	11.02
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	16.39	15.75	15.70
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	21.72	20.81	20.74
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.68	13.13	13.11
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.38	9.29	9.52
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.70	9.61	9.83
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.96	9.77	9.94
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.21	9.31	9.72
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	10.10	-	-
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	日本円	971	981	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	12.01	11.39	11.25
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.38	9.93	-
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.21	10.73	10.66
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.42	11.23	11.42
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.90	10.67	10.81
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.41	11.03	11.08
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,087	1,063	1,073
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	10.14	9.95	10.11
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.10	-	-
クラスS毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.25	-	-
クラスS無分配投資証券	米ドル	10.26	-	-
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.18	-	-
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.19	-	-
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	10.14	9.95	10.11
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.61	10.49	10.67
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.27	9.38	9.78
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.52	9.63	-
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.56	9.55	9.88
クラスX無分配投資証券	米ドル	11.67	11.02	10.82

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年8月31日現在(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2019年	2018年	2017年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	12.20	11.61	11.41
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.25	10.72	10.60
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.79	11.52	11.66
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.48	11.17	11.26
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.21	10.79	10.78
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	10.67	10.38	10.48

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスでは、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年8月31日現在(続き)

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	通貨	2019	2018年	2017年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,756,701,574	1,968,227,941	1,693,798,830
以下の1口当たり純資産価額:				
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	8.56	8.41*	8.57
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	8.55	8.40*	8.56
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	シンガポール・ドル	9.65	9.56*	9.82
クラスA無分配投資証券	米ドル	13.74	13.19*	13.18
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.03	9.92*	10.18
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	10.21	-	-
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	8.57	8.42*	8.58
クラスC無分配投資証券	米ドル	11.14	10.82*	10.95
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	9.82	9.64*	9.83
クラスD無分配投資証券	米ドル	14.07	13.45*	13.40
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.96	9.82*	10.04
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.54	12.09*	12.15
クラスI 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.25	-	-
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.72	10.24*	10.19
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.00	9.85*	10.06
クラスX無分配投資証券	米ドル	15.37	14.63*	14.50

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスでは、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

* 希薄化調整を含む。詳細については、注記2(g)を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2019年8月31日に終了した会計年度

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
期首純資産		11,829,873,767	1,968,227,941
収益			
預金利息	2 (b)	12,149,571	424,735
債券利息、源泉徴収税控除後	2 (b)	392,733,686	56,070,188
スワップ利息	2 (c)	164,623,518	4,089,545
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)	-	38,834
エクイティ・リンク・ノートによる収益	2 (c)	647	-
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	908,920	595,115
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	2 (b)	349,657	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	2,798,750	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	130,056	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	1,373,428	100,417
収益合計	2 (b)	575,068,233	61,318,834
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	6,713	-
スワップ利息	2 (c)	170,407,818	1,848,773
差金決済契約に係る配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	94,817	-
管理事務代行報酬、補助金控除後	7	7,646,789	1,007,543
保管および預託報酬	2 (h), 8	2,078,474	247,834
販売報酬	6	5,337,220	837,064
税金	9	2,430,466	573,585
投資運用報酬	5	46,008,427	6,807,725
費用合計		234,010,724	11,322,524
純利益		341,057,509	49,996,310
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(56,876,005)	(6,557,476)
事後通告証券契約	2 (c)	(17,926,408)	2,494,327
差金決済取引	2 (c)	(86,080)	-
上場先物取引	2 (c)	(52,801,991)	(2,056,595)
オプション / スワップション契約	2 (c)	222,290	(398,796)
スワップ取引	2 (c)	(12,240,740)	(1,816,491)
先渡為替予約	2 (c)	(226,988,584)	(6,718,915)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	3,721,925	231,303
当期実現純評価損		(362,975,593)	(14,822,643)
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :			
投資有価証券	2 (a)	275,523,108	37,396,829
事後通告証券契約	2 (c)	(724,802)	(148,039)
差金決済取引	2 (c)	143,866	-
上場先物取引	2 (c)	(5,684,607)	(516,173)
オプション / スワップション契約	2 (c)	12,983,015	319,216
スワップ取引	2 (c)	(34,769,901)	(1,104,384)
先渡為替予約	2 (c)	(88,676,438)	(2,101,843)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(194,716)	(24,698)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		158,599,525	33,820,908
運用成績による純資産の増加		136,681,441	68,994,575

損益および純資産変動計算書 2019年8月31日に終了した会計年度(続き)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		2,900,592,429	612,617,752
投資証券買戻しによる正味支払額		(5,079,081,588)	(890,420,608)
資本の変動による純資産の減少		(2,178,489,159)	(277,802,856)
配当金宣言額	16	(45,533,644)	(2,718,086)
期末純資産		9,742,532,405	1,756,701,574

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2019年8月31日に終了した会計年度

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	83,120	7,300	13,126	77,294
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,294,152	135,610	387,152	1,042,610
クラスA 毎日分配型投資証券	4,256,941	944,386	1,209,055	3,992,272
クラスA 毎月分配型投資証券	492,282	167,499	236,475	423,306
クラスA 毎四半期分配型投資証券	7,960,401	1,189,495	2,396,425	6,753,471
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,642,078	169,204	758,238	1,053,044
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	267,133	81,114	112,441	235,806
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	209,577	84,357	139,794	154,140
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	47,320	-	-	47,320
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	215,241	16,656	36,940	194,957
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	63,861	-	-	63,861
クラスA 無分配投資証券	55,308,483	11,666,718	19,283,106	47,692,095
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,102,199	233,493	1,092,221	4,243,471
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	36,613,655	2,389,454	25,045,481	13,957,628
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	503,464	1,832	504,730	566
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	14,566,146	6,854,071	11,954,070	9,466,147
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	1,022,891	2,043	341,532	683,402
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	4,090,766	1,744,459	484,008	5,351,217
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	403,397	78,503	164,075	317,825
クラスA I 無分配投資証券	-	445	-	445
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	-	445	-	445
クラスC 毎日分配型投資証券	550,932	5,440	135,069	421,303
クラスC 毎四半期分配型投資証券	1,081,194	123,097	351,938	852,353
クラスC 無分配投資証券	7,636,416	1,407,447	2,021,526	7,022,337
クラスD 毎年分配型投資証券	128,684	28,411	35,598	121,497
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,007,826	304,501	210,024	1,102,303
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,568,974	145,302	2,205,932	508,344
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	3,552,419	896,218	1,331,769	3,116,868
クラスD 毎四半期分配型投資証券	18,005,343	4,540,748	6,944,676	15,601,415
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	736,340	310,748	167,549	879,539
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,379,716	284,382	240,955	1,423,143
クラスD 無分配投資証券	68,631,865	16,741,656	40,604,095	44,769,426
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10,189,875	809,742	5,250,848	5,748,769

発行済投資証券口数変動表 2019年8月31日に終了した会計年度(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	55,881,729	10,767,940	33,688,490	32,961,179
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	5,613,080	1,282,349	3,005,547	3,889,882
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	41,037	-	-	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	34,598	6,640	18,398	22,840
クラスE無分配投資証券	21,785,153	3,148,763	7,813,239	17,120,677
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	61,418,087	3,521,088	19,507,963	45,431,212
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	44,930	-	-	44,930
クラスI毎四半期分配型投資証券	61,957,328	2,887,214	51,310,336	13,534,206
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,273,810	419,227	144,266	3,548,771
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	1,679,134	58,192	1,620,942
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	535	20,797	-	21,332
クラスI無分配投資証券	71,358,948	45,504,659	35,146,963	81,716,644
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	655	20,099	5,391	15,363
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	50,957	14,164,550	56,579	14,158,928
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,800,865	1,769,505	2,281,939	5,288,431
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	88,459,514	35,284,607	75,115,209	48,628,912
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	62,524,426	5,342,637	32,299,519	35,567,544
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	53,496,917	6,678,383	17,564,379	42,610,921
クラスJ毎月分配型投資証券	1,262,380	580,410	196,696	1,646,094
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	-	63,486	-	63,486
クラスS毎四半期分配型投資証券	-	151,575	-	151,575
クラスS無分配投資証券	-	424,919	-	424,919
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	-	1,680,298	-	1,680,298
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	-	325,910	-	325,910
クラスX毎月分配型投資証券	36,137,863	75,567	287,379	35,926,051
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,540,475	55,430	250,889	1,345,016
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	272,757	76,350	12,377	336,730
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	4,995,436	2,662,423	-	7,657,859
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	27,770,065	166,098	15,156,909	12,779,254
クラスX無分配投資証券	34,935,307	44,773,927	200,207	79,509,027
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	12,470,367	167,378	4,291,715	8,346,030
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	108,785,353	24,026,932	15,778,972	117,033,313
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,849,144	-	-	3,849,144
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	5,880,275	392,622	237,050	6,035,847

発行済投資証券口数変動表 2019年8月31日に終了した会計年度(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資 証券	48,084,178	155,856	2,715,442	45,524,592
クラスXスウェーデン・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	99,306,318	18,224,461	9,508,107	108,022,672

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2019年8月31日に終了した会計年度(続き)

U S ダラ ー ・ ショ ー ト ・ デ ュ レ ー シ ョ ン ・ ボ ン ド ・ フ ァ ン ド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	3,490,520	1,669,254	1,829,097	3,330,677
クラスA 毎月分配型投資証券	1,436,415	3,067,424	3,217,576	1,286,263
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配 型投資証券	28,560	45,445	16,380	57,625
クラスA 無分配投資証券	30,410,346	15,789,018	11,745,281	34,454,083
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,717,003	1,348,611	843,605	2,222,009
クラスA I 無分配投資証券	-	1,000	-	1,000
クラスC 毎日分配型投資証券	364,556	114,139	211,168	267,527
クラスC 無分配投資証券	722,920	865,845	744,022	844,743
クラスD 毎月分配型投資証券	5,576,303	1,194,433	2,758,642	4,012,094
クラスD 無分配投資証券	23,038,804	10,523,497	11,336,621	22,225,680
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	539,765	202,145	453,942	287,968
クラスE 無分配投資証券	11,856,720	3,360,647	4,586,608	10,630,759
クラスI 毎四半期分配型投資証券	-	2,949,440	-	2,949,440
クラスI 無分配投資証券	2,764,255	2,597,852	3,225,864	2,136,243
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	11,291,151	6,687,272	5,879,726	12,098,697
クラスX 無分配投資証券	56,253,134	334,751	21,999,020	34,588,865

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2019年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通ノ優先株式およびワラント			
バミューダ			
37,332	Marvell Technology Group Ltd	915,007	0.01
カナダ			
350,962	Largo Resources Ltd*	359,852	0.01
25,000	Lions Gate Entertainment Corp	232,750	0.00
5,883	Norbord Inc	146,663	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	7,144	0.00
		746,409	0.01
ケイマン諸島			
147,094	Vantage Drilling Co	1,589	0.00
フランス			
94,000	Engie SA	1,436,561	0.02
90,600	Orange SA	1,383,599	0.01
18,000	TOTAL SA	903,797	0.01
		3,723,957	0.04
ドイツ			
140,834	Daimler AG*	6,681,709	0.07
イタリア			
76	Enel SpA	556	0.00
272,389	Snam SpA	1,400,338	0.02
444,801	UniCredit SpA	4,972,367	0.05
		6,373,261	0.07
ルクセンブルグ			
23,835	Intelsat SA*	503,157	0.00
オランダ			
89,000	ABN AMRO Bank NV	1,594,130	0.02
85,634	Altice Europe NV*	382,443	0.00
285,700	ING Groep NV	2,757,335	0.03
434,432	Koninklijke KPN NV	1,381,114	0.01
36,150	NXP Semiconductors NV	3,711,159	0.04
		9,826,181	0.10
スペイン			
144,483	Iberdrola SA	1,499,285	0.02
175,538	Telefonica SA	1,222,180	0.01
		2,721,465	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	スウェーデン		
323,000	Telia Co AB	1,414,067	0.01
	英国		
122,517	AA Plc	84,031	0.00
232,000	BAE Systems Plc	1,544,464	0.02
24,759	Liberty Global Plc (Restricted)	660,818	0.01
132,000	National Grid Plc	1,389,106	0.01
31,000	Royal Dutch Shell Plc 'A'	863,964	0.01
		4,542,383	0.05
	米国		
24,171	Advanced Micro Devices Inc	767,671	0.01
2,951	Alphabet Inc 'A'	3,536,951	0.04
267,413	Altice USA Inc*	7,744,280	0.08
5,560	Amgen Inc	1,155,368	0.01
6,587	Analog Devices Inc	726,744	0.01
94,781	Applied Materials Inc	4,521,054	0.05
119,707	Bank of America Corp	3,297,928	0.03
22,643	Beazer Homes USA Inc*	278,962	0.00
6,099	Broadcom Inc	1,737,666	0.02
390,093	Caesars Entertainment Corp	4,503,624	0.05
34,888	Centene Corp	1,636,247	0.02
72,800	Centennial Resource Development Inc/DE 'A' *	356,720	0.00
58,273	Century Communities Inc*	1,607,752	0.02
12,000	Cigna Corp	1,852,800	0.02
12,891	Cisco Systems Inc	608,326	0.01
34,025	Citigroup Inc	2,195,633	0.02
29,456	Corning Inc	825,357	0.01
110,676	Delta Air Lines Inc	6,478,973	0.07
25,983	Diamondback Energy Inc*	2,573,876	0.03
14,078	Everi Holdings Inc	126,702	0.00
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp	1,056,456	0.01
87,600	Federal National Mortgage Association(Pref)*	1,063,464	0.01
42,321	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	1,653,481	0.02
10,972	Golden Entertainment Inc*	158,216	0.00
33,449	HCA Healthcare Inc	4,045,657	0.04
3,739	Humana Inc	1,055,482	0.01
7,242	Johnson & Johnson	927,555	0.01
57,100	JPMorgan Chase & Co	6,288,423	0.06
15,936	Lam Research Corp	3,376,201	0.03
9,583	Liberty Oilfield Services Inc 'A' *	105,509	0.00
55,228	M/I Homes Inc	2,009,195	0.02
15,682	Microchip Technology Inc*	1,367,157	0.01
14,472	Microsoft Corp	2,003,070	0.02
8,248	Morgan Stanley (Pref)	235,810	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
19,561	NVIDIA Corp	3,330,456	0.03
144,238	PulteGroup Inc	4,846,397	0.05
19,951	Pure Acquisition Corp (Wts 17/4/2023)	21,348	0.00
164,279	Rattler Midstream LP	3,026,019	0.03
29,854	Sciplay Corp	291,077	0.00
127,286	Sentinel Energy Services Inc (Wts 22/12/2022)	53,460	0.00
202,208	Target Hospitality Corp*	1,184,939	0.01
6,913	Target Hospitality Corp (Wts 15/3/2024)	6,083	0.00
136,121	Taylor Morrison Home Corp 'A'	3,192,037	0.03
39,556	Texas Instruments Inc	4,927,491	0.05
3,654	UnitedHealth Group Inc	855,401	0.01
22,243	VICI Properties Inc (Reit)*	493,127	0.01
21,358	Vistra Energy Corp	526,902	0.01
21,469	Walt Disney Co/The	2,966,157	0.03
77,224	William Lyon Homes 'A'*	1,357,598	0.01
6,394	Xilinx Inc	667,534	0.01
		99,624,336	1.02
普通/優先株式およびワラント合計		137,073,521	1.41
債券			
	アルゼンチン		
ARS	31,967,000 Argentina Bonar Bonds FRN 1/3/2020	384,692	0.00
CHF	645,000 Argentine Republic Government International Bond 3.375% 12/10/2020	341,931	0.00
USD	2,869,000 Argentine Republic Government International Bond 4.625% 11/1/2023	1,159,255	0.01
USD	21,763,000 Argentine Republic Government International Bond 5.875% 11/1/2028	8,378,755	0.09
USD	5,166,000 Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021*	2,292,412	0.02
USD	7,257,000 Argentine Republic Government International Bond 6.875% 11/1/2048	2,855,629	0.03
USD	4,409,000 Argentine Republic Government International Bond 7.125% 6/7/2036	1,741,555	0.02
USD	2,801,000 Argentine Republic Government International Bond 7.5% 22/4/2026	1,106,395	0.01
ARS	120,373,000 Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	1,224,146	0.01
ARS	48,553,000 Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 4% 6/3/2020	741,867	0.01
USD	5,196,000 Generacion Mediterraneo SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	3,013,680	0.03
USD	1,731,000 Rio Energy SA / UGEN SA / UENSA SA 6.875% 1/2/2025	804,915	0.01
USD	5,666,000 Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	1,796,571	0.02
USD	2,476,000 Telecom Argentina SA '144A' 8% 18/7/2026	1,999,757	0.02
USD	2,426,000 YPF SA 7% 15/12/2047	1,435,479	0.02
		29,277,039	0.30
	オーストラリア		
AUD	5,300,000 Australia Government Bond 3% 21/3/2047	4,807,411	0.05
USD	187,500 Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	65,625	0.00
EUR	900,000 Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074	997,368	0.01
USD	3,640,000 Pacific National Finance Pty Ltd 4.75% 22/3/2028	3,853,522	0.04

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		オーストラリア(続き)		
USD	777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	828,158	0.01
USD	922,000	Santos Finance Ltd 4.125% 14/9/2027	946,906	0.01
USD	4,100,000	Santos Finance Ltd 5.25% 13/3/2029	4,486,276	0.04
			15,985,266	0.16
		オーストリア		
EUR	2,400,000	BAWAG Group AG FRN 14/5/2025 (Perpetual)	2,697,507	0.03
EUR	4,400,000	BAWAG Group AG FRN 26/3/2029	5,058,068	0.05
USD	3,251,000	BRF GmbH '144A' 4.35% 29/9/2026	3,179,884	0.03
USD	2,863,000	Eldorado Intl. Finance GmbH '144A' 8.625% 16/6/2021	2,996,309	0.03
EUR	4,600,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)*	5,854,723	0.06
EUR	800,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)	1,011,965	0.01
EUR	4,400,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2025 (Perpetual)*	5,218,825	0.05
USD	3,162,000	JBS Investments II GmbH '144A' 5.75% 15/1/2028	3,320,100	0.03
EUR	4,200,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 15/12/2022 (Perpetual)	4,900,416	0.05
EUR	600,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	679,865	0.01
USD	1,640,000	Suzano Austria GmbH 5% 15/1/2030	1,685,100	0.02
USD	2,464,000	Suzano Austria GmbH 6% 15/1/2029*	2,744,280	0.03
USD	2,956,000	Suzano Austria GmbH '144A' 7% 16/3/2047	3,443,740	0.04
			42,790,782	0.44
		バハマ		
USD	1,021,000	Intercorp Peru Ltd '144A' 3.875% 15/8/2029*	1,029,934	0.01
USD	4,076,000	Silversea Cruise Finance Ltd '144A' 7.25% 1/2/2025	4,381,700	0.05
			5,411,634	0.06
		ベルギー		
EUR	630,000	House of Finance NV/The 4.375% 15/7/2026	722,529	0.01
EUR	3,000,000	KBC Group NV FRN 5/3/2024 (Perpetual)*	3,518,407	0.04
EUR	2,200,000	KBC Group NV FRN 24/10/2025 (Perpetual)	2,403,454	0.02
EUR	700,000	Solvay SA FRN 4/12/2023 (Perpetual)	855,008	0.01
			7,499,398	0.08
		バミューダ		
USD	200,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd (Defaulted) 6.75% 17/10/2018	169,500	0.00
USD	519,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd (Defaulted) 7.95% 15/2/2019	439,853	0.00
USD	2,972,483	Digicel Group Two Ltd '144A' 8.25% 30/9/2022*	564,772	0.01
USD	877,738	Digicel Group Two Ltd 9.125% 1/4/2024	83,659	0.00
USD	369,000	Digicel Ltd '144A' 6.75% 1/3/2023	157,286	0.00
USD	1,571,000	Inkia Energy Ltd '144A' 5.875% 9/11/2027	1,640,222	0.02
USD	4,600,000	Luye Pharma Group Ltd 1.5% 9/7/2024	4,891,847	0.05
USD	844,000	NCL Corp Ltd '144A' 4.75% 15/12/2021	857,715	0.01
HKD	4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	440,508	0.01
HKD	348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	15,825	0.00
			9,261,187	0.10

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ブラジル		
USD	12,368,000	Brazilian Government International Bond 4.5% 30/5/2029*	13,102,690	0.13
USD	3,769,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	4,067,731	0.04
USD	1,578,000	Brazilian Government International Bond 5.625% 21/2/2047	1,810,015	0.02
USD	2,238,000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island '144A' FRN 12/12/2022 (Perpetual)	2,259,709	0.02
USD	1,554,000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island '144A' FRN 19/3/2023 (Perpetual)	1,587,265	0.02
USD	6,550,000	Oi SA 10% 27/7/2025	5,829,500	0.06
			28,656,910	0.29
		英領バージン諸島		
USD	1,454,000	Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	1,206,803	0.01
USD	915,000	Baoxin Auto Finance I Ltd 7.9% 9/2/2020	898,975	0.01
USD	2,435,000	Beijing Environment Bvi Co Ltd 5.3% 18/10/2021	2,510,713	0.03
USD	1,315,000	Bi Hai Co Ltd 6.25% 5/3/2022	1,352,189	0.01
USD	5,395,000	CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,348,637	0.05
USD	2,540,000	Chalco Hong Kong Investment Co Ltd 4.875% 7/9/2021*	2,627,719	0.03
USD	2,130,000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 4.75% 21/2/2029	2,399,717	0.02
HKD	15,000,000	China Conch Venture Holdings International Ltd 5/9/2023 (Zero Coupon)	1,947,258	0.02
USD	4,176,000	China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022	4,197,533	0.04
USD	3,450,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022*	3,460,643	0.04
USD	3,015,000	Coastal Emerald Ltd FRN 1/8/2024 (Perpetual)	3,017,977	0.03
USD	1,740,000	Coastal Emerald Ltd 3.95% 1/8/2022*	1,753,050	0.02
USD	1,591,000	Easy Tactic Ltd 8.125% 11/7/2024	1,504,371	0.02
USD	1,800,000	Easy Tactic Ltd 8.625% 27/2/2024*	1,750,500	0.02
USD	2,460,000	Franshion Brilliant Ltd 4.25% 23/7/2029	2,460,886	0.03
USD	1,735,000	Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022	1,740,151	0.02
USD	4,600,000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 4.5% 29/5/2029	4,890,964	0.05
USD	1,270,000	Joy Treasure Assets Holdings Inc 4.5% 20/3/2029*	1,381,954	0.01
USD	1,853,000	Knight Castle Investments Ltd 7.99% 23/1/2021	880,175	0.01
USD	2,500,000	Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)	2,542,709	0.03
USD	1,545,000	New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020	1,400,519	0.01
USD	1,448,000	New Metro Global Ltd 6.5% 23/4/2021*	1,359,585	0.01
USD	3,200,000	NWD MTN Ltd 4.125% 18/7/2029*	3,204,653	0.03
USD	3,218,000	Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	2,366,738	0.02
USD	1,959,000	Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	1,500,888	0.02
USD	5,365,000	Rongshi International Finance Ltd 3.75% 21/5/2029	5,819,781	0.06
USD	3,702,000	Scenery Journey Ltd 11% 6/11/2020	3,789,922	0.04
USD	657,000	Shandong Iron And Steel Xinheng International Co Ltd 6.5% 14/6/2021	661,822	0.01
USD	263,000	Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	267,295	0.00
USD	1,925,000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 4.75% 5/8/2029*	1,856,216	0.02
USD	1,370,000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 5.25% 30/4/2022	1,407,233	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英領バージン諸島(続き)		
USD	2,800,000	Studio City Finance Ltd 7.25% 11/2/2024*	2,943,500	0.03
			74,451,076	0.76
		カナダ		
USD	520,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.25% 15/5/2024	538,075	0.01
USD	3,139,191	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust ' 144A' 5% 15/12/2023	3,320,362	0.03
EUR	2,706,000	Bausch Health Cos Inc 4.5% 15/5/2023	3,035,640	0.03
USD	3,179,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.5% 1/11/2025	3,344,435	0.03
USD	500,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.875% 15/5/2023	508,125	0.01
USD	9,641,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.5% 15/3/2022	9,993,379	0.10
USD	7,107,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7% 15/3/2024	7,540,527	0.08
USD	500,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9% 15/12/2025	566,560	0.01
USD	965,000	Brookfield Residential Properties Inc '144A' 6.5% 15/12/2020	967,412	0.01
USD	422,000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp '144A' 6.125% 1/7/2022	428,330	0.01
USD	1,092,000	Cenovus Energy Inc 3.8% 15/9/2023	1,128,452	0.01
USD	2,975,000	Enbridge Inc 4% 1/10/2023	3,148,672	0.03
GBP	711,000	Entertainment One Ltd 4.625% 15/7/2026	949,325	0.01
USD	2,011,000	Frontera Energy Corp '144A' 9.7% 25/6/2023	2,142,658	0.02
USD	110,000	Masonite International Corp '144A' 5.75% 15/9/2026	116,738	0.00
USD	4,250,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.875% 1/6/2024	4,372,188	0.05
USD	6,147,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5.25% 1/8/2023	6,262,256	0.06
USD	242,000	Seven Generations Energy Ltd '144A' 5.375% 30/9/2025	232,622	0.00
USD	6,669,189	Stoneway Capital Corp '144A' 10% 1/3/2027	4,164,242	0.04
USD	2,931,074	Stoneway Capital Corp 10% 1/3/2027	1,830,163	0.02
USD	1,356,000	Teck Resources Ltd 6.25% 15/7/2041	1,547,224	0.02
			56,137,385	0.58
		ケイマン諸島		
USD	1,365,000	21Vianet Group Inc 7.875% 15/10/2021	1,381,664	0.01
USD	793,000	Agile Group Holdings Ltd FRN 7/3/2023 (Perpetual)	772,638	0.01
USD	3,767,037	Ambac LSNI LLC '144A' FRN 12/2/2023	3,837,669	0.04
USD	1,624,000	Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 9.75% 5/12/2020	1,653,943	0.02
USD	773,000	Baozun Inc '144A' 1.625% 1/5/2024	863,237	0.01
USD	2,000,000	Bizlink Holding Inc 1/2/2023 (Zero Coupon)	2,122,650	0.02
USD	515,000	Central China Real Estate Ltd 6.5% 5/3/2021	513,259	0.01
USD	1,605,000	Central China Real Estate Ltd 6.875% 23/10/2020	1,616,034	0.02
USD	1,295,000	Central China Real Estate Ltd 7.325% 27/1/2020*	1,297,266	0.01
USD	2,024,000	CFLD Cayman Investment Ltd 8.6% 8/4/2024	1,991,110	0.02
USD	1,797,000	CFLD Cayman Investment Ltd 8.625% 28/2/2021	1,837,433	0.02
USD	751,000	China Aoyuan Group Ltd 7.95% 7/9/2021	776,346	0.01
USD	5,002,000	China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/2/2023	5,085,548	0.05
USD	1,820,000	China Aoyuan Group Ltd 8.5% 23/1/2022*	1,899,625	0.02
HKD	22,000,000	China Education Group Holdings Ltd 2% 28/3/2024	3,001,535	0.03
HKD	50,000,000	China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	5,699,035	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD	946,000 China Evergrande Group 6.25% 28/6/2021*	871,059	0.01
USD	2,464,000 China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023*	2,137,135	0.02
USD	4,624,000 China Evergrande Group 8.75% 28/6/2025	3,819,135	0.04
USD	1,390,000 China Evergrande Group 9.5% 11/4/2022*	1,313,550	0.01
USD	1,800,000 China Evergrande Group 10% 11/4/2023	1,685,816	0.02
USD	1,900,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/4/2023	1,819,250	0.02
USD	2,673,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 9/4/2024*	2,532,528	0.03
USD	1,438,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.45% 17/4/2021*	1,456,680	0.01
USD	3,800,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 5.5% 23/1/2022	3,738,250	0.04
USD	200,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.55% 28/3/2024	192,936	0.00
USD	2,560,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.875% 23/4/2021	2,610,253	0.03
USD	857,000 Country Garden Holdings Co Ltd 8% 27/1/2024*	922,346	0.01
USD	682,000 Ctrip.com International Ltd (Restricted) 1.25% 15/9/2022	682,533	0.01
USD	1,170,000 Energuate Trust '144A' 5.875% 3/5/2027	1,172,937	0.01
USD	3,925,000 Esic Sukuk Ltd 3.939% 30/7/2024	3,944,625	0.04
USD	1,981,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022	1,700,255	0.02
USD	1,780,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 8/3/2021	1,670,697	0.02
USD	200,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/4/2022	189,697	0.00
USD	970,000 Future Land Development Holdings Ltd 6.5% 12/9/2020*	944,434	0.01
USD	2,000,000 Future Land Development Holdings Ltd 7.5% 22/1/2021*	1,928,750	0.02
USD	733,000 FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)	696,350	0.01
USD	4,804,000 Gol Finance Inc '144A' 7% 31/1/2025*	4,737,945	0.05
HKD	33,000,000 Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	4,213,858	0.04
USD	2,120,000 Jingrui Holdings Ltd 9.45% 23/4/2021	1,975,906	0.02
USD	1,398,000 Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	1,255,439	0.01
USD	2,006,000 King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	1,759,638	0.02
USD	323,000 KWG Group Holdings Ltd 5.875% 10/11/2024	279,748	0.00
USD	3,158,000 Latam Finance Ltd '144A' 7% 1/3/2026	3,284,320	0.03
USD	2,000,000 Logan Property Holdings Co Ltd 6.5% 16/7/2023	1,960,000	0.02
USD	1,204,000 Logan Property Holdings Co Ltd 6.875% 24/4/2021	1,228,182	0.01
USD	1,250,000 Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	1,214,265	0.01
USD	1,615,870 Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6.35% 1/12/2021	1,607,807	0.02
USD	1,638,009 Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 6.72% 1/12/2022	1,609,856	0.02
USD	56,863 Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 7.72% 1/12/2026	15,069	0.00
USD	289,000 Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd '144A' 30/9/2019 (Perpetual) (Zero Coupon)	3,974	0.00
USD	5,000,000 OFSI Fund VI Ltd 'Series 2014-6A BR' FRN 20/3/2025	4,927,370	0.05
USD	580,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	563,985	0.01
USD	3,250,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	3,126,668	0.03
USD	1,690,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	1,690,158	0.02
USD	2,200,000 Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	1,749,000	0.02
USD	6,079,000 Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	5,982,496	0.06
USD	1,380,000 Redco Properties Group Ltd 13.5% 21/1/2020	1,402,425	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD	1,580,000 Ronshine China Holdings Ltd 8.75% 25/10/2022	1,586,251	0.02
USD	1,760,000 Ronshine China Holdings Ltd 8.95% 22/1/2023	1,742,304	0.02
USD	645,000 Ronshine China Holdings Ltd 10.5% 1/3/2022	673,502	0.01
USD	760,000 Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/8/2021	807,825	0.01
USD	1,943,000 Saudi Electricity Global Sukuk Co 4 4.222% 27/1/2024	2,079,496	0.02
USD	690,000 Shimao Property Holdings Ltd 5.6% 15/7/2026	694,727	0.01
USD	2,000,000 Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,017,582	0.02
USD	403,165 SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	385,652	0.00
USD	1,550,000 Sunac China Holdings Ltd 7.25% 14/6/2022	1,505,932	0.02
USD	4,000,000 Tencent Holdings Ltd 3.975% 11/4/2029*	4,333,686	0.04
USD	1,548,000 Times China Holdings Ltd 5.75% 26/4/2022*	1,520,577	0.02
USD	2,300,000 Times China Holdings Ltd 7.625% 21/2/2022*	2,359,724	0.02
GBP	800,000 Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	862,778	0.01
USD	970,990 Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15/1/2024	984,341	0.01
USD	1,439,000 Transocean Inc '144A' 9% 15/7/2023	1,488,646	0.02
USD	7,450,500 Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.75% 15/10/2024	7,897,530	0.08
USD	664,500 Transocean Proteus Ltd '144A' 6.25% 1/12/2024	681,113	0.01
EUR	2,630,000 UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029	3,108,322	0.03
USD	2,296,000 Vale Overseas Ltd 4.375% 11/1/2022	2,380,665	0.02
USD	1,442,000 Xinyuan Real Estate Co Ltd 9.875% 19/3/2020	1,410,997	0.01
USD	2,400,000 Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020	2,413,656	0.02
USD	860,000 Yuzhou Properties Co Ltd 6% 25/10/2023	770,103	0.01
USD	2,155,000 Yuzhou Properties Co Ltd 8.5% 26/2/2024*	2,090,350	0.02
USD	2,000,000 Yuzhou Properties Co Ltd 8.625% 23/1/2022	2,040,000	0.02
USD	556,000 YY Inc '144A' 0.75% 15/6/2025	513,132	0.00
		161,315,208	1.66
チリ			
CLP	1,420,000,000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 1/3/2026	2,209,388	0.02
USD	1,829,000 Celulosa Arauco y Constitucion SA '144A' 4.25% 30/4/2029	1,929,595	0.02
USD	1,793,000 Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA '144A' 4.75% 1/8/2026	1,897,498	0.02
		6,036,481	0.06
中国			
CNY	30,000,000 Central Huijin Investment Ltd 3.83% 22/5/2024	4,247,278	0.04
EUR	2,600,000 Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd 2.5% 20/3/2021	2,841,537	0.03
USD	2,470,000 China Construction Bank Corp FRN 27/2/2029	2,601,058	0.03
CNY	78,000,000 China Development Bank 3.3% 1/2/2024	10,907,220	0.11
CNY	46,700,000 China Development Bank 3.68% 26/2/2026	6,568,227	0.07
CNY	71,200,000 China Development Bank 4.04% 6/7/2028	10,270,344	0.11
CNY	385,500,000 China Government Bond 3.19% 11/4/2024	54,587,958	0.56
CNY	47,500,000 China Government Bond 3.22% 6/12/2025	6,715,099	0.07
CNY	127,700,000 China Government Bond 3.25% 22/11/2028	18,113,613	0.19
CNY	306,500,000 China Government Bond 3.29% 23/5/2029	43,809,078	0.45

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		中国(続き)		
CNH	10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,420,149	0.01
CNY	116,400,000	China Government Bond 3.54% 16/8/2028	16,885,617	0.17
CNY	129,200,000	China Government Bond 3.86% 22/7/2049	18,768,919	0.19
CNY	97,400,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	14,600,671	0.15
USD	947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	949,220	0.01
CNY	30,000,000	China National Petroleum Corp 4.16% 16/8/2025	4,294,314	0.04
CNY	15,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 1.5% 21/12/2021	2,062,547	0.02
CNY	30,000,000	China Southern Power Grid Co Ltd 3.76% 14/1/2024	4,222,261	0.04
CNY	20,000,000	China State Railway Group Co Ltd 4.88% 17/10/2024	3,020,202	0.03
CNY	10,000,000	China State Railway Group Co Ltd 5.42% 27/5/2024	1,536,737	0.02
USD	2,000,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,924,959	0.02
USD	2,062,000	Huachen Energy Co Ltd 6.625% 18/5/2020	1,185,856	0.01
USD	687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	682,796	0.01
CNY	20,000,000	PetroChina Co Ltd 3.66% 22/2/2024	2,808,757	0.03
CNY	30,000,000	PetroChina Co Ltd 3.96% 23/4/2024	4,256,125	0.04
CNY	10,000,000	State Grid Corp of China 5.38% 19/8/2024	1,505,005	0.02
USD	1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	1,008,942	0.01
USD	1,720,000	Xi ' an Municipal Infrastructure Construction Investment Group Corp Ltd 4% 24/6/2022	1,730,423	0.02
			243,524,912	2.50
		コロンビア		
USD	11,647,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	12,131,078	0.12
USD	3,697,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	4,207,648	0.04
COP	31,349,000,000	Colombian TES 7% 30/6/2032	9,754,072	0.10
COP	14,176,700,000	Colombian TES 10% 24/7/2024	4,982,738	0.05
USD	2,596,000	Credivalores-Crediservicios SAS ' 144A ' 9.75% 27/7/2022	2,585,859	0.03
USD	1,967,000	Ecopetrol SA 5.875% 28/5/2045	2,324,134	0.02
USD	2,609,000	Ecopetrol SA 7.375% 18/9/2043	3,515,628	0.04
USD	3,637,000	Empresas Publicas de Medellin ESP ' 144A ' 4.25% 18/7/2029*	3,827,943	0.04
			43,329,100	0.44
		キュラソー		
USD	350,000	Teva Pharmaceutical Finance IV BV 3.65% 10/11/2021	333,703	0.00
		チェコ共和国		
EUR	2,713,000	Residomo SRO 3.375% 15/10/2024	3,131,211	0.03
		デンマーク		
EUR	5,231,000	DKT Finance ApS 7% 17/6/2023	6,234,027	0.06
USD	800,000	DKT Finance ApS ' 144A ' 9.375% 17/6/2023	861,640	0.01
			7,095,667	0.07

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ドミニカ共和国		
USD	1,431,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	1,508,140	0.02
USD	2,757,000	Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028*	3,036,146	0.03
			4,544,286	0.05
		エクアドル		
USD	2,353,000	Ecuador Government International Bond 7.875% 23/1/2028	2,207,408	0.02
		エジプト		
EGP	16,885,000	Egypt Government Bond 15.9% 2/7/2024	1,072,454	0.01
EGP	75,566,000	Egypt Government Bond 16.1% 7/5/2029	4,913,375	0.05
EUR	2,781,000	Egypt Government International Bond '144A' 4.75% 16/4/2026	3,170,376	0.03
EUR	3,981,000	Egypt Government International Bond 5.625% 16/4/2030	4,456,624	0.05
EUR	3,538,000	Egypt Government International Bond '144A' 6.375% 11/4/2031	4,121,910	0.04
USD	4,601,000	Egypt Government International Bond 6.875% 30/4/2040*	4,537,736	0.05
USD	1,499,000	Egypt Government International Bond '144A' 8.7% 1/3/2049*	1,642,810	0.02
EGP	102,425,000	Egypt Treasury Bills 10/9/2019 (Zero Coupon)	6,178,850	0.06
EGP	51,875,000	Egypt Treasury Bills 5/11/2019 (Zero Coupon)	3,046,626	0.03
			33,140,761	0.34
		フィンランド		
EUR	4,130,000	Fortum Oyj 2.125% 27/2/2029	5,135,262	0.05
		フランス		
EUR	1,400,000	Altice France SA/France 5.875% 1/2/2027	1,713,750	0.02
USD	3,400,000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 1/2/2027	3,749,214	0.04
EUR	400,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)*	491,560	0.01
USD	9,975,000	BNP Paribas SA FRN 25/3/2024 (Perpetual)	10,418,538	0.11
USD	1,500,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 25/3/2024 (Perpetual)*	1,566,698	0.02
USD	1,800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)	1,997,289	0.02
USD	3,165,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 1/3/2033*	3,373,310	0.04
EUR	400,000	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama FRN 28/5/2024 (Perpetual)	524,617	0.01
EUR	600,000	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6% 23/1/2027*	853,380	0.01
EUR	100,000	Casino Guichard Perrachon SA FRN 31/1/2024 (Perpetual)	64,789	0.00
EUR	200,000	CMA CGM SA 6.5% 15/7/2022	190,665	0.00
EUR	100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	126,744	0.00
EUR	1,627,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,945,505	0.02
USD	2,400,000	Credit Agricole SA '144A' FRN 23/9/2024 (Perpetual)	2,548,716	0.03
USD	200,000	Credit Agricole SA FRN 23/12/2025 (Perpetual)	233,453	0.00
USD	5,666,000	Credit Agricole SA '144A' FRN 10/1/2033*	5,924,933	0.06
EUR	1,400,000	Credit Mutuel Arkea SA 3.5% 9/2/2029	1,844,356	0.02
EUR	900,000	Crown European Holdings SA 2.25% 1/2/2023*	1,060,786	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR	434,000 Crown European Holdings SA '144A' 2.25% 1/2/2023	511,348	0.01
EUR	227,000 Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	280,643	0.00
EUR	400,000 Electricite de France SA FRN 4/7/2024 (Perpetual)	485,162	0.01
EUR	700,000 Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	883,610	0.01
GBP	900,000 Electricite de France SA FRN 29/1/2026 (Perpetual)	1,215,457	0.01
EUR	400,000 Engie SA FRN 2/6/2024 (Perpetual)	500,306	0.01
EUR	2,000,000 Engie SA FRN 28/11/2024 (Perpetual)	2,453,339	0.03
EUR	5,600,000 Engie SA 4/3/2027 (Zero Coupon)	6,176,279	0.06
EUR	731,000 Europcar Mobility Group 4% 30/4/2026	840,842	0.01
EUR	1,628,305 FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,807,882	0.02
EUR	1,724,088 FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,912,952	0.02
EUR	26,469,800 French Republic Government Bond OAT '144A' 1.5% 25/5/2050	38,429,263	0.39
EUR	1,168,000 Loxam SAS 3.25% 14/1/2025*	1,357,944	0.01
EUR	167,000 Loxam SAS 3.5% 15/4/2022	188,672	0.00
EUR	200,000 Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	226,474	0.00
EUR	1,074,000 Loxam SAS 3.75% 15/7/2026*	1,251,623	0.01
EUR	1,900,000 Orange SA 4/9/2026 (Zero Coupon)	2,088,681	0.02
EUR	400,000 Orange SA 0.5% 4/9/2032	440,228	0.00
EUR	800,000 Orano SA 3.375% 23/4/2026	961,687	0.01
EUR	309,670 Parts Europe SA FRN 1/5/2022*	343,962	0.00
EUR	1,403,000 Parts Europe SA FRN 1/5/2022	1,552,183	0.02
EUR	1,310,000 Parts Europe SA 4.375% 1/5/2022*	1,457,571	0.02
EUR	200,000 Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	217,537	0.00
EUR	380,000 Rexel SA 2.625% 15/6/2024	431,739	0.00
USD	248,000 Societe Generale SA '144A' FRN 13/9/2021 (Perpetual)*	261,020	0.00
USD	200,000 Societe Generale SA FRN 29/9/2025 (Perpetual)	223,421	0.00
EUR	2,000,000 Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)*	2,560,069	0.03
EUR	300,000 Solvay Finance SA FRN 3/6/2024 (Perpetual)*	395,079	0.00
EUR	300,000 SPIE SA 2.625% 18/6/2026	352,596	0.00
EUR	200,000 SPIE SA 3.125% 22/3/2024	243,807	0.00
EUR	100,000 TOTAL SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	113,988	0.00
EUR	160,000 TOTAL SA FRN 5/5/2023 (Perpetual)	190,758	0.00
		108,984,425	1.12
ドイツ			
EUR	400,000 ADLER Real Estate AG 1.875% 27/4/2023	458,152	0.00
EUR	490,000 ADLER Real Estate AG 2.125% 6/2/2024	567,645	0.01
EUR	1,000,000 ADLER Real Estate AG 3% 27/4/2026	1,189,565	0.01
EUR	1,717,000 Consus Real Estate AG 9.625% 15/5/2024	1,822,462	0.02
EUR	12,472,000 Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	16,272,640	0.17
EUR	2,400,000 Deutsche Pfandbriefbank AG FRN 28/4/2023 (Perpetual)	2,731,627	0.03
EUR	100,000 Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	122,833	0.00
EUR	1,821,000 IHO Verwaltungs GmbH 3.625% 15/5/2025*	2,058,068	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ドイツ(続き)			
EUR	555,000 IHO Verwaltungs GmbH 3.875% 15/5/2027	614,743	0.01
USD	1,100,000 IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6% 15/5/2027	1,105,500	0.01
EUR	6,500,000 IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028	7,022,062	0.07
EUR	3,400,000 Merck KGaA FRN 25/6/2079*	4,078,304	0.04
EUR	200,000 Nidda BondCo GmbH 5% 30/9/2025	226,721	0.00
EUR	599,000 Nidda BondCo GmbH 7.25% 30/9/2025	708,030	0.01
EUR	1,467,000 Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023*	1,601,249	0.02
EUR	1,450,000 RWE AG FRN 21/4/2075	1,636,527	0.02
EUR	400,000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	480,991	0.00
EUR	350,000 Tele Columbus AG 3.875% 2/5/2025	374,566	0.00
EUR	2,830,000 thyssenkrupp AG 2.875% 22/2/2024	3,233,532	0.03
EUR	1,700,000 Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027	2,008,158	0.02
USD	1,400,000 Unitymedia GmbH '144A' 6.125% 15/1/2025	1,465,450	0.02
EUR	182,000 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	214,228	0.00
USD	6,009,000 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH '144A' 5% 15/1/2025*	6,227,547	0.06
EUR	856,800 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 6.25% 15/1/2029	1,056,737	0.01
EUR	400,000 Volkswagen Financial Services AG 2.25% 1/10/2027	487,301	0.01
		57,764,638	0.59
ギリシャ			
EUR	6,085,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 1.875% 23/7/2026	6,983,349	0.07
EUR	9,340,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.45% 2/4/2024	11,489,955	0.12
EUR	1,463,760 Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	1,768,871	0.02
EUR	397,600 Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028	517,912	0.00
EUR	19,165,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.875% 12/3/2029	25,432,229	0.26
EUR	415,360 Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	564,322	0.01
EUR	331,133 Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037	453,881	0.00
EUR	1,874,923 Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	2,681,304	0.03
		49,891,823	0.51
ガーンジー			
USD	419,664 Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	433,830	0.00
USD	2,525,000 EFG International Guernsey Ltd FRN 5/4/2027	2,561,635	0.03
EUR	236,000 Summit Properties Ltd 2% 31/1/2025	254,349	0.00
		3,249,814	0.03
香港			
USD	4,600,000 Bagan Capital Ltd 23/9/2021 (Zero Coupon)	4,594,969	0.05
USD	1,550,000 Chalieco Hong Kong Corp Ltd FRN 15/1/2020 (Perpetual)	1,560,656	0.02
CNH	917,253 China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	5,773	0.00
USD	1,729,000 Chong Hing Bank Ltd FRN 26/7/2027	1,737,375	0.02
USD	5,555,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.625% 14/3/2023	5,871,177	0.06
USD	6,047,000 CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020	6,120,834	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
香港(続き)			
USD 2,775,000	GLP China Holdings Ltd 4.974% 26/2/2024	2,939,766	0.03
USD 2,443,000	HBIS Group Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020*	2,441,473	0.02
USD 1,430,000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/10/2019 (Perpetual)	1,034,645	0.01
USD 484,000	Hubei Science & Technology Investment Group Hong Kong Ltd 4.375% 5/3/2021	487,554	0.00
USD 1,605,000	Wanda Group Overseas Ltd 7.5% 24/7/2022	1,590,249	0.02
USD 1,846,000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)	1,842,827	0.02
USD 1,790,000	Yanlord Land HK Co Ltd 6.8% 27/2/2024	1,787,762	0.02
		32,015,060	0.33
インド			
USD 200,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4% 30/7/2027	207,500	0.00
USD 3,050,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4.375% 3/7/2029*	3,200,594	0.03
USD 2,167,000	Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,227,270	0.02
INR 8,044,790,000	India Government Bond 7.17% 8/1/2028	116,180,944	1.19
INR 2,932,150,000	India Government Bond 7.27% 8/4/2026	42,889,467	0.44
INR 152,500,000	India Government Bond 7.95% 28/8/2032	2,322,071	0.03
INR 378,000,000	Indian Railway Finance Corp Ltd 8.45% 4/12/2028	5,785,202	0.06
INR 341,000,000	NHPC Ltd 8.12% 22/3/2029	4,903,189	0.05
USD 2,710,000	Oil India Ltd 5.125% 4/2/2029*	3,109,055	0.03
USD 2,740,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 18/6/2024*	2,810,816	0.03
USD 4,093,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027	4,112,186	0.04
USD 3,785,000	Power Finance Corp Ltd 4.5% 18/6/2029	4,002,084	0.04
INR 500,000,000	Power Finance Corp Ltd 7.44% 11/6/2027	7,139,230	0.07
USD 2,462,000	REC Ltd 4.625% 22/3/2028*	2,614,336	0.03
USD 2,400,000	ReNew Power Synthetic 6.67% 12/3/2024	2,454,909	0.03
USD 1,500,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) (Defaulted) 5.75% 16/7/2019	1,317,520	0.02
USD 116,049	Videocon Industries Ltd (Restricted) (Step-up coupon) 2.8% 31/12/2020	34,662	0.00
		205,311,035	2.11
インドネシア			
USD 2,055,000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 3.75% 11/4/2024	2,123,771	0.02
USD 6,172,000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.71% 15/11/2023	6,866,350	0.07
USD 6,025,000	Indonesia Government International Bond 3.7% 8/1/2022	6,213,281	0.06
USD 11,647,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	12,071,024	0.12
USD 4,685,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029*	5,422,981	0.06
USD 11,647,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021*	12,136,441	0.12
IDR 281,139,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	18,243,809	0.19
IDR 124,402,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	7,963,131	0.08
IDR 47,000,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	3,252,062	0.03
IDR 43,024,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/6/2035	2,984,534	0.03
IDR 196,036,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	13,405,351	0.14

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インドネシア(続き)			
IDR 712,203,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	53,446,602	0.55
IDR 117,374,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	8,604,114	0.09
IDR 47,000,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	3,515,785	0.04
IDR 249,344,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	18,553,583	0.19
IDR 271,873,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/4/2039	20,124,542	0.21
USD 1,525,000	Pertamina Persero PT 4.7% 30/7/2049*	1,660,344	0.02
USD 2,225,000	Perusahaan Listrik Negara PT 4.875% 17/7/2049	2,486,438	0.02
USD 900,000	Perusahaan Listrik Negara PT 5.375% 25/1/2029*	1,060,201	0.01
USD 900,000	Perusahaan Listrik Negara PT 5.45% 21/5/2028	1,056,656	0.01
USD 600,000	Perusahaan Listrik Negara PT 6.15% 21/5/2048	780,281	0.01
USD 1,425,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 1/3/2028	1,575,738	0.02
IDR 28,140,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	1,923,171	0.02
		205,470,190	2.11
アイルランド			
EUR 3,752,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)*	4,433,242	0.05
EUR 743,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	856,152	0.01
EUR 2,075,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023*	2,350,785	0.02
USD 3,206,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.25% 15/9/2022	3,262,105	0.03
USD 6,911,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.625% 15/5/2023*	7,088,613	0.07
GBP 2,192,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027	2,724,104	0.03
USD 1,225,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.25% 15/8/2027	1,237,250	0.01
EUR 905,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	1,059,262	0.01
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	152,123	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	159,754	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	427,517	0.00
EUR 760,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	781,730	0.01
EUR 1,400,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	1,528,525	0.02
EUR 600,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	628,632	0.01
EUR 2,350,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)*	2,720,665	0.03
USD 1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027*	1,913,047	0.02
GBP 200,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	240,855	0.00
USD 4,964,000	C&W Senior Financing DAC '144A' 6.875% 15/9/2027	5,292,865	0.05
EUR 340,000	Cadogan Square CLO XI DAC FRN 15/2/2031	372,869	0.00
EUR 490,000	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO 2014-2 Ltd FRN 17/11/2031	524,690	0.00
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO I DAC FRN 15/7/2032	430,987	0.00
EUR 730,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	534,731	0.01
EUR 573,000	eircom Finance DAC 3.5% 15/5/2026	676,089	0.01
EUR 700,000	Halcyon Loan Advisors European Funding FRN 18/10/2031	767,491	0.01
EUR 1,350,000	Harvest CLO XVI DAC FRN 15/10/2031	1,483,102	0.01
EUR 500,000	Harvest CLO XXII DAC FRN 15/1/2032	546,601	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		アイルランド(続き)		
EUR	710,000	Invesco Euro CLO I DAC FRN 15/7/2031	785,716	0.01
USD	2,956,000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC '144A' 4.7% 30/5/2026	3,164,768	0.03
EUR	720,000	OZLME IV DAC FRN 27/7/2032	797,921	0.01
EUR	400,000	Providus Clo III DAC FRN 20/7/2032	428,729	0.00
EUR	1,420,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 DAC FRN 20/12/2031	1,569,124	0.02
EUR	560,562	Taurus 2016-2 DEU DAC 'Series 2016-DE2 C' FRN 3/1/2027	621,395	0.01
EUR	595,700	Taurus 2016-2 DEU DAC 'Series 2016-DE2 D' FRN 3/1/2027	661,028	0.01
EUR	500,000	Tikehau CLO V BV FRN 15/4/2032	531,603	0.01
GBP	693,000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	871,911	0.01
GBP	1,340,000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/4/2023	1,694,458	0.02
			53,320,439	0.55
		イタリア		
GBP	100,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	129,865	0.00
EUR	900,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 12/12/2042	1,223,650	0.01
EUR	403,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	537,303	0.01
EUR	700,000	Assicurazioni Generali SpA 4.125% 4/5/2026	916,564	0.01
EUR	1,700,000	Banca Carige SpA 0.75% 26/7/2020	1,886,096	0.02
EUR	830,000	Banco BPM SpA 1.75% 24/4/2023	932,218	0.01
EUR	1,100,000	Banco BPM SpA 2.5% 21/6/2024	1,254,505	0.01
EUR	225,000	Brignole Co 2019-1 SRL FRN 24/7/2034	248,542	0.00
EUR	1,200,000	Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023*	1,403,923	0.01
EUR	691,000	Diocle Spa FRN 30/6/2026	778,413	0.01
EUR	4,000,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	4,694,678	0.05
EUR	200,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 16/5/2024 (Perpetual)	233,353	0.00
USD	300,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 17/9/2025 (Perpetual)*	305,506	0.00
EUR	9,110,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)	11,698,447	0.12
EUR	150,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	172,935	0.00
EUR	39,507,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 1/7/2024	46,468,803	0.48
EUR	8,475,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	11,106,561	0.11
EUR	16,886,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.8% 1/12/2028	21,906,559	0.23
EUR	7,350,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.45% 1/3/2048	10,898,346	0.11
EUR	9,030,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.85% 1/9/2049	14,219,934	0.15
EUR	7,935,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.75% 1/9/2044	13,602,360	0.14
EUR	820,000	Nexi Capital SpA 4.125% 1/11/2023*	936,100	0.01
EUR	1,810,000	Sisal Group SpA 7% 31/7/2023*	2,079,176	0.02
EUR	5,468,915	Taurus 2018-1 IT SRL 'Series 2018-IT1 A' FRN 18/5/2030	6,025,542	0.06
EUR	2,500,000	Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	2,777,786	0.03
EUR	1,899,000	Telecom Italia SpA/Milano 2.75% 15/4/2025	2,201,896	0.02
EUR	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 3% 30/9/2025	233,500	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		イタリア(続き)		
EUR	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	239,475	0.00
EUR	2,854,000	Telecom Italia SpA/Milano 4% 11/4/2024	3,498,992	0.04
EUR	380,000	Telecom Italia SpA/Milano 4.875% 25/9/2020	441,920	0.00
EUR	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 5.25% 17/3/2055	249,437	0.00
USD	1,218,000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30/5/2024	1,304,783	0.01
GBP	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 5.875% 19/5/2023	272,338	0.00
EUR	950,000	UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)	1,107,116	0.01
EUR	2,140,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	2,739,179	0.03
EUR	2,555,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)	2,945,807	0.03
USD	1,400,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2024 (Perpetual)*	1,435,875	0.02
EUR	600,000	UniCredit SpA FRN 28/10/2025	701,193	0.01
EUR	6,145,000	UniCredit SpA (Restricted) FRN 3/6/2026 (Perpetual)*	7,458,262	0.08
EUR	1,000,000	UniCredit SpA FRN 3/1/2027	1,189,598	0.01
EUR	3,700,000	UniCredit SpA FRN 20/2/2029*	4,628,492	0.05
USD	500,000	UniCredit SpA '144A' FRN 2/4/2034	561,948	0.01
USD	1,675,000	UniCredit SpA '144A' 6.572% 14/1/2022	1,800,222	0.02
			189,447,198	1.94
		日本		
JPY	20,000,000	ANA Holdings Inc 16/9/2022 (Zero Coupon)	186,771	0.00
JPY	160,000,000	ANA Holdings Inc 19/9/2024 (Zero Coupon)	1,495,313	0.02
JPY	240,000,000	Daio Paper Corp 17/9/2020 (Zero Coupon)	2,270,745	0.02
JPY	40,000,000	Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	373,105	0.00
JPY	150,000,000	HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	1,393,899	0.01
JPY	290,000,000	Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,716,716	0.03
JPY	1,158,900,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.4% 20/6/2049	11,773,567	0.12
JPY	3,813,500,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2028	37,967,939	0.39
JPY	4,134,400,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2029	40,862,703	0.42
JPY	230,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	2,210,985	0.02
JPY	230,000,000	LINE Corp 19/9/2025 (Zero Coupon)	1,960,996	0.02
JPY	230,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,150,591	0.02
JPY	100,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	920,085	0.01
JPY	490,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,599,176	0.05
JPY	140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,316,029	0.01
USD	3,890,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.801% 18/7/2024*	3,983,189	0.04
USD	9,270,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.761% 26/7/2023	9,800,663	0.10
USD	6,040,000	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd FRN 6/3/2029 (Perpetual)*	6,777,786	0.07
JPY	180,000,000	SBI Holdings Inc/Japan 13/9/2023 (Zero Coupon)	1,749,211	0.02
JPY	150,000,000	Shimizu Corp 16/10/2020 (Zero Coupon)	1,411,380	0.02
USD	600,000	Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	569,705	0.01
USD	1,800,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)*	1,748,250	0.02
USD	800,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2027 (Perpetual)	785,879	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本(続き)			
EUR	200,000 SoftBank Group Corp 3.125% 19/9/2025	234,439	0.00
EUR	4,505,000 SoftBank Group Corp 4% 20/4/2023	5,433,114	0.06
EUR	800,000 SoftBank Group Corp 4% 19/9/2029*	962,009	0.01
EUR	200,000 SoftBank Group Corp 4.5% 20/4/2025	251,129	0.00
EUR	981,000 SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	1,238,077	0.01
EUR	700,000 SoftBank Group Corp 5% 15/4/2028	896,650	0.01
USD	4,525,000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.04% 16/7/2029	4,679,678	0.05
JPY	240,000,000 T&D Holdings Inc 5/6/2020 (Zero Coupon)	2,242,947	0.02
JPY	320,000,000 Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,989,872	0.03
JPY	120,000,000 Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,090,729	0.01
USD	3,000,000 Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	2,967,180	0.03
		162,010,507	1.66
ジャージー			
GBP	3,277,000 AA Bond Co Ltd 2.75% 31/7/2023	3,685,979	0.04
GBP	510,000 AA Bond Co Ltd 4.249% 31/7/2020	630,360	0.01
EUR	1,236,000 Avis Budget Finance Plc 4.75% 30/1/2026*	1,474,084	0.02
GBP	6,638,000 CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	8,218,266	0.08
GBP	157,000 CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	196,415	0.00
USD	890,000 Ensco Jersey Finance Ltd 3% 31/1/2024	640,244	0.01
GBP	781,000 Galaxy Bidco Ltd 6.5% 31/7/2026*	918,217	0.01
USD	2,200,000 HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/12/2019 (Perpetual)	2,246,750	0.02
GBP	1,000,000 Intu Jersey 2 Ltd 2.875% 1/11/2022	863,124	0.01
EUR	4,616,179 LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024*	5,296,202	0.05
USD	800,000 Sirius Minerals Finance NO 2 Ltd 5% 23/5/2027	742,375	0.01
USD	3,400,000 Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	3,916,766	0.04
		28,828,782	0.30
クウェート			
USD	950,000 Burgan Bank SAK FRN 9/7/2024 (Perpetual)	949,288	0.01
ルクセンブルグ			
USD	17,895,000 Allergan Funding SCS 3.8% 15/3/2025	18,808,929	0.19
EUR	500,000 Altice Financing SA 5.25% 15/2/2023	570,365	0.01
USD	1,559,000 Altice Financing SA '144A' 6.625% 15/2/2023	1,609,668	0.02
USD	4,083,000 Altice Financing SA '144A' 7.5% 15/5/2026	4,367,177	0.05
EUR	3,310,000 Altice Finco SA 4.75% 15/1/2028	3,487,568	0.04
USD	230,000 Altice Finco SA '144A' 7.625% 15/2/2025	236,544	0.00
EUR	388,000 Altice Luxembourg SA 8% 15/5/2027	461,748	0.01
USD	3,175,000 Altice Luxembourg SA '144A' 10.5% 15/5/2027	3,452,812	0.04
GBP	800,000 B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022	992,405	0.01
EUR	294,000 Cabot Financial Luxembourg II SA FRN 14/6/2024	336,076	0.00
GBP	1,700,000 Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023	2,161,398	0.02
EUR	167,000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/5/2025	195,916	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ルクセンブルグ(続き)		
EUR	182,000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	216,714	0.00
USD	600,000	Cirsa Finance International Sarl '144A' 7.875% 20/12/2023	635,631	0.01
EUR	200,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 1/11/2021	217,289	0.00
USD	2,400,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7.625% 1/11/2021*	2,345,904	0.02
EUR	2,031,000	ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 1/8/2023	2,336,183	0.02
EUR	1,053,000	ContourGlobal Power Holdings SA 4.125% 1/8/2025	1,249,233	0.01
EUR	200,000	ContourGlobal Power Holdings SA 4.125% 1/8/2025	236,043	0.00
USD	2,847,600	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	2,898,985	0.03
EUR	800,000	European TopSoho Sarl 4% 21/9/2021	824,540	0.01
EUR	260,000	Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023	253,765	0.00
EUR	2,050,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.5% 1/8/2022*	2,171,081	0.02
GBP	1,217,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.5% 1/11/2022	1,399,245	0.01
EUR	300,000	Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3.5% 15/6/2024	372,991	0.00
EUR	1,375,000	Holcim Finance Luxembourg SA FRN 5/7/2024 (Perpetual)*	1,598,827	0.02
EUR	325,000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/2/2022	369,840	0.00
EUR	1,150,000	INEOS Group Holdings SA 5.375% 1/8/2024	1,307,196	0.01
USD	2,855,000	Intelsat Jackson Holdings SA 5.5% 1/8/2023	2,608,756	0.03
USD	1,139,000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 8% 15/2/2024	1,190,414	0.01
USD	4,203,000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 8.5% 15/10/2024	4,166,224	0.04
USD	2,309,000	Intelsat SA 4.5% 15/6/2025	3,369,247	0.04
USD	4,689,000	Klabin Finance SA '144A' 4.875% 19/9/2027	4,757,137	0.05
EUR	1,370,000	Lincoln Financing SARL FRN 1/4/2024*	1,536,255	0.02
EUR	67,000	Matterhorn Telecom SA FRN 1/2/2023*	74,082	0.00
EUR	500,000	Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027	568,729	0.01
EUR	880,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 7/3/2027	1,041,291	0.01
EUR	1,310,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 7/3/2031	1,627,674	0.02
EUR	1,100,000	Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 7/3/2039	1,470,706	0.02
USD	1,800,000	Millicom International Cellular SA '144A' 6.625% 15/10/2026	1,980,281	0.02
USD	4,080,000	Pacific Drilling SA '144A' 8.375% 1/10/2023	3,758,700	0.04
USD	4,682,000	Puma International Financing SA '144A' 5% 24/1/2026	4,354,458	0.05
EUR	1,938,000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	2,344,200	0.02
USD	3,202,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025	3,379,111	0.04
EUR	200,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)	236,701	0.00
EUR	2,700,000	SES SA FRN 29/1/2024 (Perpetual)*	3,344,130	0.03
EUR	300,000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	333,909	0.00
EUR	300,000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	339,767	0.00
EUR	1,997,000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/8/2024	2,272,654	0.02
EUR	500,000	Swissport Financing Sarl 9% 15/2/2025*	568,153	0.01
USD	1,020,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	1,081,200	0.01
USD	200,000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 4/6/2038	231,500	0.00
EUR	353,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	580,586	0.01
EUR	1,162,000	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027	1,413,671	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ルクセンブルグ(続き)		
USD	1,088,000	Usiminas International Sarl '144A' 5.875% 18/7/2026	1,104,320	0.01
USD	1,498,000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC ' 144A' 5.75% 15/7/2025	1,258,470	0.01
EUR	500,000	Vivion Investments Sarl 3% 8/8/2024	552,020	0.01
			106,658,419	1.09
		マレーシア		
USD	4,600,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	4,853,000	0.05
USD	8,874,000	Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	8,553,768	0.09
MYR	32,700,000	Malaysia Government Bond 3.906% 15/7/2026	8,071,031	0.08
MYR	36,700,000	Malaysia Government Bond 4.642% 7/11/2033	9,778,266	0.10
MYR	31,200,000	Malaysia Government Bond 4.893% 8/6/2038	8,724,606	0.09
USD	472,000	Press Metal Labuan Ltd 4.8% 30/10/2022	468,018	0.00
USD	450,000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.851% 1/11/2028	521,523	0.01
USD	2,800,000	Top Glove Labuan Ltd 2% 1/3/2024	2,770,814	0.03
			43,741,026	0.45
		モルディブ		
USD	2,480,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	2,396,920	0.02
		モーリシャス		
USD	2,277,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023*	2,264,903	0.02
USD	2,300,000	Greenko Mauritius Ltd 6.25% 21/2/2023	2,348,875	0.03
USD	3,725,000	UPL Corp Ltd 4.5% 8/3/2028	3,917,173	0.04
			8,530,951	0.09
		メキシコ		
USD	1,529,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman '144A' ' FRN 6/7/2022 (Perpetual)	1,517,294	0.01
USD	1,529,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman '144A' ' FRN 10/1/2028 (Perpetual)	1,535,431	0.02
EUR	625,000	Cemex SAB de CV 3.125% 19/3/2026	714,858	0.01
USD	791,000	Cemex SAB de CV 3.72% 15/3/2020	793,768	0.01
USD	683,000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER '144A' FRN 29/11/2022 (Perpetual)	698,688	0.01
USD	3,784,000	Cydsa SAB de CV '144A' 6.25% 4/10/2027	3,802,920	0.04
USD	5,122,000	Grupo KUO SAB De CV '144A' 5.75% 7/7/2027	5,175,621	0.05
MXN	634,876	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	2,959,167	0.03
MXN	8,028,115	Mexican Bonos 6.5% 9/6/2022	39,578,522	0.41
MXN	2,502,966	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	12,963,420	0.13
MXN	1,965,010	Mexican Bonos 8% 5/9/2024	10,233,273	0.10
MXN	5,598,763	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	30,815,114	0.32
MXN	5,895,020	Mexican Bonos 10% 5/12/2024	33,395,591	0.34
USD	2,528,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	2,645,552	0.03
USD	5,488,000	Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	6,075,216	0.06
USD	8,878,000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/2/2028	8,393,872	0.09
USD	3,527,000	Petroleos Mexicanos 5.625% 23/1/2046	3,005,114	0.03
USD	7,257,000	Petroleos Mexicanos 6.375% 4/2/2021	7,478,338	0.08

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		メキシコ(続き)		
USD	6,480,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	6,778,080	0.07
USD	2,437,000	Trust F/1401 '144A' 4.869% 15/1/2030*	2,488,786	0.02
USD	2,951,000	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR '144A' FRN 29/1/2025 (Perpetual)	2,609,791	0.03
			183,658,416	1.89
		モンゴル		
USD	2,472,000	Mongolian Mortgage Corp Hfc LLC 9.75% 29/1/2022	2,462,173	0.03
		オランダ		
EUR	2,500,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	2,891,452	0.03
EUR	375,000	Aegon NV FRN 15/4/2029 (Perpetual)*	460,884	0.00
EUR	700,000	ALME Loan Funding V BV FRN 15/7/2031	777,570	0.01
EUR	1,700,000	ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)	1,979,577	0.02
EUR	800,000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	920,175	0.01
EUR	600,000	Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	660,907	0.01
EUR	500,000	Constellium SE 4.25% 15/2/2026	581,116	0.01
EUR	800,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/12/2025 (Perpetual)	976,917	0.01
EUR	200,000	Diamond BC BV 5.625% 15/8/2025	175,667	0.00
EUR	500,000	Encavis Finance BV FRN 13/9/2023 (Perpetual)	667,887	0.01
USD	415,000	Enel Finance International NV '144A' 3.625% 25/5/2027	426,560	0.00
EUR	1,500,000	Ferrovial Netherlands BV FRN 4/2/2023 (Perpetual)*	1,606,653	0.02
USD	573,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.5% 15/4/2020	580,879	0.01
EUR	2,452,000	Hertz Holdings Netherlands BV 5.5% 30/3/2023	2,861,586	0.03
EUR	4,000,000	Iberdrola International BV FRN 12/11/2024 (Perpetual)	4,903,453	0.05
USD	420,000	ING Groep NV FRN 16/4/2020 (Perpetual)*	424,452	0.00
USD	6,045,000	ING Groep NV FRN 16/4/2024 (Perpetual)	6,346,349	0.07
USD	1,800,000	ING Groep NV FRN 22/3/2028*	1,897,875	0.02
EUR	967,000	Intertrust Group BV 3.375% 15/11/2025	1,136,685	0.01
EUR	879,000	InterXion Holding NV 4.75% 15/6/2025	1,058,940	0.01
EUR	550,000	LeasePlan Corp NV FRN 29/5/2024 (Perpetual)*	646,879	0.01
USD	2,290,000	Marfrig Holdings Europe BV '144A' 8% 8/6/2023	2,389,114	0.02
USD	3,075,000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 7/5/2029	3,119,771	0.03
USD	2,122,000	MV24 Capital BV '144A' 6.748% 1/6/2034	2,148,525	0.02
EUR	2,200,000	Naturgy Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	2,651,309	0.03
EUR	700,000	Naturgy Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)	826,920	0.01
EUR	350,000	NN Group NV FRN 13/6/2024 (Perpetual)	435,300	0.00
USD	7,021,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	7,278,385	0.07
USD	10,173,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	10,436,406	0.11
USD	525,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.625% 1/6/2023	561,018	0.01
USD	5,880,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc '144A' 4.3% 18/6/2029	6,312,101	0.07
EUR	2,485,000	OCI NV 5% 15/4/2023*	2,881,460	0.03
USD	1,972,000	Petrobras Global Finance BV 5.999% 27/1/2028	2,174,820	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		オランダ(続き)		
USD	14,200,000	Petrobras Global Finance BV 7.25% 17/3/2044*	16,844,750	0.17
USD	7,008,000	Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	8,812,560	0.09
EUR	2,231,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)	2,599,998	0.03
EUR	904,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075	1,149,652	0.01
USD	538,000	Royal Capital BV FRN 5/5/2024 (Perpetual)*	540,079	0.01
USD	2,951,000	SABIC Capital II BV '144A' 4% 10/10/2023	3,139,126	0.03
USD	1,924,000	SABIC Capital II BV 4.5% 10/10/2028	2,181,335	0.02
EUR	5,965,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.5% 5/9/2034	6,579,070	0.07
EUR	2,531,000	Summer BidCo BV 9% 15/11/2025	2,983,376	0.03
GBP	400,000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	518,967	0.01
EUR	4,000,000	Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)	4,703,528	0.05
EUR	400,000	Telefonica Europe BV FRN 7/3/2023 (Perpetual)	451,241	0.00
EUR	2,100,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	2,713,698	0.03
EUR	10,900,000	Telefonica Europe BV FRN 14/12/2024 (Perpetual)	13,349,869	0.14
EUR	400,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.5% 1/3/2025	396,700	0.00
USD	1,000,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.2% 21/7/2021	939,844	0.01
EUR	123,000	Trivium Packaging Finance BV FRN 15/8/2026*	139,418	0.00
EUR	1,423,000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/8/2026	1,680,404	0.02
EUR	571,000	United Group BV 4.375% 1/7/2022	647,862	0.01
EUR	1,226,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024*	1,423,202	0.01
EUR	4,331,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024*	5,022,500	0.05
EUR	2,766,000	UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029*	3,242,062	0.03
USD	380,000	UPC Holding BV '144A' 5.5% 15/1/2028	397,100	0.00
EUR	1,400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,601,398	0.02
EUR	200,000	Volkswagen International Finance NV FRN 27/6/2028 (Perpetual)	242,879	0.00
EUR	300,000	Ziggo Bond Co BV 4.625% 15/1/2025	344,134	0.00
USD	900,000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5.875% 15/1/2025	934,875	0.01
USD	1,621,000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6% 15/1/2027	1,697,998	0.02
EUR	2,000,000	Ziggo BV 4.25% 15/1/2027	2,408,425	0.02
USD	8,437,000	Ziggo BV '144A' 5.5% 15/1/2027	8,943,220	0.09
			169,826,862	1.74
		ナイジェリア		
NGN	702,985,000	Nigeria Government Bond 13.98% 23/2/2028	1,938,299	0.02
NGN	401,706,000	Nigeria Government International Bond 12/9/2019 (Zero Coupon)	1,104,353	0.01
NGN	200,853,000	Nigeria Government International Bond 3/10/2019 (Zero Coupon)	546,158	0.01
NGN	401,706,000	Nigeria Government International Bond 28/11/2019 (Zero Coupon)	1,075,275	0.01
NGN	401,706,000	Nigeria Government International Bond 28/5/2020 (Zero Coupon)	1,000,868	0.01
NGN	200,855,000	Nigeria Government International Bond 30/7/2020 (Zero Coupon)	489,377	0.00
USD	1,170,000	Nigeria Government International Bond 7.143% 23/2/2030	1,179,872	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ナイジェリア(続き)		
USD	1,424,000	Nigeria Government International Bond 8.747% 21/1/2031	1,567,290	0.02
USD	1,736,000	Nigeria Government International Bond 9.248% 21/1/2049	1,917,195	0.02
NGN	401,706,000	Nigeria Treasury Bill 16/1/2020 (Zero Coupon)	1,059,539	0.01
NGN	702,984,000	Nigeria Treasury Bill 30/1/2020 (Zero Coupon)	1,835,615	0.02
			13,713,841	0.14
		ノルウェー		
USD	400,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2020 (Perpetual)	403,014	0.00
		パナマ		
USD	624,000	AES Panama SRL '144A' 6% 25/6/2022*	642,726	0.01
USD	499,000	Avianca Holdings SA / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd (Restricted) 8.375% 10/5/2020	394,522	0.00
			1,037,248	0.01
		ペルー		
USD	2,863,000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5.625% 28/4/2027	2,958,731	0.03
USD	5,844,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	6,703,251	0.07
PEN	6,500,000	Telefonica del Peru SAA '144A' 7.375% 10/4/2027	2,036,901	0.02
			11,698,883	0.12
		フィリピン		
USD	3,322,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029*	3,774,623	0.04
		ポルトガル		
EUR	200,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 2.625% 8/5/2017	54,127	0.00
EUR	20,500,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4% 21/1/2019	5,548,005	0.06
EUR	2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4.75% 15/1/2018	541,269	0.01
EUR	300,000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/4/2079	370,327	0.00
EUR	500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	551,979	0.01
EUR	900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,019,339	0.01
EUR	5,217,982	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta IV 2.423% 12/2/2021	5,851,477	0.06
EUR	8,153,039	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII 0.7% 12/2/2024	9,008,344	0.09
EUR	11,767,875	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta V 0.85% 12/2/2022	13,066,991	0.13
			36,011,858	0.37
		カタール		
USD	1,861,000	Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	2,186,675	0.02
		ロシア連邦		
RUB	720,117,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/5/2029	10,771,093	0.11
RUB	1,539,570,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	23,352,567	0.24
RUB	955,850,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.4% 17/7/2024	14,771,128	0.15

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ロシア連邦(続き)		
RUB	2,877,384,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/9/2031	48,147,870	0.49
USD	5,200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/3/2029	5,595,200	0.06
			102,637,858	1.05
		サウジアラビア		
USD	1,918,000	Saudi Government International Bond 5.25% 16/1/2050	2,480,847	0.02
USD	2,373,000	Saudi Telecom Co '144A' 3.89% 13/5/2029	2,562,697	0.03
			5,043,544	0.05
		シンガポール		
USD	1,235,000	Alam Synergy Pte Ltd 6.625% 24/4/2022	1,160,443	0.01
USD	1,301,000	Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/4/2021*	1,349,710	0.01
USD	2,164,000	Jubilant Pharma Ltd/SG 6% 5/3/2024*	2,237,035	0.02
USD	1,976,400	LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 4/2/2039	2,353,650	0.03
USD	4,075,000	Medco Straits Services Pte Ltd 8.5% 17/8/2022	4,322,047	0.05
EUR	3,953,000	Mulhacen Pte Ltd 6.5% 1/8/2023*	3,627,424	0.04
USD	3,105,000	United Overseas Bank Ltd FRN 19/10/2023 (Perpetual)	3,126,152	0.03
			18,176,461	0.19
		南アフリカ		
USD	3,810,000	Eskom Holdings SOC Ltd '144A' 5.75% 26/1/2021	3,829,050	0.04
USD	3,690,000	Eskom Holdings SOC Ltd '144A' 6.75% 6/8/2023	3,786,863	0.04
USD	1,040,000	Eskom Holdings SOC Ltd '144A' 7.125% 11/2/2025	1,072,500	0.01
ZAR	71,435,400	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	4,394,257	0.04
ZAR	65,120,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 28/2/2048	3,803,917	0.04
ZAR	55,690,264	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	3,375,805	0.03
USD	4,309,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 27/9/2027*	4,492,132	0.05
			24,754,524	0.25
		韓国		
USD	3,082,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2022 (Perpetual)	3,003,932	0.03
KRW	1,600,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	1,514,234	0.02
USD	2,820,000	KDB Life Insurance Co Ltd FRN 21/5/2023 (Perpetual)	2,795,766	0.03
USD	4,600,000	Kookmin Bank 4.35% 31/12/2099	4,678,364	0.05
EUR	1,100,000	LG Chem Ltd 16/4/2021 (Zero Coupon)	1,211,734	0.01
USD	2,000,000	LG Display Co Ltd 1.5% 22/8/2024	1,988,160	0.02
USD	2,900,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 13/8/2023 (Perpetual)	3,105,719	0.03
USD	2,625,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 5/2/2030	2,684,870	0.03
USD	1,900,000	Woori Bank 5.125% 6/8/2028	2,197,994	0.02
			23,180,773	0.24
		スペイン		
EUR	200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 18/2/2020 (Perpetual)	226,454	0.00
EUR	4,400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)*	5,413,434	0.06

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		スペイン(続き)		
EUR	7,000,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 29/3/2024 (Perpetual)	8,161,637	0.08
USD	4,600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 5/3/2025 (Perpetual)	4,657,500	0.05
EUR	3,600,000	Banco de Sabadell SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	3,951,576	0.04
EUR	2,000,000	Banco de Sabadell SA FRN 12/12/2028*	2,428,518	0.03
EUR	2,500,000	Banco de Sabadell SA 5.625% 6/5/2026	3,198,666	0.03
EUR	1,800,000	Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)	2,165,614	0.02
EUR	3,200,000	Banco Santander SA FRN 19/3/2025 (Perpetual)	3,364,686	0.04
USD	4,800,000	Banco Santander SA 2.706% 27/6/2024	4,884,308	0.05
USD	2,000,000	Banco Santander SA 3.306% 27/6/2029	2,093,127	0.02
EUR	1,400,000	Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	1,568,442	0.02
EUR	2,800,000	Bankia SA FRN 19/9/2023 (Perpetual)*	3,211,765	0.03
EUR	1,100,000	Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	1,214,910	0.01
EUR	400,000	Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	420,529	0.00
EUR	7,600,000	CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	9,069,575	0.09
EUR	2,400,000	CaixaBank SA FRN 23/3/2026 (Perpetual)*	2,481,892	0.03
EUR	300,000	CaixaBank SA FRN 14/7/2028	351,118	0.00
EUR	1,100,000	CaixaBank SA FRN 17/4/2030	1,258,770	0.01
EUR	1,200,000	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA 1% 28/4/2021*	1,073,926	0.01
EUR	1,302,000	El Corte Ingles SA 3% 15/3/2024	1,507,033	0.02
EUR	3,000,000	Hipercom SA 3.875% 19/1/2022	3,559,201	0.04
EUR	400,000	Mapfre SA FRN 7/9/2048	512,942	0.01
EUR	188,833	NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	213,470	0.00
EUR	21,462,000	Spain Government Bond '144A' 1.4% 30/7/2028	26,650,194	0.27
EUR	16,061,000	Spain Government Bond '144A' 1.45% 30/4/2029	20,102,772	0.21
EUR	13,715,000	Spain Government Bond '144A' 2.7% 31/10/2048	21,647,501	0.22
EUR	602,000	Tendam Brands SAU 5% 15/9/2024*	683,933	0.01
			136,073,493	1.40
		スリランカ		
USD	1,475,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	1,501,737	0.02
		スウェーデン		
EUR	1,000,000	Corral Petroleum Holdings AB 11.75% 15/5/2021	1,162,778	0.01
EUR	634,000	Intrum AB 2.75% 15/7/2022	715,820	0.01
EUR	952,000	Intrum AB 3.5% 15/7/2026	1,102,574	0.01
EUR	400,000	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 1/3/2024	469,759	0.00
EUR	2,346,000	Verisure Holding AB 3.5% 15/5/2023*	2,707,534	0.03
EUR	1,817,000	Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023	2,084,628	0.02
			8,243,093	0.08
		スイス		
USD	3,425,000	Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	3,632,041	0.04
USD	6,270,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 17/7/2023 (Perpetual)	6,732,632	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	スイス(続き)		
USD 700,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 11/12/2023 (Perpetual)*	773,451	0.01
USD 2,500,000	Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)*	2,762,325	0.03
USD 400,000	Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)	423,500	0.00
USD 1,783,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 18/12/2024 (Perpetual)	1,884,294	0.02
USD 1,300,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 12/9/2025 (Perpetual)*	1,380,139	0.01
USD 2,300,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2020 (Perpetual)	2,372,151	0.03
EUR 1,100,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	1,332,896	0.01
USD 15,016,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 31/1/2024 (Perpetual)	15,950,746	0.16
		37,244,175	0.38
	台湾		
USD 2,400,000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,273,566	0.02
	タイ		
USD 2,900,000	Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,889,125	0.03
	トルコ		
USD 6,154,000	Turkey Government International Bond 5.125% 17/2/2028	5,527,061	0.06
USD 6,996,000	Turkey Government International Bond 7.625% 26/4/2029	7,197,135	0.07
USD 1,536,757	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	1,444,603	0.02
		14,168,799	0.15
	ウクライナ		
USD 7,942,000	Ukraine Government International Bond 9.75% 1/11/2028*	9,242,503	0.10
	アラブ首長国連邦		
USD 3,000,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4.6% 2/11/2047	3,729,375	0.04
USD 4,900,000	Emirates NBD PJSC FRN 20/3/2025 (Perpetual)	5,181,750	0.05
		8,911,125	0.09
	英国		
EUR 174,000	Arrow Global Finance Plc FRN 1/3/2026*	192,470	0.00
GBP 2,351,000	Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	2,855,607	0.03
USD 1,800,000	Barclays Plc FRN 15/6/2024 (Perpetual)	1,882,377	0.02
GBP 9,180,000	Barclays Plc FRN 15/6/2025 (Perpetual)*	11,642,057	0.12
EUR 6,967,000	Barclays Plc FRN 11/11/2025	7,804,723	0.08
EUR 2,000,000	Barclays Plc FRN 7/2/2028	2,179,767	0.02
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,037,270	0.01
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	4,560,024	0.05
EUR 2,625,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,089,610	0.03
EUR 3,925,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,396,503	0.05
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,421,372	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英国(続き)		
EUR	500,000	CVC Cordatus Loan Fund XV DAC FRN 26/8/2032	543,919	0.01
GBP	1,384,124	Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	1,870,243	0.02
GBP	350,000	Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	365,748	0.00
EUR	613,000	EC Finance Plc 2.375% 15/11/2022	689,659	0.01
EUR	3,679,000	eG Global Finance Plc 3.625% 7/2/2024*	3,953,151	0.04
EUR	3,363,000	eG Global Finance Plc 4.375% 7/2/2025*	3,615,313	0.04
GBP	7,750,000	EI Group Plc 6% 6/10/2023*	9,699,977	0.10
GBP	425,000	EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	526,818	0.01
GBP	390,000	EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	488,709	0.00
USD	1,400,200	EnQuest Plc '144A' 7% 15/4/2022*	1,113,159	0.01
GBP	232,612	Eurosail 2006-4np Plc 'Series 2006-4X A3C' FRN 10/12/2044	282,017	0.00
GBP	1,993,144	Eurosail-UK 2007-4bl Plc 'Series 2007-4X A3' FRN 13/6/2045	2,417,903	0.02
GBP	950,048	Eurosail-UK 2007-4bl Plc 'Series 2007-4X A4' FRN 13/6/2045	1,129,483	0.01
USD	1,606,000	Evraz Plc '144A' 5.25% 2/4/2024	1,723,238	0.02
GBP	781,000	Finsbury Square 2016-2 Plc 'Series 2016-2 B' FRN 16/8/2058	956,279	0.01
GBP	967,000	Finsbury Square 2016-2 Plc 'Series 2016-2 C' FRN 16/8/2058	1,184,257	0.01
GBP	949,979	Finsbury Square 2017-1 Plc 'Series 2017-1 C' FRN 12/3/2059	1,164,021	0.01
GBP	887,981	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,076,358	0.01
GBP	1,297,972	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,574,469	0.02
GBP	1,385,970	Finsbury Square 2018-1 Plc 'Series 2018-1 B' FRN 12/9/2065	1,684,957	0.02
GBP	950,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	1,170,254	0.01
GBP	5,981,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	7,341,322	0.08
GBP	215,000	Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/12/2069	263,763	0.00
GBP	235,000	Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/12/2069	287,936	0.00
GBP	305,928	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	367,274	0.00
GBP	884,793	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	1,055,706	0.01
GBP	3,000,000	GKN Holdings Ltd 4.625% 12/5/2032	3,773,446	0.04
GBP	2,434,000	GKN Holdings Ltd 5.375% 19/9/2022	3,247,967	0.03
GBP	233,299	Gosforth Funding 2014-1 Plc 'Series 2014-1 A2' FRN 19/10/2056	285,662	0.00
GBP	3,770,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc 'Series 2007-2X BA' FRN 18/6/2039	4,140,819	0.04
GBP	9,595,020	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	11,795,613	0.12
GBP	2,875,000	Greene King Finance Plc 3.593% 15/3/2035	3,839,481	0.04
GBP	1,261,022	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	1,714,241	0.02
USD	1,661,000	HSBC Holdings Plc FRN 1/6/2021 (Perpetual)	1,740,894	0.02
USD	400,000	HSBC Holdings Plc FRN 17/9/2024 (Perpetual)	409,534	0.00
USD	600,000	HSBC Holdings Plc FRN 23/3/2028 (Perpetual)	615,210	0.01
GBP	200,000	Iceland Bondco Plc 4.625% 15/3/2025	211,258	0.00
EUR	2,300,000	Imperial Brands Finance Plc 2.125% 12/2/2027	2,737,092	0.03
EUR	449,000	International Game Technology Plc 3.5% 15/7/2024*	540,825	0.01
EUR	503,000	International Game Technology Plc 3.5% 15/6/2026	591,334	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英国(続き)		
EUR	1,000,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	1,230,586	0.01
USD	3,570,000	International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/2/2022	3,784,200	0.04
USD	346,000	International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/1/2027	381,898	0.00
USD	400,000	International Game Technology Plc '144A' 6.5% 15/2/2025	441,000	0.00
GBP	490,000	Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025*	600,073	0.01
USD	1,400,000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.375% 15/7/2024	1,442,070	0.01
GBP	800,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 2.75% 24/1/2021*	917,542	0.01
USD	2,600,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4.5% 1/10/2027	2,067,000	0.02
EUR	1,956,625	Kensington Mortgage Securities Plc 'Series 2007- 1X A3B' FRN 14/6/2040	2,142,936	0.02
GBP	200,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 16/9/2022	257,993	0.00
GBP	550,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023*	714,876	0.01
USD	300,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 1/10/2035 (Perpetual)*	311,250	0.00
USD	87,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	91,568	0.00
USD	513,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 21/5/2037 (Perpetual)	539,933	0.01
GBP	950,000	Marks & Spencer Plc 3.25% 10/7/2027	1,162,612	0.01
GBP	1,555,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,419,526	0.01
GBP	2,137,000	Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,652,557	0.03
GBP	426,000	Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	522,797	0.01
GBP	355,000	Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	431,816	0.00
USD	1,000,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/11/2019 (Perpetual)	806,250	0.01
USD	3,100,000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15/5/2025	3,101,550	0.03
GBP	2,200,000	Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/7/2025	2,694,373	0.03
GBP	1,750,000	Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 D' FRN 15/7/2025	2,146,986	0.02
EUR	1,106,805	Newgate Funding Plc 'Series 2006- 1 BB' FRN 1/12/2050	1,130,244	0.01
EUR	850,000	NGG Finance Plc FRN 5/12/2079	940,742	0.01
EUR	1,100,000	NGG Finance Plc FRN 5/9/2082	1,217,765	0.01
EUR	300,000	Nomad Foods Bondco Plc 3.25% 15/5/2024	344,343	0.00
EUR	402,000	OTE Plc 3.5% 9/7/2020	458,973	0.00
EUR	98,903	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	103,316	0.00
EUR	354,849	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	370,466	0.00
EUR	429,237	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	444,594	0.00
EUR	1,107,282	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,130,309	0.01
EUR	2,795,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,690,188	0.03
EUR	105,047	Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	116,362	0.00
GBP	113,443	Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	138,653	0.00
GBP	1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	1,437,428	0.01
GBP	2,635,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	3,127,214	0.03
GBP	2,100,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	2,511,923	0.03
GBP	282,000	PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 B' FRN 15/6/2022	345,250	0.00
GBP	179,000	PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/6/2022	219,522	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英国(続き)		
GBP	470,000	PCL Funding III Plc 'Series 2017-2 C' FRN 15/6/2023	563,454	0.01
GBP	1,062,000	PCL Funding III PLC FRN 15/6/2023	1,291,735	0.01
GBP	2,234,000	Pinnacle Bidco Plc 6.375% 15/2/2025	2,898,701	0.03
GBP	200,000	Premier Foods Finance Plc 6.25% 15/10/2023	251,657	0.00
GBP	2,981,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	3,640,725	0.04
GBP	799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	977,650	0.01
GBP	180,000	Residential Mortgage Securities 30 PLC FRN 20/3/2050	219,657	0.00
GBP	1,070,000	Residential Mortgage Securities 31 PLC FRN 20/9/2065	1,312,690	0.01
GBP	1,480,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	1,806,336	0.02
GBP	11,250,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	13,704,905	0.14
GBP	420,000	RMAC NO 2 Plc 'Series 2018-2 C' FRN 12/6/2046	510,274	0.01
EUR	62,346	RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2006-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	64,097	0.00
EUR	909,774	RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2007-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	948,176	0.01
GBP	2,969,516	Scorpio European Loan Conduit No. 34 DAC '144A' FRN 17/5/2029	3,632,777	0.04
GBP	600,000	Shop Direct Funding Plc 7.75% 15/11/2022	645,985	0.01
GBP	475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	609,903	0.01
GBP	4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,469,719	0.06
GBP	209,000	Stanlington No 1 Plc 'Series 2017- 1 E' FRN 12/6/2046	261,427	0.00
GBP	1,357,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022*	1,680,533	0.02
GBP	625,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% 15/3/2022*	784,050	0.01
EUR	283,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	327,203	0.00
EUR	545,841	Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	604,357	0.01
EUR	510,339	Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	568,780	0.01
EUR	1,512,000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 1.375% 24/10/2023	1,728,159	0.02
GBP	521,000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 2.5% 2/5/2025	653,689	0.01
EUR	300,000	Tesco Plc 5.125% 10/4/2047	491,450	0.00
GBP	910,504	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,650,579	0.02
GBP	2,147,640	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,478,870	0.04
GBP	973,551	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,588,613	0.02
EUR	400,000	Thomas Cook Group Plc 6.25% 15/6/2022*	85,905	0.00
GBP	360,000	Trinity Square 2015-1 Plc 'Series 2015-1X B' FRN 15/7/2051	442,170	0.00
USD	900,000	Tullow Oil Plc '144A' 6.25% 15/4/2022	902,813	0.01
GBP	1,270,000	Turbo Finance 8 PLC FRN 20/2/2026	1,539,558	0.02
GBP	488,000	Twin Bridges 2018-1 Plc 'Series 2018-1 D' FRN 12/9/2050	594,378	0.01
GBP	545,000	Twin Bridges 2019-1 Plc FRN 12/12/2052	665,052	0.01
GBP	2,717,962	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	3,788,675	0.04
GBP	900,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	1,250,121	0.01
GBP	1,084,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,526,233	0.02
USD	1,114,000	Vedanta Resources Finance II Plc 8% 23/4/2023	1,093,113	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英国(続き)		
USD	1,811,000	Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/7/2022	1,745,068	0.02
GBP	432,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027	552,642	0.01
GBP	2,500,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5% 15/4/2027	3,211,690	0.03
GBP	100,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.125% 15/1/2025	126,966	0.00
GBP	2,028,600	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	2,640,240	0.03
GBP	1,800,000	Vodafone Group Plc 26/11/2020 (Zero Coupon)	2,164,070	0.02
GBP	150,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	192,824	0.00
USD	1,900,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	2,028,250	0.02
EUR	400,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078*	501,679	0.01
EUR	600,000	Vodafone Group Plc FRN 3/1/2079	698,080	0.01
USD	1,570,000	Vodafone Group Plc FRN 4/4/2079*	1,789,608	0.02
USD	4,398,000	Vodafone Group Plc 3.75% 16/1/2024	4,645,869	0.05
GBP	4,842,173	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	5,931,620	0.06
GBP	6,200,000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	7,584,844	0.08
GBP	3,700,000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc FRN 21/9/2049	4,537,237	0.05
			273,444,629	2.81
		米国		
USD	460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ' Series 2015-1211 D ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	492,578	0.01
USD	320,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P ' Series 2017-245P D ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	337,838	0.00
USD	1,412,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P ' Series 2017-245P E ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	1,424,753	0.01
USD	7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P ' Series 2017-245P XA ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	96,460	0.00
USD	2,040,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ' Series 2017- 280P D ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	2,043,487	0.02
USD	5,105,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ' Series 2017- 280P E ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	5,127,625	0.05
USD	8,265,000	AbbVie Inc 3.75% 14/11/2023	8,714,960	0.09
USD	10,234,000	AbbVie Inc 4.25% 14/11/2028	11,172,181	0.11
USD	4,440,000	Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 ' Series 2006-1 M2 ' FRN 25/4/2036	2,426,805	0.03
USD	1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series ' 2003-MH1 B2 ' ' 144A ' 15/8/2030 (Zero Coupon)	949,262	0.01
USD	2,323,934	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 ' Series 2007-HE4 A2A ' FRN 25/5/2037	648,287	0.01
USD	3,049,084	ACIS CLO 2014-4 Ltd ' Series 2014-4A A ' ' 144A ' FRN 1/5/2026	3,052,389	0.03
USD	1,526,111	Adams Mill CLO Ltd ' Series 2014- 1A A2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	1,525,728	0.02
USD	1,700,000	Advanced Micro Devices Inc 7.5% 15/8/2022	1,926,950	0.02
USD	250,000	AIMCO CLO Series 2017-A ' Series 2017-AA A ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	250,053	0.00
USD	9,340,479	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D ' Series 2017-D A ' ' 144A ' FRN 25/12/2057	9,924,189	0.10
USD	1,698,698	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D ' Series 2017-D B ' ' 144A ' FRN 25/12/2057	764,414	0.01
USD	2,575,899	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A ' Series 2018-A B ' ' 144A ' FRN 25/4/2058	1,494,022	0.02
USD	6,805,204	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A ' Series 2018-A A ' ' 144A ' 3.85% 25/4/2058	6,693,898	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,168,071	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- B ' Series 2018-B B ' ' 144A ' 26/2/2057 (Zero Coupon)	327,060	0.00
USD 4,870,020	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B ' Series 2018-B A ' ' 144A ' 3.75% 26/2/2057	5,078,528	0.05
USD 4,764,125	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-E FRN 25/6/2058	4,830,107	0.05
USD 15,883,095	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-F ' Series 2018-F A ' ' 144A ' FRN 25/11/2058	16,489,426	0.17
USD 24,630,297	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-C ' Series 2019-C A ' ' 144A ' FRN 25/10/2058	25,472,919	0.26
USD 680,000	Aldine Independent School District 5% 15/2/2043	835,768	0.01
USD 145,855	Allegro CLO I Ltd ' Series 2013-1A A1R ' ' 144A ' FRN 30/1/2026	146,006	0.00
USD 330,000	Allegro CLO I Ltd ' Series 2013-1A C ' ' 144A ' FRN 30/1/2026	330,261	0.00
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S Ltd ' Series 2014-1RA B ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	1,548,375	0.02
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S Ltd ' Series 2014-1RA C ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	2,228,288	0.02
USD 670,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	670,297	0.01
USD 1,790,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	1,791,925	0.02
USD 2,300,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	2,302,546	0.02
USD 250,000	Allegro CLO VI Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 17/1/2031	248,772	0.00
USD 1,535,000	Allergan Sales LLC ' 144A ' 5% 15/12/2021	1,614,496	0.02
USD 560,000	Allstate Corp/The 3.85% 10/8/2049	647,998	0.01
USD 2,080,000	ALM V Ltd ' Series 2012-5A A1R3 ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	2,078,232	0.02
USD 1,700,000	ALM V Ltd ' Series 2012-5A BR3 ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	1,682,962	0.02
USD 1,061,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A A2R3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	1,054,338	0.01
USD 2,620,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A CR3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	2,599,991	0.03
USD 3,100,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A DR3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	3,004,096	0.03
USD 6,275,000	ALM VII Ltd ' Series 2012-7A SUB ' ' 144A ' FRN 15/10/2116	3,086,854	0.03
USD 1,190,000	ALM VII R Ltd ' Series 2013-7RA A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	1,189,977	0.01
USD 6,285,000	ALM VIII Ltd ' Series 2013-8A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	6,288,527	0.06
USD 300,000	ALM VIII Ltd ' Series 2013-8A A2R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	299,812	0.00
USD 1,323,248	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A A1R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,323,068	0.01
USD 1,293,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A BR2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,288,871	0.01
USD 950,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A C1R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	929,123	0.01
USD 460,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A C2R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	451,948	0.00
USD 3,051,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	3,042,729	0.03
USD 340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	321,443	0.00
USD 2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ' 144A ' FRN 15/7/2027	2,233,368	0.02
USD 1,309,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ' Series 2015-16A BR2 ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	1,295,946	0.01
USD 900,000	ALM XVII Ltd ' Series 2015-17A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	897,148	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 800,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A BR' '144A' FRN 15/1/2028	798,766	0.01
USD 720,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A CR' '144A' FRN 15/1/2028	703,775	0.01
USD 870,000	ALM XVIII Ltd 'Series 2016-18A A2R' '144A' FRN 15/1/2028	868,319	0.01
USD 3,243,714	Alternative Loan Trust 2005-22T1 'Series 2005-22T1 A1' FRN 25/6/2035	2,820,657	0.03
USD 2,922,479	Alternative Loan Trust 2005-72 'Series 2005-72 A3' FRN 25/1/2036	2,561,947	0.03
USD 1,000,866	Alternative Loan Trust 2005-76 'Series 2005-76 2A1' FRN 25/2/2036	948,740	0.01
USD 3,223,500	Alternative Loan Trust 2005-J4 'Series 2005-J4 B1' FRN 25/7/2035	3,206,193	0.03
USD 4,751,800	Alternative Loan Trust 2006-11CB 'Series 2006-11CB 3A1' 6.5% 25/5/2036	3,752,609	0.04
USD 1,314,047	Alternative Loan Trust 2006-15CB 'Series 2006-15CB A1' 6.5% 25/6/2036	966,878	0.01
USD 1,931,499	Alternative Loan Trust 2006-23CB 'Series 2006-23CB 2A5' FRN 25/8/2036	657,880	0.01
USD 1,097,465	Alternative Loan Trust 2006-J7 'Series 2006-J7 2A1' FRN 20/11/2046	821,980	0.01
USD 749,750	Alternative Loan Trust 2006-OA11 'Series 2006-OA11 A4' FRN 25/9/2046	683,598	0.01
USD 4,760,624	Alternative Loan Trust 2006-OA14 'Series 2006-OA14 1A1' FRN 25/11/2046	4,241,109	0.04
USD 3,369,285	Alternative Loan Trust 2006-OA16 'Series 2006-OA16 A4C' FRN 25/10/2046	2,051,649	0.02
USD 2,307,809	Alternative Loan Trust 2006-OA6 'Series 2006-OA6 1A2' FRN 25/7/2046	2,123,075	0.02
USD 649,134	Alternative Loan Trust 2006-OA8 'Series 2006-OA8 1A1' FRN 25/7/2046	632,719	0.01
USD 1,462,543	Alternative Loan Trust 2006-OC10 'Series 2006-OC10 2A3' FRN 25/11/2036	1,199,904	0.01
USD 5,757,445	Alternative Loan Trust 2006-OC7 'Series 2006-OC7 2A3' FRN 25/7/2046	4,701,994	0.05
USD 4,297,056	Alternative Loan Trust 2007-25 'Series 2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	3,046,202	0.03
USD 6,962,395	Alternative Loan Trust 2007-3T1 'Series 2007-3T1 1A1' 6% 25/4/2037	4,952,418	0.05
USD 3,856,993	Alternative Loan Trust 2007-9T1 'Series 2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	2,740,714	0.03
USD 1,370,649	Alternative Loan Trust 2007-OA3 'Series 2007-OA3 1A1' FRN 25/4/2047	1,283,266	0.01
USD 143,420	Alternative Loan Trust 2007-OA3 'Series 2007-OA3 2A2' FRN 25/4/2047	44,475	0.00
USD 348,862	Alternative Loan Trust 2007-OA8 'Series 2007-OA8 2A1' FRN 25/6/2047	280,446	0.00
USD 471,775	Alternative Loan Trust 2007-OH2 'Series 2007-OH2 A2A' FRN 25/8/2047	372,602	0.00
USD 8,651,000	Altria Group Inc 2.85% 9/8/2022	8,825,730	0.09
USD 2,922,000	Altria Group Inc 3.8% 14/2/2024	3,094,204	0.03
USD 4,320,000	Altria Group Inc 4% 31/1/2024	4,612,833	0.05
USD 2,706,000	Altria Group Inc 4.4% 14/2/2026	2,973,059	0.03
USD 6,800,000	Altria Group Inc 4.8% 14/2/2029*	7,648,661	0.08
USD 1,374,000	Altria Group Inc 6.2% 14/2/2059	1,771,798	0.02
USD 671,973	Ambac Assurance Corp '144A' 5.1% 7/6/2020	962,602	0.01
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc '144A' 4.625% 1/3/2020	2,383,676	0.02
USD 12,812,000	American Airlines Group Inc '144A' 5% 1/6/2022	13,308,465	0.14

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 280,000	American Airlines Group Inc '144A' 5.5% 1/10/2019	281,820	0.00
USD 13,111,000	American Airlines Pass Through Certificate 3.5% 15/12/2027	13,111,000	0.13
USD 2,035,000	American Airlines Pass Through Certificate 4% 15/12/2025	2,035,000	0.02
USD 10,453,000	American Airlines Pass Through Certificate '2019- 1C' 4% 15/6/2022	10,453,000	0.11
USD 1,127,030	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 ' Series 2006-3 2A11' FRN 25/10/2046	1,016,224	0.01
USD 2,498,417	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 ' Series 2006-4 1A12' FRN 25/10/2046	1,752,636	0.02
USD 3,998,738	American Home Mortgage Assets Trust 2006-5 ' Series 2006-5 A1' FRN 25/11/2046	2,006,575	0.02
USD 751,673	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 ' Series 2007-1 A1' FRN 25/2/2047	459,217	0.00
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014- SFR2 Trust 'Series 2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	2,112,998	0.02
USD 5,148,141	American Homes 4 Rent 2015- SFR1 'Series 2015- SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052	51	0.00
USD 725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	1,091,970	0.01
USD 1,345,000	American Municipal Power Inc 7.834% 15/2/2041	2,267,710	0.02
USD 16,150,000	American Tower Corp 3.375% 15/5/2024	16,867,469	0.17
USD 5,905,000	American Tower Corp 3.95% 15/3/2029	6,449,470	0.07
USD 4,195,000	American Tower Corp 5% 15/2/2024	4,656,092	0.05
USD 4,283,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	4,900,139	0.05
USD 550,000	AmericoId 2010 LLC 'Series 2010- ARTA C' '144A' 6.811% 14/1/2029	573,310	0.01
USD 260,000	Ammc Clo 19 Ltd 'Series 2016-19A C' '144A' FRN 15/10/2028	261,229	0.00
USD 530,000	AMMC CLO 21 Ltd 'Series 2017- 21A A' '144A' FRN 2/11/2030	529,091	0.01
USD 1,675,000	AMMC CLO XII Ltd 'Series 2013- 12A AR' '144A' FRN 10/11/2030	1,669,089	0.02
USD 3,100,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013- 13A A1LR' '144A' ' FRN 24/7/2029	3,113,195	0.03
USD 3,050,000	AMMC CLO XIV Ltd 'Series 2014- 14A A1LR' '144A' FRN 25/7/2029	3,050,683	0.03
USD 2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA A1' ' '144A' FRN 13/4/2031	2,325,554	0.02
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A1R' '144A' FRN 13/10/2030	838,597	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 13/10/2030	1,056,673	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A BR' '144A' FRN 13/10/2030	336,996	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A CR' '144A' FRN 13/10/2030	406,205	0.00
USD 1,040,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' FRN 13/10/2030	1,017,664	0.01
USD 1,050,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA A' ' '144A' FRN 28/1/2031	1,044,263	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA B' ' '144A' FRN 28/1/2031	1,621,169	0.02
USD 250,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA D' ' '144A' FRN 28/1/2031	233,222	0.00
USD 1,920,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA A' ' '144A' FRN 28/1/2031	1,912,407	0.02
USD 5,475,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA B' ' '144A' FRN 15/1/2030	5,427,055	0.06

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA C' '144A' FRN 15/1/2030	1,284,294	0.01
USD	1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A AR' '144A' FRN 15/7/2030	1,569,591	0.02
USD	590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A DR' '144A' FRN 15/7/2030	585,229	0.01
USD	12,950,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A AR' '144A' FRN 15/10/2027	12,926,019	0.13
USD	1,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A B1R' '144A' FRN 15/10/2027	1,489,563	0.02
USD	3,778,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A CR' '144A' FRN 15/10/2027	3,740,085	0.04
USD	2,915,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A DR' '144A' FRN 15/10/2027	2,893,176	0.03
USD	2,250,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A ER' '144A' FRN 15/10/2027	2,182,241	0.02
USD	1,150,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A AR' '144A' FRN 28/7/2028	1,144,712	0.01
USD	3,895,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A BR' '144A' FRN 28/7/2028	3,885,283	0.04
USD	5,810,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A CR' '144A' FRN 28/7/2028	5,813,600	0.06
USD	1,850,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A DR' '144A' FRN 28/7/2028	1,824,655	0.02
USD	4,030,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A ER' '144A' FRN 28/7/2028	3,957,902	0.04
EUR	280,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031	304,511	0.00
USD	3,162,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp (Restricted) 5.25% 15/1/2025	3,326,765	0.03
USD	8,721,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.5% 15/10/2019	8,728,671	0.09
USD	3,538,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp (Restricted) 6.25% 15/10/2022	3,614,067	0.04
USD	190,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp (Restricted) 6.375% 1/5/2024	199,927	0.00
USD	4,800,000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.65% 1/2/2026	5,161,042	0.05
USD	4,540,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.15% 23/1/2025	4,969,193	0.05
USD	3,869,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.75% 23/1/2029	4,527,376	0.05
USD	5,899,000	Antero Resources Corp 5.375% 1/11/2021	5,736,778	0.06
USD	340,000	Apidos CLO XI FRN 17/1/2028	340,013	0.00
USD	1,290,000	Apidos CLO XV 'Series 2013-15A A1RR' '144A' FRN 20/4/2031	1,275,476	0.01
USD	475,000	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A CR' '144A' FRN 19/1/2025	475,715	0.01
USD	500,000	Apidos CLO XXI 'Series 2015-21A CR' '144A' FRN 18/7/2027	489,127	0.01
USD	1,070,000	Apidos CLO XXIII 'Series 2015-23A D2' '144A' FRN 15/1/2027	1,056,834	0.01
USD	640,000	Apidos CLO XXIX 'Series 2018- 29A D' '144A' FRN 25/7/2030	576,084	0.01
USD	6,310,892	APS Resecuritization Trust 2016-1 'Series 2016-1 1MZ' '144A' FRN 31/7/2057	2,408,199	0.02
USD	5,070,923	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 3A' '144A' FRN 27/9/2046	5,142,245	0.05
USD	1,094,240	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 4A' '144A' FRN 27/4/2047	1,107,536	0.01
USD	3,460,000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017- FL3 Ltd 'Series 2017-FL3 A' '144A' FRN 15/12/2027	3,461,383	0.04
USD	1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd 'Series 2017-FL2 A' '144A' FRN 15/8/2027	1,331,462	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 433,000	Arconic Inc 5.125% 1/10/2024	461,890	0.01
USD 280,000	Arconic Inc 5.4% 15/4/2021	288,498	0.00
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,623,231	0.02
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027	8,406,044	0.09
USD 4,004,000	Arconic Inc 6.15% 15/8/2020	4,125,161	0.04
USD 58,135	AREIT 2018-CRE1 Trust 'Series 2018-CRE1 A' '144A' ' FRN 14/2/2035	58,207	0.00
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd 'Series 2016-41A D' '144A' FRN 15/1/2029	401,050	0.00
USD 200,000	ARES XLIV CLO Ltd 'Series 2017- 44A D' '144A' FRN 15/10/2029	192,598	0.00
USD 375,000	ARES XLV CLO Ltd 'Series 2017- 45A C' '144A' FRN 15/10/2030	367,988	0.00
USD 184,658	Ares XXIX CLO Ltd 'Series 2014- 1A A1R' '144A' FRN 17/4/2026	184,859	0.00
USD 250,000	Ares XXXIV CLO Ltd 'Series 2015- 2A BR' '144A' FRN 29/7/2026	249,944	0.00
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015- 4A A1R' '144A' ' FRN 15/10/2030	1,498,308	0.02
USD 560,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015- 4A DR' '144A' FRN 15/10/2030	528,713	0.01
USD 4,683,982	Argent Mortgage Loan Trust 2005- W1 'Series 2005- W1 A2' FRN 25/5/2035	4,470,254	0.05
USD 2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,800,000	0.03
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,861,766	0.02
USD 1,060,000	Arizona State University 5% 1/7/2043	1,297,551	0.01
USD 5,085,000	Arrow Bidco LLC '144A' 9.5% 15/3/2024	5,097,713	0.05
USD 1,667,000	Ashford Hospitality Trust 2018- ASHF 'Series 2018-ASHF D' '144A' FRN 15/4/2035	1,674,734	0.02
USD 896,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.125% 15/8/2025	920,640	0.01
USD 250,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.375% 15/8/2027	257,187	0.00
USD 300,000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.25% 1/8/2026	320,250	0.00
USD 1,788,000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.625% 1/10/2024	1,848,345	0.02
USD 822,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A' 6.75% 1/8/2025	817,890	0.01
USD 5,505,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A' 9.875% 1/4/2027	6,027,975	0.06
USD 53,371	Asset Securitization Corp 'Series 1997-D5 B2' 6.93% 14/2/2043	53,562	0.00
USD 1,040,000	ASSURANT CLO I Ltd 'Series 2017- 1A B' '144A' FRN 20/10/2029	1,037,293	0.01
USD 370,000	ASSURANT CLO III Ltd 'Series 2018-2A C' '144A' FRN 20/10/2031	364,481	0.00
USD 8,351,000	AT&T Inc 3.4% 15/5/2025	8,756,603	0.09
USD 5,130,000	AT&T Inc 4.125% 17/2/2026	5,587,079	0.06
USD 6,180,000	AT&T Inc 4.35% 1/3/2029	6,897,533	0.07
USD 5,970,000	AT&T Inc 4.55% 9/3/2049	6,534,592	0.07
USD 4,410,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017- ATRM 'Series 2017-ATRM D' '144A' FRN 15/12/2036	4,420,518	0.05
USD 824,447	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017- ATRM 'Series 2017-ATRM E' '144A' FRN 15/12/2036	828,590	0.01
USD 1,490,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2018- ATRM 'Series 2018-ATRM E' '144A' FRN 15/6/2035	1,501,256	0.02
USD 985,000	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	984,540	0.01
USD 1,385,000	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	1,372,474	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	9,978,000	AvalonBay Communities Inc 3.3% 1/6/2029	10,703,122	0.11
USD	1,092,000	Avantor Inc '144A' 6% 1/10/2024	1,173,900	0.01
USD	5,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM D' '144A' FRN 5/12/2032	5,068,702	0.05
USD	7,053,181	Avery Point IV CLO Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' 'FRN 25/4/2026	7,056,484	0.07
USD	1,559,888	Avery Point V CLO Ltd 'Series 2014-5A AR' '144A' 'FRN 17/7/2026	1,560,540	0.02
USD	520,000	Avery Point V CLO Ltd 'Series 2014-5A BR' '144A' 'FRN 17/7/2026	517,629	0.01
USD	2,800,000	Avery Point VI CLO Ltd 'Series 2015-6A AR' '144A' 'FRN 5/8/2027	2,797,208	0.03
USD	4,630,000	Avery Point VI CLO Ltd 'Series 2015-6A BR' '144A' 'FRN 5/8/2027	4,599,895	0.05
USD	780,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 7.125% 15/10/2020	821,333	0.01
USD	389,000	Azul Investments LLP '144A' 5.875% 26/10/2024*	388,271	0.00
USD	23,797	B2R Mortgage Trust 2015-1 'Series 2015-1 A1' ' 144A' 2.524% 15/5/2048	23,723	0.00
USD	7,452,975	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 XA' ' 144A' FRN 15/11/2048	151,444	0.00
USD	622,147	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 A' ' 144A' 3.336% 15/11/2048	623,118	0.01
USD	1,250,000	Babson CLO Ltd 2015-II 'Series 2015-2A AR' '144A' 'FRN 20/10/2030	1,246,465	0.01
USD	4,000,000	Bain Capital Credit Clo 2016-2 Ltd 'Series 2016- 2A AR' '144A' FRN 15/1/2029	4,000,000	0.04
USD	2,650,000	Bain Capital Credit Clo 2016-2 Ltd 'Series 2016- 2A BR' '144A' FRN 15/1/2029	2,650,000	0.03
USD	1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 'Series 2018-2A A1' '144A' FRN 19/7/2031	1,774,468	0.02
USD	1,147,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015- 200P 'Series 2015-200P F' '144A' FRN 14/4/2033	1,168,409	0.01
USD	230,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016- ISQ 'Series 2016-ISQ C' '144A' FRN 14/8/2034	243,602	0.00
USD	5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016- ISQ 'Series 2016-ISQ E' '144A' FRN 14/8/2034	5,035,706	0.05
USD	5,860,000	Bamll Commercial Mortgage Securities Trust 2016- SS1 'Series 2016-SS1 XA' '144A' FRN 15/12/2035	197,423	0.00
USD	3,820,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017- SCH 'Series 2017-SCH CL' '144A' FRN 15/11/2032	3,848,325	0.04
USD	1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017- SCH 'Series 2017-SCH DL' '144A' FRN 15/11/2032	1,791,902	0.02
USD	1,430,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017- SCH 'Series 2017-SCH BF' '144A' FRN 15/11/2033	1,428,707	0.01
USD	2,676,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018- DSNY 'Series 2018-DSNY D' '144A' FRN 15/9/2034	2,676,471	0.03
USD	299,815	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2007-1 'Series 2007-1 AMFX' FRN 15/1/2049	300,593	0.00
USD	2,030,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016- UBS10 'Series 2016-UB10 C' FRN 15/7/2049	2,251,675	0.02
USD	9,780,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017- BNK3 'Series 2017-BNK3 XB' FRN 15/2/2050	427,724	0.00
USD	4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017- BNK3 'Series 2017-BNK3 XD' '144A' FRN 15/2/2050	332,760	0.00
USD	517,399	Banc of America Funding 2006-A Trust 'Series 2006-A 3A2' FRN 20/2/2036	500,956	0.01
USD	15,417,020	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 'Series 2014-R2 1C' '144A' FRN 26/11/2036	3,004,754	0.03
USD	1,542,087	Bancorp Commercial Mortgage 2018-CRE3 Trust/The ' Series 2018-CR3 A' '144A' FRN 15/1/2033	1,538,026	0.02
EUR	970,000	Banff Merger Sub Inc 8.375% 1/9/2026*	966,271	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 600,000	Banff Merger Sub Inc '144A' 9.75% 1/9/2026	557,400	0.01
USD 2,810,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2024	2,936,520	0.03
USD 5,800,000	Bank of America Corp FRN 5/9/2024 (Perpetual)	6,340,647	0.07
USD 2,927,000	Bank of America Corp FRN 23/10/2024 (Perpetual)	3,285,660	0.03
USD 3,693,000	Bank of America Corp FRN 15/3/2025	3,883,827	0.04
USD 748,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	851,526	0.01
USD 2,450,000	Bank of America Corp FRN 23/4/2027	2,606,749	0.03
USD 2,165,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2028	2,335,356	0.02
USD 575,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2028	615,171	0.01
USD 910,000	Bank of America Corp FRN 20/12/2028	961,148	0.01
USD 6,255,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2029	6,873,498	0.07
USD 18,764,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2029	21,111,361	0.22
USD 7,847,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2030	8,194,320	0.08
USD 4,325,000	Bank of America Corp FRN 15/3/2050	5,282,476	0.05
USD 10,870,000	Bank of America Corp 4.183% 25/11/2027	11,812,062	0.12
USD 2,160,000	Bank of America Corp 4.25% 22/10/2026	2,355,505	0.02
USD 11,135,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	12,250,625	0.13
USD 690,000	Bank of America NA 6% 15/10/2036	963,993	0.01
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1997-2 B1 ' FRN 10/2/2022	1,172,705	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1998-2 B1 ' FRN 10/12/2025	1,427,609	0.01
USD 790,000	Barings CLO Ltd 2018-III FRN 20/7/2031	785,680	0.01
USD 11,860,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	12,019,260	0.12
USD 1,250,000	BAT Capital Corp 3.222% 15/8/2024	1,285,169	0.01
USD 630,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014- 7A A1RR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	628,312	0.01
USD 4,438,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014- 7A BRR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	4,440,175	0.05
USD 1,080,000	Battalion CLO XI Ltd ' Series 2017- 11A E ' ' 144A ' FRN 24/10/2029	1,047,618	0.01
USD 1,000,000	Bausch Health Americas Inc ' 144A ' 8.5% 31/1/2027	1,111,250	0.01
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	5,467,425	0.06
USD 6,550,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	11,367,001	0.12
USD 680,000	Bayer US Finance II LLC ' 144A ' 3.5% 25/6/2021	694,136	0.01
USD 3,628,000	Bayer US Finance II LLC ' 144A ' 4.25% 15/12/2025	3,908,446	0.04
USD 4,633,000	Bayer US Finance II LLC ' 144A ' 4.875% 25/6/2048	5,207,939	0.05
USD 1,779,000	Bayer US Finance LLC ' 144A ' 3.375% 8/10/2024	1,834,736	0.02
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	2,173,487	0.02
USD 255,813	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	248,011	0.00
USD 71,988	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A A2 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	70,100	0.00
USD 190,253	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A M1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	184,274	0.00
USD 276,686	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A A2 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	268,293	0.00
USD 795,473	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A M2 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	765,287	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 191,414	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M3' '144A' FRN 25/4/2036	184,012	0.00
USD 1,046,298	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M4' '144A' FRN 25/4/2036	1,009,288	0.01
USD 1,098,850	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A1' '144A' FRN 25/10/2036	1,056,628	0.01
USD 492,651	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A2' '144A' FRN 25/10/2036	474,685	0.01
USD 5,722,096	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 'Series 2006-4A A1' '144A' FRN 25/12/2036	5,540,051	0.06
USD 20,283,658	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 'Series 2007-4A A1' '144A' FRN 25/9/2037	19,375,060	0.20
USD 1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 'Series 2007-6A A4A' '144A' FRN 25/12/2037	1,520,515	0.02
USD 6,789,376	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 'Series 2004-B A1' '144A' FRN 28/5/2039	6,236,320	0.06
USD 2,326,132	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 'Series 2004-B A2' '144A' FRN 28/5/2039	2,152,170	0.02
USD 4,148,616	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 'Series 2005-A A1' '144A' FRN 28/2/2040	3,973,601	0.04
USD 923,156	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 'Series 2005-E A1' '144A' FRN 28/12/2040	898,231	0.01
USD 880,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 'Series 2018-CHRS E' '144A' FRN 5/8/2038	840,044	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL A' '144A' FRN 15/3/2037	876,645	0.01
USD 1,060,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL D' '144A' FRN 15/3/2037	1,060,349	0.01
USD 20,840,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XA' '144A' FRN 10/8/2035	1,263,529	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XB' '144A' FRN 10/8/2035	180,568	0.00
USD 100,000	BBCMS Trust 2015-STP 'Series 2015-STP E' '144A' FRN 10/9/2028	99,017	0.00
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000- A A2' FRN 15/6/2030	557,300	0.01
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000- A A3' FRN 15/6/2030	534,606	0.01
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000- A A4' FRN 15/6/2030	407,962	0.00
USD 130,000	Bean Creek CLO Ltd 'Series 2015- 1A ER' '144A' FRN 20/4/2031	113,648	0.00
USD 725,877	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 'Series 2006-6 1A1' FRN 25/11/2036	752,461	0.01
USD 124,296	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 'Series 2004-5 2A' FRN 25/7/2034	125,368	0.00
USD 194,491	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-HE7 'Series 2004-HE7 M2' FRN 25/8/2034	192,478	0.00
USD 2,824,247	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-AC9 (Step-up coupon) 'Series 2005- AC9 A5' 6.25% 25/12/2035	2,817,343	0.03
USD 3,979,557	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-AC1 (Step-up coupon) 'Series 2006- AC1 1A2' 6.25% 25/2/2036	3,749,919	0.04
USD 1,354,336	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE1 'Series 2006-HE1 1M4' FRN 25/12/2035	1,800,369	0.02
USD 4,123,878	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE7 'Series 2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	5,165,108	0.05
USD 1,222,246	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-FS1 'Series 2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,315,995	0.01
USD 662,140	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	656,092	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 836,605	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 1A4' FRN 25/3/2037	625,008	0.01
USD 989,247	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	984,222	0.01
USD 2,126,876	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 23A' FRN 25/3/2037	2,271,575	0.02
USD 916,543	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 'Series 2007-HE3 1A3' FRN 25/4/2037	979,269	0.01
USD 5,267,980	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 'Series 2007-HE3 1A4' FRN 25/4/2037	4,627,177	0.05
USD 127,532	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-4 'Series 2005-4 M2' FRN 25/1/2036	127,559	0.00
USD 577,401	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2005- PWR7 'Series 2005-PWR7 B' FRN 11/2/2041	576,296	0.01
USD 798,641	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007- TOP26 'Series 2007-T26 AM' FRN 12/1/2045	797,730	0.01
USD 889,603	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 'Series 2006- SL1 A1' FRN 25/8/2036	889,392	0.01
USD 580,943	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 'Series 2007- AR2 A1' FRN 25/3/2037	546,651	0.01
USD 887,595	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 'Series 2007- AR3 1A1' FRN 25/3/2037	856,875	0.01
USD 706,333	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 'Series 2007- AR4 2A1' FRN 25/6/2037	686,752	0.01
USD 5,229,000	Beazer Homes USA Inc 8.75% 15/3/2022	5,470,841	0.06
EUR 320,000	Belden Inc 2.875% 15/9/2025*	361,757	0.00
EUR 1,560,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	1,825,255	0.02
USD 200,000	BENCHMARK 2018-B3 Mortgage Trust 'Series 2018-B3 D' '144A' FRN 10/4/2051	190,680	0.00
USD 11,065,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA A2R' '144A' FRN 15/7/2029	11,036,528	0.11
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA CR' '144A' FRN 15/7/2029	501,054	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO III Ltd 'Series 2013-IIIA A1R' '144A' FRN 20/7/2029	501,973	0.01
USD 5,972,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A1R' '144A' FRN 18/10/2029	5,972,317	0.06
USD 1,440,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A2R' '144A' FRN 18/10/2029	1,434,032	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA CR' '144A' FRN 18/10/2029	610,259	0.01
USD 1,770,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA A1AR' '144A' FRN 18/7/2027	1,764,909	0.02
USD 2,370,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA D' '144A' FRN 18/7/2027	2,365,720	0.02
USD 1,110,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd 'Series 2015-8A A1AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,102,949	0.01
USD 370,000	Benefit Street Partners Clo XII Ltd 'Series 2017-12A D' '144A' FRN 15/10/2030	350,378	0.00
USD 1,630,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2047	1,915,861	0.02
USD 1,550,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2050	1,815,019	0.02
USD 1,730,000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 1/4/2036	2,446,587	0.03
USD 4,820,000	BHMS 2018-ATLS 'Series 2018- ATLS A' '144A' FRN 15/7/2035	4,829,038	0.05
USD 4,000,000	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 6/2/2026	3,999,784	0.04
USD 441,391	Black Diamond CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R' '144A' FRN 17/10/2026	441,680	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,970,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,967,682	0.03
USD	480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	481,365	0.01
USD	889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	886,920	0.01
USD	530,000	BlueMountain CLO 2015-3 Ltd 'Series 2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2031	525,950	0.01
USD	250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/8/2028	249,846	0.00
USD	2,370,000	Boeing Co/The 2.95% 1/2/2030	2,461,345	0.03
USD	3,866,000	Boston Properties LP 3.4% 21/6/2029	4,099,301	0.04
USD	1,717,000	Boyd Gaming Corp 6.875% 15/5/2023	1,787,449	0.02
USD	3,758,000	Brinker International Inc '144A' 5% 1/10/2024	3,889,530	0.04
USD	750,000	Bristol Park CLO Ltd 'Series 2016- 1A E' '144A' FRN 15/4/2029	742,416	0.01
USD	5,704,000	Bristow Group Inc (Restricted) (Defaulted) '144A' 8.75% 1/3/2023*	5,504,360	0.06
USD	3,680,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.2% 15/1/2021	3,663,930	0.04
USD	7,805,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15/1/2027	7,776,523	0.08
USD	6,245,000	Broadcom Inc '144A' 3.125% 15/4/2021	6,292,682	0.06
USD	6,540,000	Broadcom Inc '144A' 3.625% 15/10/2024	6,644,214	0.07
USD	4,440,000	Broadcom Inc '144A' 4.75% 15/4/2029	4,682,741	0.05
USD	6,239,000	Bruin E&P Partners LLC '144A' 8.875% 1/8/2023	4,484,281	0.05
USD	4,430,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	4,452,172	0.05
USD	203,000	Builders FirstSource Inc '144A' 5.625% 1/9/2024	212,643	0.00
USD	1,060,000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.55% 15/2/2050	1,165,163	0.01
USD	2,810,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 A2' '144A' 3.454% 10/3/2033	3,009,686	0.03
USD	2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 D' '144A' 3.633% 10/3/2033	2,858,414	0.03
USD	14,000,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 E' '144A' 3.717% 10/3/2033	14,602,696	0.15
USD	2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust 'Series 2015-1740 E' '144A' FRN 10/1/2035	2,098,227	0.02
USD	1,110,000	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA 'Series 2018-BIOA E' '144A' FRN 15/3/2037	1,112,552	0.01
USD	11,077,367	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018-IND H' '144A' FRN 15/11/2035	11,126,526	0.11
USD	600,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017- CC D' '144A' FRN 13/8/2037	613,566	0.01
USD	2,260,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017- CC E' '144A' FRN 13/8/2037	2,295,509	0.02
USD	470,000	BXP Trust 2017-GM 'Series 2017- GM D' '144A' FRN 13/6/2039	494,505	0.01
USD	990,000	BXP Trust 2017-GM 'Series 2017- GM E' '144A' FRN 13/6/2039	983,530	0.01
USD	1,689,000	Caesars Entertainment Corp 5% 1/10/2024	2,856,996	0.03
USD	1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,252,697	0.01
USD	1,560,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2047	1,868,560	0.02
USD	1,120,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 1/11/2047	1,762,824	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,970,000	California Pollution Control Financing Authority '144A' 5% 21/11/2045	2,114,263	0.02
USD	1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,832,943	0.03
USD	1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,535,200	0.02
USD	1,930,000	Calpine Corp '144A' 5.875% 15/1/2024	1,976,050	0.02
USD	1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2045	1,837,074	0.02
USD	1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2048	1,875,604	0.02
USD	1,859,000	Capital One Financial Corp FRN 1/6/2020 (Perpetual)	1,880,313	0.02
USD	11,623,000	Capital One Financial Corp 3.9% 29/1/2024	12,332,433	0.13
USD	1,515,000	Capitol Investment Merger Sub 2 LLC '144A' 10% 1/8/2024	1,571,812	0.02
USD	2,959,000	Carlson Travel Inc '144A' 6.75% 15/12/2023	3,010,782	0.03
USD	210,000	Carlson Travel Inc '144A' 9.5% 15/12/2024	211,050	0.00
USD	2,260,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A AR' '144A' FRN 18/1/2029	2,251,598	0.02
USD	2,020,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ' Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 17/4/2031	1,999,800	0.02
USD	250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A CR' '144A' FRN 27/4/2027	246,545	0.00
USD	250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A DR' '144A' FRN 27/4/2027	239,391	0.00
USD	2,630,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ' Series 2015-3A A2R' '144A' FRN 28/7/2028	2,621,208	0.03
USD	331,348	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' Series 2015-4A SBB1' '144A' FRN 20/7/2032	327,351	0.00
USD	4,750,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd 'Series 2017-4A A1' ' 144A' FRN 15/1/2030	4,736,293	0.05
USD	4,787,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	4,903,519	0.05
USD	1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE1 ' Series 2006- FRE1 A4' FRN 25/4/2036	1,604,745	0.02
USD	2,587,160	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006- FRE2 A5' FRN 25/3/2035	2,017,899	0.02
USD	978,371	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006- FRE2 A2' FRN 25/10/2036	767,109	0.01
USD	2,784,926	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006- FRE2 A3' FRN 25/10/2036	2,194,974	0.02
USD	490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 ' Series 2006- NC1 M2' FRN 25/1/2036	380,483	0.00
USD	876,231	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 ' Series 2006- NC4 A3' FRN 25/10/2036	817,223	0.01
USD	1,442,589	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC5 ' Series 2006- NC5 A3' FRN 25/1/2037	1,197,289	0.01
USD	1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-RFC1 ' Series 2007- RFC1 A4' FRN 25/10/2036	1,166,746	0.01
USD	1,044,000	Carrizo Oil & Gas Inc 6.25% 15/4/2023*	1,003,806	0.01
USD	7,500,000	CBAM 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 20/7/2030	7,475,630	0.08
USD	780,000	CBAM 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A B1' '144A' FRN 17/10/2029	779,205	0.01
USD	250,000	CBAM 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A B1' '144A' FRN 17/10/2029	247,715	0.00
USD	390,000	CBAM 2018-6 Ltd 'Series 2018-6A A' '144A' FRN 15/7/2031	389,334	0.00
USD	640,000	CBAM 2018-6 Ltd 'Series 2018-6A B1' '144A' FRN 15/7/2031	628,917	0.01
USD	276,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.125% 15/2/2023	281,175	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 275,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/5/2023	281,875	0.00
USD 138,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 15/1/2024	141,622	0.00
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT ' Series 2016- HEAT D ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	545,039	0.01
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT ' Series 2016- HEAT X ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	265,069	0.00
USD 1,072,865	CD 2006-CD3 Mortgage Trust ' Series 2006-CD3 AM ' 5.648% 15/10/2048	1,116,069	0.01
USD 1,724,000	CDK Global Inc 3.8% 15/10/2019	1,726,155	0.02
USD 1,157,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	1,220,635	0.01
USD 500,000	CDO Repack SPC Ltd ' Series 2006-CLF1 D1 ' ' 144A ' 20/5/2030 (Zero Coupon)	534,200	0.01
USD 516,000	Cedar Funding II CLO Ltd ' Series 2013-1A A1R ' ' 144A ' FRN 9/6/2030	516,060	0.01
USD 1,600,000	Cedar Funding II CLO Ltd ' Series 2013-1A BR ' ' 144A ' FRN 9/6/2030	1,594,253	0.02
USD 1,290,000	Cedar Funding IX CLO Ltd ' Series 2018-9A A1 ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	1,276,836	0.01
USD 580,000	Cedar Funding IX CLO Ltd ' Series 2018-9A E ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	515,805	0.01
USD 5,620,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ' Series 2016-6A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	5,613,573	0.06
USD 1,200,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ' Series 2016-6A DR ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	1,171,632	0.01
USD 9,480,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ' Series 2017-8A A1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	9,481,691	0.10
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ' Series 2017-8A B ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	573,875	0.01
USD 6,995,000	Celgene Corp (Restricted) 3.875% 15/8/2025	7,583,962	0.08
EUR 100,000	CEMEX Finance LLC 4.625% 15/6/2024	116,262	0.00
USD 3,400,000	Cent CLO 17 Ltd ' 144A ' FRN 30/4/2031	3,362,355	0.03
USD 5,200,000	Cent CLO 24 Ltd ' Series 2015-24A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	5,199,212	0.05
USD 11,178,000	Centennial Resource Production LLC ' 144A ' 5.375% 15/1/2026	10,702,935	0.11
USD 5,433,000	Centennial Resource Production LLC ' 144A ' 6.875% 1/4/2027	5,460,165	0.06
USD 4,350,000	CenterPoint Energy Inc 3.85% 1/2/2024	4,623,597	0.05
USD 1,650,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2050	1,957,065	0.02
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	847,507	0.01
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	854,256	0.01
USD 10,321,000	Century Communities Inc ' 144A ' 6.75% 1/6/2027	10,966,063	0.11
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 ' Series 2016-C3 XD ' ' 144A ' FRN 10/1/2048	520,737	0.01
USD 2,497,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 ' Series 2016-C4 C ' FRN 10/5/2058	2,733,560	0.03
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 ' Series 2016-C4 XB ' FRN 10/5/2058	247,529	0.00
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN ' Series 2018- TAN C ' ' 144A ' 5.295% 15/2/2033	1,162,438	0.01
USD 3,990,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust 2015-SMRT ' Series 2015- SMRT E ' ' 144A ' FRN 10/4/2028	4,011,426	0.04
USD 2,500,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ' Series 2017- BIOC A ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	2,502,320	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,350,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ' Series 2017- BIOC D ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	3,353,423	0.03
USD 6,510,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ' Series 2017- BIOC E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	6,518,147	0.07
USD 188,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital FRN 1/2/2024	191,042	0.00
USD 11,161,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	12,322,564	0.13
USD 2,030,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.05% 30/3/2029	2,294,570	0.02
USD 12,967,970	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 ' Series 2007-S6 1A1 ' 6% 25/12/2037	9,600,528	0.10
USD 9,623,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30/6/2027	10,705,588	0.11
USD 1,373,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31/3/2025	1,541,193	0.02
USD 9,613,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/6/2024	11,127,048	0.11
USD 15,169,532	Cheniere Energy Inc ' 144A ' 4.875% 28/5/2021	15,372,978	0.16
USD 5,849,000	Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025	6,082,960	0.06
USD 380,000	Cheniere Energy Partners LP 5.625% 1/10/2026	401,850	0.00
USD 730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	877,511	0.01
USD 575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	667,750	0.01
USD 238,000	Chesapeake Energy Corp 6.125% 15/2/2021	224,910	0.00
USD 6,298,000	Chesapeake Energy Corp 6.625% 15/8/2020	6,345,235	0.07
USD 2,649,444	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A4 ' Series 2006-0A4 A1 ' FRN 25/4/2046	1,299,611	0.01
USD 627,493	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A5 ' Series 2006-0A5 3A1 ' FRN 25/4/2046	598,364	0.01
USD 7,349,904	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 ' Series 2007-15 2A2 ' 6.5% 25/9/2037	5,408,828	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd ' Series 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 16/7/2030	249,497	0.00
USD 11,000,000	CIFC Funding 2013-II Ltd ' Series 2013-2A A1LR ' ' 144A ' FRN 18/10/2030	10,973,562	0.11
USD 250,000	CIFC Funding 2014 Ltd ' Series 2014-1A A1R2 ' ' 144A ' FRN 18/1/2031	247,375	0.00
USD 12,650,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ' Series 2014-4RA A1A ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	12,640,454	0.13
USD 395,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ' Series 2014-4RA A2 ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	392,105	0.00
USD 941,294	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	939,518	0.01
USD 1,940,000	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A CR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	1,924,007	0.02
USD 940,000	CIFC Funding 2016-I Ltd ' Series 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	939,442	0.01
USD 3,780,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 23/4/2029	3,771,190	0.04
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ' Series 2017-1A C ' ' 144A ' FRN 23/4/2029	2,733,084	0.03
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-II Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 20/4/2030	1,000,173	0.01
USD 2,395,000	Cigna Corp 3.75% 15/7/2023	2,517,394	0.03
USD 2,174,000	Cigna Corp 4.125% 15/11/2025	2,358,613	0.02
USD 1,300,000	Cigna Corp 4.375% 15/10/2028	1,453,895	0.02
USD 866,000	Cigna Corp 4.9% 15/12/2048	1,028,719	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 759,000	Citigo Holding Inc '144A' 9.25% 1/8/2024	805,489	0.01
USD 1,952,293	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-9 'Series 2007-9 1A1' 6.25% 25/12/2037	1,758,257	0.02
USD 2,359,554	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2008-2 'Series 2008-2 1A1' 6.5% 25/6/2038	2,075,200	0.02
USD 2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series 2007-2 (Step-up coupon) 'Series 2007-2 M1' 5.015% 25/6/2037	2,270,279	0.02
USD 1,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ' Series 2014- GC19 C' FRN 10/3/2047	1,854,745	0.02
USD 4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 ' Series 2015- GC27 C' FRN 10/2/2048	4,431,820	0.05
USD 300,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2 ' Series 2015- SHP2 F' '144A' FRN 15/7/2027	307,246	0.00
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1 ' Series 2016-C1 C' FRN 10/5/2049	1,333,998	0.01
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ' Series 2016-P3 C' FRN 15/4/2049	110,466	0.00
USD 308,983	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ' Series 2016-P3 D' '144A' FRN 15/4/2049	277,514	0.00
USD 2,929,000	Citigroup Inc FRN 24/4/2025	3,058,542	0.03
USD 430,000	Citigroup Inc FRN 10/1/2028	466,041	0.01
USD 11,171,000	Citigroup Inc FRN 23/4/2029	12,333,829	0.13
USD 280,000	Citigroup Inc 3.3% 27/4/2025	296,024	0.00
USD 6,180,000	Citigroup Inc 4.45% 29/9/2027	6,821,790	0.07
USD 5,623,152	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 'Series 2007-AHL2 A3B' FRN 25/5/2037	4,141,381	0.04
USD 1,927,594	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 'Series 2007-AHL2 A3C' FRN 25/5/2037	1,433,393	0.01
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 'Series 2007- WFH2 M3' FRN 25/3/2037	2,666,515	0.03
USD 2,610,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc 'Series 2006- WFH4 M3' FRN 25/11/2036	2,317,802	0.02
USD 2,700,000	City & County of Denver CO 5% 1/8/2044	3,242,984	0.03
USD 840,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	994,371	0.01
USD 3,280,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2041	3,978,427	0.04
USD 3,170,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2046	3,810,182	0.04
USD 1,560,000	City of Austin TX Water & Wastewater System Revenue 5% 15/11/2043	1,798,290	0.02
USD 3,475,000	City of New York NY 2.85% 1/8/2031	3,629,881	0.04
USD 5,715,000	City of New York NY 2.9% 1/8/2032	5,987,120	0.06
USD 4,515,000	City of New York NY 6.271% 1/12/2037	6,471,146	0.07
USD 500,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	597,760	0.01
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,861,566	0.02
USD 800,000	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 5% 1/2/2048	889,224	0.01
USD 216,000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15/8/2027	226,260	0.00
USD 1,375,000	Clear Creek CLO 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2030	1,270,423	0.01
USD 522,000	CLNS Trust 2017-IKPR 'Series 2017- IKPR E' ' 144A' FRN 11/6/2032	524,238	0.01
USD 720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	760,568	0.01
USD 2,590,000	Comcast Corp 3.95% 15/10/2025	2,838,106	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,720,000	Comcast Corp 3.999% 1/11/2049	4,197,203	0.04
USD 45,000	Comcast Corp 4% 1/3/2048	50,945	0.00
USD 2,560,000	Comcast Corp 4.15% 15/10/2028	2,903,180	0.03
USD 1,425,000	Comcast Corp 4.25% 15/10/2030	1,659,181	0.02
USD 1,795,000	Comcast Corp 4.95% 15/10/2058	2,334,401	0.02
USD 319,871	COMM 2005-C6 Mortgage Trust 'Series 2005-C6 F' '144A' FRN 10/6/2044	326,005	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 'Series 2013-300P D' '144A' FRN 10/8/2030	105,811	0.00
USD 640,000	COMM 2013-GAM 'Series 2013- GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	645,960	0.01
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust 'Series 2013-WWP D' '144A' 3.898% 10/3/2031	1,855,418	0.02
USD 1,500,000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 'Series 2014-CR15 C' FRN 10/2/2047	1,637,408	0.02
USD 1,314,000	COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS4 C' FRN 10/8/2047	1,384,036	0.01
USD 210,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CMC' '144A' FRN 10/5/2048	211,347	0.00
USD 2,340,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CMD' '144A' FRN 10/5/2048	2,343,176	0.02
USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CME' '144A' FRN 10/5/2048	1,948,470	0.02
USD 880,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'Series 2015-CR25 C' FRN 10/8/2048	935,632	0.01
USD 7,989,284	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'Series 2015-CR25 XA' FRN 10/8/2048	328,049	0.00
USD 1,860,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 'Series 2015-LC19 C' FRN 10/2/2048	1,985,775	0.02
USD 1,536,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 'Series 2015-LC19 D' '144A' FRN 10/2/2048	1,439,777	0.02
USD 1,500,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 C' FRN 10/7/2048	1,598,502	0.02
USD 1,380,000	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 'Series 2015-LC23 A4' 3.774% 10/10/2048	1,509,754	0.02
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 'Series 2016-667M D' '144A' FRN 10/10/2036	1,126,775	0.01
USD 116,665,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 'Series 2016-667M XA' '144A' FRN 10/10/2036	594,992	0.01
USD 740,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust 'Series 2017-COR2 D' '144A' 3% 10/9/2050	689,321	0.01
USD 3,050,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 'Series 2018-COR3 XD' '144A' FRN 10/5/2051	389,546	0.00
USD 3,747,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	3,868,777	0.04
USD 5,416,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,416,000	0.06
USD 1,634,000	Commercial Metals Co 5.75% 15/4/2026	1,678,935	0.02
USD 54,363	Commercial Mortgage Trust 2006- GG7 'Series 2006- GG7 AM' FRN 10/7/2038	54,733	0.00
USD 2,464,000	CommonSpirit Health 3.347% 1/10/2029	2,542,747	0.03
USD 1,627,000	CommonSpirit Health 4.187% 1/10/2049	1,739,799	0.02
USD 1,285,000	CommonSpirit Health 4.35% 1/11/2042	1,388,993	0.01
USD 7,775,000	Commonwealth Financing Authority 3.807% 1/6/2041	9,013,635	0.09
USD 2,100,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	2,386,839	0.02
USD 1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038*	1,719,141	0.02
USD 4,710,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035	2,625,825	0.03
USD 2,000,000	CommScope Inc '144A' 5.5% 1/3/2024	2,045,000	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,000,000	CommScope Inc '144A' 5.5% 15/6/2024	947,500	0.01
USD	1,815,000	CommScope Inc '144A' 6% 1/3/2026	1,851,300	0.02
USD	1,000,000	CommScope Inc '144A' 8.25% 1/3/2027	983,750	0.01
USD	1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,604,330	0.02
USD	2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,379,070	0.02
USD	1,630,850	Conseco Finance Corp 'Series 1997-3 M1' FRN 15/3/2028	1,647,411	0.02
USD	953,096	Conseco Finance Corp 'Series 1997-6 M1' FRN 15/1/2029	976,395	0.01
USD	1,339,657	Conseco Finance Corp 'Series 1999-5 A5' FRN 1/3/2030	986,674	0.01
USD	980,320	Conseco Finance Corp 'Series 1999-5 A6' FRN 1/3/2030	697,670	0.01
USD	285,088	Conseco Finance Corp 'Series 1998-4 M1' FRN 1/4/2030	265,960	0.00
USD	698,262	Conseco Finance Corp 'Series 1998-6 M1' FRN 1/6/2030	675,527	0.01
USD	2,117,920	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 M1' FRN 1/9/2030	1,920,905	0.02
USD	888,963	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 A1' 6.28% 1/9/2030	948,784	0.01
USD	1,323,631	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-1 A5' FRN 1/9/2029	587,983	0.01
USD	1,653,836	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A6' FRN 1/5/2032	719,686	0.01
USD	1,915,218	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A6' 7.96% 1/5/2031	1,062,786	0.01
USD	4,611,852	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A5' 7.97% 1/5/2032	1,925,531	0.02
USD	3,485,723	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A7' 8.2% 1/5/2031	1,988,803	0.02
USD	143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	149	0.00
USD	5,106,000	Continental Resources Inc/OK 5% 15/9/2022	5,147,404	0.05
USD	890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,240,949	0.01
USD	8,992,000	Core Industrial Trust 2015-CALW 'Series 2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	9,090,328	0.09
USD	2,480,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW D' '144A' FRN 10/2/2034	2,574,530	0.03
USD	1,269,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW E' '144A' FRN 10/2/2034	1,310,685	0.01
USD	3,140,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW F' '144A' FRN 10/2/2034	3,226,031	0.03
USD	13,239,906	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	204,689	0.00
USD	424,000	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST E' '144A' FRN 10/2/2037	454,452	0.00
USD	27,146,221	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	1,259,313	0.01
EUR	200,000	Coty Inc 4% 15/4/2023	220,149	0.00
USD	4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 'Series 2006-BC4 M1' FRN 25/11/2036	4,228,208	0.04
USD	1,331,769	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) 'Series 2006-S3 A4' 6.634% 25/1/2029	1,440,715	0.02
USD	540,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2032	708,844	0.01
USD	540,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2033	707,022	0.01
USD	1,140,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2035	1,481,327	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 970,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2041	1,235,693	0.01
USD 1,930,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2042	2,456,012	0.03
USD 1,670,000	County of King WA Sewer Revenue 5% 1/7/2047	1,932,474	0.02
USD 3,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	3,596,846	0.04
USD 455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	495,402	0.01
USD 835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	913,252	0.01
USD 780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	854,548	0.01
USD 1,545,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,770,176	0.02
USD 1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	2,114,080	0.02
USD 1,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2040	1,888,045	0.02
USD 2,810,000	Cox Communications Inc '144A' 3.25% 15/12/2022	2,887,581	0.03
USD 1,491,000	Cox Communications Inc '144A' 3.5% 15/8/2027	1,568,209	0.02
USD 935,573	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A ' Series 2013-A B' '144A' 2.5% 25/1/2030	914,856	0.01
USD 31,016	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp 'Series 2005-C3 C' FRN 15/7/2037	30,909	0.00
USD 9,103	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp 'Series 2005-C2 AMFX' 4.877% 15/4/2037	9,118	0.00
USD 7,509,583	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates ' Series 2009-12R 3A1' '144A' 6.5% 27/10/2037	4,335,738	0.04
USD 2,161,359	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 'Series 2007- CB6 A4' '144A' FRN 25/7/2037	1,485,242	0.02
USD 395,153	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-CB2 AF4' 3.43% 25/12/2036	364,479	0.00
USD 3,808,315	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-SL1 A2' '144A' 6.056% 25/9/2036	555,162	0.01
USD 705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-MH1 B1' '144A' 6.25% 25/10/2036	735,489	0.01
USD 1,895,000	Crown Castle International Corp 3.1% 15/11/2029	1,937,183	0.02
USD 12,087,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	12,880,860	0.13
USD 1,080,000	Crown Castle International Corp 4.3% 15/2/2029	1,210,117	0.01
USD 2,983,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15/10/2025	2,949,441	0.03
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2027	321,417	0.00
USD 830,000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 'Series 2018-C14 C' FRN 15/11/2051	948,213	0.01
USD 4,898,000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 15/7/2023	5,038,817	0.05
USD 329,000	CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 1/2/2028	350,796	0.00
USD 492,000	CSC Holdings LLC '144A' 5.5% 15/5/2026	520,597	0.01
USD 553,000	CSC Holdings LLC '144A' 5.5% 15/4/2027	593,093	0.01
USD 675,000	CSC Holdings LLC '144A' 6.5% 1/2/2029	754,734	0.01
USD 5,781,000	CSC Holdings LLC '144A' 6.625% 15/10/2025	6,212,899	0.06
USD 8,739,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.875% 15/10/2025	9,935,151	0.10

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,051,781	CSFB Mortgage-Backed PassThrough Certificates Series 2005-10 'Series 2005-10 10A1' FRN 25/11/2035	328,809	0.00
USD	122,260,000	CSMC 2014-USA 0A LLC 'Series 2014-USA X2' '144A' FRN 15/9/2037	558,728	0.01
USD	770,000	CSMC 2017-TIME 'Series 2017-TIME A' '144A' 3.646% 13/11/2039	847,440	0.01
USD	9,610,457	CSMC 2018-RPL8 Trust 'Series 2018-RPL8 A1' '144A' FRN 25/7/2058	9,773,352	0.10
USD	2,130,050	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 'Series 2007-5 1A11' FRN 25/8/2037	1,749,982	0.02
USD	1,814,681	CSMC Series 2009-5R 'Series 2009-5R 4A4' '144A' FRN 25/6/2036	1,689,444	0.02
USD	3,321,384	CSMC Series 2014-11R 'Series 2014-11R 16A1' '144A' FRN 27/9/2047	3,271,645	0.03
USD	858,624	CSMC Series 2014-4R 'Series 2014-4R 16A3' '144A' FRN 27/2/2036	824,716	0.01
USD	1,402,896	CSMC Series 2014-9R 'Series 2014-9R 9A1' '144A' FRN 27/8/2036	1,280,959	0.01
USD	1,650,000	CSMC Series 2015-4R 'Series 2015-4R 1A4' '144A' FRN 27/10/2036	1,175,561	0.01
USD	570,000	CSMC Series 2015-4R 'Series 2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	565,777	0.01
USD	142,330	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	142,167	0.00
USD	2,708,147	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	2,125,895	0.02
USD	879,000	CSMC Trust 2017-CHOP 'Series 2017-CHOP E' '144A' FRN 15/7/2032	882,059	0.01
USD	790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 'Series 2017-PFHP A' '144A' FRN 15/12/2030	790,625	0.01
USD	1,214,000	CSWF 2018-TOP 'Series 2018-TOP A' '144A' FRN 15/8/2035	1,217,716	0.01
USD	530,000	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2028	520,944	0.01
USD	333,500	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A ER' '144A' FRN 20/7/2028	323,485	0.00
USD	633,163	Cutwater 2014-I Ltd 'Series 2014-1A A1AR' '144A' FRN 15/7/2026	633,249	0.01
USD	300,748	CVP Cascade CLO-1 Ltd 'Series 2013-CLO1 A1R' '144A' FRN 16/1/2026	300,747	0.00
USD	286,000	CVR Refining LLC / Coffeyville Finance Inc 6.5% 1/11/2022	290,290	0.00
USD	850,000	CVS Health Corp 2.625% 15/8/2024	856,690	0.01
USD	545,000	CVS Health Corp 3% 15/8/2026	551,211	0.01
USD	3,240,000	CVS Health Corp 3.5% 20/7/2022	3,356,600	0.03
USD	4,320,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	4,513,491	0.05
USD	6,972,000	CVS Health Corp 4.1% 25/3/2025	7,457,162	0.08
USD	6,511,798	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 1AF' FRN 25/4/2036	6,521,986	0.07
USD	1,392,799	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 2AF3' FRN 25/5/2036	1,419,853	0.01
USD	5,183,901	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 (Step-up coupon) 'Series 2005-17 1AF4' 6.047% 25/5/2036	5,364,768	0.06
USD	211,187	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 'Series 2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	208,650	0.00
USD	736,723	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 'Series 2004-U 2A' FRN 15/3/2034	707,555	0.01
USD	52,499	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S2 'Series 2006-S2 A3' 5.841% 25/7/2027	130,586	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 583,555	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 ' Series 2006-S5 A5 ' 6.155% 25/6/2035	641,305	0.01
USD 6,436,462	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES ' Series 2006-RES 5B1A ' ' 144A ' FRN 15/5/2035	6,125,366	0.06
USD 220,239	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES ' Series 2006-RES 5B1B ' ' 144A ' FRN 15/5/2035	212,013	0.00
USD 1,019,859	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES ' Series 2006-RES 5F1A ' ' 144A ' FRN 15/12/2035	1,011,360	0.01
USD 670,755	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B ' Series 2005-B 2A ' FRN 15/5/2035	653,090	0.01
USD 3,008,839	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C ' Series 2006-C 2A ' FRN 15/5/2036	2,937,132	0.03
USD 1,577,807	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H ' Series 2006-H 1A ' FRN 15/11/2036	1,351,093	0.01
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,735,049	0.02
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,328,392	0.02
USD 1,530,000	Dallas/Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	1,607,571	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	354,807	0.00
USD 2,664,000	Danaher Corp 3.35% 15/9/2025	2,847,061	0.03
USD 2,150,000	DaVita Inc 5.75% 15/8/2022	2,173,220	0.02
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust ' Series 2017-C6 XD ' FRN 10/6/2050	283,682	0.00
USD 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust ' Series 2011-LC1A E ' ' 144A ' FRN 10/11/2046	933,761	0.01
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ' Series 2017-BRBK D ' ' 144A ' FRN 10/10/2034	1,122,955	0.01
USD 9,600,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ' Series 2017-BRBK E ' ' 144A ' FRN 10/10/2034	9,781,824	0.10
USD 2,040,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ' Series 2017-BRBK F ' ' 144A ' FRN 10/10/2034	2,050,273	0.02
USD 5,733,000	DCP Midstream Operating LP ' 144A ' 5.35% 15/3/2020	5,816,129	0.06
USD 8,054,120	DCP Rights LLC ' Series 2014-1A A ' ' 144A ' 5.463% 25/10/2044	8,414,415	0.09
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	496,679	0.01
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	468,812	0.01
USD 2,370,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 4.42% 15/6/2021	2,441,952	0.03
USD 411,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 5.875% 15/6/2021	417,846	0.00
USD 3,324,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 6.02% 15/6/2026	3,725,726	0.04
USD 311,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 7.125% 15/6/2024	327,862	0.00
USD 108,976	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT ' Series 2007-RS1 A2 ' ' 144A ' FRN 27/1/2037	104,162	0.00
USD 7,895,352	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE ' Series 2007-OA4 A2A ' FRN 25/8/2047	5,549,271	0.06
USD 451,627	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 ' Series 2006-AB3 A3 ' FRN 25/7/2036	427,473	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 288,280	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 'Series 2006-AB3 A8' FRN 25/7/2036	272,894	0.00
USD 1,000,000	Dewolf Park Clo Ltd 'Series 2017- 1A E' '144A' FRN 15/10/2030	950,850	0.01
USD 2,727,000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 5.375% 15/8/2026	2,871,940	0.03
USD 1,050,000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 6.625% 15/8/2027	1,098,825	0.01
USD 5,699,000	Diamondback Energy Inc 4.75% 1/11/2024	5,905,589	0.06
USD 12,702,000	Diamondback Energy Inc 5.375% 31/5/2025	13,412,804	0.14
USD 2,347,000	Dignity Health 2.637% 1/11/2019	2,347,095	0.02
USD 1,340,000	Dignity Health 3.812% 1/11/2024	1,433,305	0.01
USD 2,050,000	Discover Financial Services 4.1% 9/2/2027	2,206,888	0.02
USD 2,285,000	Discovery Communications LLC 2.95% 20/3/2023	2,332,144	0.02
USD 265,000	DISH DBS Corp 7.875% 1/9/2019	265,000	0.00
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,119,712	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,115,936	0.01
USD 929,000	Dominion Energy Inc (Step-up coupon) 2.715% 15/8/2021	936,522	0.01
USD 1,507,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A BR' '144A' FRN 20/4/2028	1,489,749	0.02
USD 640,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 20/4/2028	631,896	0.01
USD 11,181,000	Dryden 53 CLO Ltd 'Series 2017- 53A A' '144A' FRN 15/1/2031	11,142,015	0.11
USD 510,000	Dryden 55 CLO Ltd 'Series 2018- 55A A1' '144A' FRN 15/4/2031	505,725	0.01
USD 250,000	Dryden Senior Loan Fund 'Series 2017-47A E' '144A' FRN 15/4/2028	235,874	0.00
USD 6,250,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A ARR' '144A' FRN 15/10/2027	6,244,005	0.06
USD 500,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A CRR' '144A' FRN 15/10/2027	494,049	0.01
USD 530,000	Dryden XXVI Senior Loan Fund 'Series 2013-26A AR' '144A' FRN 15/4/2029	526,764	0.01
USD 6,505,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 'Series 2013-28A A1LR' '144A' FRN 15/8/2030	6,507,480	0.07
USD 1,010,000	DTE Energy Co 2.6% 15/6/2022	1,020,042	0.01
USD 1,070,000	DuBois Hospital Authority 5% 15/7/2043	1,272,979	0.01
USD 1,290,000	Duke Energy Corp 3.15% 15/8/2027	1,354,458	0.01
USD 3,190,000	Duke University 3.299% 1/10/2046	3,517,682	0.04
USD 750,000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 10.25% 15/2/2027	822,188	0.01
USD 4,320,000	DuPont de Nemours Inc 4.205% 15/11/2023	4,641,866	0.05
USD 2,785,000	DuPont de Nemours Inc 4.493% 15/11/2025	3,090,857	0.03
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,563,705	0.03
USD 743,000	Elanco Animal Health Inc 3.912% 27/8/2021	757,181	0.01
USD 1,118,000	Elanco Animal Health Inc 4.272% 28/8/2023	1,170,651	0.01
USD 1,118,000	Elanco Animal Health Inc 4.9% 28/8/2028	1,209,059	0.01
USD 225,000	Eldorado Resorts Inc 7% 1/8/2023	235,688	0.00
USD 500,000	Elevation CLO 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A DR' '144A' FRN 15/10/2026	501,321	0.01
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust 'Series 2015- 11MD A' '144A' FRN 10/9/2035	1,041,840	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 260,000	EMC Corp 2.65% 1/6/2020	258,930	0.00
USD 560,000	Emerson Park CLO Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' ' FRN 15/7/2025	559,886	0.01
USD 2,430,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A' 5.5% 30/1/2026	2,536,313	0.03
USD 743,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A' 5.75% 30/1/2028	782,008	0.01
USD 11,093,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	11,510,984	0.12
USD 3,305,000	Energy Transfer Operating LP 4.25% 15/3/2023	3,471,480	0.04
USD 1,654,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	1,773,839	0.02
USD 6,295,000	Energy Transfer Operating LP 5.25% 15/4/2029	7,223,682	0.07
USD 5,722,000	Energy Transfer Operating LP 6.25% 15/4/2049	7,094,442	0.07
USD 4,743,000	Energy Transfer Operating LP 7.5% 15/10/2020	5,007,237	0.05
USD 4,110,000	EnLink Midstream Partners LP FRN 15/12/2022 (Perpetual)	3,103,050	0.03
USD 1,860,000	Enterprise Products Operating LLC 3.125% 31/7/2029	1,928,237	0.02
USD 4,320,000	Enterprise Products Operating LLC 3.75% 15/2/2025	4,629,622	0.05
USD 6,787,000	Enterprise Products Operating LLC 3.9% 15/2/2024	7,258,146	0.07
USD 3,865,000	Enterprise Products Operating LLC 4.15% 16/10/2028	4,298,956	0.04
USD 724,000	Enterprise Products Operating LLC 4.2% 31/1/2050	788,639	0.01
EUR 1,732,000	Equinix Inc 2.875% 15/3/2024	1,991,901	0.02
EUR 785,000	Equinix Inc 2.875% 1/10/2025	903,316	0.01
EUR 100,000	Equinix Inc 2.875% 1/2/2026	115,975	0.00
USD 551,000	Equinix Inc 5.375% 1/1/2022	566,153	0.01
USD 1,710,000	ERP Operating LP 2.5% 15/2/2030	1,721,440	0.02
USD 5,072,000	ERP Operating LP 3% 1/7/2029	5,310,408	0.05
USD 1,221,000	ERP Operating LP 3.25% 1/8/2027	1,304,012	0.01
USD 1,217,000	ESH Hospitality Inc '144A' 5.25% 1/5/2025	1,259,595	0.01
USD 3,543,335	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd 'Series 2018- RS06 A' '144A' FRN 15/6/2035	3,549,839	0.04
USD 2,705,000	Extraction Oil & Gas Inc '144A' 7.375% 15/5/2024	2,042,275	0.02
USD 1,861,380	Fannie Mae Pool '890694' 4% 1/9/2045	2,011,202	0.02
USD 168,962	Fannie Mae Pool '890751' 4% 1/9/2046	180,769	0.00
USD 1,446,386	Fannie Mae Pool 'AB8742' 4% 1/3/2043	1,575,879	0.02
USD 1,961,965	Fannie Mae Pool 'AB9076' 4% 1/4/2043	2,137,399	0.02
USD 3,786,252	Fannie Mae Pool 'AE0625' 4% 1/12/2040	4,106,614	0.04
USD 43,013	Fannie Mae Pool 'AL5624' 4.5% 1/8/2044	47,919	0.00
USD 91,456	Fannie Mae Pool 'AL8195' 4.5% 1/2/2046	101,874	0.00
USD 2,369,766	Fannie Mae Pool 'AL9276' 4% 1/9/2046	2,541,450	0.03
USD 107,359	Fannie Mae Pool 'AL9281' 4.5% 1/9/2046	115,552	0.00
USD 112,077	Fannie Mae Pool 'AL9520' 4% 1/2/2046	119,918	0.00
USD 325,544	Fannie Mae Pool 'AL9980' 4% 1/2/2046	348,293	0.00
USD 2,622,667	Fannie Mae Pool 'AP6347' 4% 1/9/2042	2,858,175	0.03
USD 947,782	Fannie Mae Pool 'AS3707' 4% 1/11/2044	1,011,056	0.01
USD 5,507,117	Fannie Mae Pool 'AS4067' 4% 1/12/2044	6,001,184	0.06
USD 43,880	Fannie Mae Pool 'AS5848' 4.5% 1/9/2045	48,889	0.00
USD 109,732	Fannie Mae Pool 'AS6016' 4% 1/10/2045	117,414	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 63,722	Fannie Mae Pool 'AS6220' 4% 1/11/2045	68,184	0.00
USD 2,678,463	Fannie Mae Pool 'AS6840' 4% 1/3/2046	2,857,440	0.03
USD 3,847,170	Fannie Mae Pool 'AS7940' 4% 1/9/2046	4,104,702	0.04
USD 4,218,349	Fannie Mae Pool 'AS8376' 4% 1/11/2046	4,500,738	0.05
USD 6,307,265	Fannie Mae Pool 'AS8377' 4% 1/11/2046	6,729,493	0.07
USD 190,118	Fannie Mae Pool 'AS9920' 4% 1/7/2047	202,813	0.00
USD 1,601,918	Fannie Mae Pool 'BC0170' 4% 1/1/2046	1,708,961	0.02
USD 1,812,195	Fannie Mae Pool 'BC0908' 4% 1/5/2046	1,931,252	0.02
USD 3,912,495	Fannie Mae Pool 'BC1222' 4% 1/7/2046	4,227,385	0.04
USD 250,901	Fannie Mae Pool 'BD6043' 4% 1/8/2046	271,095	0.00
USD 7,619,886	Fannie Mae Pool 'BD7085' 4% 1/3/2047	8,232,056	0.08
USD 28,252	Fannie Mae Pool 'BE5013' 4% 1/2/2045	30,229	0.00
USD 1,408,292	Fannie Mae Pool 'BE5047' 4% 1/11/2046	1,521,620	0.02
USD 842,332	Fannie Mae Pool 'BJ8745' 3.5% 1/8/2049	881,898	0.01
USD 735,894	Fannie Mae Pool 'BJ8749' 3.5% 1/9/2049	773,616	0.01
USD 313,440	Fannie Mae Pool 'BJ8759' 3% 1/8/2034	322,136	0.00
USD 159,957	Fannie Mae Pool 'BJ8784' 4% 1/2/2048	174,179	0.00
USD 1,772,911	Fannie Mae Pool 'BK4213' 4% 1/7/2048	1,889,972	0.02
USD 477,472	Fannie Mae Pool 'BM1068' 3.5% 1/1/2032	499,356	0.01
USD 4,602,173	Fannie Mae Pool 'BM1907' 4% 1/11/2046	5,014,272	0.05
USD 14,144,347	Fannie Mae Pool 'BM4299' 3% 1/3/2030	14,542,833	0.15
USD 25,452,789	Fannie Mae Pool 'BM4857' 4% 1/3/2048	27,716,154	0.28
USD 5,317,045	Fannie Mae Pool 'BM4858' 4% 1/8/2048	5,789,890	0.06
USD 16,251,399	Fannie Mae Pool 'BM4859' 4% 1/4/2048	17,547,813	0.18
USD 44,420	Fannie Mae Pool 'BM4888' 4.5% 1/8/2048	49,440	0.00
USD 23,905	Fannie Mae Pool 'BM4889' 4.5% 1/1/2047	25,972	0.00
USD 5,868,242	Fannie Mae Pool 'BM5757' 4% 1/8/2048	6,335,426	0.07
USD 2,071,507	Fannie Mae Pool 'BN7683' 4% 1/8/2049	2,214,940	0.02
USD 1,065,472	Fannie Mae Pool 'BN7715' 3% 1/8/2034	1,095,690	0.01
USD 884,128	Fannie Mae Pool 'BN7720' 3% 1/8/2034	907,180	0.01
USD 278,013	Fannie Mae Pool 'B01822' 3.5% 1/7/2034	288,621	0.00
USD 843,750	Fannie Mae Pool 'B01835' 3.5% 1/7/2034	887,930	0.01
USD 662,918	Fannie Mae Pool 'B01837' 3.5% 1/7/2034	698,041	0.01
USD 10,688,378	Fannie Mae Pool 'B01844' 3.5% 1/8/2049	11,221,117	0.12
USD 868,981	Fannie Mae Pool 'B04492' 3% 1/8/2034	893,091	0.01
USD 109,268	Fannie Mae Pool 'CA1008' 4% 1/1/2048	116,906	0.00
USD 27,262	Fannie Mae Pool 'CA3344' 4.5% 1/4/2049	30,257	0.00
USD 8,261,728	Fannie Mae Pool 'CA3500' 4% 1/5/2049	8,842,557	0.09
USD 6,466,642	Fannie Mae Pool 'CA3668' 4% 1/6/2049	6,841,641	0.07
USD 13,676,039	Fannie Mae Pool 'CA3821' 4% 1/7/2049	14,791,837	0.15
USD 10,177,682	Fannie Mae Pool 'CA3826' 4% 1/7/2049	10,882,702	0.11
USD 3,078,453	Fannie Mae Pool 'CA3831' 4% 1/7/2049	3,348,343	0.03
USD 7,861,168	Fannie Mae Pool 'CA3832' 4% 1/7/2049	8,550,367	0.09
USD 2,862,455	Fannie Mae Pool 'CA3925' 3.5% 1/7/2034	3,012,324	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,742,980	Fannie Mae Pool 'CA4084' 3% 1/9/2034	5,901,612	0.06
USD 3,381,470	Fannie Mae Pool 'CA4087' 3.5% 1/8/2034	3,559,362	0.04
USD 2,859,740	Fannie Mae Pool 'CA4088' 3.5% 1/9/2034	3,003,117	0.03
USD 6,103,479	Fannie Mae Pool 'CA4112' 3.5% 1/9/2049	6,431,288	0.07
USD 7,315,643	Fannie Mae Pool 'CA4119' 4% 1/9/2049	7,703,085	0.08
USD 6,242,040	Fannie Mae Pool 'CA4124' 4% 1/9/2049	6,584,449	0.07
USD 4,961,505	Fannie Mae Pool 'CA4125' 4% 1/8/2049	5,226,629	0.05
USD 3,871,814	Fannie Mae Pool 'FM1326' 4% 1/7/2049	4,139,920	0.04
USD 1,554,935	Fannie Mae Pool 'FM1373' 4% 1/6/2049	1,691,352	0.02
USD 734,045	Fannie Mae Pool 'FM1374' 4% 1/8/2049	791,740	0.01
USD 2,909,571	Fannie Mae Pool 'FM1419' 3.5% 1/9/2049	3,074,748	0.03
USD 4,157,000	FedEx Corp 4.95% 17/10/2048	4,855,862	0.05
EUR 2,030,000	Fidelity National Information Services Inc 2.95% 21/5/2039*	2,839,550	0.03
USD 3,975,000	Fidelity National Information Services Inc 3% 15/8/2026	4,116,885	0.04
GBP 960,000	Fidelity National Information Services Inc 3.36% 21/5/2031	1,319,495	0.01
USD 715,000	Fidelity National Information Services Inc 3.75% 21/5/2029	783,273	0.01
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 'Series 2004-FFH3 M3' FRN 25/10/2034	745,530	0.01
USD 1,897,480	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 'Series 2006-FF13 A1' FRN 25/10/2036	1,554,319	0.02
USD 2,191,635	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 'Series 2006-FFH1 M2' FRN 25/1/2036	1,371,449	0.01
USD 3,480,000	FirstEnergy Corp 3.9% 15/7/2027	3,752,721	0.04
USD 1,970,000	Fiserv Inc 2.75% 1/7/2024	2,016,218	0.02
GBP 920,000	Fiserv Inc 3% 1/7/2031	1,217,538	0.01
USD 9,847,000	Fiserv Inc 3.2% 1/7/2026	10,281,756	0.11
USD 12,325,000	Fiserv Inc 3.5% 1/7/2029	13,069,892	0.13
USD 4,935,000	Fiserv Inc 3.8% 1/10/2023	5,228,857	0.05
USD 845,000	Fiserv Inc 4.2% 1/10/2028	945,714	0.01
USD 7,644,000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15/11/2025	7,701,330	0.08
USD 1,325,651	Flatiron CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 15/4/2027	1,326,445	0.01
USD 3,025,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 15/4/2027	3,017,259	0.03
EUR 2,075,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.514% 17/2/2023	2,333,067	0.02
USD 1,680,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.425% 12/6/2020	1,675,736	0.02
USD 1,680,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	1,688,187	0.02
USD 6,050,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.25% 20/9/2022	6,254,535	0.06
USD 4,038,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 3/5/2029	4,170,614	0.04
USD 4,792,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18/3/2024	5,145,111	0.05
USD 7,774,000	Forestar Group Inc '144A' 8% 15/4/2024	8,415,355	0.09
USD 1,545,000	Fox Corp '144A' 4.03% 25/1/2024	1,655,950	0.02
USD 2,686,274	Freddie Mac Gold Pool 'G60691' 4% 1/6/2046	2,867,532	0.03
USD 652,202	Freddie Mac Gold Pool 'G67702' 4% 1/1/2047	698,129	0.01
USD 1,887,259	Freddie Mac Gold Pool 'Q04688' 4% 1/11/2041	2,017,161	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 27,186	Freddie Mac Gold Pool ' Q48235 ' 4.5% 1/5/2047	30,210	0.00
USD 1,342	Freddie Mac Gold Pool ' Q49807 ' 4.5% 1/8/2047	1,495	0.00
USD 1,734,104	Freddie Mac Gold Pool ' Q50871 ' 4% 1/9/2047	1,890,337	0.02
USD 8,056	Freddie Mac Gold Pool ' Q53762 ' 4.5% 1/1/2048	8,883	0.00
USD 892,548	Freddie Mac Gold Pool ' Q57394 ' 4% 1/7/2048	938,633	0.01
USD 1,439,074	Freddie Mac Gold Pool ' Q57403 ' 4% 1/7/2048	1,511,797	0.02
USD 3,297	Freddie Mac Gold Pool ' Q61428 ' 4.5% 1/2/2049	3,672	0.00
USD 920,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K040 A2 ' 3.241% 25/9/2024	978,932	0.01
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K061 A2 ' FRN 25/11/2026	690,031	0.01
USD 187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K062 A2 ' 3.413% 25/12/2026	206,031	0.00
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K072 A2 ' 3.444% 25/12/2027	698,501	0.01
USD 6,397,836	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K718 X1 ' FRN 25/1/2022	79,658	0.00
USD 824,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K730 A2 ' FRN 25/1/2025	890,504	0.01
USD 6,207,520	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW03 X1 ' FRN 25/6/2027	316,303	0.00
USD 930,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW06 A2 ' FRN 25/6/2028	1,051,695	0.01
USD 783,075	Freddie Mac Pool ' QA1859 ' 4% 1/8/2049	845,428	0.01
USD 424,989	Freddie Mac Pool ' QN0262 ' 3% 1/7/2034	435,743	0.00
USD 445,367	Freddie Mac Pool ' QN0428 ' 3% 1/8/2034	457,447	0.00
USD 396,557	Freddie Mac Pool ' QN0483 ' 3% 1/8/2034	407,560	0.00
USD 1,188,280	Freddie Mac Pool ' SB0034 ' 3.5% 1/8/2034	1,244,270	0.01
USD 8,784,517	Freddie Mac Pool ' SD0052 ' 3.5% 1/8/2049	9,233,552	0.10
USD 30,219,013	Freddie Mac Pool ' SD7501 ' 4% 1/7/2049	32,293,970	0.33
USD 1,060,006	Freddie Mac Pool ' ZM5552 ' 4% 1/2/2048	1,153,108	0.01
USD 791,468	Freddie Mac Pool ' ZS9953 ' 4% 1/2/2047	846,762	0.01
USD 389,631	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-DN1 B ' FRN 25/1/2025	549,165	0.01
USD 412,353	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-HQ2 B ' FRN 25/5/2025	506,548	0.01
USD 1,165,455	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 B1 ' FRN 25/10/2029	1,329,047	0.01
USD 1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA3 B1 ' FRN 25/3/2030	1,702,887	0.02
USD 701,352	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-HRP1 M2 ' FRN 25/12/2042	709,725	0.01
USD 100,109,614	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust ' Series 2015-K718 X2A ' ' 144A ' FRN 25/2/2048	186,114	0.00
USD 1,150,000	FREMF 2016-K54 Mortgage Trust ' Series 2016-K54 B ' ' 144A ' FRN 25/4/2048	1,234,249	0.01
USD 598,333	FREMF 2017-K64 Mortgage Trust ' Series 2017-K64 B ' ' 144A ' FRN 25/5/2050	644,999	0.01
USD 820,000	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust ' Series 2017-KGX1 BFX ' ' 144A ' FRN 25/10/2027	826,835	0.01
USD 1,700,000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust FRN 25/5/2025	1,807,062	0.02
USD 390,000	FREMF 2018-K74 Mortgage Trust ' Series 2018-K74 B ' ' 144A ' FRN 25/2/2051	423,354	0.00
USD 700,000	FREMF 2018-K77 Mortgage Trust ' Series 2018-K77 B ' ' 144A ' FRN 25/5/2051	763,872	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	9,725,971	Fremont Home Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' ' FRN 25/2/2037	7,463,783	0.08
USD	2,198,668	FRESB 2018-SB52 Mortgage Trust 'Series 2018-SB52 A10F' FRN 25/6/2028	2,363,014	0.02
USD	1,326,654	FRESB 2018-SB53 Mortgage Trust 'Series 2018-SB53 A10F' FRN 25/6/2028	1,481,017	0.02
USD	1,572,000	Frontier Communications Corp '144A' 8% 1/4/2027	1,642,740	0.02
USD	1,831,000	Frontier Communications Corp '144A' 8.5% 1/4/2026	1,780,648	0.02
USD	2,198,000	Galaxy XXIII CLO Ltd 'Series 2017- 23A A' '144A' ' FRN 24/4/2029	2,198,612	0.02
USD	250,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018- 29A B' '144A' ' FRN 15/11/2026	248,456	0.00
USD	850,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018- 29A C' '144A' ' FRN 15/11/2026	843,277	0.01
USD	2,130,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018- 29A D' '144A' ' FRN 15/11/2026	2,100,717	0.02
USD	5,056,341	GAM Resecuritization Trust 2018-B FRN 27/1/2027	4,947,415	0.05
USD	282,000	Gates Global LLC / Gates Global Co '144A' 6% 15/7/2022	281,013	0.00
USD	1,230,000	General Electric Co 3.15% 7/9/2022	1,237,066	0.01
USD	1,105,000	General Mills Inc 4.2% 17/4/2028	1,245,015	0.01
USD	3,285,000	General Motors Co FRN 10/9/2021	3,287,672	0.03
USD	4,130,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022	4,185,370	0.04
USD	1,590,000	General Motors Financial Co Inc 3.55% 9/4/2021	1,616,296	0.02
USD	2,060,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	2,135,453	0.02
USD	15,000	General Motors Financial Co Inc 4.35% 17/1/2027	15,554	0.00
USD	6,092,000	General Motors Financial Co Inc 5.1% 17/1/2024	6,586,189	0.07
USD	3,138,000	George Washington University/The 4.126% 15/9/2048	3,881,324	0.04
USD	313,768	GE-WMC Asset-Backed PassThrough Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	312,233	0.00
USD	3,933,673	GE-WMC Asset-Backed PassThrough Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 M1' FRN 25/12/2035	2,472,177	0.03
USD	1,500,000	Gilbert Park CLO Ltd 'Series 2017- 1A E' '144A' ' FRN 15/10/2030	1,435,795	0.02
USD	2,160,000	Gilead Sciences Inc 3.5% 1/2/2025	2,302,319	0.02
USD	9,305,000	Gilead Sciences Inc 3.65% 1/3/2026	10,004,491	0.10
USD	2,455,000	Gilead Sciences Inc 4.8% 1/4/2044	2,968,532	0.03
USD	40,850	GLG Ore Hill CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A' ' 144A' FRN 15/7/2025	40,844	0.00
USD	3,228,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 3.35% 1/9/2024	3,260,183	0.03
USD	1,375,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.375% 15/4/2021	1,406,322	0.01
USD	8,692,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.875% 1/11/2020	8,903,216	0.09
USD	1,880,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.25% 1/6/2025	2,052,152	0.02
USD	904,000	Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15/4/2026	937,900	0.01
USD	720,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd 'Series 2014-9A AR2' '144A' FRN 29/10/2029	719,031	0.01
USD	349,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd 'Series 2015-11A AR2' '144A' FRN 18/1/2031	347,622	0.00
USD	2,080,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN5/6/2023	2,116,076	0.02
USD	410,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 24/7/2023	416,419	0.00
USD	5,365,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	5,940,317	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 310,000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.75% 24/1/2022	335,680	0.00
USD 2,471,412	Government National Mortgage Association ' Series 2013-145 SI ' FRN 16/4/2040	156,786	0.00
USD 4,880,163	Government National Mortgage Association ' Series 2015-48 IO ' FRN 16/2/2050	222,525	0.00
USD 15,768,335	Government National Mortgage Association ' Series 2013-63 IO ' FRN 16/9/2051	850,594	0.01
USD 2,724,257	Government National Mortgage Association ' Series 2012-23 IO ' FRN 16/6/2053	63,932	0.00
USD 11,473,639	Government National Mortgage Association ' Series 2013-30 IO ' FRN 16/9/2053	471,127	0.01
USD 2,254,442	Government National Mortgage Association ' Series 2013-191 IO ' FRN 16/11/2053	75,920	0.00
USD 12,842,523	Government National Mortgage Association ' Series 2013-78 IO ' FRN 16/10/2054	539,613	0.01
USD 15,916,288	Government National Mortgage Association ' Series 2015-22 IO ' FRN 16/3/2055	723,297	0.01
USD 5,748,010	Government National Mortgage Association ' Series 2015-173 IO ' FRN 16/9/2055	373,567	0.00
USD 9,248,223	Government National Mortgage Association ' Series 2016-97 IO ' FRN 16/7/2056	783,144	0.01
USD 12,555,437	Government National Mortgage Association ' Series 2016-128 IO ' FRN 16/9/2056	955,751	0.01
USD 2,240,312	Government National Mortgage Association ' Series 2015-37 IO ' FRN 16/10/2056	129,693	0.00
USD 4,534,871	Government National Mortgage Association ' Series 2016-67 IO ' FRN 16/7/2057	368,442	0.00
USD 3,990,055	Government National Mortgage Association ' Series 2016-36 IO ' FRN 16/8/2057	295,906	0.00
USD 7,010,252	Government National Mortgage Association ' Series 2016-125 IO ' FRN 16/12/2057	554,168	0.01
USD 6,362,460	Government National Mortgage Association ' Series 2016-165 IO ' FRN 16/12/2057	518,001	0.01
USD 15,412,352	Government National Mortgage Association ' Series 2016-96 IO ' FRN 16/12/2057	1,170,819	0.01
USD 7,845,794	Government National Mortgage Association ' Series 2016-113 IO ' FRN 16/2/2058	740,770	0.01
USD 15,896,947	Government National Mortgage Association ' Series 2016-26 IO ' FRN 16/2/2058	1,017,603	0.01
USD 2,502,958	Government National Mortgage Association ' Series 2016-119 IO ' FRN 16/4/2058	188,375	0.00
USD 5,101,485	Government National Mortgage Association ' Series 2016-110 IO ' FRN 16/5/2058	396,511	0.00
USD 7,088,684	Government National Mortgage Association ' Series 2016-152 IO ' FRN 15/8/2058	530,397	0.01
USD 22,644,474	Government National Mortgage Association ' Series 2016-87 IO ' FRN 16/8/2058	1,739,498	0.02
USD 24,051,935	Government National Mortgage Association ' Series 2016-162 IO ' FRN 16/9/2058	1,993,070	0.02
USD 8,644,181	Government National Mortgage Association ' Series 2016-175 IO ' FRN 16/9/2058	642,454	0.01
USD 9,791,823	Government National Mortgage Association ' Series 2018-106 IO ' FRN 16/4/2060	561,506	0.01
USD 603,291	Government National Mortgage Association ' Series 2016-158 VA ' 2% 16/3/2035	586,645	0.01
USD 955,584	Government National Mortgage Association ' Series 2015-97 VA ' 2.25% 16/12/2038	948,868	0.01
USD 10,861,620	Government National Mortgage Association ' Series 2018-85 IO ' FRN 16/6/2060	641,471	0.01
USD 2,509,871	GPMT 2018-FL1 Ltd ' Series 2018- FL1 A ' ' 144A ' FRN 21/11/2035	2,514,494	0.03
USD 9,330,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE E ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	9,457,001	0.10

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	8,844,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE F ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	8,931,014	0.09
USD	2,366,000	Gran Tierra Energy Inc ' 144A ' 7.75% 23/5/2027	2,300,935	0.02
USD	3,160,000	Grand Parkway Transportation Corp 5% 1/10/2043	3,889,849	0.04
USD	730,000	Grant County Public Utility District No 2 4.584% 1/1/2040	922,410	0.01
USD	95,000	Graphic Packaging International LLC 4.75% 15/4/2021	98,087	0.00
USD	2,018,000	Great Lakes Dredge & Dock Corp 8% 15/5/2022	2,144,125	0.02
USD	500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	616,925	0.01
USD	2,240,000	Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp ' 144A ' 9% 30/9/2021	1,988,000	0.02
USD	1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing ' Series 1999-5 M1B ' FRN 15/12/2029	1,101,973	0.01
USD	1,143,351	Greenpoint Manufactured Housing ' Series 1999-5 M2 ' FRN 15/12/2029	985,511	0.01
USD	1,702,635	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 ' Series 2006- AR2 4A1 ' FRN 25/3/2036	1,695,557	0.02
USD	820,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd ' Series 2017-FL1A A ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	818,872	0.01
USD	5,000,000	GS Mortgage Securities Corp II ' Series 2013-KING E ' ' 144A ' FRN 10/12/2027	4,987,137	0.05
USD	440,000	GS Mortgage Securities Corp II ' Series 2017-375H A ' ' 144A ' FRN 10/9/2037	477,057	0.01
USD	25,000,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ' Series 2005- ROCK X1 ' ' 144A ' FRN 3/5/2032	362,690	0.00
USD	2,570,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ' Series 2005- ROCK A ' ' 144A ' 5.366% 3/5/2032	2,997,833	0.03
USD	1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT ' Series 2016-RENT C ' ' 144A ' FRN 10/2/2029	1,070,377	0.01
USD	1,700,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT ' Series 2016-RENT E ' ' 144A ' FRN 10/2/2029	1,714,105	0.02
USD	1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K D ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,452,513	0.02
USD	2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,998,480	0.02
USD	1,119,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K F ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,122,474	0.01
USD	675,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K G ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	673,692	0.01
USD	2,170,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-GPTX ' Series 2017-GPTX A ' ' 144A ' 2.856% 10/5/2034	2,186,559	0.02
USD	1,085,218	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-HULA ' Series 2018-HULA D ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	1,090,432	0.01
USD	110,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014-GC20 B ' FRN 10/4/2047	118,837	0.00
USD	1,126,736	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014-GC20 XA ' FRN 10/4/2047	38,137	0.00
USD	540,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC24 ' Series 2014-GC24 C ' FRN 10/9/2047	511,139	0.01
USD	980,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-590M ' Series 2015-590M E ' ' 144A ' FRN 10/10/2035	1,010,463	0.01
USD	450,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28 ' Series 2015-GC28 B ' 3.98% 10/2/2048	478,987	0.01
USD	1,129,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 D ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	1,082,570	0.01
USD	780,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 E ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	730,694	0.01
USD	2,052,325	GSAA Home Equity Trust 2006-4 ' Series 2006-4 1A1 ' FRN 25/3/2036	1,781,848	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 12,961,603	GSAA Home Equity Trust 2006-5 'Series 2006-5 1A1' ' FRN 25/3/2036	6,366,172	0.07
USD 478,667	GSAA Home Equity Trust 2007-2 'Series 2007-2 AF3' ' FRN 25/3/2037	164,656	0.00
USD 3,819,467	GSAMP Trust 2006-FM3 'Series 2006-FM3 A1' FRN 25/11/2036	2,257,350	0.02
USD 1,212,937	GSAMP Trust 2007-H1 'Series 2007-H1 A1B' FRN 25/1/2047	747,387	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 'Series 2007-HS1 M6' FRN 25/2/2047	2,064,718	0.02
USD 1,244,753	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 'Series 2005- RP1 1AF' '144A' FRN 25/1/2035	1,146,394	0.01
USD 1,495,541	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 'Series 2005- RP2 1AF' '144A' FRN 25/3/2035	1,393,192	0.01
USD 1,152,181	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1 'Series 2006- RP1 1AF1' '144A' FRN 25/1/2036	1,005,533	0.01
USD 13,020,709	GSR Mortgage Loan Trust 2006- OA1 'Series 2006- OA1 1A1' FRN 25/8/2046	5,236,601	0.05
USD 2,373,032	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 'Series 2007-1F 2A4' 5.5% 25/1/2037	2,646,180	0.03
USD 329,000	H&E Equipment Services Inc 5.625% 1/9/2025	347,088	0.00
USD 5,188	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A' '144A' FRN 1/8/2025	5,187	0.00
USD 250,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A C' '144A' FRN 1/8/2025	250,411	0.00
USD 680,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A B1R' '144A' FRN 22/10/2025	680,265	0.01
USD 2,000,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 25/7/2027	1,997,767	0.02
USD 1,083,000	Halliburton Co 3.8% 15/11/2025	1,147,647	0.01
USD 718,429	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 'Series 2007-4 2A2' FRN 19/7/2047	659,087	0.01
USD 685,000	HCA Healthcare Inc 6.25% 15/2/2021	721,237	0.01
USD 4,581,000	HCA Inc 4.125% 15/6/2029	4,871,705	0.05
USD 4,098,000	HCA Inc 4.75% 1/5/2023	4,401,115	0.05
USD 2,171,000	HCA Inc 5% 15/3/2024	2,377,616	0.02
USD 3,128,000	HCA Inc 5.25% 15/4/2025	3,492,489	0.04
USD 3,074,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	3,461,139	0.04
USD 900,000	HCA Inc 5.375% 1/2/2025	997,803	0.01
USD 729,000	HCA Inc 5.375% 1/9/2026	812,835	0.01
USD 1,092,000	HCA Inc 5.625% 1/9/2028	1,247,610	0.01
USD 520,000	HCA Inc 5.875% 15/2/2026	595,400	0.01
USD 1,409,000	HCA Inc 5.875% 1/2/2029	1,625,634	0.02
USD 260,000	HD Supply Inc '144A' 5.375% 15/10/2026	278,252	0.00
USD 3,895,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.086% 15/9/2051	4,063,186	0.04
USD 550,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.651% 15/1/2046	633,421	0.01
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	951,416	0.01
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 A1B' '144A' FRN 18/7/2031	319,110	0.00
USD 650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 D' '144A' FRN 18/7/2031	569,579	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A DR' '144A' FRN 20/10/2029	242,713	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,830,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ' Series 6A-2015 A1R ' ' 144A ' FRN 5/2/2031	2,804,765	0.03
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' Series 7A-2015 CR ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	325,215	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' Series 7A-2015 DR ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	328,964	0.00
USD 260,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' Series 7A-2015 ER ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	239,783	0.00
USD 345,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.25% 1/9/2024	352,763	0.00
USD 3,219,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.625% 1/4/2025	3,340,388	0.03
USD 207,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 1/4/2027	218,644	0.00
USD 329,000	Hologic Inc ' 144A ' 4.375% 15/10/2025	338,459	0.00
USD 1,472,000	Home Depot Inc/The 2.95% 15/6/2029	1,557,118	0.02
USD 1,980,000	Home Equity Asset Trust 2007-1 ' Series 2007-1 2A3 ' FRN 25/5/2037	1,660,042	0.02
USD 9,353,330	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E ' Series 2006-E 2A3 ' FRN 25/4/2037	6,371,341	0.07
USD 1,919,641	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ' Series 2007-A 2A2 ' FRN 25/4/2037	1,445,587	0.02
USD 9,388,338	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ' Series 2007-A 2A3 ' FRN 25/4/2037	7,121,871	0.07
USD 3,869,515	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-B ' Series 2007-B 2A3 ' FRN 25/7/2037	2,652,420	0.03
USD 543,469	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A ' Series 2004-A M2 ' FRN 25/7/2034	546,118	0.01
USD 3,008,405	Home Equity Mortgage Trust 2006-2 (Step-up coupon) ' Series 2006-2 1A1 ' 5.867% 25/7/2036	939,785	0.01
USD 1,167,715	Home Loan Mortgage Loan Trust 2005-1 ' Series 2005-1 A3 ' FRN 15/4/2036	1,091,450	0.01
USD 1,630,000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust ' Series 2016-10HY A ' ' 144A ' 2.835% 10/8/2038	1,699,754	0.02
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,703,839	0.02
USD 8,062,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 3.4% 20/6/2024	8,236,583	0.08
USD 5,266,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 3.95% 1/2/2022	5,456,050	0.06
USD 2,450,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 19/10/2028	2,445,272	0.03
USD 970,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	1,170,310	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017- APTS AFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	1,280,210	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017- APTS BFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,934,333	0.03
USD 5,890,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017- APTS DFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	6,070,322	0.06
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017- APTS EFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,008,746	0.02
USD 2,610,000	Indiana Finance Authority 5% 1/10/2045	3,010,361	0.03
USD 820,000	Indiana Housing & Community Development Authority 3.8% 1/7/2038	897,884	0.01
USD 4,875,207	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 ' Series 2007- HOA1 AXPP ' FRN 25/7/2047	232,332	0.00
USD 8,042,734	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 ' Series 2007- AR19 3A1 ' FRN 25/9/2037	5,768,313	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 989,581	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 ' Series 2007- FLX5 2A2 ' FRN 25/8/2037	888,681	0.01
EUR 7,220,000	International Business Machines Corp 0.875% 31/1/2025*	8,366,784	0.09
EUR 4,810,000	International Business Machines Corp 1.25% 29/1/2027	5,779,750	0.06
USD 3,950,000	International Business Machines Corp 3.3% 15/5/2026	4,189,588	0.04
USD 18,720,000	International Business Machines Corp 3.5% 15/5/2029	20,317,278	0.21
USD 4,050,000	International Business Machines Corp 4.25% 15/5/2049	4,734,414	0.05
USD 3,810,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 4.65% 1/10/2028	4,323,934	0.04
USD 560,000	InTown Hotel Portfolio Trust 2018- STAY ' Series 2018-STAY A ' ' 144A ' FRN 15/1/2033	559,035	0.01
USD 1,915,882	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 E ' ' 144A ' FRN 17/3/2037	1,919,020	0.02
USD 2,623,165	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 A ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,623,211	0.03
USD 2,256,127	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 E ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,257,763	0.02
EUR 2,850,000	IQVIA Inc 3.25% 15/3/2025	3,245,806	0.03
EUR 2,338,000	Iron Mountain Inc 3% 15/1/2025*	2,672,165	0.03
USD 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc ' 144A ' 5.375% 1/6/2026	1,174,725	0.01
USD 1,105,171	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 (Step-up coupon) ' Series 2006-3 2A3 ' ' 144A ' 6.53% 25/9/2037	1,101,418	0.01
USD 284,710	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 ' Series 2006-P1 1A ' ' 144A ' FRN 25/12/2036	273,242	0.00
USD 11,320,904	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 ' Series 2007-HE1 A4 ' FRN 25/5/2037	3,986,126	0.04
USD 7,280,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016- NINE ' Series 2016-NINE A ' ' 144A ' FRN 6/10/2038	7,606,189	0.08
USD 2,553,000	Jagged Peak Energy LLC 5.875% 1/5/2026	2,559,382	0.03
USD 364,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 5.75% 15/6/2025	380,778	0.00
USD 655,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 5.875% 15/7/2024	676,225	0.01
USD 311,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 6.75% 15/2/2028	346,376	0.00
USD 2,605,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,911,179	0.03
USD 406,010	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 ' Series 2007-A2 2A1 ' FRN 25/5/2037	371,276	0.00
USD 1,490,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- JP1 ' Series 2015-JP1 C ' FRN 15/1/2049	1,617,222	0.02
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- JP1 ' Series 2015-JP1 D ' FRN 15/1/2049	2,296,161	0.02
USD 3,100,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- UES ' Series 2015-UES D ' ' 144A ' FRN 5/9/2032	3,113,467	0.03
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- UES ' Series 2015-UES E ' ' 144A ' FRN 5/9/2032	4,963,943	0.05
USD 230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015- UES ' Series 2015-UES F ' ' 144A ' FRN 5/9/2032	229,520	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016- JP3 'Series 2016-JP3 XC' '144A' FRN 15/8/2049	482,360	0.01
USD 1,090,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018- WPT 'Series 2018-WPT FFX' '144A' 5.542% 5/7/2033	1,138,703	0.01
USD 888,874	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-1 'Series 2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	945,129	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 'Series 2006- CW1 M1' FRN 25/5/2036	923,040	0.01
USD 14,485,800	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 'Series 2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	14,755,142	0.15
USD 1,373,812	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 'Series 2014-C22 XA' FRN 15/9/2047	48,107	0.00
USD 1,138,210	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 'Series 2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	28,990	0.00
USD 1,928,550	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 'Series 2014-C26 XA' FRN 15/1/2048	74,524	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	164,361	0.00
USD 2,232,967	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C29 'Series 2015-C29 XA' FRN 15/5/2048	57,414	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 'Series 2015-C33 D1' '144A' FRN 15/12/2048	1,494,645	0.02
USD 930,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 'Series 2017-JP5 C' FRN 15/3/2050	986,073	0.01
USD 1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 'Series 2017-JP5 D' '144A' FRN 15/3/2050	1,432,440	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XC' '144A' FRN 15/12/2049	195,258	0.00
USD 2,000,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C5 'Series 2017-C5 C' FRN 15/3/2050	2,183,697	0.02
USD 4,096,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2020 (Perpetual)	4,158,321	0.04
USD 5,821,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2024 (Perpetual)	6,487,301	0.07
USD 10,925,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	11,469,576	0.12
USD 1,620,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	1,720,450	0.02
USD 13,685,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/8/2024 (Perpetual)	14,187,924	0.15
USD 5,555,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2028	6,036,808	0.06
USD 14,515,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	16,136,096	0.17
USD 10,810,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2029	12,191,756	0.13
USD 10,950,000	JPMorgan Chase & Co FRN 5/12/2029	12,584,322	0.13
USD 2,880,000	JPMorgan Chase & Co FRN 15/11/2048*	3,318,816	0.03
USD 4,884,000	Kaiser Aluminum Corp 5.875% 15/5/2024	5,079,360	0.05
USD 1,900,000	Kansas City Industrial Development Authority 5% 1/3/2049	2,336,250	0.02
USD 1,362,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	1,535,655	0.02
USD 150,000	KB Home 8% 15/3/2020	154,687	0.00
USD 690,000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5.25% 1/6/2050	775,929	0.01
USD 1,100,000	Kentucky Turnpike Authority 5% 1/7/2020	1,134,491	0.01
USD 2,730,000	Keurig Dr Pepper Inc 4.057% 25/5/2023	2,899,020	0.03
USD 4,770,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 5% 1/6/2024	4,942,912	0.05
USD 364,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 5.25% 1/6/2026	385,840	0.00
USD 2,165,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3.5% 1/3/2021	2,198,129	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,080,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.8% 1/3/2021	1,133,719	0.01
USD 594,000	Lamar Media Corp 5.375% 15/1/2024	613,305	0.01
USD 289,000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.625% 1/11/2024	303,089	0.00
USD 289,000	Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 1/11/2026	303,089	0.00
USD 1,100,000	Las Vegas Sands Corp 3.2% 8/8/2024	1,121,201	0.01
USD 1,215,000	Las Vegas Sands Corp 3.5% 18/8/2026	1,240,099	0.01
USD 950,000	Las Vegas Valley Water District 5% 1/6/2046	1,135,744	0.01
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust 'Series 2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	4,049,869	0.04
USD 4,770,000	LCM 26 Ltd '144A' FRN 20/1/2031	4,743,858	0.05
USD 730,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2031	397,797	0.00
USD 1,000,000	LCM XX LP '144A' FRN 20/10/2027	999,472	0.01
USD 1,330,000	LCM XXI LP '144A' FRN 20/4/2028	1,321,086	0.01
USD 400,000	LCM XXIV Ltd '144A' FRN 20/3/2030	400,750	0.00
USD 355,687	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 'Series 2002-A C' 15/6/2033 (Zero Coupon)	306,390	0.00
USD 387,984	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 'Series 2007-1 2A1' '144A' FRN 25/6/2037	281,829	0.00
USD 530,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 'Series 2006-2A M2' '144A' FRN 25/9/2036	517,558	0.01
USD 964,092	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 'Series 2007-1A 1A' '144A' FRN 25/3/2037	906,338	0.01
USD 1,027,862	Lehman XS Trust Series 2007-20N 'Series 2007-20N A1' FRN 25/12/2037	972,703	0.01
USD 620,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A B' '144A' 3.38% 20/5/2026	623,504	0.01
USD 1,000,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A C' '144A' 4.33% 20/5/2026	1,010,274	0.01
USD 1,267,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	1,299,294	0.01
USD 14,400,000	Lendmark Funding Trust 2018-2 'Series 2018-2A A' '144A' 4.23% 20/4/2027	15,012,449	0.15
USD 18,000	Lennar Corp 2.95% 29/11/2020	18,045	0.00
USD 895,000	Lennar Corp 4.125% 15/1/2022	925,206	0.01
USD 1,002,000	Lennar Corp 4.5% 15/11/2019	1,005,106	0.01
USD 225,000	Lennar Corp 4.5% 30/4/2024	239,625	0.00
USD 964,000	Lennar Corp 4.75% 1/4/2021	995,166	0.01
USD 10,973,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	11,590,231	0.12
USD 173,000	Lennar Corp 4.75% 30/5/2025	185,759	0.00
USD 311,000	Lennar Corp 4.75% 29/11/2027	339,767	0.00
USD 1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,105,962	0.01
USD 60,000	Lennar Corp 5.25% 1/6/2026	65,325	0.00
USD 3,962,000	Lennar Corp 5.875% 15/11/2024	4,442,392	0.05
USD 5,843,000	Level 3 Financing Inc 5.125% 1/5/2023	5,959,918	0.06
USD 269,000	Level 3 Financing Inc 5.25% 15/3/2026	281,105	0.00
USD 2,561,000	Level 3 Financing Inc 5.375% 15/8/2022	2,581,232	0.03
USD 653,000	Level 3 Financing Inc 5.375% 15/1/2024	667,692	0.01
USD 459,000	Level 3 Financing Inc 5.375% 1/5/2025	479,081	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,393,000	Level 3 Financing Inc 5.625% 1/2/2023	2,435,595	0.03
USD	840,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	983,569	0.01
USD	3,410,719	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	3,398,058	0.04
USD	822,000	LGI Homes Inc '144A' 6.875% 15/7/2026	861,045	0.01
USD	1,223,869	Limerock CLO III LLC 'Series 2014- 3A A1R' ' 144A' FRN 20/10/2026	1,223,684	0.01
USD	2,165,000	Limerock CLO III LLC 'Series 2014- 3A C' '144A' ' FRN 20/10/2026	2,103,967	0.02
USD	7,140,000	LoanCore 2018-CRE1 Issuer Ltd 'Series 2018-CRE1 A' ' '144A' FRN 15/5/2028	7,144,568	0.07
USD	354,164	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	157,765	0.00
USD	3,642,622	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	1,645,110	0.02
USD	1,295,818	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	594,823	0.01
USD	5,512,396	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-2 'Series 2006-2 1A' FRN 25/3/2046	4,539,896	0.05
USD	10,965,992	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-4 'Series 2006-4 2A3' FRN 25/5/2036	4,820,809	0.05
USD	3,531,869	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 'Series 2006-5 2A3' FRN 25/6/2036	1,949,489	0.02
USD	906,338	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 'Series 2006-6 2A3' FRN 25/7/2036	466,615	0.01
USD	5,728,366	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 'Series 2006-7 2A3' FRN 25/8/2036	2,969,425	0.03
USD	2,478,101	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-8 'Series 2006-8 2A3' FRN 25/9/2036	1,036,026	0.01
USD	1,315,144	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 'Series 2006-9 2A2' FRN 25/10/2036	560,477	0.01
USD	5,051,111	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 'Series 2006-9 2A3' FRN 25/10/2036	2,181,914	0.02
USD	1,600,533	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 'Series 2006-9 2A4' FRN 25/10/2036	704,269	0.01
USD	1,660,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	2,678,227	0.03
USD	5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,532,275	0.06
USD	1,015,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.603% 1/7/2050	1,731,636	0.02
USD	1,030,000	Louisiana Public Facilities Authority 5% 1/7/2048	1,246,568	0.01
USD	11,880,000	Lowe's Cos Inc 4.55% 5/4/2049	13,947,968	0.14
USD	3,000,000	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 'Series 2015-3 AS' '144A' FRN 20/4/2048	3,082,823	0.03
USD	2,660,196	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 'Series 2017-5 X' '144A' FRN 10/3/2050	112,071	0.00
USD	4,200,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 'Series 2017-330M D' ' '144A' FRN 15/8/2034	4,353,457	0.04
USD	6,600,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 'Series 2017-330M E' ' '144A' FRN 15/8/2034	6,790,245	0.07
USD	1,309,087	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 'Series 2002-A B2' FRN 25/3/2032	1,334,445	0.01
USD	6,600,000	Madison Avenue Trust 2013-650M 'Series 2013-650M D' '144A' FRN 12/10/2032	6,667,041	0.07
USD	4,225,000	Madison Park Funding XI Ltd 'Series 2013-11A AR' ' '144A' FRN 23/7/2029	4,225,045	0.04
USD	4,930,000	Madison Park Funding XIII Ltd 'Series 2014-13A AR2' '144A' FRN 19/4/2030	4,923,148	0.05
USD	600,000	Madison Park Funding XIII Ltd 'Series 2014-13A CR2' '144A' FRN 19/4/2030	589,132	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	340,000	Madison Park Funding XV Ltd 'Series 2014-15A CR' '144A' FRN 27/1/2026	340,824	0.00
USD	1,243,116	Madison Park Funding XVI Ltd 'Series 2015-16A A1R' '144A' FRN 20/4/2026	1,243,523	0.01
USD	500,000	Madison Park Funding XVI Ltd 'Series 2015-16A A2R' '144A' FRN 20/4/2026	500,360	0.01
USD	550,000	Madison Park Funding XVI Ltd 'Series 2015-16A C' '144A' FRN 20/4/2026	551,837	0.01
USD	1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd 'Series 2015-16A D' '144A' FRN 20/4/2026	1,221,942	0.01
USD	5,430,000	Madison Park Funding XVIII Ltd 'Series 2015-18A A1R' '144A' FRN 21/10/2030	5,421,939	0.06
USD	1,510,000	Madison Park Funding XXI Ltd 'Series 2016-21A A1' '144A' FRN 25/7/2029	1,511,145	0.02
USD	700,000	Madison Park Funding XXX Ltd 'Series 2018-30A E' '144A' FRN 15/4/2029	652,423	0.01
USD	240,745	Marathon CLO VII Ltd 'Series 2014- 7A A1R' ' 144A' FRN 28/10/2025	240,825	0.00
USD	1,620,000	Marathon CRE 2018 FL1 Ltd FRN 15/6/2028	1,621,678	0.02
USD	4,000,000	Mariner CLO 2015-1 LLC 'Series 2015-1A CR' ' 144A' FRN 20/4/2029	3,991,046	0.04
USD	690,000	Mariner CLO 2017-4 LLC 'Series 2017-4A A' '144A' ' FRN 26/10/2029	688,083	0.01
USD	1,118,000	Marriott Ownership Resorts Inc / ILG LLC 6.5% 15/9/2026	1,209,542	0.01
USD	5,185,000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15/3/2029	5,960,258	0.06
USD	835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	971,760	0.01
USD	1,500,000	Maryland Stadium Authority 5% 1/5/2041	1,792,388	0.02
USD	790,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2039	974,414	0.01
USD	835,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2040	1,027,701	0.01
USD	810,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2043	987,815	0.01
USD	2,785,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	3,283,292	0.03
USD	1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,231,968	0.01
USD	2,600,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	3,150,277	0.03
USD	500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	542,515	0.01
USD	860,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	903,159	0.01
USD	1,060,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	1,149,422	0.01
USD	910,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	958,498	0.01
USD	1,500,000	Massachusetts Port Authority 5% 1/7/2043	1,776,945	0.02
USD	870,000	Massachusetts Water Resources Authority 5% 1/8/2040	1,055,471	0.01
USD	4,090,000	MassMutual Global Funding II '144A' 3.4% 8/3/2026	4,366,077	0.05
USD	4,649,426	Mastr Asset Backed Securities Trust 2006-HE2 ' Series 2006- HE2 A3' FRN 25/6/2036	2,621,361	0.03
USD	1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE1 ' Series 2007- HE1 A4' FRN 25/5/2037	1,101,659	0.01
USD	611,569	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 'Series 2008- 3 A1' '144A' FRN 25/8/2037	418,801	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 536,360	Mastr Specialized Loan Trust ' Series 2006-3 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2046	512,425	0.01
USD 1,840,000	Matagorda County Navigation District No 1 2.6% 1/11/2029	1,915,192	0.02
USD 4,552,000	Mauser Packaging Solutions Holding Co ' 144A ' 5.5% 15/4/2024	4,717,010	0.05
USD 2,165,000	McDonald ' s Corp 3.8% 1/4/2028	2,397,841	0.02
USD 475,000	McDonald ' s Corp 4.7% 9/12/2035	573,775	0.01
USD 3,806,000	McDonald ' s Corp 4.875% 9/12/2045	4,710,180	0.05
USD 9,768,475	MCM Capital _ 18-NPL2 4% 25/10/2028	9,768,215	0.10
USD 8,799,827	MCM Trust 2018-NPL1 ' Series 2018- NPL1 A ' ' 144A ' 4% 28/5/2058	8,839,925	0.09
USD 3,074,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	3,166,220	0.03
USD 2,202,998	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 ' Series 2007-OAR2 A2 ' FRN 25/4/2037	1,944,276	0.02
USD 6,026,619	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 ' Series 2007-2 A2C ' FRN 25/5/2037	3,651,812	0.04
USD 911,167	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 ' Series 2006-RM3 A2B ' FRN 25/6/2037	273,890	0.00
USD 936,390	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005- CIP1 ' Series 2005-CIP1 D ' FRN 12/7/2038	952,669	0.01
USD 1,070,000	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005- MKB2 ' Series 2005-MKB2 F ' ' 144A ' FRN 12/9/2042	1,077,791	0.01
USD 1,380,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2041	1,638,619	0.02
USD 1,290,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2045	1,549,625	0.02
USD 770,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2040	910,640	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,638,574	0.02
USD 2,100,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2047	2,554,934	0.03
USD 1,840,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/5/2022	2,022,528	0.02
USD 1,860,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2040	2,340,652	0.02
USD 1,150,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2041	1,452,847	0.02
USD 2,230,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2042	2,795,495	0.03
USD 1,570,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2043	1,974,259	0.02
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	2,052,879	0.02
USD 2,950,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2048	3,605,254	0.04
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,075,920	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	2,224,154	0.02
USD 173,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.5% 1/9/2026	181,650	0.00
USD 8,641,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	9,461,895	0.10
USD 260,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc ' 144A ' 5.75% 1/2/2027	287,352	0.00
USD 143,000	MGM Resorts International 5.25% 31/3/2020	145,145	0.00
USD 640,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5% 1/4/2053	767,222	0.01
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	997,291	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 700,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	837,263	0.01
USD 100,000	Michigan Finance Authority 5% 1/12/2047	109,566	0.00
USD 1,000,000	Micron Technology Inc 4.185% 15/2/2027	1,031,631	0.01
USD 2,723,000	Micron Technology Inc 4.663% 15/2/2030	2,842,376	0.03
USD 3,197,000	Mid-America Apartments LP 3.95% 15/3/2029	3,529,809	0.04
USD 1,370,000	MidOcean Credit CLO III 'Series 2014-3A A3A2' '144A' FRN 21/4/2031	1,348,183	0.01
USD 1,330,000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,514,444	0.02
USD 3,095,000	Montefiore Obligated Group 5.246% 1/11/2048	3,713,494	0.04
USD 1,479,000	Morgan Stanley FRN 15/7/2020 (Perpetual)	1,503,034	0.02
USD 8,445,000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	8,883,909	0.09
USD 4,044,000	Morgan Stanley FRN 22/7/2025	4,124,774	0.04
USD 9,235,000	Morgan Stanley FRN 24/1/2029	9,984,687	0.10
USD 21,322,000	Morgan Stanley FRN 23/1/2030*	24,357,481	0.25
USD 2,380,000	Morgan Stanley 3.125% 23/1/2023	2,453,300	0.03
USD 3,159,114	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE5 'Series 2005- HE5 M4' FRN 25/9/2035	1,788,219	0.02
USD 10,874,859	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-NC1 'Series 2007- NC1 A1' FRN 25/11/2036	6,693,004	0.07
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XD' '144A' FRN 15/12/2047	636,110	0.01
USD 3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XF' '144A' FRN 15/12/2047	192,113	0.00
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 'Series 2015-C21 XB' '144A' FRN 15/3/2048	59,300	0.00
USD 1,704,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 'Series 2015-C23 D' '144A' FRN 15/7/2050	1,718,814	0.02
USD 220,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 C' FRN 15/10/2048	239,905	0.00
USD 5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 XD' '144A' FRN 15/10/2048	399,003	0.00
USD 1,023,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 D' '144A' 3.06% 15/10/2048	975,169	0.01
USD 2,164,328	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 'Series 2016-C31 XA' FRN 15/11/2049	163,472	0.00
USD 660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 'Series 2017-C33 C' FRN 15/5/2050	722,953	0.01
USD 780,000	Morgan Stanley Capital Barclays Bank Trust 2016-MART 'Series 2016-MART A' '144A' 2.2% 13/9/2031	781,997	0.01
USD 380,000	Morgan Stanley Capital I 2017- HR2 'Series 2017-HR2 D' 2.73% 15/12/2050	349,249	0.00
USD 1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ11 'Series 2006-IQ11 C' FRN 15/10/2042	1,500,741	0.02
USD 464,022	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	495,019	0.01
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 'Series 2014-150E F' '144A' FRN 9/9/2032	1,457,823	0.02
USD 200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT E' '144A' FRN 13/7/2029	201,831	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,000,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ' Series 2014-CPT F ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	5,048,478	0.05
USD 1,875,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ' Series 2014-CPT G ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	1,880,746	0.02
USD 360,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ' Series 2015-MS1 C ' FRN 15/5/2048	377,062	0.00
USD 250,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ' Series 2015-MS1 D ' ' 144A ' FRN 15/5/2048	242,281	0.00
USD 5,480,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS ' Series 2017-CLS F ' ' 144A ' FRN 15/11/2034	5,500,851	0.06
USD 1,560,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ' Series 2017-H1 C ' FRN 15/6/2050	1,689,321	0.02
USD 2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ' Series 2017-H1 XD ' ' 144A ' FRN 15/6/2050	390,139	0.00
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR ' Series 2017-JWDR D ' ' 144A ' FRN 15/11/2034	920,429	0.01
USD 1,097,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR ' Series 2017-JWDR E ' ' 144A ' FRN 15/11/2034	1,097,445	0.01
USD 1,280,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 C ' FRN 15/7/2051	1,433,412	0.01
USD 880,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 D ' ' 144A ' 3% 15/7/2051	812,585	0.01
USD 4,004,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP ' Series 2018-MP E ' ' 144A ' FRN 11/7/2040	4,121,741	0.04
USD 911,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN ' Series 2018-SUN F ' ' 144A ' FRN 15/7/2035	916,389	0.01
USD 1,015,385	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-9SL ' Series 2007-9SL A ' FRN 25/7/2037	975,005	0.01
USD 7,557,977	Mortgage Loan Resecuritization Trust ' Series 2009-RS1 A85 ' ' 144A ' FRN 16/4/2036	6,561,005	0.07
USD 4,060,985	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2- GS ' Series 2018-2GS A ' ' 144A ' 4.2% 22/2/2044	4,240,687	0.04
USD 8,686,681	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 ' Series 2019-1A A ' ' 144A ' 4.37% 21/12/2043	9,015,725	0.09
USD 6,195,000	Motorola Solutions Inc 4.6% 23/5/2029	6,795,216	0.07
USD 3,920,000	Mountain Hawk II CLO Ltd ' Series 2013-2A BR ' ' 144A ' FRN 20/7/2024	3,919,319	0.04
USD 2,639,305	Mountain Hawk III CLO Ltd ' Series 2014-3A AR ' ' 144A ' FRN 18/4/2025	2,643,055	0.03
USD 1,895,000	MP CLO VII Ltd ' Series 2015-1A ARR ' ' 144A ' FRN 18/10/2028	1,884,320	0.02
EUR 950,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24/3/2025	1,171,170	0.01
USD 649,102	Multi Security Asset Trust LP Commercial Mortgage-Backed Securities Pass-Through ' Series 2005-RR4A N ' ' 144A ' FRN 28/11/2035	653,366	0.01
USD 1,305,000	National Retail Properties Inc 4.3% 15/10/2028	1,464,342	0.02
USD 3,545,000	National Retail Properties Inc 4.8% 15/10/2048	4,378,049	0.05
USD 146,263	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-C ' Series 2007-C 2AV3 ' FRN 25/6/2037	146,124	0.00
USD 691,598	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ' Series 2018-FL1 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	691,199	0.01
USD 1,195,978	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ' Series 2018-FL1 MCR1 ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	1,191,264	0.01
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A ' Series 2014-AA B ' ' 144A ' 3.5% 15/8/2044	3,122,310	0.03
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT ' Series 2014-CTA B ' ' 144A ' FRN 17/10/2044	4,946,561	0.05
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A ' Series 2015-AA B ' ' 144A ' 3.5% 15/12/2044	2,390,507	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-B ' Series 2015-BA A3 ' ' 144A ' FRN 16/7/2040	5,063,853	0.05
USD 6,630,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-D ' Series 2018- DA A2A ' ' 144A ' 4% 15/12/2059	6,932,575	0.07
USD 8,530,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D ' Series 2019- D A2B ' ' 144A ' FRN 15/12/2059	8,449,609	0.09
USD 7,500,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D ' Series 2019- D A2A ' ' 144A ' 3.01% 15/12/2059	7,673,183	0.08
USD 4,689,000	Navient Student Loan Trust 2018- EA ' Series 2018- EA A2 ' ' 144A ' 4% 15/12/2059	5,013,664	0.05
USD 1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc ' 144A ' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,471,811	0.02
USD 2,160,000	NBCUniversal Media LLC 4.45% 15/1/2043	2,556,476	0.03
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,132,227	0.01
USD 500,000	NCR Corp ' 144A ' 5.75% 1/9/2027	526,875	0.01
USD 500,000	NCR Corp ' 144A ' 6.125% 1/9/2029	528,750	0.01
EUR 1,485,000	Netflix Inc 3.875% 15/11/2029	1,788,239	0.02
USD 780,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd ' Series 2017-16SA A ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	777,382	0.01
USD 350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd ' Series 2017-16SA D ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	341,954	0.00
USD 439,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd ' Series 2015-20A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	436,471	0.00
USD 1,100,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd ' Series 2015-20A ER ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	1,030,231	0.01
USD 500,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd ' Series 2016-23A BR ' ' 144A ' FRN 17/10/2027	496,299	0.01
USD 7,100,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd ' Series 2017-26A A ' ' 144A ' FRN 18/10/2030	7,095,549	0.07
USD 7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B ' Series 2005-B M1 ' FRN 25/10/2035	7,057,446	0.07
USD 1,150,000	New Hope Cultural Education Facilities Finance Corp 5% 15/8/2047	1,382,099	0.01
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	934,530	0.01
USD 2,340,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	2,764,488	0.03
USD 3,615,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6.104% 15/12/2028	3,793,292	0.04
USD 1,360,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,544,069	0.02
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	913,940	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	3,947,165	0.04
USD 4,310,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.35% 1/11/2030	4,749,749	0.05
USD 4,740,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.55% 1/5/2025	5,101,781	0.05
USD 2,650,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.65% 1/11/2024	2,828,915	0.03
USD 2,650,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.75% 1/11/2025	2,831,459	0.03
USD 3,660,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	4,093,893	0.04
USD 820,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/5/2036	995,878	0.01
USD 1,590,000	New York City Water & Sewer System 5.44% 15/6/2043	2,309,403	0.02
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	2,364,020	0.02
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	932,217	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,950,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2046	2,342,457	0.02
USD	2,000,000	New York Liberty Development Corp '144A' 5% 15/11/2044	2,221,690	0.02
USD	1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2036	1,988,992	0.02
USD	760,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2037	942,183	0.01
USD	740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2038	914,954	0.01
USD	700,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2040	861,112	0.01
USD	2,400,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	2,541,528	0.03
USD	3,655,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	3,967,576	0.04
USD	1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,853,280	0.02
USD	620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	693,975	0.01
USD	4,940,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	5,571,505	0.06
USD	242,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	266,055	0.00
USD	1,923,000	Nexstar Escrow Inc '144A' 5.625% 15/7/2027	2,011,939	0.02
USD	2,576,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.375% 15/8/2022	2,666,160	0.03
USD	411,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15/8/2027	437,849	0.00
USD	6,570,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 7.768% 15/12/2037	8,598,685	0.09
USD	100,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co 4.5% 1/10/2020	100,438	0.00
USD	5,435,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5% 15/4/2022	5,489,350	0.06
USD	329,798	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 'Series 2001-R1A A' '144A' ' FRN 19/2/2030	340,857	0.00
USD	520,475	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 (Step-up coupon) 'Series 2006-AF1 1A4' 6.634% 25/5/2036	203,470	0.00
USD	302,169	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A1' '144A' ' FRN 25/10/2036	282,372	0.00
USD	2,260,231	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2007-2 'Series 2007-2 A4' FRN 25/6/2037	1,874,717	0.02
USD	1,070,000	North Carolina Turnpike Authority 5% 1/1/2035	1,346,905	0.01
USD	1,090,000	North Texas Tollway Authority 5% 1/1/2043	1,331,975	0.01
USD	1,360,778	Northern Oil and Gas Inc 8.5% 15/5/2023	1,406,704	0.01
USD	47,858	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	49,660	0.00
USD	2,734,000	NRG Energy Inc 2.75% 1/6/2048	2,966,770	0.03
USD	285,000	NRG Energy Inc 5.75% 15/1/2028	307,800	0.00
USD	425,000	NRG Energy Inc 6.625% 15/1/2027	460,594	0.00
USD	347,000	NRG Energy Inc 7.25% 15/5/2026	380,832	0.00
USD	3,360,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A A1R' ' 144A' FRN 20/10/2027	3,356,070	0.03
USD	2,000,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' ' 144A' FRN 20/10/2027	1,975,503	0.02
USD	699,897	Oakwood Mortgage Investors Inc (Defaulted) ' Series 2001-D A2' FRN 15/1/2019	495,159	0.01
USD	577,650	Oakwood Mortgage Investors Inc 'Series 2001-D A4' ' FRN 15/9/2031	481,254	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,458,000	Occidental Petroleum Corp 2.6% 13/8/2021	2,473,526	0.03
USD 5,169,000	Occidental Petroleum Corp 2.7% 15/8/2022	5,213,614	0.05
USD 6,660,000	Occidental Petroleum Corp 2.9% 15/8/2024	6,706,815	0.07
USD 948,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,352,012	0.01
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 Ltd 'Series 2014- 5A A1R' '144A' ' FRN 26/4/2031	456,101	0.00
USD 1,350,000	OCP CLO 2014-7 Ltd 'Series 2014- 7A A2RR' '144A' ' FRN 20/7/2029	1,339,243	0.01
USD 1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd 'Series 2015-10A BR' '144A' ' FRN 26/10/2027	1,740,389	0.02
USD 1,340,000	OCP CLO 2015-8 Ltd 'Series 2015- 8A BR' '144A' FRN 17/4/2027	1,337,943	0.01
USD 2,057,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	2,055,027	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	431,589	0.00
USD 920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017- 13A D' '144A' ' FRN 15/7/2030	882,487	0.01
USD 5,200,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd 'Series 2018-18A A1A' '144A' FRN 16/4/2031	5,142,539	0.05
USD 250,000	Octagon Investment Partners 30 Ltd 'Series 2017- 1A D' '144A' FRN 17/3/2030	241,812	0.00
USD 1,000,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017- 1A E' '144A' FRN 20/7/2030	960,122	0.01
USD 1,625,000	Octagon Investment Partners 33 Ltd 'Series 2017- 1A A1' '144A' FRN 20/1/2031	1,620,461	0.02
USD 4,335,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd 'Series 2013-1A A1R2' '144A' FRN 25/1/2031	4,290,742	0.04
USD 530,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd '144A' FRN 15/7/2027	525,742	0.01
USD 1,120,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd FRN 15/7/2027	1,111,698	0.01
USD 7,105,000	OFSI Fund VI Ltd '144A' FRN 20/3/2025	7,093,317	0.07
USD 670,000	OFSI Fund VI Ltd 'Series 2014-6A CR' '144A' FRN 20/3/2025	667,143	0.01
USD 1,499,127	OFSI Fund VII Ltd 'Series 2014-7A AR' '144A' FRN 18/10/2026	1,497,947	0.02
USD 180,523	OHA Credit Partners IX Ltd 'Series 2013-9A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	180,582	0.00
USD 730,000	OHA Credit Partners VII Ltd 'Series 2012-7A DR' '144A' FRN 20/11/2027	732,240	0.01
USD 260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd 'Series 2016-13A E' '144A' FRN 21/1/2030	261,244	0.00
USD 1,360,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A AR' '144A' FRN 23/5/2031	1,347,338	0.01
USD 1,250,000	OHA Loan Funding 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 15/8/2029	1,250,402	0.01
USD 1,658,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A B1' '144A' FRN 20/1/2028	1,658,903	0.02
USD 6,395,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A C' '144A' FRN 20/1/2028	6,409,052	0.07
USD 7,920,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 20/1/2028	7,926,148	0.08
USD 1,662,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/1/2028	1,640,007	0.02
USD 1,780,000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 5% 15/2/2048	1,956,968	0.02
USD 1,000,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2043	1,217,735	0.01
USD 500,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2048	603,627	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	4,480,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.5% 15/8/2057	5,458,096	0.06
USD	2,340,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	2,428,298	0.03
USD	29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT XA' '144A' FRN 10/5/2039	848,715	0.01
USD	2,730,000	Oncor Electric Delivery Co LLC '144A' 3.7% 15/11/2028	3,048,894	0.03
USD	2,830,000	Oncor Electric Delivery Co LLC '144A' 3.8% 1/6/2049*	3,294,347	0.03
USD	43,880,000	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT 'Series 2017- 1MKT XCP' '144A' FRN 10/2/2032	154,019	0.00
USD	8,776,000	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT 'Series 2017- 1MKT XNCP' '144A' FRN 10/2/2032	88	0.00
USD	11,132,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.3% 14/3/2029	11,368,906	0.12
USD	6,900,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 'Series 2018-1A B' '144A' 3.61% 14/3/2029	7,031,074	0.07
USD	1,321,645	Option One Mortgage Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	963,714	0.01
USD	1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 'Series 2007-CP1 2A3' FRN 25/3/2037	1,348,280	0.01
USD	2,635,619	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 1A1' 5.866% 25/1/2037	2,580,795	0.03
USD	7,061,074	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 2A1' 5.866% 25/1/2037	7,085,781	0.07
USD	10,003,279	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	10,326,584	0.11
USD	2,160,000	Oracle Corp 6.125% 8/7/2039	3,072,232	0.03
USD	3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,952,515	0.05
USD	4,395,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	4,974,679	0.05
USD	5,005,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	6,047,366	0.06
USD	3,575,000	Oregon School Boards Association 5.68% 30/6/2028	4,420,023	0.05
USD	679,856	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 'Series 2001-A M1' FRN 15/3/2032	691,427	0.01
USD	1,811,720	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 'Series 2007-B A1' '144A' FRN 15/10/2037	1,739,696	0.02
USD	168,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.625% 15/2/2024	173,670	0.00
USD	1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 (Step-up coupon) 'Series 2006-2 A2C' 6% 25/1/2037	1,552,318	0.02
USD	5,030,000	OZLM Funding III Ltd 'Series 2013- 3A BR' '144A' ' FRN 22/1/2029	5,060,974	0.05
USD	2,850,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013- 4A A1R' '144A' ' FRN 22/10/2030	2,834,770	0.03
USD	290,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013- 4A A2R' '144A' ' FRN 22/10/2030	287,433	0.00
USD	250,000	OZLM Funding Ltd 'Series 2012-1A A2R2' '144A' FRN 22/7/2029	250,162	0.00
USD	1,640,000	OZLM Funding Ltd 'Series 2012- 1X SUB' FRN 22/7/2029	584,056	0.01
USD	3,200,000	OZLM VI Ltd 'Series 2014-6A SUB' '144A' FRN 17/4/2031	1,285,293	0.01
USD	500,000	OZLM VII Ltd 'Series 2014-7RA A2R' '144A' FRN 17/7/2029	493,892	0.01
USD	1,250,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A BRR' '144A' FRN 17/10/2029	1,222,884	0.01
USD	1,065,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A CRR' '144A' FRN 17/10/2029	1,015,311	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,630,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A B1R' '144A' FRN 15/1/2029	1,618,092	0.02
USD	2,190,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A CR' '144A' FRN 15/1/2029	2,129,920	0.02
USD	2,250,000	OZLM XIX Ltd 'Series 2017-19A A1' '144A' FRN 22/11/2030	2,240,353	0.02
USD	2,120,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A1' '144A' FRN 20/1/2029	2,121,322	0.02
USD	830,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A2A' '144A' FRN 20/1/2029	829,985	0.01
USD	440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A C' '144A' FRN 20/1/2029	440,732	0.00
USD	440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A D' '144A' FRN 20/1/2029	439,878	0.00
USD	580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 17/1/2031	577,103	0.01
USD	250,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2030	249,199	0.00
USD	630,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2030	610,294	0.01
USD	2,090,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 18/4/2031	2,072,949	0.02
USD	3,502,000	Palmer Square CLO 2018-3 Ltd 'Series 2018-3A A2' '144A' FRN 15/8/2026	3,483,671	0.04
USD	1,280,000	Palmer Square Loan Funding 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 15/10/2025	1,275,832	0.01
USD	910,610	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A A1' '144A' FRN 15/11/2026	910,106	0.01
USD	1,780,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A B' '144A' FRN 15/11/2026	1,771,483	0.02
USD	1,550,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A C' '144A' FRN 15/11/2026	1,478,581	0.02
USD	2,245,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	2,239,098	0.02
USD	3,512,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	3,498,994	0.04
USD	350,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd 'Series 2018-5A D' '144A' FRN 20/1/2027	349,081	0.00
EUR	4,035,000	Panther BF Aggregator 2 LP / Panther Finance Co Inc 4.375% 15/5/2026	4,553,101	0.05
USD	96,276	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	90,262	0.00
USD	1,560,000	Parallel 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 20/7/2029	1,546,574	0.02
USD	1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 23/8/2031	1,230,723	0.01
USD	2,525,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 14/11/2029	2,517,246	0.03
USD	2,320,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 14/11/2029	2,311,789	0.02
USD	3,100,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 14/11/2029	3,059,937	0.03
USD	2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 14/11/2029	2,718,627	0.03
USD	1,230,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.25% 15/8/2025	1,254,600	0.01
USD	6,070,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.375% 15/1/2025	6,206,575	0.06
USD	1,044,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.625% 15/10/2027	1,080,540	0.01
USD	4,860,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 6.25% 1/6/2024	5,017,950	0.05
USD	1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,099,740	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	465,260	0.01
USD	915,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2046	1,078,099	0.01
USD	2,470,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2048	3,008,571	0.03
USD	1,600,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5.25% 1/6/2047	1,905,032	0.02
USD	940,000	Pepperdine University 3.948% 1/12/2057	1,168,997	0.01
USD	2,585,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	3,386,712	0.04
USD	260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	358,835	0.00
USD	830,000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	992,331	0.01
USD	5,548,000	Post Holdings Inc '144A' 5.5% 1/3/2025	5,825,400	0.06
USD	1,290,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV Ltd 'Series 2015-4A C' '144A' 4% 24/8/2049	1,325,217	0.01
USD	9,500,000	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI Ltd 'Series 2016-6A C' '144A' 4% 24/8/2040	9,509,500	0.10
USD	298,124	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 'Series 2006-DR1 2A1' '144A' 5.5% 25/5/2035	251,837	0.00
USD	590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust 'Series 2015-SFR3 F' '144A' 6.643% 12/11/2032	594,241	0.01
USD	2,082,375	Progress Residential 2017-SFR1 Trust 'Series 2017-SFR1 A' '144A' 2.768% 17/8/2034	2,100,482	0.02
USD	1,480,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 F' '144A' 4.778% 17/3/2035	1,518,221	0.02
USD	920,000	Progress Residential 2018-SFR2 Trust 'Series 2018-SFR2 F' '144A' 4.953% 17/8/2035	956,820	0.01
EUR	325,000	Prologis Euro Finance LLC 0.625% 10/9/2031	359,953	0.00
USD	105,595	PRPM 2017-1 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-1A A1' '144A' 4.25% 25/1/2022	105,729	0.00
USD	1,763,000	Prudential Financial Inc FRN 15/9/2042	1,889,698	0.02
USD	3,130,000	Public Finance Authority 5% 30/9/2049	3,246,765	0.03
USD	880,000	Public Power Generation Agency 5% 1/1/2035	1,049,440	0.01
USD	134,000	PulteGroup Inc 4.25% 1/3/2021	137,183	0.00
USD	192,000	PulteGroup Inc 5% 15/1/2027	206,880	0.00
USD	5,550,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	6,084,188	0.06
USD	43,000	PulteGroup Inc 6% 15/2/2035	45,688	0.00
USD	3,255,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	3,987,375	0.04
USD	500,000	Qorvo Inc 5.5% 15/7/2026	535,010	0.01
USD	349,000	Quicken Loans Inc '144A' 5.25% 15/1/2028	362,524	0.00
USD	11,823,000	Quicken Loans Inc '144A' 5.75% 1/5/2025	12,384,593	0.13
USD	630,000	Race Point IX CLO Ltd 'Series 2015-9A A1AR' '144A' FRN 15/10/2030	629,919	0.01
USD	430,000	RAIT 2017-FL7 Trust 'Series 2017- FL7 C' '144A' FRN 15/6/2037	425,664	0.00
USD	1,085,470	RALI Series 2007-QH9 Trust 'Series 2007-QH9 A1' FRN 25/11/2037	1,015,727	0.01
USD	315,000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 9.375% 1/4/2027	276,412	0.00
EUR	5,873,000	Refinitiv US Holdings Inc 4.5% 15/5/2026	7,081,131	0.07
USD	1,000,000	Refinitiv US Holdings Inc '144A' 6.25% 15/5/2026	1,091,250	0.01
EUR	393,000	Refinitiv US Holdings Inc 6.875% 15/11/2026	495,085	0.01
USD	783,000	Refinitiv US Holdings Inc '144A' 8.25% 15/11/2026	884,790	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,530,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 5% 15/5/2047	1,807,680	0.02
USD	3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	5,351,684	0.06
USD	146,511	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 'Series 2005-R3 AF' '144A' FRN 25/9/2035	135,338	0.00
USD	1,305,000	Republic Services Inc 2.5% 15/8/2024	1,328,206	0.01
USD	1,483,809	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 'Series 2005-A5 A5' FRN 25/5/2035	1,219,759	0.01
USD	5,475,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	5,924,608	0.06
USD	141,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 7% 15/7/2024	145,847	0.00
USD	1,881,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	1,878,695	0.02
USD	1,250,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A C' '144A' FRN 15/10/2029	1,234,366	0.01
USD	4,390,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	4,357,580	0.04
USD	3,490,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A E' '144A' FRN 15/10/2029	3,312,386	0.03
USD	10,005,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A A' '144A' FRN 20/10/2030	9,986,680	0.10
USD	350,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A B' '144A' FRN 20/10/2030	341,574	0.00
USD	3,015,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A E' '144A' FRN 20/10/2030	2,694,419	0.03
USD	260,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A E' '144A' FRN 20/5/2031	230,970	0.00
USD	313,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A B' '144A' FRN 20/10/2031	311,908	0.00
USD	560,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 20/10/2031	505,851	0.01
USD	3,820,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 15/4/2029	3,807,252	0.04
USD	250,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A C' '144A' FRN 15/4/2029	250,431	0.00
USD	2,140,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 15/4/2029	2,139,574	0.02
USD	2,450,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	2,228,316	0.02
USD	13,621,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 5.625% 15/4/2020	13,825,315	0.14
USD	3,100,000	Romark WM-R Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 20/4/2031	3,067,167	0.03
USD	1,530,000	Roper Technologies Inc 2.35% 15/9/2024	1,536,642	0.02
USD	2,201,000	Rosslyn Portfolio Trust 2017-ROSS 'Series 2017-ROSS E' '144A' FRN 15/6/2033	2,186,563	0.02
USD	960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,089,139	0.01
USD	250,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	246,403	0.00
USD	410,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	391,370	0.00
USD	250,000	RR 3 Ltd 'Series 2018-3A A1R2' '144A' FRN 15/1/2030	248,827	0.00
USD	2,510,000	Ryder System Inc 3.65% 18/3/2024	2,654,107	0.03
USD	761,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/4/2023	830,857	0.01
USD	2,713,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 1/3/2025	3,049,924	0.03
USD	1,193,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	1,331,882	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,780,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/3/2022	1,921,696	0.02
USD	7,115,000	Sable Permian Resources Land LLC / AEPB Finance Corp '144A' 13% 30/11/2020	6,439,075	0.07
USD	2,245,000	Sabre GLBL Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	2,317,963	0.02
USD	2,500,000	Sabre GLBL Inc '144A' 5.375% 15/4/2023	2,575,000	0.03
USD	376,950	SACO I Trust 2006-9 'Series 2006- 9 A1' FRN 25/8/2036	370,829	0.00
USD	6,420,000	Sacramento County Sanitation Districts Financing Authority FRN 1/12/2035	6,226,341	0.06
USD	2,405,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	2,857,224	0.03
USD	900,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	1,087,101	0.01
USD	5,310,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2045	6,247,003	0.06
USD	2,050,000	San Antonio Water System 5% 15/5/2039	2,412,778	0.03
USD	1,500,000	San Diego County Regional Airport Authority 5% 1/7/2047	1,826,340	0.02
USD	1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority 5% 15/5/2039	1,216,860	0.01
USD	3,150,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2046	3,707,361	0.04
USD	3,425,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 2.958% 1/8/2024	3,604,110	0.04
USD	1,325,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.176% 1/8/2026	1,435,273	0.01
USD	1,017,538	Saxon Asset Securities Trust 2007- 1 'Series 2007-1 M1' FRN 25/1/2047	789,685	0.01
USD	3,223,000	Scientific Games International Inc 10% 1/12/2022	3,372,064	0.03
USD	5,248,000	SEACOR Holdings Inc 3.25% 15/5/2030	4,936,400	0.05
EUR	218,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023*	276,049	0.00
USD	3,827,072	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B' '144A' 25/7/2056 (Zero Coupon)	411,139	0.00
USD	5,209,947	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B10' '144A' FRN 25/7/2056	922,798	0.01
USD	514,914	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 BX' FRN 25/5/2057	268,189	0.00
USD	470,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 M' FRN 25/5/2057	475,344	0.01
USD	2,390,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 'Series 2018-3 M' '144A' FRN 25/8/2057	2,427,481	0.03
USD	5,196,186	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006- WM4 'Series 2006-WM4 A1' '144A' FRN 25/11/2036	3,065,539	0.03
USD	1,293,694	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006- WM4 'Series 2006-WM4 A2A' FRN 25/11/2036	497,590	0.01
USD	3,874,212	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006- WM4 'Series 2006-WM4 A2C' FRN 25/11/2036	1,519,916	0.02
USD	551,232	Security National Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1A 2A' '144A' FRN 25/4/2037	546,183	0.01
USD	132,114	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A AR' '144A' FRN 17/7/2026	132,104	0.00
USD	1,750,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A CR' '144A' FRN 17/7/2026	1,753,613	0.02
USD	1,590,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,596,118	0.02
USD	250,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A SUB' '144A' FRN 17/7/2026	16,411	0.00
USD	6,210,000	Sesac Finance LLC 'Series 2019-1 A2' '144A' 5.216% 25/7/2049	6,338,921	0.07

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,387,053	SG Mortgage Securities Trust 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A2C' FRN 25/7/2036	431,416	0.00
USD	1,310,000	SG Mortgage Securities Trust 2006-OPT2 'Series 2006-OPT2 A3D' FRN 25/10/2036	1,004,631	0.01
USD	3,120,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd 'Series 2013-3A AR' '144A' FRN 15/7/2030	3,100,622	0.03
USD	44,000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 5.875% 1/4/2023	45,540	0.00
USD	3,750,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014- 1A AR' '144A' FRN 20/7/2030	3,746,264	0.04
USD	1,000,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014- 1A DR' '144A' FRN 20/7/2030	997,843	0.01
USD	500,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014- 1A E1R' '144A' FRN 20/7/2030	460,047	0.00
USD	1,493,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 1/8/2022	1,526,593	0.02
USD	3,598,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4.625% 15/7/2024	3,773,403	0.04
USD	520,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5% 1/8/2027	550,550	0.01
USD	347,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.375% 15/4/2025	361,314	0.00
USD	347,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.375% 15/7/2026	367,386	0.00
USD	2,390,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.5% 1/7/2029	2,611,792	0.03
USD	3,047,440	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 'Series 2004-A A3' FRN 15/6/2033	3,007,294	0.03
USD	1,120,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B A4' FRN 15/9/2033	1,082,527	0.01
USD	1,669,234	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B B' FRN 15/9/2033	1,655,214	0.02
USD	11,970,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 'Series 2005-A A4' FRN 15/12/2038	11,678,485	0.12
USD	10,806,063	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 'Series 2005-B A4' FRN 15/6/2039	10,614,661	0.11
USD	4,347,871	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 'Series 2005-B B' FRN 15/6/2039	4,303,596	0.04
USD	9,900,731	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 'Series 2006-A A5' FRN 15/6/2039	9,713,711	0.10
USD	4,261,997	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 'Series 2006-B A5' FRN 15/12/2039	4,164,657	0.04
USD	870,495	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 'Series 2006-BW A5' FRN 15/12/2039	852,010	0.01
USD	7,270,145	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 'Series 2007-A A4A' FRN 16/12/2041	7,099,422	0.07
USD	99,412	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 4.54% 17/10/2044	100,005	0.00
USD	4,740,000	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A B' '144A' 3.5% 15/11/2044	4,796,975	0.05
USD	7,010,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 'Series 2015-B B' '144A' 3.5% 17/12/2040	7,295,501	0.08
USD	1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-C B' '144A' 3.5% 15/9/2043	1,977,890	0.02
USD	4,145,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 'Series 2019-A A2A' '144A' 3.44% 15/7/2036	4,359,463	0.05
USD	10,060,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-B 'Series 2019-B A2A' '144A' 2.84% 15/6/2037	10,313,742	0.11
USD	10,000,000	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 'Series 2018-C A2FX' '144A' 3.59% 25/1/2048	10,603,051	0.11
USD	10,000,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 'Series 2018-D A2FX' '144A' 3.6% 25/2/2048	10,554,649	0.11
USD	1,390,000	Sound Point CLO XI Ltd 'Series 2016-1A CR' '144A' FRN 20/7/2028	1,377,146	0.01
USD	440,000	Sound Point Clo XIV Ltd 'Series 2016-3A C' '144A' FRN 23/1/2029	439,861	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	Sound Point Clo XIV Ltd 'Series 2016-3A E' '144A' FRN 23/1/2029	251,191	0.00
USD 260,000	Sound Point Clo XV Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 23/1/2029	259,986	0.00
USD 3,600,000	Sound Point Clo XV Ltd 'Series 2017-1A C' '144A' FRN 23/1/2029	3,581,186	0.04
USD 41,811	Soundview Home Loan Trust 2004- WMC1 'Series 2004-WMC1 M2' FRN 25/1/2035	41,100	0.00
USD 800,000	South Carolina Ports Authority 5% 1/7/2055	952,496	0.01
USD 5,485,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	5,526,494	0.06
USD 2,090,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,214,689	0.02
USD 3,567,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	5,750,717	0.06
USD 570,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	711,796	0.01
USD 480,000	Springleaf Funding Trust 2016-A 'Series 2016-AA B' '144A' 3.8% 15/11/2029	481,238	0.01
USD 8,213,000	Springleaf Funding Trust 2017-A 'Series 2017-AA A' '144A' 2.68% 15/7/2030	8,225,196	0.08
USD 1,369,000	Sprint Capital Corp 8.75% 15/3/2032	1,714,673	0.02
USD 2,889,000	Sprint Communications Inc (Restricted) '144A' 7% 1/3/2020	2,957,469	0.03
USD 142,000	Sprint Corp 7.125% 15/6/2024	157,663	0.00
USD 2,500,000	Sprint Corp 7.25% 15/9/2021	2,692,500	0.03
USD 3,448,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,887,620	0.04
USD 7,631,438	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	7,661,192	0.08
USD 4,631,000	SSM Health Care Corp 3.688% 1/6/2023	4,893,660	0.05
USD 1,296,615	STACR Trust 2018-DNA2 'Series 2018-DNA2 M2' '144A' FRN 25/12/2030	1,301,281	0.01
USD 729,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.75% 15/1/2028	735,379	0.01
USD 173,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5% 15/2/2027	177,757	0.00
USD 380,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.375% 15/11/2024	392,350	0.00
USD 173,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.5% 15/2/2023	177,757	0.00
USD 10,218,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,779,990	0.11
USD 224,718	Staniford Street CLO Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' FRN 15/6/2025	224,734	0.00
USD 2,850,000	Staples Inc '144A' 7.5% 15/4/2026	2,892,750	0.03
USD 2,000,000	Staples Inc '144A' 10.75% 15/4/2027	2,025,000	0.02
USD 7,170,000	State of California 2.65% 1/4/2026	7,466,264	0.08
USD 2,395,000	State of California 7.3% 1/10/2039	3,809,810	0.04
USD 660,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,056,337	0.01
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	4,061,715	0.04
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,292,321	0.02
USD 2,540,000	State of Connecticut 2.99% 15/1/2023	2,611,196	0.03
USD 4,315,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	4,605,658	0.05
USD 4,140,000	State of Connecticut 5.85% 15/3/2032	5,513,404	0.06
USD 4,060,000	State of Illinois 5% 1/11/2024	4,491,192	0.05
USD 6,470,000	State of Illinois 5% 1/11/2025	7,277,003	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,920,000	State of Maryland 5% 1/8/2030	2,576,698	0.03
USD 4,110,000	State of Maryland 5% 1/8/2031	5,492,789	0.06
USD 1,690,000	State of Minnesota 5% 1/8/2035	2,228,265	0.02
USD 4,430,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	5,700,701	0.06
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,930,205	0.02
USD 5,365,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	6,604,154	0.07
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	5,643,505	0.06
USD 1,230,000	State of Texas 5% 1/4/2040	1,483,731	0.02
USD 1,970,000	State of Texas 5% 1/4/2043	2,360,956	0.02
USD 930,000	State of Washington 5% 1/8/2040	1,147,318	0.01
USD 2,400,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,851,680	0.03
USD 980,000	State of Washington 5% 1/8/2041	1,207,100	0.01
USD 1,050,000	State of West Virginia 5% 1/12/2040	1,316,479	0.01
USD 1,505,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	1,614,323	0.02
USD 1,340,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2036	1,598,178	0.02
USD 1,350,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2038	1,603,712	0.02
USD 57,000	Steel Dynamics Inc 4.125% 15/9/2025	57,713	0.00
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,947,303	0.02
USD 2,050,000	Steel Dynamics Inc 5.125% 1/10/2021	2,055,125	0.02
USD 283,000	Steel Dynamics Inc 5.25% 15/4/2023	287,882	0.00
USD 2,895,000	Steel Dynamics Inc 5.5% 1/10/2024	2,999,075	0.03
USD 330,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 15/1/2030	329,113	0.00
USD 2,320,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	1,855,534	0.02
USD 510,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	471,771	0.01
USD 1,493,510	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust ' Series 2006-3 4A' FRN 25/4/2036	1,343,983	0.01
USD 1,750,665	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 'Series 2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	1,724,263	0.02
USD 535,462	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 'Series 2006-AR5 2A1' FRN 25/5/2046	466,150	0.01
USD 11,783,849	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 'Series 2006-RF3 1A2' ' 144A' 6% 25/10/2036	9,243,392	0.10
USD 164,644	Sudbury Mill CLO Ltd 'Series 2013- 1A A1R' ' 144A' FRN 17/1/2026	164,645	0.00
USD 263,431	Sudbury Mill CLO Ltd 'Series 2013- 1A A2R' ' 144A' FRN 17/1/2026	263,432	0.00
USD 2,328,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/7/2023	2,377,470	0.02
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	958,937	0.01
USD 918,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 4.25% 1/4/2024	969,944	0.01
USD 695,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 4.65% 15/2/2022	728,664	0.01
USD 7,101,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	7,278,525	0.07
USD 445,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 15/2/2026	462,800	0.01
USD 3,489,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15/3/2028	3,637,282	0.04
USD 207,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6% 15/4/2027	218,385	0.00
USD 1,975,000	SunTrust Bank/Atlanta GA FRN 2/8/2024	2,079,604	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,450,000	SunTrust Banks Inc FRN 15/6/2022 (Perpetual)	1,464,108	0.02
USD	7,738,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	8,559,023	0.09
USD	3,408,649	Symphony CLO XII Ltd 'Series 2013-12A AR' '144A' ' FRN 15/10/2025	3,410,925	0.04
USD	274,570	Symphony CLO XIV Ltd 'Series 2014-14A A1R' ' 144A' FRN 14/7/2026	274,615	0.00
USD	1,830,000	Symphony CLO XVII Ltd 'Series 2016-17A AR' ' 144A' FRN 15/4/2028	1,821,533	0.02
USD	300,000	Symphony CLO XVIII Ltd 'Series 2016-18A B' ' 144A' FRN 23/1/2028	299,663	0.00
USD	250,000	Symphony CLO XVIII Ltd 'Series 2016-18A D' ' 144A' FRN 23/1/2028	250,436	0.00
USD	775,000	Synchrony Financial 2.85% 25/7/2022	784,800	0.01
USD	3,975,000	Synchrony Financial 4.375% 19/3/2024	4,244,795	0.04
USD	4,733,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	3,620,745	0.04
USD	13,002,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7.25% 15/5/2027	12,985,748	0.13
USD	2,966,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10.5% 15/1/2026	2,703,509	0.03
USD	4,520,000	Talos Production LLC / Talos Production Finance Inc 11% 3/4/2022	4,695,150	0.05
USD	131,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 1/2/2025	134,930	0.00
USD	3,745,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15/4/2026	3,940,452	0.04
USD	4,963,000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15/6/2027	5,335,225	0.06
USD	579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/7/2030	560,582	0.01
USD	207,000	Tempur Sealy International Inc 5.5% 15/6/2026	217,091	0.00
USD	2,856,000	Tenet Healthcare Corp 4.375% 1/10/2021	2,980,236	0.03
USD	174,000	Tenet Healthcare Corp 4.5% 1/4/2021	180,334	0.00
USD	647,000	Tenet Healthcare Corp 4.625% 15/7/2024	669,069	0.01
USD	4,706,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 1/9/2024	4,853,063	0.05
USD	3,036,000	Tenet Healthcare Corp 4.75% 1/6/2020	3,089,130	0.03
USD	5,386,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 1/1/2026	5,549,196	0.06
USD	15,134,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	15,732,096	0.16
USD	860,000	Tennessee Housing Development Agency 3.75% 1/7/2038	941,889	0.01
USD	415,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	448,019	0.00
USD	325,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	350,818	0.00
USD	2,884,000	Teva Pharmaceutical Finance IV LLC 2.25% 18/3/2020	2,872,291	0.03
USD	1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,895,878	0.02
USD	670,000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	790,824	0.01
USD	570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	640,931	0.01
USD	5,910,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 30/6/2058	7,008,669	0.07
USD	1,822,968	Thacher Park CLO Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' ' FRN 20/10/2026	1,822,965	0.02
USD	1,000,000	Thacher Park CLO Ltd 'Series 2014-1A CR' '144A' ' FRN 20/10/2026	1,000,093	0.01
USD	1,410,000	Thacher Park CLO Ltd 'Series 2014-1A D1R' '144A' ' FRN 20/10/2026	1,409,824	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 260,000	Thayer Park CLO Ltd 'Series 2017- 1A D' '144A' FRN 20/4/2029	242,330	0.00
USD 500,000	THL Credit Wind River 2016-1 CLO Ltd 'Series 2016-1A AR' '144A' FRN 15/7/2028	499,433	0.01
USD 431,253	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-3 'Series 2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	397,557	0.00
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 20/4/2029	250,217	0.00
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/4/2029	228,181	0.00
USD 263,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 16/1/2031	262,023	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 16/1/2031	733,256	0.01
USD 3,220,000	TICP CLO VII Ltd 'Series 2017-7A E' '144A' FRN 15/7/2029	3,141,352	0.03
USD 5,930,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	6,187,599	0.06
USD 3,710,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	3,597,123	0.04
USD 4,112,000	Toll Brothers Finance Corp 4.375% 15/4/2023	4,302,180	0.04
USD 1,298,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,396,972	0.01
USD 2,917,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/3/2027	3,180,259	0.03
USD 2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,858,467	0.03
USD 1,840,000	Treman Park CLO Ltd FRN 20/10/2028	1,798,659	0.02
USD 250,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A1A' '144A' FRN 25/7/2029	250,099	0.00
USD 2,173,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 25/7/2029	2,172,045	0.02
USD 750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A C' '144A' FRN 25/7/2029	751,526	0.01
USD 640,000	TRESTLES CLO II Ltd 'Series 2018-2A D' '144A' FRN 25/7/2031	575,821	0.01
USD 1,130,000	TRI Pointe Group Inc 4.875% 1/7/2021	1,170,962	0.01
USD 1,809,000	TRI Pointe Group Inc 5.25% 1/6/2027	1,827,090	0.02
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd 'Series 2006-1A A2' '144A' FRN 3/3/2039	773,505	0.01
USD 730,000	Tricon American Homes 2017- SFR2 Trust 'Series 2017-SFR2 F' '144A' 5.104% 17/1/2036	766,819	0.01
USD 850,000	Tricon American Homes 2018- SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 E' '144A' 4.564% 17/5/2037	910,538	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018- SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 F' '144A' 4.96% 17/5/2037	609,073	0.01
USD 2,000,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,469,780	0.03
USD 367,959	Trinitas CLO II Ltd 'Series 2014-2A A1R' '144A' FRN 15/7/2026	368,207	0.00
USD 1,400,000	TSASC Inc/NY 5% 1/6/2041	1,565,473	0.02
USD 1,780,000	Tyson Foods Inc 4% 1/3/2026	1,939,734	0.02
USD 10,026,000	Tyson Foods Inc 4.35% 1/3/2029	11,446,585	0.12
USD 146,900	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	155,464	0.00
EUR 383,000	UGI International LLC 3.25% 1/11/2025	447,142	0.00
USD 1,095,000	Union Pacific Corp 3.55% 15/8/2039	1,172,334	0.01
USD 1,947,114	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	2,046,179	0.02
USD 1,505,000	United Parcel Service Inc 2.2% 1/9/2024	1,518,665	0.02
USD 1,225,000	United Parcel Service Inc 3.4% 1/9/2049	1,284,331	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 260,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/10/2025	267,475	0.00
USD 578,000	United Rentals North America Inc 4.875% 15/1/2028	609,790	0.01
USD 4,942,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	5,189,397	0.05
USD 347,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/5/2027	372,591	0.00
USD 347,000	United Rentals North America Inc 5.875% 15/9/2026	371,724	0.00
USD 380,000	United Rentals North America Inc 6.5% 15/12/2026	415,625	0.00
USD 208,726,700	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024 †	216,675,792	2.22
USD 45,577,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023*	47,783,307	0.49
USD 20,153,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.875% 15/1/2029 †	22,204,034	0.23
USD 31,573,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/8/2029 †	31,341,136	0.32
USD 4,316,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049 †	4,574,960	0.05
USD 33,430,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029 †	35,981,649	0.37
USD 595,000	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048 †	728,643	0.01
USD 13,875,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	14,704,920	0.15
USD 4,405,000	United Technologies Corp 4.125% 16/11/2028	5,029,773	0.05
USD 1,525,000	UnitedHealth Group Inc 3.5% 15/8/2039	1,632,284	0.02
USD 2,380,000	UnitedHealth Group Inc 3.7% 15/12/2025	2,595,561	0.03
USD 1,895,000	UnitedHealth Group Inc 3.7% 15/8/2049	2,079,775	0.02
USD 2,455,000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15/8/2059	2,719,772	0.03
USD 3,265,000	UnitedHealth Group Inc 4.25% 15/6/2048	3,851,305	0.04
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,566,143	0.02
USD 4,345,000	University of California 3.349% 1/7/2029	4,780,804	0.05
USD 1,665,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,961,869	0.02
USD 2,595,000	University of California 5.77% 15/5/2043	3,702,416	0.04
USD 2,110,000	University of Houston 5% 15/2/2036	2,530,027	0.03
USD 2,500,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	3,056,087	0.03
USD 2,296,000	University of Notre Dame du Lac 3.394% 15/2/2048	2,608,675	0.03
USD 1,220,000	University of Oregon 5% 1/4/2046	1,452,477	0.02
USD 256,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	273,724	0.00
USD 2,075,000	University of Vermont & State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,535,474	0.03
USD 810,000	US 2018-USDC 'Series 2018- USDC E' '144A' FRN 13/5/2038	868,696	0.01
USD 1,300,000	US 2018-USDC 'Series 2018- USDC F' '144A' FRN 13/5/2038	1,347,408	0.01
USD 2,243,333	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,381,297	0.02
USD 700,752	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	732,334	0.01
USD 207,000	US Concrete Inc 6.375% 1/6/2024	217,868	0.00
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M1' FRN 25/10/2046	317,284	0.00
USD 170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M2' FRN 25/10/2046	174,782	0.00
USD 710,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M3' FRN 25/10/2046	739,271	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ' Series 2016-2 M4 ' FRN 25/10/2046	336,558	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ' Series 2017-1 M2 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	336,368	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ' Series 2017-1 M3 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	342,734	0.00
USD 1,924,779	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ' Series 2017-2 M3 ' ' 144A ' FRN 25/11/2047	1,970,747	0.02
USD 320,035	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ' Series 2017-2 M4 ' ' 144A ' FRN 25/11/2047	328,198	0.00
USD 328,068	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 ' Series 2018-1 M2 ' ' 144A ' 4.26% 25/4/2048	342,855	0.00
USD 6,028,000	Ventas Realty LP 3.5% 15/4/2024	6,336,822	0.07
USD 2,282,000	Venture XXIV CLO Ltd ' Series 2016-24A A1D ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	2,283,138	0.02
USD 804,000	Venture XXIV CLO Ltd ' Series 2016-24A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	800,786	0.01
USD 16,296,000	VeriSign Inc 4.625% 1/5/2023	16,601,550	0.17
USD 3,535,000	Verizon Communications Inc 3.376% 15/2/2025	3,745,494	0.04
USD 1,025,000	Verizon Communications Inc 3.875% 8/2/2029	1,143,181	0.01
USD 5,315,000	Verizon Communications Inc ' 144A ' 4.016% 3/12/2029	6,002,076	0.06
USD 6,240,000	Verizon Communications Inc 4.125% 16/3/2027	6,947,490	0.07
USD 1,080,000	Verizon Communications Inc 4.272% 15/1/2036	1,239,942	0.01
USD 3,961,000	Verizon Communications Inc 4.672% 15/3/2055	4,877,650	0.05
USD 240,000	Verizon Communications Inc 5.012% 15/4/2049	308,210	0.00
USD 2,129,000	Viacom Inc FRN 28/2/2057	2,229,659	0.02
USD 435,000	Viacom Inc 4.25% 1/9/2023	464,122	0.01
USD 500,000	ViaSat Inc ' 144A ' 5.625% 15/4/2027	528,750	0.01
USD 830,000	Vibrant Clo V Ltd ' Series 2016-5A A ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	830,608	0.01
USD 1,254,000	Vibrant Clo VII Ltd ' Series 2017-7A A1 ' ' 144A ' FRN 15/9/2030	1,248,020	0.01
USD 2,270,000	Virginia Small Business Financing Authority 5% 31/12/2052	2,627,309	0.03
USD 1,002,000	Vistra Energy Corp 5.875% 1/6/2023	1,025,798	0.01
USD 3,527,000	Vistra Energy Corp 7.625% 1/11/2024	3,736,962	0.04
USD 11,012,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 3.55% 15/7/2024	11,135,234	0.11
USD 6,491,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5% 31/7/2027	6,718,185	0.07
USD 347,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5.5% 1/9/2026	365,218	0.00
USD 451,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5.625% 15/2/2027	477,496	0.01
USD 450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ' Series 2013-PENN D ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	454,677	0.00
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ' Series 2013-PENN E ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	879,892	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013- 2A A1R ' ' 144A ' FRN 25/4/2031	1,835,322	0.02
USD 750,000	Voya CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015- 2A BR ' ' 144A ' FRN 23/7/2027	742,897	0.01
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd ' Series 2017- 4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	3,491,020	0.04
EUR 422,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	423,862	0.00
USD 16,376,592	Voyager OPTONE Delaware Trust ' Series 2009-1 SAA7 ' ' 144A ' FRN 25/2/2038	6,100,302	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,013,670	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	1,882,519	0.02
USD 8,352,500	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007- HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A3' FRN 25/4/2037	4,466,744	0.05
USD 894,911	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007- HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A4' FRN 25/4/2037	488,810	0.01
USD 548,313	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust 'Series 2005-AR2 B1' FRN 25/1/2045	423,274	0.00
USD 9,269,794	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 'Series 2006-AR3 A1B' FRN 25/2/2046	8,948,441	0.09
USD 682,826	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 'Series 2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	655,150	0.01
USD 870,000	Washington Metropolitan Area Transit Authority 5% 1/7/2036	1,077,473	0.01
USD 1,084,946	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 'Series 2006- 1 4CB' 6.5% 25/2/2036	977,788	0.01
USD 5,862,373	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 'Series 2006-4 1A1' 6% 25/4/2036	5,569,097	0.06
USD 372,519	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A5' 6.35% 25/5/2036	341,027	0.00
USD 1,629,618	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,491,665	0.02
USD 4,990,267	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-9 A7' 4.649% 25/10/2036	2,617,484	0.03
USD 1,516,425	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust 'Series 2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,353,921	0.01
USD 4,709,086	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 'Series 2006- HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,203,667	0.02
USD 3,857,261	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006- HE5 1A' FRN 25/10/2036	3,110,666	0.03
USD 3,499,335	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006- HE5 2A2' FRN 25/10/2036	1,823,675	0.02
USD 4,538,145	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007- HE2 2A2' FRN 25/2/2037	1,966,891	0.02
USD 1,530,000	Waste Management Inc 3.2% 15/6/2026	1,628,759	0.02
USD 3,557,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 1/2/2023	3,557,000	0.04
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6.625% 15/8/2025	1,830,105	0.02
USD 2,900,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2024 (Perpetual)	3,108,177	0.03
USD 4,726,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2025 (Perpetual)	5,215,826	0.05
USD 13,777,000	Wells Fargo & Co FRN 17/6/2027	14,362,528	0.15
USD 3,900,000	Wells Fargo & Co 3% 22/4/2026	4,033,640	0.04
USD 9,530,000	Wells Fargo & Co 3.55% 29/9/2025	10,135,660	0.10
USD 24,745,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	26,336,280	0.27
USD 6,446,000	Wells Fargo & Co 4.15% 24/1/2029	7,229,813	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,329,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 Series 2015- C27 C ' 3.894% 15/2/2048	1,352,776	0.01
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 Series 2015- NXS1 XB ' FRN 15/5/2048	95,807	0.00
USD 600,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Series 2015- NXS4 B ' FRN 15/12/2048	647,024	0.01
USD 443,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Series 2015- NXS4 D ' FRN 15/12/2048	452,075	0.00
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 Series 2015-P2 D ' ' 144A ' 3.241% 15/12/2048	434,464	0.00
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 Series 2016- BNK1 XD ' ' 144A ' FRN 15/8/2049	200,514	0.00
USD 730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C34 Series 2016- C34 C ' FRN 15/6/2049	802,414	0.01
USD 800,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 Series 2016- NXS5 C ' FRN 15/1/2059	878,993	0.01
USD 1,856,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 Series 2017- C39 D ' ' 144A ' FRN 15/9/2050	1,902,759	0.02
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 Series 2017- C39 C ' 4.118% 15/9/2050	2,071,671	0.02
USD 1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB Series 2017- HSDB A ' ' 144A ' FRN 13/12/2031	1,359,058	0.01
USD 9,624,522	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 Series 2017- RC1 XA ' FRN 15/1/2060	789,867	0.01
USD 850,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 Series 2018- 1745 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2036	947,160	0.01
USD 798,379	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-BX1 Series 2018-BX1 E ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	803,123	0.01
USD 21,622,054	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 Series 2018- C44 XA ' FRN 15/5/2051	1,151,008	0.01
USD 1,050,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 Series 2018- C44 D ' ' 144A ' 3% 15/5/2051	991,258	0.01
USD 490,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 Series 2018- C45 C ' 4.727% 15/6/2051	537,386	0.01
USD 1,669,000	Welltower Inc 3.625% 15/3/2024	1,757,790	0.02
USD 3,087,000	Welltower Inc 4.125% 15/3/2029	3,404,360	0.04
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	436,085	0.00
USD 1,173,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	1,487,000	0.02
USD 320,000	West CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A C ' ' 144A ' FRN 7/11/2025	320,266	0.00
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	919,026	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	945,483	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,069,677	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	915,260	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	1,000,533	0.01
USD 2,350,000	Western Digital Corp 4.75% 15/2/2026	2,411,687	0.03
USD 40,598	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2011-C3 Series 2011-C3 A3FL ' ' 144A ' FRN 15/3/2044	40,686	0.00
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 Series 2012-C8 C ' FRN 15/8/2045	379,131	0.00
USD 520,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 Series 2014- C24 B ' FRN 15/11/2047	547,128	0.01
USD 937,000	Whiting Petroleum Corp 1.25% 1/4/2020	925,094	0.01
USD 2,522,000	William Lyon Homes Inc 6% 1/9/2023	2,610,270	0.03
USD 537,000	William Lyon Homes Inc ' 144A ' 6.625% 15/7/2027	538,343	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD	753,000 Williams Cos Inc/The 3.75% 15/6/2027	785,237	0.01
USD	901,000 Williams Cos Inc/The 4% 15/9/2025	960,326	0.01
USD	650,000 Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/12/2044	741,367	0.01
EUR	274,000 WMG Acquisition Corp 3.625% 15/10/2026	324,435	0.00
EUR	2,610,000 WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	3,003,569	0.03
USD	225,000 WPX Energy Inc 5.25% 15/9/2024	229,739	0.00
USD	173,000 WPX Energy Inc 5.75% 1/6/2026	179,917	0.00
USD	173,000 WPX Energy Inc 8.25% 1/8/2023	193,328	0.00
USD	173,000 Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 5.375% 15/4/2026	182,515	0.00
USD	226,000 XPO Logistics Inc '144A' 6.125% 1/9/2023	234,249	0.00
USD	90,000 XPO Logistics Inc '144A' 6.5% 15/6/2022	92,199	0.00
USD	2,063,907 Yale Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1 A' '144A' FRN 25/6/2037	871,037	0.01
USD	960,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A AR' '144A' FRN 20/10/2029	958,563	0.01
USD	5,995,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A BR' '144A' FRN 20/10/2029	5,959,299	0.06
USD	2,990,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 20/10/2029	2,989,396	0.03
USD	1,520,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	1,473,055	0.02
USD	730,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A FR' '144A' FRN 20/10/2029	655,296	0.01
USD	2,740,000 York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A SUB' '144A' FRN 20/10/2029	1,888,553	0.02
USD	550,000 York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A A' '144A' FRN 20/1/2030	551,265	0.01
USD	610,000 York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/1/2030	614,932	0.01
USD	1,820,000 York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 20/1/2030	1,780,016	0.02
USD	2,010,000 York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A SUB' '144A' FRN 20/1/2030	1,326,976	0.01
USD	3,115,000 Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	3,218,979	0.03
USD	1,085,000 Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6.375% 15/5/2025	1,118,906	0.01
USD	172,000 Zekelman Industries Inc '144A' 9.875% 15/6/2023	181,352	0.00
		5,132,961,173	52.69
ウルグアイ			
USD	4,282,948 Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	4,755,411	0.05
ベトナム			
USD	5,200,000 No Va Land Investment Group Corp 5.5% 27/4/2023	5,109,000	0.05
USD	3,000,000 Vinpearl JSC 3.5% 14/6/2023	3,330,778	0.04
		8,439,778	0.09
債券合計		8,276,550,551	84.95
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		8,413,624,072	86.36

その他の譲渡可能な有価証券

債券		米国		
USD	2,391	Lehman Brothers Holdings Inc 31/12/2049 (Zero Coupon)**	27	0.00
USD	2,391	Lehman Brothers Special Finance 31/12/2049 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD	3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) FRN 1/5/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	630,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 6/11/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
			27	0.00
債券合計			27	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計			27	0.00
投資有価証券合計			8,413,624,099	86.36
その他の純資産			1,328,908,306	13.64
純資産合計(米ドル)			9,742,532,405	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

† 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券。詳細については注記14を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
ARS	90,382,500	USD	1,950,000	Citibank	3/9/2019	(418,076)
USD	1,950,000	ARS	88,920,000	BNP Paribas	3/9/2019	442,865
BRL	27,118,099	EUR	5,974,333	Deutsche Bank	4/9/2019	(58,119)
BRL	17,877,189	EUR	3,982,000	Citibank	4/9/2019	(86,384)
BRL	54,700,376	EUR	12,615,000	BNP Paribas	4/9/2019	(740,373)
BRL	23,459,920	EUR	5,533,000	JP Morgan	4/9/2019	(453,051)
BRL	14,612,902	USD	3,627,000	BNP Paribas	4/9/2019	(101,864)
BRL	8,832,200	USD	2,187,000	RBS Plc	4/9/2019	(56,369)
BRL	7,036,015	USD	1,745,000	Morgan Stanley	4/9/2019	(47,671)
BRL	20,749,708	USD	5,197,000	Bank of America	4/9/2019	(191,454)
BRL	111,333,649	USD	27,991,000	Citibank	4/9/2019	(1,133,484)
BRL	7,527,469	USD	1,992,000	Toronto Dominion	4/9/2019	(176,115)
BRL	12,623,636	USD	3,320,000	Goldman Sachs	4/9/2019	(274,744)
BRL	88,925,652	USD	23,363,000	Barclays	4/9/2019	(1,911,066)
EUR	3,318,333	BRL	14,889,340	Morgan Stanley	4/9/2019	73,993
EUR	7,081,000	BRL	30,998,357	BNP Paribas	4/9/2019	344,620
EUR	4,426,000	BRL	19,652,547	RBS Plc	4/9/2019	148,600
EUR	2,213,000	BRL	9,802,484	Citibank	4/9/2019	80,039
EUR	5,533,000	BRL	23,311,636	Deutsche Bank	4/9/2019	488,822
EUR	5,533,000	BRL	23,468,220	JP Morgan	4/9/2019	451,049
USD	18,624,000	BRL	72,903,069	BNP Paribas	4/9/2019	1,037,265
USD	8,959,000	BRL	35,855,887	Goldman Sachs	4/9/2019	309,324
USD	20,519,000	BRL	81,346,459	Deutsche Bank	4/9/2019	895,428
USD	23,657,000	BRL	92,347,309	Citibank	4/9/2019	1,379,645
USD	4,426,000	BRL	16,932,548	RBS Plc	4/9/2019	341,285
USD	1,992,000	BRL	7,521,593	HSBC Bank Plc	4/9/2019	177,532
USD	3,947,000	BRL	15,023,308	Barclays	4/9/2019	322,860
ARS	89,330,400	USD	1,959,000	BNP Paribas	5/9/2019	(456,413)
GBP	177,399,000	USD	216,284,861	Bank of America	5/9/2019	427,295
JPY	9,745,973,000	USD	91,606,100	Bank of America	5/9/2019	225,127
USD	1,371,300	ARS	89,545,890	Goldman Sachs	5/9/2019	(134,912)
USD	3,271,329	AUD	4,854,600	State Street	5/9/2019	363
USD	9,273,694	EUR	8,350,000	UBS	5/9/2019	48,600
USD	749,460,094	EUR	670,512,000	BNP Paribas	5/9/2019	8,677,354
USD	14,108,468	GBP	11,592,000	Citibank	5/9/2019	(52,420)
USD	229,025,201	GBP	187,426,000	Bank of America	5/9/2019	63,975
USD	10,413,884	JPY	1,102,723,700	State Street	5/9/2019	23,493
USD	81,435,651	JPY	8,825,605,000	Royal Bank of Canada	5/9/2019	(1,723,428)
EGP	112,201,000	USD	6,148,000	Citibank	9/9/2019	618,833
EUR	126,053	USD	141,503	Citibank	9/9/2019	(2,196)
USD	1,182,532	CHF	1,174,133	Bank of America	9/9/2019	(6,908)
USD	3,539,427	EUR	3,135,785	JP Morgan	9/9/2019	73,930
USD	8,549,268	EUR	7,519,000	Bank of America	9/9/2019	239,686

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
CLP	2,769,763,950	USD	3,903,000	Citibank	11/9/2019	(49,551)
EGP	66,813,941	USD	3,973,000	Citibank	11/9/2019	54,026
IDR	27,735,416,000	USD	1,951,000	Deutsche Bank	11/9/2019	2,740
USD	1,941,000	CLP	1,395,967,200	Citibank	11/9/2019	(1,147)
USD	1,951,000	CLP	1,402,183,700	Bank of America	11/9/2019	205
USD	1,951,000	IDR	28,037,821,000	Goldman Sachs	11/9/2019	(24,042)
USD	971,000	ARS	64,571,500	JP Morgan	16/9/2019	(69,366)
USD	3,339,500	ARS	223,746,500	Morgan Stanley	16/9/2019	(265,470)
ARS	59,231,750	USD	1,229,000	Citibank	18/9/2019	(282,304)
ARS	51,912,900	USD	986,000	BNP Paribas	18/9/2019	(156,280)
AUD	26,295,000	CAD	23,667,607	JP Morgan	18/9/2019	(123,421)
AUD	10,696,027	EUR	6,480,000	RBS Plc	18/9/2019	43,417
AUD	11,022,121	EUR	6,639,000	JP Morgan	18/9/2019	87,384
AUD	4,251,159	EUR	2,655,000	Citibank	18/9/2019	(70,674)
AUD	8,876,785	EUR	5,531,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(133,344)
AUD	4,955,771	EUR	3,098,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(85,645)
AUD	2,211,000	JPY	166,983,785	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(84,582)
AUD	6,639,000	NZD	6,921,250	RBS Plc	18/9/2019	99,971
AUD	6,197,000	NZD	6,454,615	HSBC Bank Plc	18/9/2019	97,009
AUD	3,762,000	NZD	3,940,545	Bank of America	18/9/2019	44,887
AUD	7,307,504	USD	4,984,709	JP Morgan	18/9/2019	(59,016)
AUD	5,533,000	USD	3,741,246	Citibank	18/9/2019	(11,674)
AUD	1,810,000	USD	1,266,041	Royal Bank of Canada	18/9/2019	(45,993)
AUD	22,567,000	USD	15,757,797	Bank of America	18/9/2019	(546,293)
AUD	2,770,000	USD	1,953,121	Deutsche Bank	18/9/2019	(85,976)
AUD	2,656,000	USD	1,846,156	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(55,854)
AUD	9,102,000	USD	6,307,503	RBS Plc	18/9/2019	(172,211)
AUD	940,000	USD	655,026	Nomura	18/9/2019	(21,410)
BRL	72,637,530	USD	19,136,063	Citibank	18/9/2019	(1,632,192)
BRL	9,500,000	USD	2,524,246	Goldman Sachs	18/9/2019	(234,978)
BRL	10,882,186	USD	2,888,000	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(265,659)
BRL	116,310,227	USD	29,973,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(1,945,076)
CAD	1,562,214	AUD	1,735,000	Goldman Sachs	18/9/2019	8,577
CAD	14,927,836	AUD	16,595,000	Morgan Stanley	18/9/2019	71,110
CAD	7,306,430	AUD	7,965,000	Citibank	18/9/2019	140,917
CAD	5,532,857	CHF	4,154,844	UBS	18/9/2019	(40,164)
CAD	2,213,143	CHF	1,663,952	Morgan Stanley	18/9/2019	(18,108)
CAD	3,320,000	CHF	2,499,894	Bank of America	18/9/2019	(30,967)
CAD	3,429,000	NOK	23,066,997	JP Morgan	18/9/2019	46,240
CAD	9,959,000	NOK	67,197,907	Bank of America	18/9/2019	111,904
CAD	22,039,291	NZD	25,447,000	Bank of America	18/9/2019	534,158
CAD	4,802,166	NZD	5,535,000	JP Morgan	18/9/2019	122,504
CAD	2,029,763	USD	1,549,000	Citibank	18/9/2019	(18,349)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
CAD	14,721,944	USD	11,238,000	Royal Bank of Canada	18/9/2019	(136,134)
CAD	7,394,020	USD	5,657,000	Goldman Sachs	18/9/2019	(81,145)
CAD	4,390,152	USD	3,320,000	JP Morgan	18/9/2019	(9,372)
CAD	7,994,246	USD	6,076,000	RBS Plc	18/9/2019	(47,513)
CAD	27,601,230	USD	20,940,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(125,823)
CAD	12,865,478	USD	9,643,000	BNP Paribas	18/9/2019	58,898
CAD	7,291,430	USD	5,524,000	Deutsche Bank	18/9/2019	(25,508)
CAD	2,613,865	USD	1,990,000	UBS	18/9/2019	(18,876)
CAD	21,717,487	USD	16,598,000	Bank of America	18/9/2019	(220,773)
CAD	4,801,500	USD	3,592,188	Barclays	18/9/2019	28,639
CHF	2,510,401	CAD	3,320,000	Citibank	18/9/2019	41,621
CHF	5,833,737	CAD	7,746,000	JP Morgan	18/9/2019	73,421
CHF	15,800,000	EUR	14,559,931	State Street	18/9/2019	(82,783)
CHF	15,730,000	EUR	14,488,415	Deutsche Bank	18/9/2019	(74,664)
CHF	17,485,163	EUR	16,096,240	UBS	18/9/2019	(73,261)
CHF	17,653,979	EUR	16,169,092	Goldman Sachs	18/9/2019	17,329
CHF	2,903,611	EUR	2,656,000	JP Morgan	18/9/2019	6,596
CHF	9,716,581	EUR	8,852,000	Morgan Stanley	18/9/2019	61,863
CHF	13,278,000	JPY	1,459,968,012	Citibank	18/9/2019	(307,580)
CHF	5,140,052	NZD	7,746,000	Citibank	18/9/2019	314,934
CHF	1,616,986	USD	1,656,000	JP Morgan	18/9/2019	(16,571)
CHF	3,240,184	USD	3,314,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(28,845)
CHF	5,257,105	USD	5,400,000	UBS	18/9/2019	(69,930)
CHF	8,253,729	USD	8,410,000	Citibank	18/9/2019	(41,715)
CHF	1,893,407	USD	1,944,000	Goldman Sachs	18/9/2019	(24,314)
CHF	6,929,794	USD	7,082,000	BNP Paribas	18/9/2019	(56,026)
CHF	554,521	USD	568,000	Royal Bank of Canada	18/9/2019	(5,783)
CHF	6,867,832	USD	6,987,000	Deutsche Bank	18/9/2019	(23,848)
CHF	7,401,270	USD	7,524,000	Bank of America	18/9/2019	(20,006)
CNH	357,190,000	USD	50,477,622	Royal Bank of Canada	18/9/2019	(546,757)
CNH	419,040,000	USD	59,235,804	Citibank	18/9/2019	(659,054)
CNH	100,712,532	USD	14,634,642	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(556,242)
CNH	12,475,000	USD	1,814,941	BNP Paribas	18/9/2019	(71,086)
CNY	111,860,000	USD	16,345,437	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(677,441)
EUR	3,762,000	AUD	6,181,068	Deutsche Bank	18/9/2019	(5,949)
EUR	7,524,000	AUD	12,346,750	Morgan Stanley	18/9/2019	(1,527)
EUR	10,842,000	AUD	17,884,128	Toronto Dominion	18/9/2019	(64,618)
EUR	2,877,000	AUD	4,677,455	JP Morgan	18/9/2019	28,839
EUR	5,531,000	AUD	8,829,387	State Street	18/9/2019	165,293
EUR	3,320,000	CHF	3,662,299	Barclays	18/9/2019	(41,485)
EUR	2,656,000	CHF	2,896,079	RBS Plc	18/9/2019	1,042
EUR	8,852,000	CHF	9,749,062	Citibank	18/9/2019	(94,794)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
EUR	23,477,626	CHF	25,480,000	Credit Suisse	18/9/2019	130,662
EUR	34,540,832	CHF	37,520,000	UBS	18/9/2019	158,544
EUR	13,170,000	GBP	11,994,249	Citibank	18/9/2019	(95,823)
EUR	5,860,000	GBP	5,308,989	Morgan Stanley	18/9/2019	(8,584)
EUR	7,397,968	GBP	6,660,650	State Street	18/9/2019	40,127
EUR	638,561	GBP	570,816	Bank of America	18/9/2019	8,478
EUR	6,606,998	GBP	5,923,476	Goldman Sachs	18/9/2019	66,438
EUR	1,802,423	GBP	1,620,000	Standard Chartered Bank	18/9/2019	13,180
EUR	5,404,002	GBP	4,856,663	Deutsche Bank	18/9/2019	40,006
EUR	2,784,130	GBP	2,499,861	RBS Plc	18/9/2019	23,399
EUR	2,949,000	NOK	29,360,489	Toronto Dominion	18/9/2019	28,882
EUR	5,754,000	NZD	9,610,266	Morgan Stanley	18/9/2019	288,535
EUR	5,090,000	NZD	8,860,632	JP Morgan	18/9/2019	28,070
EUR	3,541,000	NZD	5,990,083	Citibank	18/9/2019	129,557
EUR	7,523,000	SEK	80,028,949	Citibank	18/9/2019	154,046
EUR	5,533,000	SEK	59,132,331	Morgan Stanley	18/9/2019	85,461
EUR	7,746,000	SEK	81,363,287	Royal Bank of Canada	18/9/2019	264,515
EUR	3,249,375	USD	3,693,006	Toronto Dominion	18/9/2019	(99,467)
EUR	20,000,000	USD	22,633,562	Goldman Sachs	18/9/2019	(515,222)
EUR	15,324,080	USD	17,348,285	Deutsche Bank	18/9/2019	(401,124)
EUR	49,203,010	USD	55,824,607	Barclays	18/9/2019	(1,410,162)
EUR	16,478,333	USD	18,766,088	JP Morgan	18/9/2019	(542,420)
EUR	71,388,000	USD	79,998,209	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(1,049,007)
EUR	31,822,989	USD	35,844,082	RBS Plc	18/9/2019	(650,497)
EUR	20,919,311	USD	23,357,361	State Street	18/9/2019	(222,340)
EUR	8,046,792	USD	9,030,013	UBS	18/9/2019	(130,929)
EUR	206,869,878	USD	232,463,869	Citibank	18/9/2019	(3,682,953)
EUR	132,115,709	USD	149,638,257	Bank of America	18/9/2019	(3,529,250)
EUR	12,649,065	USD	14,301,840	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(313,024)
EUR	18,725,000	USD	20,916,739	Morgan Stanley	18/9/2019	(208,444)
EUR	5,540,000	USD	6,305,107	BNP Paribas	18/9/2019	(178,327)
GBP	2,600,000	EUR	2,896,753	Barclays	18/9/2019	(25,550)
GBP	5,200,000	EUR	5,840,367	Goldman Sachs	18/9/2019	(102,923)
GBP	10,360,000	EUR	11,626,941	RBS Plc	18/9/2019	(195,249)
GBP	2,709,043	USD	3,314,000	JP Morgan	18/9/2019	(2,696)
GBP	4,111,609	USD	4,978,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	47,682
GBP	1,656,000	USD	2,074,985	Bank of America	18/9/2019	(50,831)
GBP	1,910,000	USD	2,405,486	RBS Plc	18/9/2019	(70,865)
GBP	680,000	USD	864,308	Nomura	18/9/2019	(33,134)
GBP	1,656,000	USD	2,100,021	Morgan Stanley	18/9/2019	(75,868)
GBP	2,600,000	USD	3,295,838	Deutsche Bank	18/9/2019	(117,819)
IDR	14,056,482,000	USD	979,000	JP Morgan	18/9/2019	10,513
IDR	128,231,430,000	USD	9,087,982	BNY Mellon	18/9/2019	(61,062)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
IDR	45,520,000,000	USD	3,242,599	Deutsche Bank	18/9/2019	(38,194)
IDR	9,313,800,000	USD	651,588	Citibank	18/9/2019	4,062
IDR	14,169,833,800	USD	990,216	UBS	18/9/2019	7,277
IDR	9,313,800,000	USD	650,314	Bank of America	18/9/2019	5,336
IDR	423,065,705,000	USD	29,206,398	BNP Paribas	18/9/2019	575,538
INR	333,890,710	USD	4,802,927	Deutsche Bank	18/9/2019	(144,364)
INR	80,569,446	USD	1,167,000	JP Morgan	18/9/2019	(42,866)
INR	72,670,000	USD	1,053,570	BNP Paribas	18/9/2019	(39,652)
INR	1,900,404,000	USD	27,506,209	ANZ	18/9/2019	(991,088)
JPY	167,498,859	AUD	2,211,000	JP Morgan	18/9/2019	89,440
JPY	489,431,727	CHF	4,426,000	Citibank	18/9/2019	128,706
JPY	970,175,632	CHF	8,852,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	175,472
JPY	1,140,827,212	USD	10,628,763	Standard Chartered Bank	18/9/2019	131,090
JPY	893,855,503	USD	8,410,000	State Street	18/9/2019	20,510
JPY	1,092,290,793	USD	10,297,302	UBS	18/9/2019	4,774
JPY	114,413,688	USD	1,080,000	Toronto Dominion	18/9/2019	(893)
JPY	6,069,055,964	USD	56,901,872	Bank of America	18/9/2019	339,183
JPY	17,623,392,250	USD	164,362,374	Citibank	18/9/2019	1,854,836
JPY	310,322,925	USD	2,923,000	Royal Bank of Canada	18/9/2019	3,849
JPY	4,089,331,200	USD	38,451,154	HSBC Bank Plc	18/9/2019	117,880
JPY	717,603,905	USD	6,641,000	Morgan Stanley	18/9/2019	127,170
JPY	1,313,987,926	USD	12,172,000	JP Morgan	18/9/2019	221,040
JPY	305,260,000	USD	2,847,906	RBS Plc	18/9/2019	31,192
KRW	6,047,039,430	USD	5,101,000	BNP Paribas	18/9/2019	(100,330)
KRW	3,901,862,925	USD	3,299,827	JP Morgan	18/9/2019	(73,136)
KRW	4,287,303,490	USD	3,647,500	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(102,064)
KRW	3,608,210,000	USD	3,085,942	Bank of America	18/9/2019	(102,090)
KRW	3,439,175,000	USD	2,924,704	Deutsche Bank	18/9/2019	(80,637)
KRW	1,258,395,000	USD	1,076,195	Goldman Sachs	18/9/2019	(35,551)
MXN	100,617,741	USD	4,981,000	State Street	18/9/2019	17,444
MXN	24,272,101	USD	1,213,500	Morgan Stanley	18/9/2019	(7,721)
MXN	24,213,302	USD	1,213,500	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(10,642)
MXN	52,649,436	USD	2,656,000	Deutsche Bank	18/9/2019	(40,504)
MXN	86,528,763	USD	4,381,000	UBS	18/9/2019	(82,462)
MXN	55,422,667	USD	2,888,000	Bank of America	18/9/2019	(134,737)
MXN	24,551,143	USD	1,231,000	Goldman Sachs	18/9/2019	(11,359)
MXN	1,132,302,080	USD	58,240,000	JP Morgan	18/9/2019	(1,989,990)
NOK	60,444,607	CAD	8,852,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(20,622)
NOK	146,315,656	CAD	21,575,000	JP Morgan	18/9/2019	(161,034)
NOK	29,387,855	EUR	2,949,000	Deutsche Bank	18/9/2019	(25,869)
NOK	48,688,000	SEK	52,167,975	BNP Paribas	18/9/2019	37,377
NOK	79,671,000	SEK	85,867,891	Citibank	18/9/2019	9,900
NOK	44,580,187	USD	4,952,000	Deutsche Bank	18/9/2019	(43,906)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
NOK	49,756,609	USD	5,533,000	Bank of America	18/9/2019	(55,004)
NOK	27,723,899	USD	3,098,000	Barclays	18/9/2019	(45,714)
NOK	27,477,547	USD	3,222,000	JP Morgan	18/9/2019	(196,837)
NZD	17,311,325	AUD	16,598,000	Citibank	18/9/2019	(245,082)
NZD	19,917,000	CAD	17,213,254	JP Morgan	18/9/2019	(390,492)
NZD	11,065,000	CAD	9,627,225	Morgan Stanley	18/9/2019	(265,433)
NZD	7,746,000	CHF	5,130,369	Citibank	18/9/2019	(305,117)
NZD	8,822,120	EUR	5,090,000	Toronto Dominion	18/9/2019	(52,414)
NZD	15,505,772	EUR	9,295,000	Goldman Sachs	18/9/2019	(477,877)
NZD	10,978,000	SEK	67,260,878	Bank of America	18/9/2019	76,518
NZD	8,243,500	USD	5,226,994	JP Morgan	18/9/2019	(16,053)
NZD	6,171,310	USD	3,949,014	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(47,960)
NZD	2,582,902	USD	1,657,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(24,277)
NZD	3,776,934	USD	2,434,000	Toronto Dominion	18/9/2019	(46,497)
NZD	21,024,000	USD	14,176,515	Morgan Stanley	18/9/2019	(886,671)
NZD	495,000	USD	326,884	Citibank	18/9/2019	(13,981)
PHP	116,300,000	USD	2,275,533	Goldman Sachs	18/9/2019	(42,800)
PHP	28,102,500	USD	547,327	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(7,814)
PHP	28,095,000	USD	542,113	UBS	18/9/2019	(2,744)
PHP	28,102,500	USD	542,519	BNP Paribas	18/9/2019	(3,006)
RUB	66,398,427	USD	1,026,205	Bank of America	18/9/2019	(29,131)
RUB	6,223,941	USD	98,000	Citibank	18/9/2019	(4,538)
RUB	386,442,780	USD	6,059,614	Goldman Sachs	18/9/2019	(256,582)
RUB	38,522,033	USD	602,798	Deutsche Bank	18/9/2019	(24,330)
SEK	80,006,669	EUR	7,523,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(156,319)
SEK	58,402,752	EUR	5,533,000	Bank of America	18/9/2019	(159,903)
SEK	24,943,055	EUR	2,360,686	JP Morgan	18/9/2019	(65,654)
SEK	56,800,014	EUR	5,385,314	Citibank	18/9/2019	(160,111)
SEK	137,652,478	NOK	128,359,000	JP Morgan	18/9/2019	(86,395)
SEK	67,597,035	NZD	10,978,000	Bank of America	18/9/2019	(42,218)
SEK	28,801	USD	3,000	Citibank	18/9/2019	(61)
SEK	52,277,654	USD	5,535,000	Morgan Stanley	18/9/2019	(200,841)
SEK	6,180,093	USD	663,000	UBS	18/9/2019	(32,413)
SEK	37,233,866	USD	3,984,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(184,836)
SEK	61,025,524	USD	6,581,000	Bank of America	18/9/2019	(354,250)
SEK	12,400,228	USD	1,317,000	RBS Plc	18/9/2019	(51,740)
SGD	12,630,000	USD	9,107,835	UBS	18/9/2019	1,456
SGD	2,560,000	USD	1,843,185	Goldman Sachs	18/9/2019	3,195
SGD	4,008,388	USD	2,888,000	BNP Paribas	18/9/2019	3,020
TRY	5,946,804	USD	980,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	34,237
TRY	771,206	USD	124,000	Citibank	18/9/2019	7,531
TWD	117,217,504	USD	3,753,425	Deutsche Bank	18/9/2019	(10,518)
TWD	67,600,000	USD	2,184,327	JP Morgan	18/9/2019	(25,771)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
TWD	13,400,000	USD	434,670	Citibank	18/9/2019	(6,790)
TWD	13,400,000	USD	434,924	Bank of America	18/9/2019	(7,044)
USD	3,339,500	ARS	215,564,725	Citibank	18/9/2019	(105,854)
USD	7,173,133	AUD	10,598,000	Goldman Sachs	18/9/2019	29,449
USD	20,340,000	AUD	30,164,302	Bank of America	18/9/2019	7,461
USD	6,033,107	AUD	8,728,549	Standard Chartered Bank	18/9/2019	149,544
USD	3,000,200	AUD	4,426,000	Morgan Stanley	18/9/2019	16,812
USD	118,471	AUD	175,000	UBS	18/9/2019	511
USD	9,663,841	AUD	13,792,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	367,211
USD	3,620,518	AUD	5,201,000	RBS Plc	18/9/2019	114,733
USD	6,049,367	AUD	8,782,000	Citibank	18/9/2019	129,775
USD	2,888,000	BRL	11,953,432	Goldman Sachs	18/9/2019	7,515
USD	1,956,000	BRL	7,700,224	Standard Chartered Bank	18/9/2019	100,434
USD	9,760,000	BRL	40,558,656	Morgan Stanley	18/9/2019	(13,645)
USD	4,880,000	BRL	20,387,640	UBS	18/9/2019	(32,923)
USD	20,165,000	CAD	26,685,636	Bank of America	18/9/2019	41,275
USD	25,873,000	CAD	34,249,580	Morgan Stanley	18/9/2019	45,279
USD	14,976,000	CAD	19,605,681	JP Morgan	18/9/2019	191,292
USD	2,215,000	CAD	2,949,384	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(9,140)
USD	19,575,000	CAD	25,678,706	Citibank	18/9/2019	210,603
USD	3,311,000	CAD	4,402,875	RBS Plc	18/9/2019	(9,222)
USD	5,533,000	CAD	7,303,754	Barclays	18/9/2019	25,216
USD	1,770,000	CAD	2,325,184	BNP Paribas	18/9/2019	16,572
USD	9,708,164	CAD	12,699,010	Royal Bank of Canada	18/9/2019	131,799
USD	6,715,000	CAD	8,854,735	Deutsche Bank	18/9/2019	37,616
USD	3,320,000	CHF	3,272,192	Citibank	18/9/2019	2,392
USD	12,740,000	CHF	12,473,538	Deutsche Bank	18/9/2019	93,339
USD	6,987,000	CHF	6,864,221	Bank of America	18/9/2019	27,509
USD	16,369,000	CHF	16,026,219	Morgan Stanley	18/9/2019	120,349
USD	6,914,000	CHF	6,732,514	JP Morgan	18/9/2019	88,044
USD	22,955,245	CNH	160,532,228	Citibank	18/9/2019	514,770
USD	106,037,334	CNH	733,540,000	Bank of America	18/9/2019	3,497,267
USD	15,133,949	CNH	106,761,993	Royal Bank of Canada	18/9/2019	209,907
USD	4,538,677	CNH	31,960,000	RBS Plc	18/9/2019	71,053
USD	3,890,294	CNH	27,525,000	BNP Paribas	18/9/2019	42,631
USD	1,756,000	CNH	12,187,341	HSBC Bank Plc	18/9/2019	52,356
USD	16,102,269	CNY	111,860,000	Citibank	18/9/2019	434,273
USD	14,883,001	EUR	13,085,188	Goldman Sachs	18/9/2019	411,869
USD	208,113,863	EUR	182,540,565	Standard Chartered Bank	18/9/2019	6,239,150
USD	22,023,850	EUR	19,409,616	HSBC Bank Plc	18/9/2019	558,426
USD	19,586,560	EUR	17,379,885	JP Morgan	18/9/2019	365,851
USD	749,808	EUR	674,000	Royal Bank of Canada	18/9/2019	4,420

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
USD	74,475,468	EUR	66,062,066	Deutsche Bank	18/9/2019	1,416,306
USD	12,215,701	EUR	10,928,692	Toronto Dominion	18/9/2019	129,475
USD	17,164,311	EUR	15,445,212	UBS	18/9/2019	83,189
USD	45,322,168	EUR	40,749,000	Morgan Stanley	18/9/2019	257,157
USD	129,707,944	EUR	114,853,570	RBS Plc	18/9/2019	2,689,430
USD	129,144,875	EUR	115,802,497	Bank of America	18/9/2019	1,076,925
USD	174,953,621	EUR	155,407,784	Citibank	18/9/2019	3,085,513
USD	24,353,607	GBP	19,958,615	Deutsche Bank	18/9/2019	(42,108)
USD	1,658,000	GBP	1,349,544	JP Morgan	18/9/2019	8,433
USD	3,320,000	GBP	2,727,166	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(13,456)
USD	3,334,368	GBP	2,600,000	Citibank	18/9/2019	156,349
USD	48,434,037	IDR	696,328,062,344	BNP Paribas	18/9/2019	(584,349)
USD	6,875,532	IDR	96,945,000,000	JP Morgan	18/9/2019	51,037
USD	9,285,307	INR	662,970,800	HSBC Bank Plc	18/9/2019	35,299
USD	125,191,977	INR	8,788,789,786	BNP Paribas	18/9/2019	2,567,617
USD	6,855,594	INR	493,054,338	Morgan Stanley	18/9/2019	(23,677)
USD	9,978,157	INR	713,520,851	Bank of America	18/9/2019	22,857
USD	8,801,486	INR	633,927,006	BNY Mellon	18/9/2019	(43,292)
USD	4,647,690	INR	334,550,000	JP Morgan	18/9/2019	(20,072)
USD	8,802,097	INR	633,927,005	UBS	18/9/2019	(42,681)
USD	1,491,124	INR	107,100,000	Barclays	18/9/2019	(3,174)
USD	82,837,000	JPY	8,801,347,270	Bank of America	18/9/2019	(173,999)
USD	18,120,128	JPY	1,923,268,774	RBS Plc	18/9/2019	(19,420)
USD	2,929,000	JPY	309,377,382	Deutsche Bank	18/9/2019	11,069
USD	76,357,493	JPY	8,146,580,484	Citibank	18/9/2019	(477,992)
USD	10,622,667	JPY	1,143,527,109	Morgan Stanley	18/9/2019	(162,651)
USD	28,761,087	JPY	3,063,459,043	JP Morgan	18/9/2019	(132,309)
USD	5,374,000	JPY	568,544,420	Standard Chartered Bank	18/9/2019	11,703
USD	12,835,936	JPY	1,357,470,816	Goldman Sachs	18/9/2019	32,781
USD	2,907	JPY	308,003	Barclays	18/9/2019	2
USD	9,484,000	KRW	11,305,037,990	HSBC Bank Plc	18/9/2019	135,166
USD	6,786,036	KRW	8,000,000,000	UBS	18/9/2019	170,343
USD	2,434,000	KRW	2,853,986,700	JP Morgan	18/9/2019	73,862
USD	2,427,000	KRW	2,952,858,090	Deutsche Bank	18/9/2019	(14,901)
USD	1,493,276	KRW	1,810,000,000	Barclays	18/9/2019	(3,525)
USD	3,913,000	KRW	4,745,686,400	BNP Paribas	18/9/2019	(11,501)
USD	5,960,000	MXN	119,643,575	Royal Bank of Canada	18/9/2019	16,398
USD	5,567,000	MXN	111,597,316	Morgan Stanley	18/9/2019	23,117
USD	442,000	MXN	8,880,918	RBS Plc	18/9/2019	818
USD	9,760,000	MXN	195,597,281	Bank of America	18/9/2019	43,203
USD	1,660,000	MXN	32,978,294	Deutsche Bank	18/9/2019	21,719
USD	4,426,000	MXN	87,386,395	Barclays	18/9/2019	84,857
USD	6,808,000	MXN	132,146,003	HSBC Bank Plc	18/9/2019	243,308

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
USD	7,586,000	MXN	146,961,302	Citibank	18/9/2019	285,320
USD	1,550,000	NOK	13,943,501	Deutsche Bank	18/9/2019	14,879
USD	3,098,000	NOK	26,248,580	RBS Plc	18/9/2019	208,141
USD	1,548,000	NOK	13,922,193	JP Morgan	18/9/2019	15,224
USD	1,650,000	NOK	14,767,881	Bank of America	18/9/2019	24,118
USD	124,000	NOK	1,115,414	Citibank	18/9/2019	1,198
USD	5,400,000	NOK	48,518,312	Morgan Stanley	18/9/2019	58,336
USD	1,657,000	NZD	2,588,448	Standard Chartered Bank	18/9/2019	20,772
USD	5,436,408	NZD	8,206,812	Morgan Stanley	18/9/2019	248,658
USD	3,758,595	NZD	5,533,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	261,034
USD	7,460,993	NZD	11,065,000	Citibank	18/9/2019	466,505
USD	2,888,000	RUB	192,369,391	Standard Chartered Bank	18/9/2019	(722)
USD	1,124,000	RUB	73,397,211	BNP Paribas	18/9/2019	21,828
USD	4,902,355	RUB	312,356,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	211,849
USD	19,981,685	RUB	1,309,230,000	Barclays	18/9/2019	321,584
USD	4,647,000	SEK	43,830,504	RBS Plc	18/9/2019	174,747
USD	5,533,000	SEK	52,360,893	Morgan Stanley	18/9/2019	190,347
USD	4,426,000	SEK	40,682,907	Bank of America	18/9/2019	274,912
USD	3,499,000	SEK	32,703,435	Citibank	18/9/2019	162,099
USD	2,000	SEK	19,186	State Street	18/9/2019	42
USD	8,584,374	SGD	11,860,000	Goldman Sachs	18/9/2019	30,439
USD	72,722,826	SGD	98,795,000	Bank of America	18/9/2019	1,467,682
USD	24,694,683	SGD	33,569,037	Citibank	18/9/2019	483,269
USD	11,275,097	SGD	15,352,433	UBS	18/9/2019	202,271
USD	900,701	SGD	1,220,000	Deutsche Bank	18/9/2019	20,786
USD	124,000	TRY	729,797	UBS	18/9/2019	(468)
USD	2,888,000	TWD	89,403,955	BNP Paribas	18/9/2019	33,215
USD	3,913,000	TWD	123,024,720	Deutsche Bank	18/9/2019	(15,339)
USD	4,945,194	ZAR	73,042,681	Deutsche Bank	18/9/2019	162,600
USD	12,957,962	ZAR	190,738,094	Bank of America	18/9/2019	469,060
USD	1,770,000	ZAR	27,253,566	UBS	18/9/2019	(14,474)
USD	4,009,951	ZAR	59,740,000	Goldman Sachs	18/9/2019	98,373
USD	3,320,000	ZAR	49,338,188	BNP Paribas	18/9/2019	89,498
USD	12,302,777	ZAR	176,270,747	Citibank	18/9/2019	761,149
USD	2,028,086	ZAR	28,420,000	RBS Plc	18/9/2019	167,238
ZAR	78,590,000	USD	5,111,106	Royal Bank of Canada	18/9/2019	34,707
ZAR	128,751,688	USD	8,853,000	Barclays	18/9/2019	(422,764)
ZAR	29,410,000	USD	2,056,372	BNP Paribas	18/9/2019	(130,702)
ZAR	215,530,000	USD	15,025,587	JP Morgan	18/9/2019	(913,393)
ZAR	40,490,574	USD	2,888,000	UBS	18/9/2019	(236,811)
ZAR	53,791,989	USD	3,558,500	Citibank	18/9/2019	(36,378)
ZAR	18,573,239	USD	1,213,500	Morgan Stanley	18/9/2019	2,614

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
ZAR	31,597,767	USD	2,213,000	Bank of America	18/9/2019	(144,082)
ZAR	3,775,580	USD	252,000	HSBC Bank Plc	18/9/2019	(4,787)
USD	7,748,000	JPY	837,597,540	Citibank	19/9/2019	(152,494)
ARS	59,231,000	USD	971,000	Citibank	20/9/2019	(31,954)
CNH	27,660,000	USD	3,893,252	Bank of America	20/9/2019	(26,979)
IDR	115,030,811,075	USD	8,049,742	Nomura	20/9/2019	46,384
IDR	235,043,657,511	USD	16,435,742	Bank of America	20/9/2019	107,156
IDR	78,335,334,766	USD	5,589,056	JP Morgan	20/9/2019	(75,640)
IDR	65,208,975,000	USD	4,656,776	UBS	20/9/2019	(67,223)
IDR	96,320,000,000	USD	6,868,716	HSBC Bank Plc	20/9/2019	(89,499)
IDR	20,678,007,548	USD	1,451,903	Barclays	20/9/2019	3,461
IDR	78,262,265,902	USD	5,414,200	Morgan Stanley	20/9/2019	94,073
INR	114,700,000	USD	1,606,195	JP Morgan	20/9/2019	(6,652)
INR	973,757,124	USD	13,790,861	HSBC Bank Plc	20/9/2019	(211,377)
JPY	1,238,501,720	USD	11,734,737	Bank of America	20/9/2019	(51,912)
MYR	24,523,453	USD	5,868,900	Barclays	20/9/2019	(49,025)
MYR	60,400,000	USD	14,459,507	UBS	20/9/2019	(125,455)
MYR	47,836,571	USD	11,457,354	Goldman Sachs	20/9/2019	(104,840)
PHP	3,600,000	USD	68,782	BNP Paribas	20/9/2019	325
PHP	187,300,000	USD	3,656,204	JP Morgan	20/9/2019	(60,696)
USD	971,000	ARS	63,843,250	JP Morgan	20/9/2019	(41,169)
USD	53,286,305	CNH	371,200,051	Bank of America	20/9/2019	1,400,518
USD	34,882,949	CNH	240,670,000	JP Morgan	20/9/2019	1,242,458
USD	29,625,668	CNH	203,711,446	HSBC Bank Plc	20/9/2019	1,151,188
USD	2,937,270	CNH	20,227,251	Goldman Sachs	20/9/2019	109,935
USD	33,468,488	CNH	231,063,573	UBS	20/9/2019	1,170,768
USD	30,760,864	CNH	211,813,587	Citibank	20/9/2019	1,153,879
USD	4,972,417	EUR	4,378,503	Barclays	20/9/2019	129,404
USD	7,847,544	HKD	61,460,000	Bank of America	20/9/2019	7,664
USD	7,845,985	HKD	61,456,034	HSBC Bank Plc	20/9/2019	6,612
USD	8,473,744	IDR	121,271,980,409	Bank of America	20/9/2019	(61,650)
USD	25,827,147	IDR	368,692,590,732	Citibank	20/9/2019	(122,262)
USD	45,031,287	IDR	643,543,072,690	BNP Paribas	20/9/2019	(262,713)
USD	6,868,716	IDR	96,320,000,000	HSBC Bank Plc	20/9/2019	89,499
USD	4,822,668	INR	338,888,888	RBS Plc	20/9/2019	96,709
USD	6,863,381	INR	478,034,477	HSBC Bank Plc	20/9/2019	196,974
USD	4,640,224	INR	323,469,996	JP Morgan	20/9/2019	129,288
USD	18,444,124	INR	1,302,002,983	Bank of America	20/9/2019	287,103
USD	4,038,733	INR	281,196,751	Nomura	20/9/2019	117,317
USD	8,897,415	INR	617,938,613	Citibank	20/9/2019	279,982
USD	30,608,923	JPY	3,295,341,368	Bank of America	20/9/2019	(476,134)
USD	1,376,089	KRW	1,619,932,156	Bank of America	20/9/2019	36,172
USD	12,128,740	MYR	50,255,747	Goldman Sachs	20/9/2019	202,110

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
USD	26,219,461	MYR	108,883,046	UBS	20/9/2019	379,474
USD	7,089,989	MYR	29,749,592	Barclays	20/9/2019	29,853
USD	13,355,998	MYR	55,000,000	Morgan Stanley	20/9/2019	303,467
USD	8,114,798	SGD	11,209,043	BNP Paribas	20/9/2019	30,173
USD	12,626,519	SGD	17,448,712	Bank of America	20/9/2019	41,477
USD	2,185,594	TWD	68,575,206	Goldman Sachs	20/9/2019	(4,964)
USD	1,950,000	ZAR	29,913,975	Bank of America	20/9/2019	(8,152)
ZAR	29,734,770	USD	1,950,000	BNP Paribas	20/9/2019	(3,579)
USD	971,000	ARS	59,231,000	Morgan Stanley	23/9/2019	43,413
IDR	139,267,700,000	USD	9,739,000	Bank of America	25/9/2019	58,340
MXN	58,880,323	USD	2,928,000	Citibank	25/9/2019	(6,527)
MXN	192,997,763	USD	9,739,000	Deutsche Bank	25/9/2019	(163,004)
MXN	111,937,000	USD	5,661,671	UBS	25/9/2019	(107,677)
USD	54,037,454	MXN	1,068,361,422	Citibank	25/9/2019	1,028,418
USD	1,953,000	MXN	39,045,382	HSBC Bank Plc	25/9/2019	15,680
USD	60,004,971	MXN	1,184,228,111	Royal Bank of Canada	25/9/2019	1,246,963
EUR	3,531,000	USD	3,926,128	BNP Paribas	26/9/2019	(18,709)
COP	10,650,600,000	USD	3,050,000	RBS Plc	27/9/2019	65,738
USD	3,050,000	COP	10,415,750,000	UBS	27/9/2019	2,965
USD	3,912,000	ZAR	59,892,368	Deutsche Bank	30/9/2019	(3,348)
USD	4,883,000	ZAR	71,335,747	Bank of America	30/9/2019	219,563
ZAR	70,601,820	USD	4,890,000	BNP Paribas	30/9/2019	(274,542)
ZAR	51,505,561	USD	3,575,000	Bank of America	30/9/2019	(207,923)
ZAR	4,864,703	USD	337,000	Morgan Stanley	30/9/2019	(18,979)
USD	12,702,000	BRL	52,931,774	BNP Paribas	2/10/2019	(39,543)
USD	1,328,000	BRL	5,521,691	Citibank	2/10/2019	(1,161)
USD	1,950,000	BRL	8,123,505	Morgan Stanley	2/10/2019	(5,460)
USD	216,555,749	GBP	177,399,000	Bank of America	3/10/2019	(426,290)
USD	91,799,683	JPY	9,745,973,000	Bank of America	3/10/2019	(223,624)
ARS	94,329,900	USD	1,953,000	BNP Paribas	7/10/2019	(553,628)
USD	1,463,000	ARS	72,857,400	Citibank	7/10/2019	382,170
USD	2,725,000	INR	195,791,250	HSBC Bank Plc	7/10/2019	4,907
ARS	108,953,000	USD	2,210,000	JP Morgan	15/10/2019	(633,011)
USD	885,000	ARS	61,065,000	BNP Paribas	15/10/2019	1,144
USD	2,655,000	ARS	184,080,000	Goldman Sachs	15/10/2019	(9,379)
CNH	164,570,524	USD	23,984,633	HSBC Bank Plc	18/10/2019	(1,000,222)
USD	9,987,222	CNH	69,170,000	Bank of America	18/10/2019	326,733
USD	14,184,581	CNH	95,400,524	JP Morgan	18/10/2019	860,659
CLP	1,882,990,060	USD	2,600,815	JP Morgan	23/10/2019	20,225
CLP	949,229,033	USD	1,310,185	UBS	23/10/2019	11,100
COP	9,948,002,750	USD	2,933,000	UBS	23/10/2019	(26,774)
COP	16,662,735,000	USD	4,885,000	Barclays	23/10/2019	(17,121)

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
USD	3,911,000	CLP	2,780,329,900	Citibank	23/10/2019	40,902
USD	3,900,000	COP	13,501,800,000	Morgan Stanley	23/10/2019	(44,438)
USD	3,911,000	COP	13,254,379,000	RBS Plc	23/10/2019	38,844
USD	10,909,031	ZAR	168,639,544	HSBC Bank Plc	23/10/2019	(82,311)
USD	3,911,000	TWD	122,218,750	BNP Paribas	30/10/2019	(9,455)
USD	4,848,250	AUD	7,200,000	Goldman Sachs	31/10/2019	(11,238)
USD	1,340,000	ARS	99,319,500	BNP Paribas	4/11/2019	(10,625)
RUB	643,720,800	USD	9,760,000	JP Morgan	6/11/2019	(159,816)
USD	7,344,088	IDR	105,806,277,447	Goldman Sachs	6/11/2019	(51,821)
USD	28,425,530	IDR	408,815,971,450	Bank of America	6/11/2019	(150,902)
USD	14,660,000	IDR	216,601,500,000	JP Morgan	6/11/2019	(480,549)
USD	22,566,473	IDR	327,527,846,922	Citibank	6/11/2019	(327,880)
USD	14,660,000	MXN	292,669,308	Citibank	6/11/2019	241,899
USD	45,616,145	RUB	3,007,860,149	Morgan Stanley	6/11/2019	758,172
USD	9,767,000	RUB	635,929,370	Bank of America	6/11/2019	283,014
ARS	113,557,250	USD	2,210,000	HSBC Bank Plc	13/11/2019	(697,713)
RUB	118,273,170	USD	1,770,000	Bank of America	21/11/2019	(9,358)
USD	1,770,000	RUB	119,368,800	Deutsche Bank	21/11/2019	(6,952)
USD	895,000	ARS	66,453,750	Morgan Stanley	29/11/2019	43,282
USD	895,000	ARS	62,873,750	Goldman Sachs	29/11/2019	89,165
EUR	31,760,000	USD	38,858,995	JP Morgan	13/12/2019	(3,506,982)
USD	41,192,720	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	13/12/2019	5,840,707
USD	1,829,008	EUR	1,600,000	RBS Plc	15/1/2020	43,566
EUR	3,200,000	USD	3,622,179	RBS Plc	17/1/2020	(50,751)
USD	1,828,045	EUR	1,600,000	Royal Bank of Canada	17/1/2020	42,331
USD	1,966,000	ARS	178,906,000	BNP Paribas	12/2/2020	17,313
EUR	31,760,000	USD	39,139,277	JP Morgan	25/2/2020	(3,587,361)
USD	41,459,504	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	25/2/2020	5,907,588
JPY	4,230,950,000	USD	39,204,503	JP Morgan	16/3/2020	1,208,882
USD	42,233,480	JPY	4,230,950,000	HSBC Bank Plc	16/3/2020	1,820,095
未実現純評価益						<u>27,375,997</u>
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	117,727,432	USD	80,237,995	BNY Mellon	12/9/2019	(897,247)
USD	299,331	AUD	442,820	BNY Mellon	12/9/2019	899
未実現純評価損						<u>(896,348)</u>
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,487,222,407	USD	1,125,273,466	BNY Mellon	12/9/2019	(3,863,125)
未実現純評価損						<u>(3,863,125)</u>

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	237,563,662	USD	244,744,836	BNY Mellon	12/9/2019	(4,014,156)
USD	3,126,716	CHF	3,056,478	BNY Mellon	12/9/2019	29,510
未実現純評価損						(3,984,646)
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,548,065	USD	641,752	BNY Mellon	12/9/2019	(5,860)
未実現純評価損						(5,860)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,670,276,318	USD	1,875,561,146	BNY Mellon	12/9/2019	(29,213,874)
USD	20,656,804	EUR	18,563,603	BNY Mellon	12/9/2019	136,465
未実現純評価損						(29,077,409)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,152,051,145	USD	1,394,631,141	BNY Mellon	12/9/2019	13,156,897
USD	45,643,669	GBP	37,663,923	BNY Mellon	12/9/2019	(381,062)
未実現純評価益						12,775,835
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	5,897,424	USD	752,672	BNY Mellon	12/9/2019	(413)
未実現純評価損						(413)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	46,373,256,652	USD	439,361,490	BNY Mellon	12/9/2019	(2,180,692)
USD	236,799	JPY	25,000,002	BNY Mellon	12/9/2019	1,113
未実現純評価損						(2,179,579)
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	152,542,808	USD	39,596,801	BNY Mellon	12/9/2019	(1,169,603)
USD	503,441	PLN	1,959,944	BNY Mellon	12/9/2019	9,710
未実現純評価損						(1,159,893)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,224,415,735	USD	128,222,921	BNY Mellon	12/9/2019	(3,338,653)
USD	280,254	SEK	2,711,300	BNY Mellon	12/9/2019	3,717
未実現純評価損						(3,334,936)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	116,499,382	USD	84,314,898	BNY Mellon	12/9/2019	(296,421)
USD	68,226	SGD	94,529	BNY Mellon	12/9/2019	53
未実現純評価損						(296,368)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 13,641,353,586米ドル)						(4,646,745)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2019年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエク スポンジャー (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(276)	AUD	Australian 10 Year Bond	2019年9月	27,634,121	(91,031)
869	EUR	Euro Schatz	2019年9月	108,072,997	26,436
376	EUR	Euro-OAT	2019年9月	70,774,094	391,017
299	EUR	EURO STOXX 600 Bank Index	2019年9月	2,004,827	(185,197)
254	EUR	Euro-BTP	2019年9月	40,781,729	1,116,026
23	EUR	EURO STOXX 600 Bank Index	2019年9月	103,023	(5,589)
(16)	EUR	Dax Index	2019年9月	5,281,237	(114,011)
(128)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2019年9月	4,854,010	(158,989)
(150)	EUR	Euro Bund	2019年9月	29,677,546	(118,554)
(253)	EUR	Euro BUXL	2019年9月	62,635,135	(2,087,601)
(885)	EUR	Short-Term Euro-BPT	2019年9月	110,419,656	(315,384)
(1,014)	EUR	Euro BOBL	2019年9月	152,556,933	(564,533)
(11)	GBP	FTSE 250 Index	2019年9月	521,068	(10,400)
(63)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2019年9月	92,062,062	(985,256)
84	KRW	Korean 3 Year Bond	2019年9月	7,704,074	37,449
43	KRW	Korean 10 Year Bond	2019年9月	4,778,369	103,307
247	USD	MSCI Emerging Markets Index	2019年9月	12,140,050	(869,427)
(1,175)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2019年9月	172,460,625	(358,605)
213	CAD	Canadian 10 Year Bond	2019年12月	23,326,549	(46,509)
(50)	GBP	Long Gilt	2019年12月	8,218,252	8,587
12,660	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2019年12月	2,734,164,375	(822,785)
6,887	USD	US Ultra 10 Year Note	2019年12月	993,234,531	(207,784)
1,098	USD	90 Day Euro \$	2019年12月	269,366,850	(115,627)
6	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2019年12月	718,875	(938)
(90)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2019年12月	17,730,000	(62,158)
(2,611)	USD	US Long Bond (CBT)	2019年12月	431,059,781	(1,094,376)
(3,856)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2019年12月	507,244,750	378,213
1,093	USD	90 Day Euro \$	2020年12月	269,738,738	2,739,350
(1,093)	USD	90 Day Euro \$	2021年3月	269,998,325	(3,828,037)
合計				6,429,262,582	(7,242,406)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2019年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	288,985	79,005
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(145,067)	(92,622)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(20,901)	(27,576)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(34,046)	(44,122)
CDS	EUR (50,871,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2022	341,153	1,220,622
CDS	EUR (9,250)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(621)	(2,079)
CDS	USD 23,203,200	ファンドはCDX.NA.HY.30.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	(514,137)	(1,739,568)
CDS	EUR (107,914)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(7,240)	(24,251)
CDS	USD 356,290,175	ファンドはCDX.NA.IG.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(1,951,722)	(7,920,782)
CDS	USD 19,713,600	ファンドはCDX.NA.HY.31.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(449,079)	(1,521,760)
CDS	EUR (79,994)	ファンドはTelecom Italia Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	(34)	(2,746)
CDS	EUR 100,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	426	(23,296)
CDS	USD 3,830,169	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	(17,024)	(12,250)
CDS	EUR (958,600)	ファンドはITRAXX.EUR.31.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	1,969	26,763
CDS	EUR 5,360,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	(40,431)	89,006
CDS	EUR 20,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	85	(4,659)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 260,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	1,107	(60,569)
CDS	EUR (620,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	10,015	(21,285)
CDS	EUR (424,968)	ファンドはUnited Rentals Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	(181)	(14,590)
CDS	EUR (31,260,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.31.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	217,101	662,115
CDS	EUR (6,780,000)	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	346,680	(428,837)
CDS	EUR 300,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	1,926	36,212
CDS	EUR (7,499)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	(3)	(257)
CDS	USD (185,754,761)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	394,773	12,767,027
CDS	USD 411,224,500	ファンドはCDX.NA.IG.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	(893,656)	(8,856,422)
CDS	USD 1,980,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	(6,355)	(72,858)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	52,985	28,493
CDS	JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(9,114)	(8,311)
CDS	JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(11,202)	(16,259)
CDS	USD 475,000	ファンドはFrontier Communications Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	94,739	207,276
CDS	USD 1,113,000	ファンドはFrontier Communications Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	221,989	485,681
CDS	JPY 115,384,616	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(12,425)	(16,546)
CDS	EUR (3,633)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(353)	(816)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (36,367)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(3,428)	(8,173)
CDS	EUR (412,016)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(40,008)	(92,591)
CDS	USD (1,980,000)	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	35,757	201,277
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	95	(19,147)
CDS	EUR (275,799)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(25,611)	(61,979)
CDS	EUR (130,000)	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(51,848)	(64,040)
CDS	EUR 730,000	ファンドはINEOS Group Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2023	(61,814)	(109,939)
CDS	EUR 3,524,615	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(41,052)	(135,125)
CDS	USD 2,387,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(7,354)	(7,635)
CDS	USD 1,571,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	719,947	922,619
CDS	EUR 3,200,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(57,554)	5,773
CDS	EUR 1,870,000	ファンドはBayerische Motoren Werke AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(17,938)	(54,877)
CDS	EUR 1,346,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(35,292)	7,441
CDS	EUR 1,870,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(15,913)	(44,973)
CDS	USD (500,000)	ファンドはUnited Rentals Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(821)	82,817
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(28,890)	(83,709)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,324,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(8,745)	(7,433)
CDS	EUR 935,000	ファンドはBritish Telecommunications Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(4,909)	(10,170)
CDS	EUR 2,120,000	ファンドはCNH Industrial NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	3,987	(464,038)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはMarks & Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	27,352	93,668
CDS	EUR 1,425,211	ファンドはCommerzbank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(17,131)	(25,321)
CDS	EUR 1,345,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(33,601)	7,435
CDS	EUR 1,909,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(46,733)	10,553
CDS	EUR 2,270,000	ファンドはRenault SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(46,475)	(14,196)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(16,658)	(91,720)
CDS	USD 2,386,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(3,548)	(7,631)
CDS	USD 500,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに 係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(4,426)	(9,952)
CDS	USD 2,324,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(10,715)	(7,433)
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに 係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(18,409)	(48,896)
CDS	USD 3,874,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(12,816)	(12,391)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(12,179)	(91,720)
CDS	EUR 700,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(15,977)	(2,146)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,600,000	ファンドはWPP Finance 2005 Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(48,747)	(74,694)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2025	869	(8,370)
CDS	USD (857,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Barclays	17/9/2058	47,252	(30,052)
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(46,949)	(31,049)
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(26,776)	(17,544)
CDS	USD 9,312,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(207,946)	(637,346)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,450)	(15,731)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(22,249)	(69,665)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,450)	(15,731)
CDS	EUR (254,908)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(18,850)	(57,284)
CDS	EUR (759,000)	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2023	35,832	4,445
CDS	EUR 210,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2023	4,401	(37,353)
CDS	EUR 3,724,789	ファンドはCommerzbank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(54,764)	(66,175)
CDS	EUR 282,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	23,681	35,314
CDS	USD 3,857,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(20,644)	(12,336)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 150,000	ファンドはAltice France SA/Franceに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支払 う	BNP Paribas	20/6/2024	(13,207)	(21,643)
CDS	EUR 1,900,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プ ロテクションを受け取り、1%の固 定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(10,648)	32,112
CDS	EUR 1,900,000	ファンドはRoyal Bank of Scotland Group Plcに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、1%の固定金 利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(11,722)	(1,575)
CDS	EUR 130,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	8,260	37,814
CDS	EUR 670,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト ・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(4,310)	(133,670)
CDS	USD (625,000)	ファンドはFreeport-Mcmoran Incに 係るデフォルト・プロテクションを 提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	2,071	(29,131)
CDS	EUR 1,400,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクショ ンを受け取り、1%の固定金利を支 払う	BNP Paribas	20/6/2024	(9,676)	60,480
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(30,981)	(73,343)
CDS	EUR 885,000	ファンドはCNH Industrial NVに係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	3,528	(193,714)
CDS	USD 26,210,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト ・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(414,415)	399,962
CDS	EUR 9,010,000	ファンドはBanco Santander SAに係 るデフォルト・プロテクションを受 け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(324,637)	17,173
CDS	EUR 600,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(3,176)	72,424
CDS	EUR 3,552,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(39,069)	(136,175)
CDS	EUR 274,000	ファンドはLadbrokes Coral Group Ltdに係るデフォルト・プロテクショ ンを受け取り、1%の固定金利を支 払う	BNP Paribas	20/6/2024	(3,092)	5,338
CDS	USD 3,856,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト ・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(18,880)	(12,333)
CDS	USD 1,801,083	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテク ションを受け取り、1%の固定金利 を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(3,803)	(69,234)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,761,969)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	542	65,260
CDS	USD 1,789,638	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(2,295)	(68,795)
CDS	EUR 8,259	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	56	(1,924)
CDS	EUR 460,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(24,679)	28,019
CDS	USD (645,000)	ファンドはFreeport-Mcmoran Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	(2,021)	(30,063)
CDS	USD 3,857,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(18,011)	(12,336)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	16,702	(9,956)
CDS	EUR (303,519)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	53,185	(12,999)
CDS	EUR 4,490,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(86,982)	(105,371)
CDS	USD 7,190,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(113,684)	109,719
CDS	EUR (130,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	5,340	(5,568)
CDS	EUR 300,000	ファンドはOI European Group BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(471)	(50,848)
CDS	USD (300,000)	ファンドはDell Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	5,692	(13,032)
CDS	USD 8,310,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	361,290	1,125,886
CDS	USD 1,870,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(12,014)	10,022
CDS	EUR 200,000	ファンドはElis SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(6,669)	(43,322)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 194,081	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	1,309	(45,212)
CDS	EUR 82,588	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	557	(19,239)
CDS	USD 3,856,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(17,139)	(12,333)
CDS	USD (1,852,763)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	3,923	68,623
CDS	EUR 400,000	ファンドはElis SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(11,190)	(86,644)
CDS	USD 3,857,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(17,136)	(12,336)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(31,811)	(34,303)
CDS	EUR (253,054)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(24,572)	(56,868)
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(145,803)	(172,415)
CDS	EUR (78,540)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(6,392)	(17,650)
CDS	EUR (247,704)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(20,159)	(55,666)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(9,264)	(22,473)
CDS	EUR (7,854)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(639)	(1,765)
CDS	EUR (20,750)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(1,578)	(4,663)
CDS	EUR 230,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(11,208)	(43,856)
CDS	EUR 370,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2023	(27,795)	(78,403)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 950,000	ファンドはINEOS Group Holdings SAに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支払 う	Citibank	20/12/2023	(84,169)	(143,071)
CDS	EUR (900,000)	ファンドはUniCredit SpAに係るデ フォルト・プロテクションを提供 し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2023	55,345	5,271
CDS	EUR (431,034)	ファンドはTelecom Italia SpAに係 るデフォルト・プロテクションを提 供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	(184)	(14,798)
CDS	EUR 10,104,000	ファンドはHeineken NVに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(65,817)	(423,395)
CDS	USD 490,000	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、1%の固定 金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(7,330)	13,198
CDS	USD 2,000,000	ファンドはStaples Incに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(27,191)	3,822
CDS	EUR 6,025,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(75,496)	(230,983)
CDS	EUR 710,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(16,177)	(2,177)
CDS	EUR (430,595)	ファンドはTelecom Italia SpAに係 るデフォルト・プロテクションを提 供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	245	(14,783)
CDS	EUR 940,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(20,103)	44,424
CDS	EUR (7,607)	ファンドはTelecom Italia SpAに係 るデフォルト・プロテクションを提 供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	(3)	(261)
CDS	EUR 3,015,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(34,817)	(115,587)
CDS	EUR (81,053)	ファンドはTelecom Italia SpAに係 るデフォルト・プロテクションを提 供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	46	(2,783)
CDS	EUR 282,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(24,075)	(17,812)
CDS	USD 30,346,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト ・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(279,647)	(721,429)
CDS	USD 8,983,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト ・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(145,099)	137,080
CDS	EUR 1,565,000	ファンドはRenault SAに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(43,035)	(9,787)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,400,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(87,937)	85,276
CDS	USD 950,000	ファンドはFord Motor Credit Company LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(11,226)	(135,461)
CDS	EUR 3,125,000	ファンドはRenault SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(85,932)	(19,543)
CDS	USD (300,000)	ファンドはDell Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	7,476	(13,032)
CDS	USD 22,948,675	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(248,366)	122,993
CDS	USD 7,356,375	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(79,616)	39,426
CDS	USD (300,000)	ファンドはUnited Rentals Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	33	49,690
CDS	EUR (7,599)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	4	(261)
CDS	EUR (81,136)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	(35)	(2,786)
CDS	EUR 260,000	ファンドはElis SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(7,290)	(56,318)
CDS	USD 57,315,754	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(784,724)	874,632
CDS	USD (200,000)	ファンドはDell Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2024	4,601	(8,688)
CDS	EUR 100,000	ファンドはHapag-Lloyd AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(10,399)	(7,045)
CDS	USD 470,000	ファンドはSprint Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(29,674)	(65,942)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはGNK Holdings Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	3,588	5,353
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	1,465	(215,767)
CDS	EUR 900,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(28,453)	(209,661)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 32,858,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(530,741)	501,410
CDS	USD 39,774,331	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(488,476)	(127,214)
CDS	EUR 2,600,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(11,504)	43,413
CDS	EUR 460,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(17,336)	(107,160)
CDS	EUR 5,930,000	ファンドはHeidelbergCement AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	(115,601)	(1,389,201)
CDS	EUR (168,260)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2026	9,751	(15,399)
CDS	EUR (499,681)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2026	28,957	(45,731)
CDS	EUR (15,296)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2026	886	(1,400)
CDS	EUR (700,000)	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2026	54,655	145,391
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	(102)	50,495
CDS	EUR 160,000	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	44,871	52,023
CDS	EUR 150,000	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	27,898	65,678
CDS	EUR (400,000)	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2021	(10,296)	(76,431)
CDS	EUR 490,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(19,338)	(1,209)
CDS	USD 12,641,820	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(124,960)	(268,401)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(11,659)	(7,891)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに 係るデフォルト・プロテクション を提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(4,550)	(5,261)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(7,830)	(38,136)
CDS	EUR 400,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(20,585)	(76,272)
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance plcに係 るデフォルト・プロテクションを提 供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(142,089)	(172,415)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォル ト・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(2,691)	(38,294)
CDS	EUR (57,836)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SA に係るデフォルト・プロテクション を提供し、5%の固定金利を受け取 る	Credit Suisse	20/12/2023	(3,133)	(2,013)
CDS	EUR (252,164)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SA に係るデフォルト・プロテクション を提供し、5%の固定金利を受け取 る	Credit Suisse	20/12/2023	(13,658)	(8,778)
CDS	EUR 201,724	ファンドはUPC Holding BVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2023	(5,489)	(42,745)
CDS	EUR 810,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2023	(31,369)	(171,639)
CDS	EUR 950,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、5%の 固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2023	29,276	99,621
CDS	USD (675,180)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデ フォルト・プロテクションを提供 し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	(2,803)	46,406
CDS	EUR (940,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロ テクションを提供し、1%の固定金 利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	54,000	(32,272)
CDS	EUR 940,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(6,720)	(218,979)
CDS	EUR 90,000	ファンドはAltice France SA/France に係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支払 う	Credit Suisse	20/6/2024	(8,629)	(12,986)
CDS	EUR 1,400,000	ファンドはRoyal Bank of Scotland Group Plcに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、1%の固定金 利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(24,414)	(1,160)
CDS	EUR 456,667	ファンドはTDC A/Sに係るデフォル ト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	1,320	9,040

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 500,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(26,097)	(47,958)
CDS	EUR 940,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(5,544)	(218,979)
CDS	EUR 1,070,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(3,684)	(171,289)
CDS	EUR 1,235,000	ファンドはCNH Industrial NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	3,803	(270,324)
CDS	EUR (40,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	1,929	(1,713)
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(13,897)	(75,028)
CDS	EUR 840,000	ファンドはHapag-Lloyd AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(89,139)	(59,176)
CDS	EUR (490,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	35,967	(20,986)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	14,953	(13,277)
CDS	EUR (480,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	46,167	(20,558)
CDS	EUR 280,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	20,103	35,064
CDS	EUR 860,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	41,866	107,696
CDS	USD (1,146,420)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	(5,207)	78,794
CDS	EUR 310,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	14,029	38,821
CDS	EUR (196,481)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	32,436	(8,415)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 470,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	736	9,304
CDS	EUR 188,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	15,787	23,543
CDS	EUR (170,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	28,363	(7,281)
CDS	EUR 960,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(12,954)	(153,680)
CDS	EUR 400,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	8,584	116,352
CDS	EUR (290,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	18,674	(12,420)
CDS	EUR 1,585,000	ファンドはLafargeholcim Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(1,099)	(34,418)
CDS	EUR (710,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	31,449	158,155
CDS	EUR (1,500,000)	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	(8,357)	305,247
CDS	EUR (443,750)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	24,071	105,115
CDS	EUR (2,280,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	63,214	540,085
CDS	EUR (910,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2029	33,217	260,974
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	72,038	17,543
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(80,655)	(39,078)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(7,685)	(64,629)
CDS	USD 2,812,800	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2022	(62,338)	(192,518)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(65,276)	(31,394)
CDS	USD (974,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	72,926	(34,154)
CDS	USD 4,569,365	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(36,907)	(38,473)
CDS	USD 1,952,017	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(16,805)	(16,436)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	54,406	28,493
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(7,290)	(10,023)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(8,457)	(9,766)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(9,129)	(9,907)
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,666)	(19,813)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	233,764	66,438
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(9,129)	(10,664)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(8,748)	(9,766)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(8,378)	(9,766)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(28,200)	(22,971)
CDS	EUR 190,000	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2021	34,446	86,879
CDS	EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(8,561)	(41,840)
CDS	EUR (237,328)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(28,354)	(53,334)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(4,455)	(38,294)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(9,558)	(17,978)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(3,992)	(38,294)
CDS	EUR 100,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(4,269)	(19,068)
CDS	USD (938,301)	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	53,566	95,383
CDS	EUR 150,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(7,610)	(28,602)
CDS	USD (562,981)	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	31,540	57,230
CDS	USD 1,650,305	ファンドはDISH DBS Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(111,084)	(36,735)
CDS	EUR 384,615	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(9,738)	(76,159)
CDS	EUR 480,000	ファンドはSynlab Unsecured Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	5,876	(72,629)
CDS	EUR 370,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(6,693)	(73,265)
CDS	EUR 110,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	1,325	(19,566)
CDS	JPY 179,346,181	ファンドはSoftBank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(25,596)	45,129
CDS	JPY 95,300,000	ファンドはSoftBank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(26,600)	23,981
CDS	EUR 3,270,000	ファンドはAnglo American Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(44,309)	(710,635)
CDS	EUR (500,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	5,862	(21,415)
CDS	EUR 2,180,000	ファンドはRenault SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(59,882)	(13,633)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに 係るデフォルト・プロテクション を提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	7,047	(8,566)
CDS	USD 13,006,121	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(73,794)	458,624
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation SAに係るデフォルト・プロテクショ ンを受け取り、5%の固定金利を支 払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(17,040)	(241,464)
CDS	USD 894,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(5,791)	(17,794)
CDS	USD 875,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	7,276	(22,702)
CDS	EUR 570,000	ファンドはAltice France SA/France に係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支払 う	Goldman Sachs	20/6/2024	(752)	(82,242)
CDS	USD 904,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係 るデフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	419,542	530,903
CDS	USD 800,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	6,835	(20,756)
CDS	EUR 1,400,000	ファンドはArcelorMittalに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	489	(249,027)
CDS	USD 1,390,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォル ト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(2,395)	(4,446)
CDS	USD 825,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに 係るデフォルト・プロテクションを 受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	7,049	(21,405)
CDS	USD 2,085,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォル ト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(3,593)	(6,669)
CDS	USD 13,553,960	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(125,879)	477,942
CDS	EUR 6,736,000	ファンドはHeineken NVに係るデフ ォルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(43,878)	(282,263)
CDS	EUR 107,900,000	ファンドはITRAXX.X0.31.V1に係るデ フォルト・プロテクションを受け取 り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(600,694)	(13,364,086)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 950,000	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(1,351)	33,499
CDS	EUR 530,000	ファンドはFiat Chrysler Automobiles NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	409	(104,180)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	19,856	(11,673)
CDS	EUR 190,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(2,808)	(18,224)
CDS	EUR 700,000	ファンドはUnited Groupに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(52,744)	(115,085)
CDS	USD 8,710,000	ファンドはWeyerhaeuser Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(69,943)	(243,587)
CDS	USD 5,830,000	ファンドはInternational Paper Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(41,390)	(128,646)
CDS	EUR 500,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(5,942)	(99,754)
CDS	USD 2,738,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(10,304)	(8,757)
CDS	USD 2,737,831	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(11,547)	(8,757)
CDS	USD (4,000,000)	ファンドはDell Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	104,605	(173,755)
CDS	EUR 550,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(5,876)	9,183
CDS	EUR 679,000	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(53,442)	(97,969)
CDS	USD 9,025,040	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(78,420)	318,243
CDS	EUR 500,000	ファンドはFiat Chrysler Automobiles NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	729	(98,283)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (30,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	1,752	(1,030)
CDS	EUR 291,000	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(22,904)	(41,987)
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(58,684)	(17,543)
CDS	USD (935,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	62,775	9,012
CDS	USD (430,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	49,415	4,144
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	77,936	(39,590)
CDS	USD (1,841,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	158,531	(64,557)
CDS	USD (220,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	16,879	(7,715)
CDS	EUR (91,000)	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	HSBC Bank Plc	20/12/2023	4,531	533
CDS	USD 11,818,625	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(134,271)	63,342
CDS	USD 3,258,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(10,780)	(10,420)
CDS	USD 36,868,941	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(418,867)	197,599
CDS	EUR 4,810,000	ファンドはWPP Finance 2005 Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(97,559)	(138,185)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(5,819)	5,694
CDS	EUR 3,600,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(37,659)	(81,094)
CDS	EUR 3,688,385	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(41,003)	(141,403)
CDS	EUR 13,050,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(162,663)	(306,257)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,800,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(15,861)	(40,547)
CDS	USD 1,680,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	784,769	986,633
CDS	EUR 5,560,000	ファンドはWPP Finance 2005 Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(101,302)	(159,731)
CDS	EUR 1,540,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(13,598)	(34,690)
CDS	EUR 1,800,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	(18,348)	(40,547)
CDS	EUR 660,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2024	7,618	79,666
CDS	USD 2,700,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(5,912)	(106,311)
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(109,197)	(79,005)
CDS	USD 810,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(1,636)	(31,893)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	324,220	92,622
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(32,530)	(34,650)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(33,332)	(34,403)
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(24,227)	(27,434)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(34,215)	(34,498)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(9,812)	(8,437)
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(36,542)	(39,848)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(37,153)	(41,562)
CDS	EUR (440,000)	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	(16,889)	(84,074)
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(5,737)	(37,866)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(10,259)	(13,788)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(20,518)	(27,576)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(9,501)	(13,788)
CDS	EUR 470,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(29,490)	(42,915)
CDS	EUR (31,447)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(2,847)	(7,067)
CDS	EUR (78,616)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(6,398)	(17,667)
CDS	USD (12,641,820)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	72,196	268,401
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(851)	(19,147)
CDS	EUR (4,717)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(427)	(1,060)
CDS	EUR (47,170)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(4,271)	(10,600)
CDS	EUR (3,144)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(285)	(707)
CDS	EUR (247,944)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(20,178)	(55,719)
CDS	EUR (360,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(11,533)	(80,901)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(21,817)	(191,472)
CDS	EUR (7,862)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(640)	(1,767)
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(18,328)	(47,192)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(9,738)	(17,978)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogy Group LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	119,654	113,087
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sons Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(2,104)	34,304
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Homeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(138,056)	(256,426)
CDS	EUR 160,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(2,573)	(31,682)
CDS	EUR 180,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	1,997	(32,017)
CDS	EUR 490,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(2,906)	(114,149)
CDS	USD 654,064	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(8,561)	7,942
CDS	USD 654,064	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,157)	7,942
CDS	USD 3,383,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(18,830)	18,131
CDS	USD 654,064	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,952)	7,942
CDS	EUR 550,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,032)	9,183
CDS	USD 3,382,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(19,580)	18,126

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,383,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(17,316)	18,131
CDS	USD 2,900,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	14,474	(23,530)
CDS	USD 474,101	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(1,728)	(3,847)
CDS	USD 4,604,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(27,684)	24,675
CDS	EUR 10,875,000	ファンドはLafargeholcim Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(24,832)	(236,147)
CDS	USD 3,782,000	ファンドはCDX.EM.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	19,223	192,709
CDS	USD 250,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,235)	(6,486)
CDS	USD 6,312,000	ファンドはCDX.EM.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	32,083	321,624
CDS	USD 576,923	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(4,751)	14,981
CDS	USD 601,824	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(4,659)	1,057
CDS	USD 601,824	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,688)	1,057
CDS	EUR 2,670,000	ファンドはLafargeholcim Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,068)	(57,978)
CDS	USD 601,823	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(2,544)	1,057
CDS	EUR 3,030,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(31,297)	(68,254)
CDS	EUR 500,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	10,737	145,439
CDS	EUR 2,060,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(74,875)	130,295
CDS	USD 1,119,231	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,062)	29,063
CDS	USD 237,050	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(646)	(1,923)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 474,101	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(1,321)	(3,847)
CDS	USD 3,383,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(15,044)	18,131
CDS	USD 601,824	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,570)	1,057
CDS	USD 576,923	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,522)	14,981
CDS	USD 1,000,000	ファンドはGeneral Electric Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	3,095	22,277
CDS	USD (500,000)	ファンドはUnited Rentals Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	8,721	82,817
CDS	EUR 935,000	ファンドはBritish Telecommunications Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(2,887)	(10,170)
CDS	USD (500,000)	ファンドはUnited Rentals Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	1,632	82,817
CDS	USD 474,101	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(1,112)	(3,847)
CDS	USD 3,383,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(16,559)	18,131
CDS	USD 237,050	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(644)	(1,923)
CDS	USD 576,923	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,197)	14,981
CDS	EUR 510,000	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(20,656)	(73,585)
CDS	EUR 940,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(14,257)	40,608
CDS	EUR 1,530,000	ファンドはDeutsche Lufthansa AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	9,716	(24,926)
CDS	EUR 3,030,000	ファンドはCNH Industrial NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(654)	(663,224)
CDS	EUR 3,030,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(31,440)	(68,254)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,700,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(89,798)	107,525
CDS	USD 654,064	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,729)	7,942
CDS	EUR 470,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	38,135	58,857
CDS	EUR 3,864,000	ファンドはAnglo American Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(85,862)	(839,722)
CDS	USD (507,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	37,803	(17,779)
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	106,835	(40,326)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	1,994	(1,169)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	477	64,629
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(13,965)	(9,087)
CDS	USD 1,439,000	ファンドはTransocean Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2022	19,083	150,326
CDS	EUR (330,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(5,420)	(8,680)
CDS	EUR (630,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(48,732)	(141,577)
CDS	EUR 1,340,000	ファンドはWPP Finance 2005 Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(28,780)	(38,496)
CDS	USD (4,494,900)	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2024	(29,686)	(608,994)
CDS	EUR 1,890,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	5,867	(24,790)
CDS	EUR 3,480,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(58,198)	(82,055)
CDS	EUR 5,430,000	ファンドはAnglo American Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(98,468)	(1,180,045)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,900,000	ファンドはMondelez International Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(10,916)	(86,521)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	6,597	(11,114)
CDS	EUR 900,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(17,538)	(21,221)
CDS	EUR 2,700,000	ファンドはCarrefour SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(27,998)	(60,820)
CDS	EUR 980,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(18,579)	(23,108)
CDS	EUR (77,817)	ファンドはTelecom Italia Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2024	122	(2,672)
CDS	EUR (413,403)	ファンドはTelecom Italia Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2024	646	(14,193)
CDS	EUR 450,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	4,395	23,160
CDS	EUR (7,295)	ファンドはTelecom Italia Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2024	11	(250)
CDS	EUR 3,405,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(37,452)	(130,539)
CDS	USD 2,900,000	ファンドはConocoPhillipsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	13,587	(55,922)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	5,807	(11,114)
CDS	USD 9,669,600	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	413,220	1,310,092
CDS	USD 5,894,000	ファンドはQatar Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(57,722)	(140,003)
CDS	USD 2,900,000	ファンドはAmerican International Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	5,084	(39,727)
CDS	USD 2,900,000	ファンドはKinder Morgan Inc/DEに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(2,280)	(43,364)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	7,417	(11,114)
CDS	USD 2,800,000	ファンドはPfizer Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(4,622)	(96,070)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	8,165	(11,114)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	8,218	(11,114)
CDS	USD 2,820,000	ファンドはLowe's Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(14,499)	(90,792)
CDS	USD 3,475,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	10,594	(11,114)
CDS	USD 2,785,000	ファンドはAllstate Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(3,018)	(103,363)
CDS	EUR 4,450,000	ファンドはSolvay SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(46,620)	(115,122)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	1,010	(46,591)
CDS	USD 2,820,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(850)	(77,143)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	2,604	(7,304)
CDS	EUR (1,010,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	26,295	(73,769)
CDS	EUR (3,190,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	83,051	(232,994)
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(82,242)	(39,846)
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(11,419)	17,779
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(14,550)	22,653
CDS	USD 4,020,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(96,157)	(44,128)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(45,311)	(21,954)
CDS	EUR 1,800,000	ファンドはLafargeholcim Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Societe Generale	20/6/2024	(4,348)	(39,086)
IFS	EUR 26,620,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2024	275,442	275,442
IFS	EUR 24,500,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.0153%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/7/2024	275,830	275,830
IFS	EUR 9,426,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、0.88%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2024	18,796	18,796
IFS	EUR 7,840,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.2895%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2029	(267,738)	(267,738)
IFS	GBP 6,090,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.49%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/3/2029	(222,759)	(222,759)
IFS	EUR 11,800,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.3225%の固定金利を受け取る	Bank of America	18/3/2029	(453,750)	(453,750)
IFS	EUR 26,620,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.16%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/7/2029	(500,944)	(500,944)
IFS	EUR 24,500,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.2%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/7/2029	(587,424)	(587,424)
IFS	GBP 1,947,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.725%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/8/2029	-	-
IFS	EUR 9,426,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.0683%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2029	(50,365)	(50,365)
IFS	GBP 1,946,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.71%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2029	(4,778)	(4,778)
IFS	GBP 1,917,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.745%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2029	6,285	6,285
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/3/2048	145,078	145,078
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	411,778	411,778
IRS MXN	1,157,956,000	ファンドは8.2062%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	7/10/2020	466,775	466,775
IRS MXN	1,750,000,000	ファンドは8.505%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	4/11/2020	1,108,140	1,108,140
IRS	USD 95,500,000	ファンドは1.528%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	22/11/2020	(115,805)	(115,805)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 328,694,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.766%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2021	(1,490,395)	(1,490,395)
IRS	CAD 37,020,000	ファンドは1.755%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	26/6/2021	37,668	37,668
IRS	CAD 37,020,000	ファンドは1.77%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	26/6/2021	45,950	45,950
IRS	CAD 37,280,000	ファンドは1.824%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2021	79,103	79,103
IRS	USD 166,495,000	ファンドは2.098%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2021	1,105,085	1,614,604
IRS	CAD 23,215,000	ファンドは1.905%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	78,296	78,296
IRS	CAD 299,555,000	ファンドは1.9075%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	1,021,432	1,021,432
IRS	MXN 177,249,452	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.86%の固定金利を支払う	Bank of America	23/7/2021	(23,311)	(23,311)
IRS	MXN 247,396,167	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.9%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2021	(37,493)	(37,493)
IRS	CAD 32,410,000	ファンドは1.7925%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	1/8/2021	63,648	63,648
IRS	USD 88,183,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.75%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2021	(505,620)	(505,620)
IRS	MXN 782,700,671	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.78%の固定金利を支払う	Bank of America	6/8/2021	(81,529)	(81,529)
IRS	USD 12,500,000	ファンドは1.529%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2021	(4,154)	(4,154)
IRS	USD 12,500,000	ファンドは1.5325%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2021	(3,319)	(3,319)
IRS	USD 49,950,000	ファンドは1.294%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/8/2021	62,356	62,356
IRS	CZK 634,565,221	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.64%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2021	66,704	66,704
IRS	CZK 634,412,956	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.6575%の固定金利を支払う	Bank of America	20/8/2021	55,680	55,680
IRS	CZK 318,758,750	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.72%の固定金利を支払う	Bank of America	20/8/2021	11,226	11,226
IRS	HUF 7,901,580,591	ファンドは0.295%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/8/2021	(48,327)	(48,327)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	HUF 7,903,477,046	ファンドは0.305%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/8/2021	(43,139)	(43,139)
IRS	HUF 3,976,245,000	ファンドは0.3125%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	22/8/2021	(19,763)	(19,763)
IRS	HUF 7,952,092,376	ファンドは0.34%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2021	(26,446)	(26,446)
IRS	CZK 637,485,624	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.775%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2021	(6,733)	(6,733)
IRS	HUF 4,423,661,034	ファンドは0.375%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2021	(4,669)	(4,669)
IRS	CZK 354,626,202	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.775%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2021	(4,255)	(4,255)
IRS	HUF 4,447,719,288	ファンドは0.36%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2021	(7,811)	(7,811)
IRS	CZK 354,819,971	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.74%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2021	5,681	5,681
IRS	HUF 4,031,730,526	ファンドは0.31%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/8/2021	(19,791)	(19,791)
IRS	CZK 321,144,711	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.715%の固定金利を支払う	Bank of America	30/8/2021	11,983	11,983
IRS	HUF 6,978,511,776	ファンドは0.36%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/9/2021	(11,461)	(11,461)
IRS	USD 25,010,000	ファンドは1.2055%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/9/2021	6,280	6,280
IRS	USD 50,010,000	ファンドは1.22%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/9/2021	19,645	19,645
IRS	USD 50,010,000	ファンドは1.2285%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/9/2021	23,800	23,800
IRS	CZK 563,234,742	ファンドは6ヶ月CZK Interbankの変動金利を受け取り、1.74%の固定金利を支払う	Bank of America	2/9/2021	7,253	7,253
IRS	USD 402,400,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.1%の固定金利を支払う	Bank of America	15/9/2021	198,704	173,496
IRS	THB 367,260,000	ファンドは1.165%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	(17,615)	(17,615)
IRS	THB 617,030,000	ファンドは1.39%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	60,107	60,107
IRS	SGD 22,420,000	ファンドは1.555%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	(5,415)	(5,415)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	SGD 11,810,000	ファンドは1.622%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	8,365	8,365
IRS	PLN 120,899,964	ファンドは1.6886%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	36,083	36,083
IRS	PLN 50,740,000	ファンドは1.7%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	17,991	17,991
IRS	PLN 63,420,000	ファンドは1.716%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	27,482	27,482
IRS	PLN 91,330,000	ファンドは1.717%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	40,026	40,026
IRS	PLN 63,420,000	ファンドは1.721%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2021	29,043	29,043
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/11/2021	4,230,167	4,230,167
IRS	CAD 13,047,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.582%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2021	(226,162)	(226,162)
IRS	DKK 76,930,000	ファンドは0.12%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2021	147,951	149,466
IRS	SEK 107,005,000	ファンドは0.166%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2021	91,299	92,460
IRS	USD 9,883,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2021	(331,662)	(333,366)
IRS	USD 86,935,000	ファンドは2.521%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/1/2022	2,052,473	2,052,473
IRS	USD 115,170,000	ファンドは2.528%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/1/2022	2,734,869	2,734,869
IRS	USD 130,250,000	ファンドは2.34%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/1/2022	2,617,267	2,617,267
IRS	USD 140,210,000	ファンドは2.51%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/2/2022	3,409,065	3,409,065
IRS	USD 162,060,000	ファンドは2.0267%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/3/2022	2,393,535	2,393,535
IRS	USD 186,210,000	ファンドは2.2432%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/4/2022	3,635,389	3,635,389
IRS	USD 45,756,000	ファンドは1.742%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2022	458,947	458,947
IRS	EUR 8,000,000	ファンドは-0.3525%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	3/7/2022	52,062	52,062

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 319,810,000	ファンドは1.7055%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2022	1,698,985	1,698,985
IRS	MXN 192,146,162	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.23%の固定金利を支払う	Bank of America	18/7/2022	(95,419)	(95,419)
IRS	MXN 96,087,025	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.23%の固定金利を支払う	Bank of America	19/7/2022	(47,796)	(47,796)
IRS	MXN 36,951,186	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.22%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2022	(17,932)	(17,932)
IRS	MXN 51,731,659	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.21%の固定金利を支払う	Bank of America	25/7/2022	(24,671)	(24,671)
IRS	GBP 5,100,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、0.634%の固定金利を支払う	Bank of America	1/8/2022	(1,982)	(1,982)
IRS	MXN 436,014,000	ファンドは7%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2022	91,303	91,303
IRS	CAD 66,600,000	ファンドは1.5775%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2022	66,824	66,824
IRS	USD 16,340,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.4863%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2023	(421,216)	(421,216)
IRS	USD 69,760,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5138%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2023	(1,835,464)	(1,835,464)
IRS	USD 38,290,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5347%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2023	(1,024,918)	(1,024,918)
IRS	USD 65,010,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.526%の固定金利を支払う	Bank of America	5/3/2023	(1,732,089)	(1,732,089)
IRS	USD 127,580,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.43%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2023	(3,132,251)	(3,129,542)
IRS	USD 324,970,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.7605%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2023	(1,746,312)	(1,746,312)
IRS	EUR 97,710,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.3%の固定金利を支払う	Bank of America	25/7/2023	(572,352)	(572,352)
IRS	EUR 123,990,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.29%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2023	(755,135)	(755,135)
IRS	EUR 13,340,000	ファンドは-0.45%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2023	32,530	32,530
IRS	EUR 13,390,000	ファンドは-0.575%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2023	(5,419)	(5,419)
IRS	JPY 453,000,000	ファンドは0.14%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2023	53,899	53,899

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 34,601,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0405%の固定金利を支払う	Bank of America	29/11/2023	(2,415,809)	(2,415,809)
IRS	CAD 8,010,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.62%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2023	(281,137)	(281,987)
IRS	EUR 6,246,000	ファンドは0.281%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/12/2023	245,961	246,702
IRS	DKK 46,473,000	ファンドは0.422%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2023	254,947	258,330
IRS	SEK 64,897,000	ファンドは0.505%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2023	194,718	196,592
IRS	USD 6,097,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.992%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2023	(412,643)	(415,921)
IRS	MXN 489,941,250	ファンドは8.39%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2024	1,513,379	1,513,379
IRS	MXN 257,104,355	ファンドは8.125%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	2/2/2024	670,271	670,271
IRS	MXN 184,788,602	ファンドは8.135%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2024	486,339	486,339
IRS	USD 135,189,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.304%の固定金利を支払う	Bank of America	29/2/2024	(218,360)	(275,235)
IRS	JPY 4,068,000,000	ファンドは-0.004%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/3/2024	293,694	293,694
IRS	NOK 49,000,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの変動金利を受け取り、1.765%の固定金利を支払う	Bank of America	5/6/2024	(58,090)	(58,090)
IRS	USD 96,556,000	ファンドは1.7115%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/6/2024	1,684,536	1,684,536
IRS	EUR 137,810,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.54%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	(8,027,382)	(8,027,382)
IRS	USD 10,346,000	ファンドは1.7535%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/7/2024	200,987	200,987
IRS	USD 50,110,000	ファンドは1.7135%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2024	880,873	880,873
IRS	USD 150,304,000	ファンドは1.714%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2024	2,645,693	2,645,693
IRS	MXN 146,965,505	ファンドは6.72%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2024	(10,705)	(10,705)
IRS	USD 87,484,111	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.1445%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2024	(3,371,567)	(3,371,567)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 323,311,495	ファンドは6.67%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	(63,608)	(63,608)
IRS	USD 97,610,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.12675%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	(3,686,274)	(3,686,274)
IRS	MXN 278,202,000	ファンドは6.715%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	(28,358)	(28,358)
IRS	SEK 305,675,000	ファンドは-0.0725%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/8/2024	142,712	142,712
IRS	SEK 305,675,000	ファンドは-0.0775%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/8/2024	134,948	134,948
IRS	USD 318,058,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5095%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2024	(2,651,745)	(2,651,745)
IRS	THB 114,258,000	ファンドは1.48%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	36,858	36,858
IRS	SGD 15,360,000	ファンドは1.5%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(14,179)	(14,179)
IRS	SGD 12,490,000	ファンドは1.695%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	72,930	72,930
IRS	USD 3,369,713	ファンドは1.786%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	75,414	75,414
IRS	USD 13,628,976	ファンドは1.84791%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	319,956	345,858
IRS	CNY 208,420,257	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.115%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(317,904)	(317,904)
IRS	INR 2,148,430,000	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.954%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(1,235,004)	(1,235,004)
IRS	SGD 9,865,617	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.57%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(14,993)	(14,993)
IRS	SGD 4,029,618	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.5725%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(6,476)	(6,476)
IRS	SGD 4,576,275	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.6225%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(15,216)	(15,216)
IRS	SGD 9,263,490	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.635%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(35,111)	(35,111)
IRS	SGD 9,245,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.6625%の固定金利を支払う	Bank of America	18/9/2024	(43,922)	(43,922)
IRS	USD 20,008,000	ファンドは1.28%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	29/11/2024	(11,996)	(11,996)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 50,253,000	ファンドは1.28%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	29/11/2024	(30,131)	(30,131)
IRS	USD 354,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.867%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(9,959)	(9,959)
IRS	USD 50,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.33625%の固定金利を支払う	Bank of America	27/4/2025	(2,635,390)	(2,635,390)
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	107,825	107,825
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	107,825	107,825
IRS	MXN 10,285,479	ファンドは6.27%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	(14,014)	(14,014)
IRS	USD 3,246,500	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	(336,690)	(336,690)
IRS	USD 7,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Bank of America	13/1/2027	(478,882)	(478,776)
IRS	USD 289,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2028	(36,195)	(36,195)
IRS	USD 3,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Bank of America	13/9/2028	(560,926)	(560,926)
IRS	JPY 137,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3535%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2028	(57,187)	(57,187)
IRS	CAD 4,262,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.75%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2028	(345,468)	(347,376)
IRS	EUR 3,229,000	ファンドは0.884%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/12/2028	409,678	410,153
IRS	DKK 23,964,000	ファンドは1.026%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2028	412,232	418,583
IRS	SEK 33,823,000	ファンドは1.156%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2028	331,106	336,658
IRS	USD 3,266,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.06%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2028	(481,828)	(483,404)
IRS	JPY 863,940,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.1915%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2029	(242,205)	(242,205)
IRS	JPY 124,920,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.159%の固定金利を支払う	Bank of America	29/1/2029	(31,493)	(31,493)
IRS	USD 82,192,193	ファンドは1.5057%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2029	988,125	988,125

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 67,625,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	(9,824,018)	(9,824,018)
IRS	JPY 2,018,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.176%の固定金利を支払う	Bank of America	6/3/2029	(542,032)	(542,032)
IRS	USD 35,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.4%の固定金利を支払う	Bank of America	15/5/2029	(177,482)	(163,932)
IRS	MXN 290,620,000	ファンドは7.9625%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	1,065,119	1,065,119
IRS	MXN 148,538,065	ファンドは7.96%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	543,067	543,067
IRS	MXN 142,081,935	ファンドは7.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	529,593	529,593
IRS	NOK 24,500,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの変動金利を受け取り、1.8595%の固定金利を支払う	Bank of America	5/6/2029	(79,686)	(79,686)
IRS	USD 34,196,000	ファンドは1.94%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/6/2029	1,756,734	1,756,734
IRS	USD 21,310,000	ファンドは1.975%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/6/2029	1,163,297	1,163,297
IRS	USD 11,256,000	ファンドは1.954%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/7/2029	592,826	592,826
IRS	USD 12,695,000	ファンドは1.9715%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/8/2029	690,240	690,240
IRS	USD 5,415,000	ファンドは1.5245%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2029	68,436	68,436
IRS	USD 2,707,500	ファンドは1.531%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2029	35,869	35,869
IRS	USD 5,880,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.545%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2029	(85,618)	(85,618)
IRS	USD 7,440,000	ファンドは1.64%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2029	171,727	174,726
IRS	USD 10,710,000	ファンドは1.406%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2029	16,992	16,992
IRS	USD 10,700,000	ファンドは1.4265%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2029	37,609	37,609
IRS	USD 2,720,000	ファンドは1.4215%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2029	8,197	8,197
IRS	USD 6,510,000	ファンドは1.423%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2029	20,540	20,540

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 3,240,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5585%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2029	(51,629)	(51,629)
IRS	SGD 8,880,000	ファンドは1.615%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2029	(24,250)	(24,250)
IRS	SGD 6,970,000	ファンドは1.952%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/9/2029	138,718	138,718
IRS	JPY 1,371,000,000	ファンドは-0.073%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/12/2029	43,820	43,820
IRS	USD 7,290,000	ファンドは2.4205%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/5/2031	696,408	696,408
IRS	USD 3,460,000	ファンドは2.079%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	22/6/2031	219,260	219,260
IRS	JPY 287,470,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2034	(150,787)	(150,787)
IRS	JPY 622,590,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.336%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2034	(310,372)	(310,372)
IRS	JPY 255,240,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.336%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2034	(127,579)	(127,579)
IRS	USD 2,490,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.295%の固定金利を支払う	Bank of America	24/6/2034	(168,810)	(168,810)
IRS	USD 10,350,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.645%の固定金利を支払う	Bank of America	22/8/2034	(96,360)	(96,360)
IRS	JPY 224,900,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6165%の固定金利を支払う	Bank of America	14/12/2038	(240,246)	(240,246)
IRS	JPY 340,690,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.409%の固定金利を支払う	Bank of America	3/4/2039	(235,550)	(235,550)
IRS	JPY 249,520,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3291%の固定金利を支払う	Bank of America	10/6/2039	(135,365)	(135,365)
IRS	JPY 232,070,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.295%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2039	(110,979)	(110,979)
IRS	JPY 266,130,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.1665%の固定金利を支払う	Bank of America	8/8/2039	(62,477)	(62,477)
IRS	JPY 163,330,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.715%の固定金利を支払う	Bank of America	21/3/2044	(180,445)	(180,445)
IRS	JPY 150,180,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.2005%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2044	(15,655)	(15,655)
IRS	USD 7,090,000	ファンドは1.625%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/5/2045	151,189	155,725

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 17,890,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.30994%の固定金利を支払う	Bank of America	9/11/2048	(7,715,461)	(7,715,461)
IRS	CAD 1,805,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.91%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2048	(384,493)	(384,948)
IRS	EUR 1,266,000	ファンドは1.46%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/12/2048	578,086	578,112
IRS	GBP 946,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.732%の固定金利を支払う	Bank of America	4/12/2048	(350,451)	(349,139)
IRS	DKK 9,291,000	ファンドは1.5325%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	551,982	552,503
IRS	SEK 13,474,000	ファンドは1.681%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	428,679	430,636
IRS	USD 1,414,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.152%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2048	(555,648)	(556,968)
IRS	USD 2,948,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.814%の固定金利を支払う	Bank of America	9/1/2049	(919,971)	(919,971)
IRS	USD 4,960,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3375%の固定金利を支払う	Bank of America	5/7/2049	(268,710)	(268,710)
IRS	USD 5,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.891%の固定金利を支払う	Bank of America	8/8/2049	(458,489)	(458,489)
IRS	USD 4,875,000	ファンドは1.7215%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2049	223,163	223,163
IRS	USD 1,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.636%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2049	(31,831)	(31,831)
IRS	USD 4,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.705%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2049	(39,722)	(39,722)
IRS	USD 3,500,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6645%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2049	(20,375)	(20,375)
IRS	USD 4,080,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.556%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2049	(19,156)	(19,156)
IRS	USD 4,060,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.585%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2049	(48,345)	(48,345)
IRS	USD 1,250,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.538%の固定金利を支払う	Bank of America	30/8/2049	(451)	(451)
IRS	USD 2,970,000	ファンドは1.86%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/11/2049	241,982	241,982
IRS	USD 12,850,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3405%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2050	(2,585,740)	(2,585,740)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 3,430,000	ファンドは3.0335%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/2/2053	1,207,919	1,207,919
IRS	THB 459,570,000	ファンドは1.403%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	18/9/2021	48,628	48,628
IRS	CNY 75,894,320	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.11%の固定金利を支払う	BNP Paribas	18/9/2024	(113,293)	(113,293)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	(704,513)	(704,513)
IRS	BRL 65,085,195	ファンドは9.48%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	1,192,128	1,192,128
IRS	THB 116,800,000	ファンドは1.195%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Citibank	18/9/2024	(14,938)	(14,938)
IRS	THB 315,260,000	ファンドは1.5125%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Citibank	18/9/2024	117,892	117,892
IRS	INR 238,360,000	ファンドは4.9825%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Citibank	18/9/2024	(4,670)	(4,670)
IRS	INR 2,058,992,007	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.507%の固定金利を支払う	Citibank	18/9/2024	(620,445)	(620,445)
IRS	INR 1,140,142,500	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.7875%の固定金利を支払う	Citibank	18/9/2024	(539,246)	(539,246)
IRS	CNY 72,600,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.075%の固定金利を支払う	Citibank	18/9/2024	(91,842)	(91,842)
IRS	BRL 64,351,074	ファンドは8.67%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	1,629,420	1,629,420
IRS	MXN 86,921,000	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(98,777)	(98,777)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(575,970)	(575,970)
IRS	EUR 88,880,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.50668%の固定金利を支払う	Credit Suisse	12/8/2021	(118,688)	(92,146)
IRS	MXN 352,026,968	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.2%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/8/2022	(165,930)	(165,930)
IRS	EUR 56,520,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.43507%の固定金利を支払う	Credit Suisse	14/8/2024	(300,126)	(303,597)
IRS	USD 10,231,311	ファンドは1.527%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	18/9/2024	100,707	100,707
IRS	MXN 128,100,000	ファンドは8.72%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2029	798,091	798,091

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 253,592,767	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.105%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	(100,528)	(100,528)
IRS	MXN 193,289,233	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	(77,986)	(77,986)
IRS	MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	402,561	402,561
IRS	INR 1,228,096,800	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.55%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	18/9/2024	(402,379)	(402,379)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	777,429	777,429
IRS	THB 6,015,150	ファンドは1.31%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/9/2029	(1,407)	(1,407)
IRS	THB 29,239,000	ファンドは1.659%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/9/2029	24,328	24,328
IRS	THB 41,450,000	ファンドは1.7125%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/9/2029	41,261	41,261
IRS	THB 116,800,000	ファンドは1.185%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2024	(16,785)	(16,785)
IRS	THB 266,602,000	ファンドは1.46%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2024	77,573	77,573
IRS	INR 1,098,971,193	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.51%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2024	(333,175)	(333,175)
IRS	THB 194,489,850	ファンドは1.295%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2029	(54,420)	(54,420)
IRS	THB 200,505,000	ファンドは1.32%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2029	(40,792)	(40,792)
IRS	THB 12,531,000	ファンドは1.66%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/9/2029	10,464	10,464
IRS	BRL 16,868,978	ファンドは12.17%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	1,040,944	1,040,944
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	874,624	874,624
IRS	BRL 28,035,808	ファンドは8.195%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	422,513	422,513
IRS	BRL 26,757,858	ファンドは8.26%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	411,788	411,788
IRS	BRL 91,014,356	ファンドは8.27%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,408,982	1,408,982

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 21,530,833	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	378,938	378,938
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,113,765	1,113,765
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	236,050	236,050
IRS	INR 155,680,000	ファンドは5.3525%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	18/9/2024	32,195	32,195
IRS	BRL 71,963,017	ファンドは6.72%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	(224,474)	(224,474)
IRS	MXN 144,525,723	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	(334,732)	(334,732)
TRS	USD (20,000)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、Ford Motor Co + Obpsを支払う	Bank of America	24/8/2020	(7,800)	(7,800)
TRS	USD (19,258)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 45bpsを受け取り、Canadian Natural Resources + Obpsを支払う	BNP Paribas	27/11/2019	(25,613)	(25,613)
TRS	USD (38,280)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、Occidental Petroleum Corp + Obpsを支払う	BNP Paribas	15/5/2020	10,336	10,336
TRS	USD (211,473)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 7.5bpsを受け取り、Sprint Corp + Obpsを支払う	BNP Paribas	17/7/2020	(3,891)	(3,891)
TRS	USD (1,294)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 25bpsを受け取り、Charter Communications Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	5/8/2020	(34,893)	(34,893)
TRS	USD (2,566)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 10bpsを受け取り、Charter Communications Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	26/8/2020	(26,789)	(26,789)
TRS	EUR 3,000,000	ファンドはEuro Interbank 3ヶ月 Offer Rate + Obpsを受け取り、Markit iBoxx Euro Corporate + Obpsを支払う	Citibank	20/12/2019	(10,820)	(12,351)
TRS	USD (79,478)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、Sprint Corp + Obpsを支払う	Citibank	11/6/2020	(21,403)	(21,403)
TRS	USD (79,478)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、Sprint Corp + Obpsを支払う	Citibank	11/6/2020	(20,315)	(20,315)
TRS	USD (300)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 20bpsを受け取り、Netflix Inc + Obpsを支払う	Citibank	27/8/2020	(1,674)	(1,674)
TRS	USD (63,560)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 52bpsを受け取り、Intelsat SA + Obpsを支払う	Credit Suisse	11/6/2020	(108,687)	(108,687)
TRS	USD 53,248,000	ファンドはiBoxx USD Liquid + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2019	2,910,636	2,822,048

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	EUR 1,500,000	ファンドはEuro Interbank 3ヶ月 Offer Rate + 0bpsを受け取り、iBoxx EUR Liquid High Yield + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/12/2019	(19,352)	(20,100)
TRS	USD (9,195)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	5,265	5,265
TRS	USD (4,767)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	1,869	1,869
TRS	USD (6,355)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	2,023	2,023
TRS	USD (21,927)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	12,310	12,310
TRS	USD (15,889)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	5,661	5,661
TRS	USD (11,917)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	4,279	4,279
TRS	USD (56,396)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	20,799	20,799
TRS	USD (5,243)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	2,517	2,517
TRS	USD (13,798)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	4,306	4,306
TRS	USD (8,290)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	6,047	6,047
TRS	USD (5,113)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	3,451	3,451
TRS	EUR 2,400,000	ファンドはEuro Interbank 3ヶ月 Offer Rate + 0bpsを受け取り、iBoxx EUR Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2019	(14,538)	(14,695)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 10,413,422,099米ドル)					(16,764,529)	(35,484,519)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2019年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
16,267,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.095	3/9/2019	(44,115)	2,911
11,065,000	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 1	4/9/2019	(10,301)	1,760
7,330,000	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.685	5/9/2019	(27,523)	1,170
7,810,000	コール	OTC USD/TWD	Bank of America	USD 31.75	5/9/2019	(32,343)	1,724
44,262,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.135	6/9/2019	(126,215)	11
5,230,000	プット	OTC USD/KRW	Bank of America	USD 1,190	10/9/2019	(13,310)	4,529
5,230,000	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 19.5	10/9/2019	(44,130)	2,307
14,664,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 102.5	12/9/2019	(20,845)	5,301
7,332,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 102.5	12/9/2019	(6,881)	2,651
33,196,000	プット	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.975	17/9/2019	(104,248)	72,654
332,000	プット	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.955	17/9/2019	(22,352)	7,860
115,053,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 106	19/9/2019	(63,329)	831,209
22,132,000	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.3	25/9/2019	3,204	16,705
114,773,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105.25	26/9/2019	(199,566)	681,431
143,687,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1175	3/10/2019	1,313,474	1,986,736
16,598,250	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.715	11/10/2019	(50,581)	1,927
11,065,000	プット	OTC EUR/AUD	Bank of America	EUR 1.6	11/10/2019	(121,246)	30,774
6,639,000	コール	OTC EUR/AUD	Bank of America	EUR 1.64	11/10/2019	(52,965)	87,555
11,065,000	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.3	25/10/2019	6,473	25,173
5,865,000	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 20.15	30/10/2019	3,664	91,827
33,196,000	コール	OTC AUD/CHF	Bank of America	AUD 0.71	5/11/2019	(11,581)	10,526
22,131,000	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 14.2	5/11/2019	(119,968)	76,334
22,131,000	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 3.8	7/11/2019	(103,080)	33,003
2,400,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.135	8/11/2019	(4,335)	9,159
650,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.17	8/11/2019	(63,764)	20,659
664,000	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 3.45	21/11/2019	(33,706)	822
780,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.09	27/11/2019	54,247	187,997
71,149,000	プット	OTC EUR/GBP	Bank of America	EUR 0.87	20/12/2019	164,221	829,911
94,702,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.11	20/1/2020	703,018	1,310,730
6,471,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.095	27/1/2020	20,439	58,577
885,200	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 14	12/2/2020	15,704	122,813
870,000	プット	OTC USD/TRY	Bank of America	USD 5.05	25/2/2020	29,891	108,138
16,440,000	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 20.75	15/4/2020	117,904	620,294
52,566,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1537	23/4/2020	649,864	2,138,229
11,710,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.115	23/7/2020	76,777	240,243
22,130,667	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.335	13/9/2019	(13,400)	14,264
443,000	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.5	2/9/2019	(72,594)	59
16,267,000	コール	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.95	3/9/2019	393,589	456,054
16,466,000	プット	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,125	3/9/2019	(23,299)	-
27,445,000	コール	OTC USD/CHF	BNP Paribas	USD 1.02	4/9/2019	(45,284)	1
25,700,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.11	10/9/2019	92,803	168,770
22,131,000	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 105	12/9/2019	(57,546)	57,536
22,131,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3375	13/9/2019	(72,470)	36,857
11,066,000	プット	OTC USD/CHF	BNP Paribas	USD 0.96	17/9/2019	(20,359)	7,129
324,000	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 103.5	20/9/2019	(51,262)	79,861

買建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
5,533,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.35	9/10/2019	(1,597)	11,743
3,903,500	プット	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4.08	29/10/2019	5,047	52,194
39,360,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.11	27/11/2019	115,129	499,046
29,300,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.11	20/12/2019	(50,893)	2,134
664,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.05	27/1/2020	5,838	46,680
664,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.05	27/1/2020	14,006	46,680
650,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14	12/2/2020	12,182	90,182
21,650,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.115	10/9/2019	(3,991)	24,128
11,260,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.5	30/9/2019	(13,348)	276
3,710,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.75	4/10/2019	(35,940)	18,910
22,131,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 110	5/11/2019	(1,366)	33,269
28,000,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 103	13/11/2019	(41,941)	881,639
11,065,000	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1.01	4/9/2019	(13,666)	43
44,262,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.15	6/9/2019	(4,906)	-
11,065,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.5	12/9/2019	(14,402)	34,860
5,828,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20	12/9/2019	22,758	68,694
16,598,000	プット	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.96	17/9/2019	(24,114)	10,692
64,925,000	プット	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.27	20/9/2019	(84,509)	348
7,798,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4	25/9/2019	(10,271)	11,664
13,140,000	プット	OTC EUR/BRL	Deutsche Bank	EUR 4.15	26/9/2019	(108,306)	657
3,319,500	コール	OTC EUR/BRL	Deutsche Bank	EUR 4.3	26/9/2019	(3,244)	237,456
7,801,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 105	26/9/2019	(1,762)	11,648
7,383,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.93	7/10/2019	(76,879)	15,475
5,849,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 66.25	18/10/2019	4,779	61,660
22,131,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.4	30/10/2019	(2,762)	35,082
609,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.5	30/10/2019	(13,515)	51,039
17,354,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.9	7/11/2019	7,863	55,118
33,196,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 62	20/11/2019	1,052	19,675
22,131,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 65	20/11/2019	3,487	140,810
11,065,000	プット	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 5.4	2/9/2019	(32,409)	-
22,131,000	プット	OTC EUR/BRL	Goldman Sachs	EUR 4.15	26/9/2019	(160,026)	1,106
43,450,000	プット	OTC EUR/GBP	Goldman Sachs	EUR 0.88	22/1/2020	154,074	481,450
14,664,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 105.05	12/9/2019	(102,008)	39,587
22,131,000	コール	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 20	12/9/2019	73,252	260,857
22,131,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 105.5	26/9/2019	(45,926)	149,364
19,918,000	プット	OTC AUD/USD	HSBC Bank Plc	AUD 0.68	11/10/2019	88,635	205,803
11,065,000	プット	OTC USD/CAD	HSBC Bank Plc	USD 1.3	25/10/2019	5,533	25,173
32,355,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.85	25/10/2019	39,602	58,754
10,800,000	プット	OTC USD/BRL	HSBC Bank Plc	USD 3.7	7/11/2019	(13,471)	5,289
48,714,000	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,125	3/9/2019	(75,020)	-
22,131,000	コール	OTC EUR/NZD	JP Morgan	EUR 1.7	20/9/2019	637,646	718,876
217,000	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.3	30/9/2019	5,908	33,250
23,375,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.75	30/9/2019	(159,261)	2,260
19,918,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.75	30/9/2019	(124,952)	1,926
18,460,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	30/9/2019	(42,005)	453
17,704,000	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.69	11/10/2019	211,379	311,217

買建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
13,278,000	コール	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.73	11/10/2019	(8,019)	155
22,131,000	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.1	6/11/2019	(11,178)	51,342
5,533,000	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.15	6/11/2019	(7,480)	66,883
28,026,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.65	22/11/2019	(254,753)	12,615
11,677,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.4	22/11/2019	(10,936)	157
19,014,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1067	29/4/2020	26,881	293,455
6,640,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19.25	12/9/2019	(8,049)	915
10,850,000	プット	OTC EUR/BRL	Morgan Stanley	EUR 4.04	26/9/2019	(4,565)	45
3,319,500	コール	OTC EUR/BRL	Morgan Stanley	EUR 4.3	26/9/2019	186,738	237,456
19,918,000	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.975	9/10/2019	(53,040)	98,556
11,065,000	プット	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.61	11/10/2019	(50,727)	44,488
9,959,000	コール	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.625	11/10/2019	57,324	189,095
43,120,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 110	18/10/2019	(545)	40,419
33,196,000	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.125	23/10/2019	(33,224)	28,397
22,131,000	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.125	23/10/2019	(17,142)	18,931
3,903,500	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.08	29/10/2019	5,558	52,194
13,278,000	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.95	27/11/2019	(15,437)	57,539
6,471,000	プット	OTC EUR/CAD	Morgan Stanley	EUR 1.4405	27/1/2020	6,897	47,170
4,900,000	プット	OTC EUR/USD	RBS Plc	EUR 1.11	8/11/2019	21,787	58,175
22,131,000	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.35	13/9/2019	(9,786)	11,216
33,196,000	コール	OTC USD/CAD	UBS	USD 1.35	25/9/2019	(58,467)	41,818
6,974,000	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.115	11/10/2019	37,787	87,590
22,318	コール	S&P 500 Index	Goldman Sachs	USD 2,850	20/12/2019	(292,607)	672,055
1,748	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	13/12/2019	(144,874)	10,925
1,918	プット	3 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	13/9/2019	(135,718)	11,987
1,460	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 4.5	20/9/2019	(30,997)	8,064
1,095	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 4.4	20/9/2019	(23,248)	7,862
365	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 4.8	18/10/2019	(9,368)	3,226
730	コール	American Airlines Group Inc	Exchange Traded	USD 35	20/12/2019	(145,355)	15,330
445	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 195	17/1/2020	634,717	1,046,862
2,575	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 28	18/10/2019	14,832	198,275
6,099	コール	Caesars Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 12	17/1/2020	(210,175)	121,980
329	プット	Caesars Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 10	17/1/2020	(3,685)	3,290
7,644	コール	Caesars Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 12	15/1/2021	(203,830)	707,070
357	プット	Casino Guichard Perrachon SA	Exchange Traded	EUR 28	18/10/2019	(38,080)	27,210
289	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	18/9/2019	5,433	18,063
55	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 25	18/9/2019	(1,559)	3,025
1,438	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 67.5	18/10/2019	17,693	181,907
175	プット	CommScope Holding Co Inc	Exchange Traded	USD 10	15/11/2019	640	13,125
981	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 12,000	20/9/2019	334,017	801,895
1,610	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 13,700	20/12/2019	(492,153)	42,238

買建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
144	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 13,300	20/12/2019	(58,834)	14,356
288	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 14,000	20/3/2020	(118,021)	20,758
107	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 13,600	20/3/2020	(42,780)	22,014
150	プット	Dell Technologies Inc	Exchange Traded	USD 45	20/9/2019	(20,205)	3,375
580	コール	Delta Air Lines Inc	Exchange Traded	USD 65	20/12/2019	(105,075)	58,580
1,323	コール	Emerson Electric Co	Exchange Traded	USD 65	17/1/2020	(163,324)	198,450
731	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 173	25/10/2019	(294,810)	246,283
1,812	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,450	20/9/2019	322,975	764,607
211	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,150	20/9/2019	(113,009)	10,721
164	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,300	20/9/2019	(120,495)	28,080
144	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,650	20/9/2019	(34,239)	477
712	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,600	18/10/2019	(184,300)	72,358
5,623	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,850	20/12/2019	(456,687)	136,649
242	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,750	20/12/2019	(38,700)	21,920
100	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,800	20/12/2019	(15,379)	4,860
575	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,900	20/3/2020	(77,295)	44,144
259	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,600	20/3/2020	(50,148)	183,676
214	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,800	20/3/2020	(35,779)	38,768
1,261	コール	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 105	20/9/2019	(220,239)	3,482
536	コール	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 85	20/9/2019	(14,334)	18,503
500	コール	EURO STOXX Banks Index	Exchange Traded	EUR 97.5	20/9/2019	(30,599)	1,381
2,900	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99	11/10/2019	(40,297)	18,125
1,557	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 98.5	11/10/2019	(75,522)	63,253
3,421	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.75	16/3/2020	5,318,697	5,901,225
250	プット	Ford Motor Co	Exchange Traded	USD 9	27/9/2019	(3,200)	4,250
150	プット	General Electric Co	Exchange Traded	USD 7	20/12/2019	(780)	5,700
256	プット	Kellogg Co	Exchange Traded	USD 57.5	17/1/2020	(55,466)	37,760
200	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 15	20/3/2020	(14,940)	6,500
1,470	コール	Lowe's Cos Inc	Exchange Traded	USD 100	17/1/2020	1,458,191	2,296,875
817	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 150	18/10/2019	(59,386)	53,513
553	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 130	17/1/2020	430,123	757,610
75	コール	Mylan NV	Exchange Traded	USD 20	20/9/2019	(446)	6,000
20	コール	NASDAQ 100 Stock Index	Exchange Traded	USD 7,875	18/10/2019	56,261	280,100
30	プット	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 250	18/10/2019	(850)	11,775
607	プット	Occidental Petroleum Corp	Exchange Traded	USD 37.5	20/9/2019	(6,798)	5,766
5,933	コール	Pfizer Inc	Exchange Traded	USD 42	20/9/2019	(452,100)	5,933
125	コール	QUALCOMM Inc	Exchange Traded	USD 80	20/9/2019	5,662	13,438
1,323	コール	QUALCOMM Inc	Exchange Traded	USD 70	17/1/2020	608,646	1,336,230

買建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
89	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,900	20/9/2019	(161,255)	275,455
35	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,725	20/9/2019	(6,749)	23,800
135	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	6/9/2019	(1,714)	2,902
50	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	13/9/2019	(5,285)	3,825
50	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 277	16/9/2019	(7,372)	3,200
2,016	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 302	20/9/2019	56,263	144,144
1,008	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 296	20/9/2019	129,326	295,848
453	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 303	20/9/2019	(157,055)	24,235
3,401	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	20/12/2019	(1,623,410)	2,348,391
10	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	20/12/2019	2,808	9,750
294	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 315	31/12/2019	(48,325)	51,597
2,160	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 325	30/6/2020	(247,456)	780,840
2,806	コール	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd Teva	Exchange Traded	USD 46	17/1/2020	(76,323)	392,840
500	プット	Pharmaceutical Industries Ltd Teva	Exchange Traded	USD 6	18/10/2019	(5,350)	17,250
200	プット	Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 7	18/10/2019	460	15,100
218	コール	Unicredit SpA	Exchange Traded	EUR 12	20/12/2019	(62,104)	23,358
387	コール	United Airlines Holdings Inc	Exchange Traded	USD 100	20/12/2019	(128,991)	29,992
59	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131.5	6/9/2019	4,981	19,820
59	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 132.5	6/9/2019	(11,152)	4,609
858	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131	20/9/2019	45,618	341,860
57	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130	20/9/2019	(20,571)	8,016
10	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130	25/10/2019	(1,031)	3,984
218	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 132	22/11/2019	(36,097)	223,109
200	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 141	13/9/2019	(240)	20,300
65	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 141	20/9/2019	4,241	9,913
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,878,850,020米ドル)						4,173,396	38,305,981

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション 2019年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(32,534,000)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.084	3/9/2019	39,292	(75)
(11,065,000)	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 1.01	4/9/2019	4,161	(43)
(16,598,000)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.11	6/9/2019	(63,975)	(100,158)
(66,392,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.15	6/9/2019	54,637	-
(25,700,000)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.11	10/9/2019	(35,116)	(168,770)
(14,664,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105.05	12/9/2019	54,820	(39,587)
(27,664,000)	プット	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.96	17/9/2019	53,608	(17,821)
(115,053,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 104.5	19/9/2019	(14,819)	(354,225)
(114,773,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 103.75	26/9/2019	54,380	(306,582)
(664,000)	プット	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.69	11/10/2019	(6,392)	(11,672)
(13,278,000)	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.73	11/10/2019	13,508	(155)
(9,959,000)	コール	OTC EUR/AUD	Bank of America	EUR 1.625	11/10/2019	91,623	(189,096)
(11,065,000)	プット	OTC EUR/AUD	Bank of America	EUR 1.61	11/10/2019	155,224	(44,489)
(8,797,000)	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 19.65	30/10/2019	(4,893)	(56,663)
(38,729,000)	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 13.9	5/11/2019	118,229	(68,058)
(27,664,000)	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 3.7	7/11/2019	52,958	(13,546)
(32,480,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.17	8/11/2019	62,320	(23,505)
(94,702,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.16	20/1/2020	481,820	(172,639)
(6,471,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.155	27/1/2020	24,986	(13,731)
(13,278,000)	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.4	2/9/2019	44,171	-
(324,000)	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 103.5	3/9/2019	80,242	(3,998)
(27,663,500)	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 104	12/9/2019	48,099	(33,608)
(5,828,000)	コール	OTC USD/MXN	BNP Paribas	USD 20.2	12/9/2019	(9,166)	(41,366)
(13,280,000)	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.32	13/9/2019	15,420	(32,388)
(33,196,000)	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.35	13/9/2019	62,847	(16,824)
(332,000)	プット	OTC USD/CHF	BNP Paribas	USD 0.955	17/9/2019	44,596	(7,860)
(14,272,000)	プット	OTC USD/CHF	BNP Paribas	USD 0.975	17/9/2019	125,316	(31,236)
(18,924,000)	プット	OTC USD/CHF	BNP Paribas	USD 0.975	17/9/2019	73,017	(41,418)
(33,196,000)	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.35	25/9/2019	8,806	(41,818)
(1,952,000)	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4.3	29/10/2019	3,825	(22,490)
(3,903,500)	プット	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.92	29/10/2019	(2,867)	(14,497)
(5,565,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.4	4/10/2019	28,876	(10,614)
(28,000,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 98	13/11/2019	39,609	(2,067,112)
(11,065,000)	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1	4/9/2019	33,914	(1,760)
(3,320,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20	12/9/2019	5,146	(39,133)
(2,924,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 66	20/9/2019	1,080	(15,903)
(3,942,000)	コール	OTC EUR/BRL	Deutsche Bank	EUR 4.3	26/9/2019	(218,164)	(281,985)
(13,140,000)	プット	OTC EUR/BRL	Deutsche Bank	EUR 4.05	26/9/2019	36,917	(70)
(14,646,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 106.25	26/9/2019	(20,526)	(109,295)
(3,692,000)	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4.2	7/10/2019	(25,655)	(50,813)
(7,383,000)	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.8	7/10/2019	22,522	(2,580)
(2,924,000)	コール	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 70	18/10/2019	5,461	(13,261)
(22,131,000)	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.5	30/10/2019	3,573	(66,693)
(3,095,000)	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4.1	7/11/2019	(52,334)	(98,140)
(33,196,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 64	20/11/2019	(5,798)	(107,212)

売建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(443,000)	プット	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 5.5	2/9/2019	154,205	(59)
(6,639,000)	コール	OTC EUR/BRL	Goldman Sachs	EUR 4.3	26/9/2019	(363,702)	(474,912)
(22,131,000)	プット	OTC EUR/BRL	Goldman Sachs	EUR 4.04	26/9/2019	47,078	(92)
(16,267,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.95	3/9/2019	(335,679)	(456,054)
(21,996,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102.5	12/9/2019	62,039	(7,952)
(11,065,000)	プット	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 19.25	12/9/2019	34,437	(1,524)
(33,196,000)	コール	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 20.5	12/9/2019	11,107	(104,581)
(11,065,000)	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 107	26/9/2019	1,717	(48,739)
(27,664,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 104.5	26/9/2019	45,098	(111,574)
(17,040,000)	プット	OTC AUD/USD	HSBC Bank Plc	AUD 0.69	11/10/2019	(118,685)	(299,545)
(4,900,000)	プット	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.11	8/11/2019	(11,737)	(58,175)
(29,038,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	30/9/2019	93,081	(712)
(38,729,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	30/9/2019	113,688	(950)
(33,196,000)	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.68	11/10/2019	(239,667)	(342,999)
(8,852,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.1	6/11/2019	(37,306)	(140,709)
(8,758,000)	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.95	22/11/2019	(406,328)	(515,278)
(35,032,000)	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.5	22/11/2019	83,933	(2,246)
(6,861,000)	コール	OTC EUR/NZD	Morgan Stanley	EUR 1.7	20/9/2019	(195,057)	(222,864)
(15,270,000)	コール	OTC EUR/NZD	Morgan Stanley	EUR 1.7	20/9/2019	(415,750)	(496,012)
(6,639,000)	プット	OTC EUR/BRL	Morgan Stanley	EUR 4.15	26/9/2019	52,917	(332)
(38,729,000)	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.965	9/10/2019	56,993	(109,425)
(11,063,000)	コール	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.64	11/10/2019	(46,571)	(145,898)
(11,065,000)	プット	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.6	11/10/2019	37,491	(30,774)
(11,065,000)	プット	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.625	11/10/2019	6,958	(75,950)
(11,065,000)	コール	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.655	11/10/2019	(3,330)	(97,998)
(33,196,000)	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.14	23/10/2019	12,378	(7,594)
(1,952,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.3	29/10/2019	1,506	(22,490)
(3,903,500)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.92	29/10/2019	(3,762)	(14,497)
(6,471,000)	コール	OTC EUR/CAD	Morgan Stanley	EUR 1.5295	27/1/2020	5,910	(30,961)
(16,440,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20.75	15/4/2020	(128,738)	(620,294)
(2,400,000)	コール	OTC EUR/USD	RBS Plc	EUR 1.135	8/11/2019	21,552	(9,159)
(22,131,000)	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.3375	13/9/2019	27,898	(36,857)
(5,533,000)	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.27	20/9/2019	8,104	(30)
(5,533,000)	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.35	9/10/2019	250	(11,743)
(3,487,000)	コール	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.137	11/10/2019	16,954	(4,558)
(5,230,000)	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.095	11/10/2019	(7,732)	(21,025)
(1,279)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.625	13/9/2019	149,310	(7,994)
(1,748)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.375	13/12/2019	51,776	(10,925)
(9,357)	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.375	13/12/2019	(6,690,466)	(9,298,519)
(23)	プット	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 1,040	18/10/2019	19,846	(10,235)
(12)	プット	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 1,550	18/10/2019	18,872	(10,620)
(504)	プット	Apple Inc	Exchange Traded	USD 192.5	20/9/2019	68,598	(66,528)
(1,008)	プット	Apple Inc	Exchange Traded	USD 197.5	20/9/2019	57,741	(202,608)

売建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(80)	プット	Apple Inc	Exchange Traded	USD 175	18/10/2019	19,220	(9,520)
(445)	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 220	17/1/2020	(290,491)	(431,650)
(232)	コール	BAE Systems Holdings Inc	Exchange Traded	GBP 5	20/9/2019	(97,880)	(136,026)
(2,725)	プット	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 25	20/9/2019	113,384	(28,613)
(6,902)	プット	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 29	20/9/2019	(629,850)	(1,187,144)
(50)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 30	18/9/2019	840	(1,500)
(2,146)	プット	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 55	20/9/2019	115,216	(18,241)
(4,014)	プット	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 67.5	20/9/2019	(820,387)	(1,334,655)
(108)	プット	Dax Index	Exchange Traded	EUR 11,100	20/9/2019	39,282	(12,467)
(873)	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 12,300	20/9/2019	(73,123)	(160,322)
(1,323)	コール	Emerson Electric Co	Exchange Traded	USD 75	17/1/2020	43,062	(19,845)
(9,400)	コール	Engie SA	Exchange Traded	EUR 13.61	20/9/2019	(18,648)	(40,496)
(211)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,000	20/9/2019	52,613	(3,962)
(336)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,200	20/9/2019	113,234	(24,868)
(1,640)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,550	20/9/2019	(37,376)	(79,710)
(2,878)	プット	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.875	16/12/2019	497,865	(323,775)
(3,421)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.875	16/3/2020	(4,452,534)	(4,917,687)
(150)	プット	General Electric Co	Exchange Traded	USD 4	20/12/2019	45	(825)
(1,412)	コール	Iberdrola SA	Exchange Traded	EUR 8.75	20/9/2019	(62,257)	(102,943)
(571)	プット	Intel Corp	Exchange Traded	USD 40	18/10/2019	15,889	(11,991)
(2,896)	プット	JPMorgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 110	20/9/2019	(109,598)	(609,608)
(4,344)	コール	Koninklijke Philips NV	Exchange Traded	EUR 2.8	20/9/2019	(21,268)	(52,784)
(1,470)	コール	Lowe's Cos Inc	Exchange Traded	USD 115	17/1/2020	(662,243)	(911,400)
(150)	プット	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 120	18/10/2019	19,394	(9,675)
(553)	プット	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 105	17/1/2020	149,195	(54,194)
(553)	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 140	17/1/2020	(258,365)	(420,280)
(132)	コール	National Grid Plc	Exchange Traded	GBP 8.5	20/9/2019	(4,174)	(35,876)
(30)	プット	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 210	18/10/2019	463	(2,370)
(906)	コール	Orange SA	Exchange Traded	EUR 14	20/9/2019	24,806	(12,009)
(5,933)	コール	Pfizer Inc	Exchange Traded	USD 44	20/9/2019	182,539	(5,933)
(125)	コール	QUALCOMM Inc	Exchange Traded	USD 85	20/9/2019	(712)	(2,063)
(190)	プット	QUALCOMM Inc	Exchange Traded	USD 60	18/10/2019	23,901	(4,370)
(1,323)	コール	QUALCOMM Inc	Exchange Traded	USD 85	17/1/2020	(126,285)	(341,995)
(14)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,700	20/9/2019	34,567	(7,490)
(35)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,825	20/9/2019	15,998	(57,575)
(75)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,800	20/9/2019	88,532	(99,375)
(272)	コール	Snam SpA	Exchange Traded	EUR 4.6	20/9/2019	2,212	(34,628)
(135)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 268	6/9/2019	7,232	(742)
(50)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 270	13/9/2019	1,606	(1,325)
(407)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 281	13/9/2019	52,019	(35,002)

売建オプション 2019年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(407)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	13/9/2019	(56,859)	(110,500)
(50)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 267	16/9/2019	2,707	(1,125)
(2,160)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	30/6/2020	(265,228)	(1,466,640)
(2,806)	コール	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Exchange Traded	USD 50	17/1/2020	17,674	(147,315)
(1,738)	コール	Telefonica SA	Exchange Traded	EUR 7.42	20/9/2019	24,781	(1,939)
(3,230)	コール	Telia Co AB	Exchange Traded	SEK 42	20/9/2019	(15,517)	(39,508)
(144)	プット	Texas Instruments Inc	Exchange Traded	USD 105	18/10/2019	18,965	(7,848)
(1,716)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 129.5	20/9/2019	(29,421)	(134,063)
(200)	コール	Walt Disney Co/The Exchange	Exchange Traded	USD 147	13/9/2019	1,460	(2,200)
(65)	コール	Walt Disney Co/The Exchange	Exchange Traded	USD 147	20/9/2019	(627)	(1,918)
(1,872)	プット	Wells Fargo & Co	Exchange Traded	USD 45	20/9/2019	63,589	(80,496)
(248)	プット	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 42.5	18/10/2019	19,170	(7,564)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,281,663,282米ドル)						(12,529,158)	(32,410,930)

シンセティック・キャップ・オプション 2019年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
790,590,000	プット	USD - 2 Year Constant Maturity Swap	Citibank	USD 0.50	13/3/2020	(181,203)	123,174
591,000,000	プット	USD - 10 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.40	31/3/2020	(302,114)	191,372
1,079,632,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.21	29/5/2020	(535,174)	1,138,256
(1,079,632,000)	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.71	29/5/2020	368,943	(116,892)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,540,854,000米ドル)						(649,548)	1,335,910

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2019年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価 益/(損) (米ドル)
	フランス		
14,301	BNP Paribas SA	Merrill Lynch	22,827
(10,730)	Casino Guichard-Perrachon SA	Merrill Lynch	(41,840)
16,423	Credit Agricole SA	Merrill Lynch	9,071
			<u>(9,942)</u>
	ドイツ		
114,728	Tele Columbus AG	Merrill Lynch	(9,252)
			<u>(9,252)</u>
	イタリア		
1,648,821	Telecom Italia SpA/Milano	Merrill Lynch	76,132
			<u>76,132</u>
	ルクセンブルグ		
38,578	SES SA	Merrill Lynch	38,992
			<u>38,992</u>
	オランダ		
99,144	ALTICE EUROPE NV	Merrill Lynch	10,185
			<u>10,185</u>
	スペイン		
266,445	Banco de Sabadell SA	Merrill Lynch	15,481
59,305	CaixaBank SA	Merrill Lynch	3,865
			<u>19,346</u>
	英国		
60,038	AA Plc	Merrill Lynch	697
256,123	Arrow Global Group Plc	Merrill Lynch	13,140
32,066	International Game Technology Plc	Merrill Lynch	25,332
(262,866)	Tullow Oil Plc	Merrill Lynch	(16,055)
			<u>23,114</u>
	米国		
24,380	AMC Entertainment Holdings Inc	Merrill Lynch	8,289
			<u>8,289</u>
	合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 6,265,618米ドル)		<u>156,864</u>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップシヨ 2019年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 330,290,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.25%の固定金利を12/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/11/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	10/8/2020	405,249	2,056,699
USD 57,865,931	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.08%の固定金利を17/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	432,814	953,394
USD 57,865,931	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に受け取り、2.08%の固定金利を17/2/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	(262,828)	235,171
EUR 51,700,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.31.V2の変動金利を20/6/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	18/9/2019	62,552	95,548
USD 324,920,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.5%の固定金利を3/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	1/6/2020	1,558,405	2,534,600
USD 26,767,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.6%の固定金利を15/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	784,530	1,934,708
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	825,712	1,170,171
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(337,382)	7,076
USD 39,820,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2021より四半期毎に受け取り、3.8%の固定金利を9/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	(1,456,218)	97,229
USD 33,330,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に受け取り、1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	(310,104)	823,116
USD 33,330,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	453,859	1,587,079

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 33,070,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/11/2022より四半期毎に受け取り、2.25%の固定金利を10/2/2023より半年毎に支払う。	Barclays	8/8/2022	(304,069)	478,863
USD 32,040,500	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に受け取り、2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	(1,147,063)	325,999
USD 32,040,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	3,022,929	4,495,991
USD 32,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に受け取り、2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	(1,106,947)	337,256
USD 32,040,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	2,980,874	4,425,077
USD 9,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を30/4/2029より四半期毎に受け取り、3.0825%の固定金利を31/7/2029より半年毎に支払う。	Barclays	29/1/2029	(314,084)	197,116
USD 9,000,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.0825%の固定金利を31/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を30/4/2029より四半期毎に支払う。	Barclays	29/1/2029	753,744	1,264,944
USD 1,250,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.32.V2の変動金利を20/6/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Citibank	18/9/2019	(2,610)	966
USD 9,612,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.85%の固定金利を7/5/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/2/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	5/11/2019	537,563	835,535
USD 145,090,524	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/2/2020より四半期毎に受け取り、1.555%の固定金利を8/5/2020より半年毎に支払う。	Citibank	6/11/2019	(414,395)	311,058
EUR 129,838,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を13/7/2020より半年毎に受け取り、0.25%の固定金利を13/1/2021より毎年支払う。	Citibank	9/1/2020	(1,074,415)	204,234

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 16,760,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を20/5/2020より四半期毎に受け取り、1.405%の固定金利を20/8/2020より半年毎に支払う。	Citibank	18/2/2020	(45,933)	286,753
USD 16,760,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.405%の固定金利を20/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を20/5/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	18/2/2020	30,527	363,213
USD 83,180,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.521%の固定金利を28/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/5/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	4,202,168	5,117,148
USD 83,180,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/5/2020より四半期毎に受け取り、2.521%の固定金利を28/8/2020より半年毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	(909,232)	5,748
USD 33,510,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に受け取り、1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	(96,599)	1,102,640
USD 33,510,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	83,879	1,283,118
USD 20,387,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2028より四半期毎に支払う。	Citibank	27/6/2028	1,673,911	2,825,895
EUR 41,300,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.31.V1の変動金利を20/6/2019より四半期毎に支払う。	Citigroup	18/9/2019	(29,903)	25,129
EUR 9,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.31.V1の変動金利を20/6/2019より四半期毎に支払う。	Citigroup	18/9/2019	(14,538)	16,961
EUR 10,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.31.V1の変動金利を20/6/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Citigroup	18/9/2019	(58,318)	12,129
EUR 45,310,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.EUR.31.V2の変動金利を20/6/2019より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Citigroup	18/9/2019	(25,692)	26,466

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 18,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/5/2020より四半期毎に受け取り、4%の固定金利を5/8/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/2/2020	(361,481)	34
USD 50,275,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.459%の固定金利を25/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/5/2020より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/2/2020	261,486	1,221,738
USD 50,275,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/5/2020より四半期毎に受け取り、1.459%の固定金利を25/8/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/2/2020	(218,879)	741,373
USD 34,930,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/8/2022より四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(1,659,515)	190,303
EUR 39,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1TRAXX.EUR.31.V2の変動金利を20/6/2019より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	JP Morgan	18/9/2019	(182,243)	2,370
USD 162,480,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/2/2020より四半期毎に受け取り、2.1%の固定金利を5/5/2020より半年毎に支払う。	JP Morgan	1/11/2019	(52,718)	22,835
USD 50,275,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.41%の固定金利を2/9/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/6/2020より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/2/2020	139,424	1,119,787
USD 50,275,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/6/2020より四半期毎に受け取り、1.41%の固定金利を2/9/2020より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/2/2020	(106,605)	873,758
JPY 1,184,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	(344,439)	25,848
JPY 1,184,200,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	1,096,819	1,466,950
USD 32,780,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に受け取り、2.25%の固定金利を4/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	(413,465)	471,595

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 28,838,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に受け取り、3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	(1,031,821)	547,060
USD 28,838,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	2,686,984	4,265,865
USD 2,255,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(29,013)	76,972
USD 2,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に受け取り、2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	183,018	289,003
USD 8,077,500	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に受け取り、2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(100,253)	299,382
USD 8,077,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	641,669	1,041,303
USD 147,902,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.26%の固定金利を25/4/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/1/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	23/10/2019	6,090,696	6,808,021
USD 186,700,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.09%の固定金利を2/6/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/3/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	13,812,790	16,216,553
USD 186,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/3/2020より四半期毎に受け取り、3.09%の固定金利を2/6/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	(2,403,748)	15
USD 100,506,881	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/3/2020より四半期毎に受け取り、1.53%の固定金利を2/6/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	(1,960)	299,561
USD 40,016,629	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/3/2020より四半期毎に受け取り、1.53%の固定金利を2/6/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	(780)	119,270

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(333,833)	7,257
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	829,081	1,170,170
USD 32,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に受け取り、2.5%の固定金利を17/12/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	(859,177)	581,288
USD 32,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/9/2024より四半期毎に受け取り、2.5%の固定金利を24/12/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	20/6/2024	(711,186)	584,201
USD 8,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に受け取り、3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	(307,739)	201,171
USD 8,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	719,437	1,228,346
USD 41,020,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/8/2022より四半期毎に受け取り、2.85%の固定金利を11/11/2022より半年毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	(1,791,906)	589,866
USD 8,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に受け取り、3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	(307,886)	200,576
USD 8,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	721,516	1,229,978
USD 360,985,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/8/2020より四半期毎に受け取り、2.0925%の固定金利を15/11/2020より半年毎に支払う。	UBS	13/5/2020	(796,932)	87,481
USD 360,985,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.0925%の固定金利を15/11/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/8/2020より四半期毎に支払う。	UBS	13/5/2020	1,950,391	2,834,804

買建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 25,190,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を20/7/2028より半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(1,277,503)	393,232
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,765,059,187米ドル)				25,738,615	80,644,996

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建スワップション 2019年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (182,960,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	(4,786,144)	(6,057,716)
USD (182,960,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に受け取り、21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	1,267,966	(3,606)
USD (15,640,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/2/2021より1.75%の固定金利を半年毎に受け取り、11/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	7/8/2020	101,165	(161,978)
USD (660,570,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/2/2021より0.75%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	10/8/2020	(406,726)	(1,769,152)
USD (289,329,655)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/2/2021より1.88%の固定金利を半年毎に受け取り、17/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	291,938	(261,415)
USD (289,329,655)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/2/2021より0.88%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	(339,980)	(972,127)
USD (41,960,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/2/2021より1.65%の固定金利を半年毎に受け取り、21/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	19/8/2020	152,080	(575,926)
USD (41,960,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/2/2021より1.25%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	19/8/2020	(208,584)	(936,590)
USD (784,851,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/4/2021より3.55%の固定金利を半年毎に受け取り、7/1/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	5/10/2020	3,934,199	(39,109)
USD (627,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/4/2021より3.75%の固定金利を半年毎に受け取り、15/1/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	13/10/2020	2,247,588	(25,541)
EUR (35,890,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/6/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、16/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Bank of America	14/6/2021	83,358	(15,779)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (22,282,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/3/2020より2.65%の固定金利を半年毎に受け取り、25/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	23/9/2019	158,763	-
USD (105,490,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	369,193	(22)
USD (121,140,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/5/2020より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、15/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	13/11/2019	420,755	(88)
USD (24,030,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/6/2020より1.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	10/12/2019	(1,054,009)	(1,228,828)
USD (24,030,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/6/2020より2.4%の固定金利を半年毎に受け取り、12/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	10/12/2019	173,397	(1,421)
EUR (91,060,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/1/2021より0.2%の固定金利を毎年受け取り、27/7/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	23/1/2020	106,584	(26)
USD (366,760,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	3/2/2020	1,642,663	(422)
USD (649,830,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3/12/2020より1%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	1/6/2020	(1,155,721)	(2,045,808)
USD (42,680,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/12/2020より2.203%の固定金利を半年毎に受け取り、15/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	838,879	(92,078)
USD (42,680,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、15/12/2020より2.203%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	(2,520,665)	(3,451,622)
USD (32,120,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/12/2020より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、15/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	392,286	(39,085)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (59,910,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/7/2021より0%の固定金利を毎年受け取り、29/1/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	27/7/2020	111,778	(57,397)
USD (17,740,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/2/2021より2%の固定金利を半年毎に受け取り、5/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	3/8/2020	179,801	(84,525)
USD (33,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/2/2021より1.605%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	13/8/2020	(457,815)	(1,276,483)
USD (33,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/2/2021より1.605%の固定金利を半年毎に受け取り、17/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	13/8/2020	317,702	(500,967)
USD (167,860,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは26/2/2021より3.5%の固定金利を半年毎に受け取り、26/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	24/8/2020	561,460	(5,068)
EUR (72,540,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/12/2021より0.55%の固定金利を毎年受け取り、23/6/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	21/12/2020	262,025	(787)
USD (48,060,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/9/2021より2.7875%の固定金利を半年毎に受け取り、10/6/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	1,328,775	(104,028)
USD (48,060,500)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/6/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、10/9/2021より2.7875%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	(4,952,582)	(6,385,386)
EUR (155,850,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/3/2022より0.1%の固定金利を毎年受け取り、30/9/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	29/3/2021	512,725	(30,024)
EUR (241,430,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/4/2022より0.12%の固定金利を毎年受け取り、12/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/4/2021	873,420	(45,177)
EUR (28,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/5/2022より2%の固定金利を毎年受け取り、6/11/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	4/5/2021	692,026	(11,083)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (79,776,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/5/2022より0.11%の固定金利を毎年受け取り、19/11/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	17/5/2021	244,896	(19,255)
USD (519,130,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/12/2021より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、1/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	27/5/2021	1,153,938	(302,222)
USD (84,340,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは9/12/2021より3.87%の固定金利を半年毎に受け取り、9/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	1,576,817	(75,468)
EUR (79,370,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/6/2022より0.05%の固定金利を毎年受け取り、14/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	10/6/2021	171,733	(27,819)
EUR (34,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/6/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、16/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	14/6/2021	80,023	(15,379)
EUR (41,760,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/7/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、5/1/2022より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	1/7/2021	66,829	(19,734)
EUR (40,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/7/2022より-0.05%の固定金利を毎年受け取り、7/1/2022より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	2/7/2021	62,454	(23,773)
EUR (42,580,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/7/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、21/1/2022より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	19/7/2021	56,253	(21,627)
EUR (95,440,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/8/2022より-0.15%の固定金利を毎年受け取り、11/2/2022より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	38,382	(94,040)
EUR (53,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/8/2022より-0.15%の固定金利を毎年受け取り、11/2/2022より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	19,857	(53,021)
USD (33,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/2/2023より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、10/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	8/8/2022	150,032	(248,461)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (33,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/2/2023より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、10/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	8/8/2022	48,563	(148,204)
USD (25,410,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/6/2029より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、14/9/2029より3.05%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	(2,163,560)	(3,511,560)
USD (25,410,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/9/2029より3.05%の固定金利を半年毎に受け取り、14/6/2029より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	773,419	(574,581)
USD (39,209,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、6/3/2020より2.01%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	4/9/2019	(1,970,810)	(2,306,047)
USD (39,209,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/3/2020より2.21%の固定金利を半年毎に受け取り、6/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	4/9/2019	347,000	-
USD (39,209,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは9/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、9/3/2020より2.015%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	5/9/2019	(1,973,440)	(2,326,321)
USD (39,209,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは9/3/2020より2.215%の固定金利を半年毎に受け取り、9/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	5/9/2019	341,118	-
USD (40,207,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/1/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/4/2020より1.78%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	30/9/2019	(1,285,619)	(1,522,643)
USD (33,171,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/1/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/4/2020より1.54%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	30/9/2019	(269,577)	(393,246)
USD (145,090,524)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/5/2020より1.655%の固定金利を半年毎に受け取り、8/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	6/11/2019	284,698	(179,592)
USD (145,090,524)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/5/2020より1.755%の固定金利を半年毎に受け取り、8/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	6/11/2019	208,871	(95,819)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (16,760,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/5/2020より1.41%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	15/11/2019	(5,667)	(258,743)
USD (16,760,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/5/2020より1.41%の固定金利を半年毎に受け取り、19/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	15/11/2019	48,080	(204,996)
USD (37,392,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/7/2020より1.69%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	30/12/2019	(1,063,693)	(1,345,571)
USD (36,186,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/7/2020より1.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	30/12/2019	(317,585)	(493,222)
EUR (129,838,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは13/1/2021より0.5%の固定金利を毎年受け取り、13/7/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	9/1/2020	260,547	(74,121)
USD (200,940,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/8/2020より2.46%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	(3,808,862)	(4,694,505)
USD (200,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/8/2020より2.46%の固定金利を半年毎に受け取り、28/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	877,619	(8,024)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/12/2020より2.3%の固定金利を半年毎に受け取り、17/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	15/6/2020	435,490	(52,161)
USD (33,510,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/2/2021より1.42%の固定金利を半年毎に受け取り、19/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	17/8/2020	102,521	(768,739)
USD (33,510,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/2/2021より1.42%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	17/8/2020	(97,537)	(968,797)
USD(126,680,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/6/2021より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、31/3/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	29/12/2020	446,066	(16,316)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/4/2022より0.1%の固定金利を毎年受け取り、14/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	12/4/2021	381,326	(25,391)
USD (386,970,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/11/2021より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、19/8/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	17/5/2021	610,275	(156,893)
EUR (42,120,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/6/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、23/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	21/6/2021	83,342	(19,071)
EUR (45,310,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/6/2019より1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.31.V2の変動金利を四半期毎に支払う。	Citigroup	18/9/2019	7,296	(7,786)
EUR (10,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/6/2019より5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.31.V1の変動金利を四半期毎に支払う。	Citigroup	18/9/2019	35,833	(3,203)
USD (588,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/3/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、16/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	12/9/2019	1,606,033	-
USD (116,035,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/5/2020より3.295%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/11/2019	(3,681,591)	(4,254,514)
USD (116,035,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/5/2020より3.295%の固定金利を半年毎に受け取り、12/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/11/2019	572,923	-
USD (111,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/8/2020より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	424,716	(127)
USD (112,110,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	454,308	(104)
USD (401,095,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/10/2020より1.5%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/4/2020	(581,510)	(1,130,695)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (401,095,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/10/2020より1.5%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/4/2020	(524,176)	(1,130,695)
USD (186,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に受け取り、16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	1,347,575	(4,390)
USD (186,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	(4,599,027)	(5,950,992)
USD (97,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/12/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	29/5/2020	710,078	(3,974)
USD (125,270,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/3/2020より3.3%の固定金利を半年毎に受け取り、10/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	6/9/2019	296,890	-
USD (86,498,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、27/3/2020より1.5%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/9/2019	(517,947)	(860,416)
USD (50,275,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/5/2020より1.463%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/11/2019	(221,806)	(933,197)
USD (50,275,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2020より1.463%の固定金利を半年毎に受け取り、25/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/11/2019	193,929	(517,462)
USD (72,417,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、30/6/2020より1.4%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/12/2019	(521,788)	(873,124)
USD (78,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/7/2020より2.8%の固定金利を半年毎に受け取り、7/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/1/2020	183,763	(167)
USD (401,095,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/10/2020より2.35125%の固定金利を半年毎に受け取り、8/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	6/4/2020	817,829	(36,504)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (401,095,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/10/2020より2.32%の固定金利を半年毎に受け取り、8/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	6/4/2020	811,179	(41,148)
USD (250,597,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/10/2020より1.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/4/2020	(2,713,943)	(3,390,555)
USD (98,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/11/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、7/8/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	5/5/2020	544,932	(1,490)
USD (136,590,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	29/5/2020	494,800	(2,046)
USD (135,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/12/2020より3.45%の固定金利を半年毎に受け取り、10/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	8/6/2020	560,780	(2,012)
USD (86,390,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/6/2020	422,416	(1,759)
USD (32,240,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/1/2021より2.3%の固定金利を半年毎に受け取り、29/10/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/7/2020	329,750	(65,190)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/4/2022より0.16%の固定金利を毎年受け取り、14/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/4/2021	391,281	(19,457)
EUR (36,120,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/6/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、22/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	18/6/2021	67,550	(16,167)
USD (87,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/11/2022より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	1,665,890	(160,747)
EUR (39,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/6/2019より1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.31.V2の変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	18/9/2019	110,069	(504)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (107,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/3/2020より2.6%の固定金利を半年毎に受け取り、25/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	23/9/2019	78,155	-
USD (107,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/3/2020より2%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	23/9/2019	(972,363)	(1,085,552)
USD (32,789,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、27/3/2020より1.76%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	25/9/2019	(966,211)	(1,175,291)
USD (20,104,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、31/3/2020より1.79%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	26/9/2019	(662,646)	(776,324)
USD (38,140,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは13/5/2020より2.55%の固定金利を半年毎に受け取り、13/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	8/11/2019	418,491	(95)
USD (50,275,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/6/2020より1.416%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	27/11/2019	(95,224)	(841,808)
USD (50,275,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/6/2020より1.416%の固定金利を半年毎に受け取り、2/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/11/2019	103,014	(643,570)
USD (74,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/6/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	233,416	(227)
USD (15,279,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、30/6/2020より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	27/12/2019	(446,363)	(558,947)
USD (25,949,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、30/6/2020より1.66%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	27/12/2019	(675,170)	(874,807)
USD (186,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/7/2020より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/1/2020	779,346	(544)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (32,820,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、7/2/2021より1.325%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	5/8/2020	(15,105)	(113,729)
USD (32,820,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/2/2021より1.325%の固定金利を半年毎に受け取り、7/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	5/8/2020	38,495	(60,129)
USD (41,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/2/2021より1.6%の固定金利を半年毎に受け取り、19/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	17/8/2020	137,543	(642,541)
USD (41,940,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/2/2021より1.2%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	17/8/2020	(79,962)	(860,046)
EUR (165,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/12/2021より0.6%の固定金利を毎年受け取り、16/6/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	14/12/2020	624,603	(1,338)
EUR (117,405,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/3/2022より0.3%の固定金利を毎年受け取り、10/9/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	8/3/2021	311,901	(7,876)
EUR (46,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/4/2022より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、21/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	19/4/2021	989,155	(13,539)
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4/2/2023より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、4/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	69,181	(145,528)
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4/2/2023より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、4/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	204,798	(244,288)
USD (61,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/4/2020より2.55%の固定金利を半年毎に受け取り、15/1/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	10/10/2019	67,306	(2)
USD (61,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/4/2020より2.55%の固定金利を半年毎に受け取り、16/1/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/10/2019	68,231	(2)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (147,902,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/1/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/4/2020より2.34%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	23/10/2019	(12,516,047)	(13,376,174)
USD (22,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、5/5/2020より2.3%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	1/11/2019	(1,806,815)	(1,935,724)
USD (22,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/5/2020より2.8%の固定金利を半年毎に受け取り、5/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	1/11/2019	110,367	(2)
USD (40,016,629)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/6/2020より1.03%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	21,310	(126,752)
USD (100,506,881)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/6/2020より1.03%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	53,522	(318,354)
USD (21,170,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/10/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/1/2021より2.007%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	6/7/2020	(913,126)	(1,375,161)
USD (21,170,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/1/2021より2.007%の固定金利を半年毎に受け取り、8/10/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	6/7/2020	372,080	(89,955)
EUR (121,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/4/2022より0.15%の固定金利を毎年受け取り、21/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	19/4/2021	417,225	(21,204)
EUR (51,990,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/6/2022より0.08%の固定金利を毎年受け取り、2/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	31/5/2021	136,218	(15,299)
USD (642,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3/12/2021より2.4%の固定金利を半年毎に受け取り、3/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	1/6/2021	909,478	(253,447)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/12/2024より3.5%の固定金利を半年毎に受け取り、17/9/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	310,773	(225,464)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/12/2024より3%の固定金利を半年毎に受け取り、17/9/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	533,854	(345,992)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは24/12/2024より3.5%の固定金利を半年毎に受け取り、24/9/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/6/2024	242,738	(226,846)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは24/12/2024より3%の固定金利を半年毎に受け取り、24/9/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/6/2024	434,553	(347,996)
USD (33,570,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/2/2025より2.25%の固定金利を半年毎に受け取り、22/11/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/8/2024	138,137	(857,102)
USD (79,570,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、5/3/2020より2.15%の固定金利を半年毎に支払う。	Nomura	3/9/2019	(911,438)	(998,965)
USD (79,570,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/3/2020より2.55%の固定金利を半年毎に受け取り、5/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	3/9/2019	63,656	-
USD (393,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/12/2020より1.76%の固定金利を半年毎に受け取り、12/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	10/6/2020	817,470	(308,438)
USD (393,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/12/2020より1.76%の固定金利を半年毎に支払う。	Nomura	10/6/2020	(954,234)	(2,080,141)
USD (23,050,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/1/2021より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、14/10/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	10/7/2020	197,240	(36,718)
USD (23,050,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/1/2021より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、14/10/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	10/7/2020	196,318	(36,718)
EUR (39,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/6/2022より0%の固定金利を毎年受け取り、29/12/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Nomura	25/6/2021	71,482	(17,993)

売建スワップション 2019年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (89,450,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/11/2022より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、11/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	2,000,336	(590,587)
USD (113,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	UBS	21/2/2020	(2,064,881)	(2,399,116)
USD (113,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	21/2/2020	441,726	(144)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 4,145,322,779米ドル)				(15,747,336)	(100,663,526)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2019年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (20,675,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 9/19 ' 2.5% TBA	(20,938,307)	(0.22)
USD (202,791,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 9/19 ' 3% TBA	(206,411,123)	(2.12)
USD (14,081,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 9/19 ' 3% TBA	(14,434,196)	(0.15)
USD 831,300,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 10/19 ' 3.5% TBA	853,868,465	8.76
USD 172,896,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 9/19 ' 3.5% TBA	177,522,308	1.82
USD 36,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 9/19 ' 3.5% TBA	37,297	0.00
USD 607,800,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 10/19 ' 4% TBA	630,853,641	6.48
USD 271,560,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 9/19 ' 4% TBA	281,626,797	2.89
USD 143,300,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 10/19 ' 4.5% TBA	150,784,093	1.55
USD 167,726,050	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 9/19 ' 4.5% TBA	176,407,173	1.81
USD (94,877,000)	Ginnie Mae ' 3.5 9/19 ' 3.5% TBA	(98,455,267)	(1.01)
USD (63,251,000)	Ginnie Mae ' 3.5 10/19 ' 3.5% TBA	(65,582,141)	(0.67)
USD 146,520,000	Ginnie Mae ' 4.5 11/19 ' 4.5% TBA	153,050,462	1.57
USD 99,468,000	Ginnie Mae ' 4.5 10/19 ' 4.5% TBA	103,916,880	1.07
USD 105,423,000	Ginnie Mae ' 4.5 9/19 ' 4.5% TBA	110,187,619	1.13
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,044,075,769米ドル)		2,232,433,701	22.91

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2019年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 6,000,000	VW Credit Inc 25/10/2019 (Zero Coupon)	5,977,932	0.34
USD 6,000,000	VW Credit Inc 6/11/2019 (Zero Coupon)	5,973,262	0.34
		11,951,194	0.68
コマーシャル・ペーパー合計		11,951,194	0.68
債券			
オーストラリア			
AUD 4,953	Apollo Series 2009-1 Trust 'Series2009-1 A3' FRN 3/10/2040	3,340	0.00
USD 1,705,000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.05% 18/9/2020	1,706,226	0.10
AUD 174,583	National Rmbs Trust 2012-2 'Series 2012-2 A1' FRN 20/6/2044	118,146	0.00
EUR 1,100,000	Telstra Corp Ltd 3.5% 21/9/2022	1,356,815	0.08
AUD 1,063,040	TORRENS Series 2013-1 Trust 'Series 2013-1 A' FRN 12/4/2044	715,735	0.04
USD 8,450,000	Westpac Banking Corp '144A' 3.15% 16/1/2024	8,919,430	0.51
		12,819,692	0.73
ブラジル			
USD 3,600,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA '144A' 5.75% 27/10/2021	3,773,250	0.21
カナダ			
USD 1,443,651	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,475,139	0.08
CAD 26,975,000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.65% 15/12/2028	22,213,668	1.26
USD 175,000	Enbridge Inc 2.9% 15/7/2022	178,327	0.01
USD 2,175,000	Encana Corp 3.9% 15/11/2021	2,228,665	0.13
EUR 810,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	913,429	0.05
USD 475,000	TransCanada PipeLines Ltd 3.75% 16/10/2023	500,305	0.03
		27,509,533	1.56
ケイマン諸島			
USD 2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,803,998	0.16
チリ			
USD 2,000,000	Empresa Nacional del Petroleo '144A' 5.25% 10/8/2020	2,057,188	0.12
コロンビア			
USD 3,635,000	Bancolombia SA 5.95% 3/6/2021	3,846,230	0.22
キプロス			
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,249,556	0.13

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス			
EUR	600,000 Air Liquide Finance SA 0.375% 18/4/2022	675,348	0.04
EUR	500,000 Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 17/1/2024	628,367	0.03
EUR	800,000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 5/2/2024	895,731	0.05
EUR	100,000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 18/3/2024	124,838	0.01
EUR	1,200,000 Credit Agricole SA/London 0.875% 19/1/2022	1,364,160	0.08
EUR	900,000 Engie SA 0.375% 28/2/2023	1,015,086	0.06
EUR	1,600,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 28/2/2021 (Zero Coupon)	1,778,958	0.10
EUR	800,000 Orange SA 0.5% 15/1/2022	899,911	0.05
EUR	2,000,000 Orange SA 0.75% 11/9/2023	2,295,577	0.13
EUR	300,000 RTE Reseau de Transport d' Electricite SADIR 1.625% 8/10/2024	361,431	0.02
EUR	300,000 Sanofi 13/9/2022 (Zero Coupon)	334,600	0.02
EUR	500,000 Societe Generale SA 27/5/2022 (Zero Coupon)	556,676	0.03
EUR	600,000 Total Capital International SA 2.125% 15/3/2023	720,203	0.04
EUR	1,200,000 Veolia Environnement SA 0.672% 30/3/2022	1,353,768	0.08
		13,004,654	0.74
ドイツ			
EUR	1,105,000 BASF SE 2% 5/12/2022	1,313,126	0.08
USD	3,695,000 Deutsche Bank AG/New York NY 4.25% 4/2/2021	3,736,443	0.21
EUR	2,100,000 Merck Financial Services GmbH 0.005% 15/12/2023	2,346,273	0.13
EUR	1,000,000 SAP SE 0.25% 10/3/2022	1,121,951	0.06
EUR	1,900,000 Volkswagen Leasing GmbH FRN 2/8/2021	2,099,773	0.12
EUR	2,455,000 Volkswagen Leasing GmbH 1% 16/2/2023	2,785,752	0.16
		13,403,318	0.76
ガーンジー			
USD	2,065,000 Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 3.125% 10/12/2020	2,088,160	0.12
アイルランド			
EUR	375,000 Abbott Ireland Financing DAC 0.875% 27/9/2023	432,378	0.02
USD	1,000,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,001,054	0.06
USD	1,160,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	1,188,876	0.07
USD	1,150,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	1,181,063	0.07
USD	3,000,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.95% 1/2/2022	3,109,065	0.18
USD	1,010,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,024,184	0.06
USD	2,889,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	2,980,022	0.17
USD	325,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 1/7/2022	342,428	0.02
USD	790,000 AIB Group Plc '144A' FRN 10/4/2025	825,189	0.05
EUR	1,590,000 Eaton Capital Unlimited Co 0.021% 14/5/2021	1,765,574	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR	325,000 ESB Finance DAC 3.494% 12/1/2024	417,795	0.02
USD	6,000,000 GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	5,962,055	0.34
USD	16,935,000 Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/9/2019	16,929,868	0.96
USD	1,200,000 Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/9/2023	1,226,457	0.07
USD	754,000 Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	792,829	0.04
		39,178,837	2.23
日本			
USD	3,441,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	3,478,536	0.20
USD	3,270,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.218% 7/3/2022*	3,351,857	0.19
USD	705,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.535% 26/7/2021	722,452	0.04
USD	5,395,000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	5,482,368	0.31
USD	1,480,000 Takeda Pharmaceutical Co Ltd '144A' 4.4% 26/11/2023	1,603,772	0.09
		14,638,985	0.83
ルクセンブルグ			
USD	8,459,000 Allergan Funding SCS 3.45% 15/3/2022	8,686,870	0.49
EUR	2,340,000 Medtronic Global Holdings SCA 2/12/2022 (Zero Coupon)	2,603,614	0.15
EUR	205,000 Novartis Finance SA 0.5% 14/8/2023	234,208	0.01
		11,524,692	0.65
メキシコ			
USD	8,300,000 Petroleos Mexicanos 6.375% 4/2/2021*	8,553,150	0.49
オランダ			
EUR	600,000 Allianz Finance II BV 0.25% 6/6/2023	677,958	0.04
EUR	150,000 Daimler International Finance BV 0.25% 9/8/2021	167,076	0.01
EUR	1,000,000 Iberdrola International BV 3.5% 1/2/2021	1,165,393	0.07
EUR	600,000 ING Bank NV 8/4/2022 (Zero Coupon)	668,236	0.04
EUR	1,100,000 ING Groep NV 1% 20/9/2023	1,267,998	0.07
USD	3,393,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	3,517,385	0.20
USD	1,967,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	2,017,931	0.11
USD	1,195,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.625% 15/6/2022	1,258,574	0.07
EUR	455,000 Roche Finance Europe BV 0.5% 27/2/2023	518,454	0.03
EUR	240,000 Shell International Finance BV 1.25% 15/3/2022	276,456	0.02
EUR	1,880,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 5/9/2021 (Zero Coupon)	2,092,830	0.12
EUR	635,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 6/9/2023	721,582	0.04
		14,349,873	0.82
パナマ			
EUR	1,015,000 Carnival Corp 1.875% 7/11/2022	1,192,413	0.07
USD	1,380,000 Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,405,424	0.08
		2,597,837	0.15

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
サウジアラビア			
USD	5,945,000 Saudi Arabian Oil Co '144A' 2.75% 16/4/2022	6,049,967	0.34
USD	1,665,000 Saudi Arabian Oil Co '144A' 2.875% 16/4/2024	1,709,955	0.10
		7,759,922	0.44
スペイン			
EUR	800,000 Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 17/11/2021	916,327	0.05
EUR	1,000,000 CaixaBank SA 0.75% 18/4/2023	1,137,797	0.07
		2,054,124	0.12
スウェーデン			
EUR	405,000 Atlas Copco AB 2.5% 28/2/2023	493,450	0.03
スイス			
USD	3,430,000 Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	3,516,471	0.20
EUR	1,460,000 UBS AG FRN 12/2/2026	1,716,944	0.10
USD	2,215,000 UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 15/8/2023	2,246,765	0.13
USD	1,395,000 UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2.65% 1/2/2022	1,409,722	0.08
		8,889,902	0.51
英国			
USD	677,000 Anglo American Capital Plc '144A' 4.125% 15/4/2021	692,578	0.04
USD	1,665,000 Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,680,741	0.10
USD	2,125,000 Barclays Plc FRN 15/2/2023	2,202,506	0.12
USD	6,600,000 Barclays Plc 2.875% 8/6/2020	6,616,619	0.38
EUR	600,000 BAT International Finance Plc 0.875% 13/10/2023	681,661	0.04
EUR	505,000 BP Capital Markets Plc 1.526% 26/9/2022	588,541	0.03
GBP	1,225,773 Compartment Driver UK Four FRN 25/3/2025	1,499,458	0.08
USD	3,574,667 Lanark Master Issuer Plc 'Series 2019-1X 1A1' FRN 22/12/2069	3,584,218	0.20
GBP	5,309,758 Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	6,479,974	0.37
EUR	270,000 Rolls-Royce Plc 2.125% 18/6/2021	310,900	0.02
USD	2,650,000 Royal Bank of Scotland Group Plc 3.875% 12/9/2023	2,729,846	0.15
USD	2,235,000 Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,275,244	0.13
USD	475,000 Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	483,729	0.03
USD	4,426,000 Santander UK Plc '144A' 5% 7/11/2023	4,694,149	0.27
EUR	515,000 Sky Ltd 1.5% 15/9/2021	589,546	0.03
USD	7,370,000 Sky Ltd '144A' 2.625% 16/9/2019	7,370,156	0.42
EUR	356,435 Turbo Finance 7 Plc FRN 20/6/2023	393,860	0.02
GBP	3,265,000 Twin Bridges 2019-1 Plc FRN 12/12/2052	3,993,264	0.23
GBP	1,080,000 Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,520,602	0.09
		48,387,592	2.75
米国			
USD	1,865,000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 'Series 2017- 280P D' '144A' FRN 15/9/2034	1,868,188	0.11
USD	2,675,000 Abbott Laboratories 2.9% 30/11/2021	2,727,175	0.16
USD	3,549,000 AbbVie Inc 3.75% 14/11/2023	3,742,213	0.21

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,448,567	Adams Mill CLO Ltd 'Series 2014- 1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	3,447,702	0.20
USD 950,000	AIG Global Funding '144A' 1.95% 18/10/2019	949,718	0.05
USD 855,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	862,459	0.05
USD 650,000	Allegro CLO II-S Ltd 'Series 2014- 1RA B' '144A' FRN 21/10/2028	645,156	0.04
USD 6,325,000	Allergan Finance LLC 3.25% 1/10/2022	6,462,959	0.37
USD 1,300,000	Allergan Inc/United States 2.8% 15/3/2023	1,310,862	0.07
USD 2,815,000	Alliant Energy Finance LLC '144A' 3.75% 15/6/2023	2,955,146	0.17
USD 2,563,337	Ally Auto Receivables Trust 2018-3 'Series 2018-3 A2' ' 2.72% 17/5/2021	2,565,189	0.15
USD 4,500,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	4,496,174	0.26
USD 2,320,279	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A A1R2' '144A' FRN 16/4/2027	2,319,962	0.13
USD 8,000,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A A1AR' '144A' FRN 15/1/2028	7,974,647	0.45
EUR 1,140,000	Altria Group Inc 1% 15/2/2023	1,301,955	0.07
USD 1,850,000	Altria Group Inc 2.85% 9/8/2022	1,887,366	0.11
USD 1,495,000	Altria Group Inc 3.49% 14/2/2022	1,546,202	0.09
USD 2,000,000	Altria Group Inc 3.8% 14/2/2024	2,117,867	0.12
USD 744,489	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	758,188	0.04
USD 290,000	American Airlines Group Inc '144A' 5% 1/6/2022	301,237	0.02
USD 3,405,000	American Electric Power Co Inc 2.15% 13/11/2020	3,408,088	0.19
USD 915,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	926,660	0.05
EUR 220,000	American Honda Finance Corp 1.375% 10/11/2022	255,790	0.01
USD 2,300,000	American Tower Corp 3.45% 15/9/2021	2,355,822	0.13
USD 370,000	American Tower Corp 3.5% 31/1/2023	384,487	0.02
USD 1,891,593	Americold 2010 LLC 'Series 2010- ARTA A1' '144A' 3.847% 14/1/2029	1,911,573	0.11
USD 302,881	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017-1 ' Series 2017-1 A3' 1.87% 18/8/2021	302,679	0.02
USD 932,537	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017-2 ' Series 2017-2 A3' 1.98% 20/12/2021	931,787	0.05
USD 4,600,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1 A3' 3.07% 19/12/2022	4,641,144	0.26
USD 2,470,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-2 ' Series 2018-2 A3' 3.15% 20/3/2023	2,507,240	0.14
USD 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013- 13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,414,471	0.19
USD 3,250,000	Anadarko Petroleum Corp (Restricted) 4.85% 15/3/2021	3,358,821	0.19
USD 335,000	Analog Devices Inc 2.85% 12/3/2020	335,949	0.02
USD 1,995,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp (Restricted) 3.5% 1/12/2022	2,050,400	0.12
USD 1,435,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp (Restricted) 6.25% 15/10/2022	1,465,852	0.08
USD 1,900,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.15% 23/1/2025	2,079,618	0.12
USD 1,110,000	Anthem Inc 3.125% 15/5/2022	1,137,368	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,300,000	AOA 2015-1177 Mortgage Trust 'Series 2015-1177 D' '144A' FRN 13/12/2029	1,308,922	0.07
USD 887,000	Apache Corp 3.25% 15/4/2022	903,134	0.05
USD 168,000	Apache Corp 3.625% 1/2/2021	170,282	0.01
USD 71,047	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A A1R' '144A' FRN 19/1/2025	71,119	0.00
EUR 1,260,000	Apple Inc 1% 10/11/2022	1,454,998	0.08
USD 7,690,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1 A' '144A' FRN 15/4/2027	7,721,186	0.44
USD 1,636,860	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A2' ' 144A' 1.91% 15/4/2026	1,633,564	0.09
USD 5,245,000	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A3' ' 144A' 2.28% 15/4/2026	5,255,703	0.30
USD 2,500,000	AT&T Inc 3% 30/6/2022	2,554,134	0.15
USD 2,325,000	AT&T Inc 3.8% 15/3/2022	2,421,112	0.14
USD 15,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM A' ' 144A' FRN 5/12/2032	15,206,106	0.87
USD 3,405,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 2.875% 20/1/2022	3,455,231	0.20
USD 94,967	B2R Mortgage Trust 2015-1 'Series 2015-1 A1' '144A' ' 2.524% 15/5/2048	94,672	0.01
USD 2,727,218	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 A' '144A' ' 3.336% 15/11/2048	2,731,476	0.16
USD 2,685,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 2.773% 15/12/2022	2,730,075	0.16
USD 7,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 'Series 2016-UB10 A2' 2.723% 15/7/2049	7,491,094	0.43
USD 26,839	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 'Series 2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	27,181	0.00
USD 3,555,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2021	3,561,176	0.20
USD 975,000	Bank of America Corp FRN 23/1/2022	982,490	0.06
USD 3,410,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	3,472,469	0.20
USD 1,500,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2023	1,530,656	0.09
USD 6,665,000	Bank of America Corp 2.503% 21/10/2022	6,714,873	0.38
USD 3,755,000	Bank of America Corp 3.3% 11/1/2023	3,903,978	0.22
USD 405,000	Bank of America NA FRN 25/1/2023	417,372	0.02
USD 6,000,000	BAT Capital Corp 2.297% 14/8/2020	6,003,917	0.34
USD 6,055,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	6,136,309	0.35
USD 1,192,000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.25% 15/12/2025	1,284,142	0.07
USD 3,020,000	Bayer US Finance LLC '144A' 2.375% 8/10/2019	3,018,773	0.17
USD 1,661	Bear Stearns ALT-A Trust 2004-13 'Series 2004-13 A1' ' FRN 25/11/2034	1,663	0.00
USD 8,506,000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020*	8,508,335	0.48
USD 2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020	2,042,497	0.12
USD 10,000,000	BellSouth LLC '144A' 4.266% 26/4/2020	10,110,500	0.58
USD 2,000,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA A2R' '144A' FRN 15/7/2029	1,994,854	0.11
USD 870,000	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 6/2/2026	869,953	0.05
USD 1,240,000	Boeing Co/The 2.7% 1/5/2022	1,263,420	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,890,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	4,885,555	0.28
USD 564,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	568,078	0.03
USD 9,195,000	Broadcom Inc '144A' 3.625% 15/10/2024	9,341,521	0.53
USD 3,086,070	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018- IND A' '144A' FRN 15/11/2035	3,090,346	0.18
USD 3,659,000	Caesars Palace Las Vegas Trust 2017-VICI 'Series 2017-VICI A' '144A' 3.531% 15/10/2034	3,821,039	0.22
USD 1,485,000	Capital One Financial Corp 2.4% 30/10/2020	1,489,638	0.09
USD 955,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	976,594	0.06
USD 1,410,000	Capital One NA 1.85% 13/9/2019	1,409,807	0.08
USD 1,710,453	Catamaran CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' ' FRN 22/4/2027	1,705,174	0.10
USD 1,095,000	CCRESE Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016- HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,106,743	0.06
USD 6,580,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A AR' '144A' ' FRN 20/10/2028	6,572,475	0.37
USD 765,000	Celgene Corp (Restricted) 2.75% 15/2/2023	781,246	0.04
USD 1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,834,031	0.10
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017- BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	3,152,923	0.18
USD 3,568,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.464% 23/7/2022	3,766,971	0.21
USD 633,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.5% 1/2/2024	680,846	0.04
USD 3,707,412	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-2A A2' ' 144A' FRN 15/5/2029	3,704,835	0.21
USD 1,519,187	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-3A A2' ' 144A' FRN 15/8/2029	1,519,124	0.09
USD 230,471	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 'Series 2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	206,055	0.01
USD 1,975,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd 'Series 2014-4RA A1A' ' 144A' FRN 17/10/2030	1,973,510	0.11
USD 7,282,642	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' ' FRN 15/4/2027	7,268,900	0.41
USD 4,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P ' Series 2013- 375P A' '144A' 3.251% 10/5/2035	4,926,466	0.28
USD 4,293,282	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 ' Series 2013- GC11 A3' 2.815% 10/4/2046	4,418,180	0.25
USD 6,455,829	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ' Series 2014- GC19 AAB' 3.552% 10/3/2047	6,701,068	0.38
USD 115,000	Citigroup Inc FRN 24/1/2023	117,549	0.01
USD 850,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	864,407	0.05
USD 1,615,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 2/3/2020	1,614,807	0.09
USD 6,640,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 30/10/2020	6,647,812	0.38
USD 4,776,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.55% 13/5/2021	4,810,757	0.27
USD 1,515,000	Citizens Bank NA/Providence RI 3.25% 14/2/2022	1,555,090	0.09
USD 6,510,000	CLNS Trust 2017-IKPR 'Series 2017-IKPR A' '144A' FRN 11/6/2032	6,501,470	0.37
EUR 600,000	Coca-Cola Co/The 1.125% 22/9/2022	692,842	0.04
USD 400,000	Comcast Corp 3.45% 1/10/2021	411,991	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,050,000	Comcast Corp 3.7% 15/4/2024	2,194,986	0.13
USD 2,471,211	COMM 2005-C6 Mortgage Trust 'Series 2005-C6 F' '144A' FRN 10/6/2044	2,518,594	0.14
USD 4,185,300	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust 'Series 2013-CR7 ASB' '2.739%' 10/3/2046	4,234,284	0.24
USD 602,814	COMM 2013-GAM 'Series 2013- GAM A1' '144A' 1.705% 10/2/2028	598,716	0.03
USD 1,111,598	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust 'Series 2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	1,120,371	0.06
USD 671,559	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 'Series 2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	669,865	0.04
USD 7,051,129	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS3 ASB' '3.367%' 10/6/2047	7,259,641	0.41
USD 2,770,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS5 ASB' '3.548%' 10/9/2047	2,862,473	0.16
USD 5,293,323	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust 'Series 2015-CR22 A2' '2.856%' 10/3/2048	5,293,352	0.30
USD 10,630,492	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 XA' 'FRN 10/5/2048	379,175	0.02
USD 2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 'Series 2015-CR24 ASB' 3.445% 10/8/2048	2,766,793	0.16
USD 10,036,198	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	10,059,908	0.57
USD 4,100,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 ASB' '3.421%' 10/7/2048	4,279,495	0.24
USD 3,935,000	Conagra Brands Inc FRN 22/10/2020	3,936,961	0.22
USD 3,220,000	Concho Resources Inc 4.375% 15/1/2025	3,340,290	0.19
USD 258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	269	0.00
USD 2,680,000	Continental Resources Inc/OK 3.8% 1/6/2024	2,716,197	0.15
USD 8,149,087	Core Industrial Trust 2015-CALW 'Series 2015-CALW A' '144A' 3.04% 10/2/2034	8,360,932	0.48
USD 6,401,604	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW A' '144A' 3.077% 10/2/2034	6,593,664	0.38
USD 1,895,000	Cox Communications Inc '144A' 3.15% 15/8/2024	1,952,059	0.11
USD 1,949,039	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2017-1 'Series 2017-1A A' '144A' 2.56% 15/10/2025	1,949,463	0.11
USD 8,160,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.01% 16/2/2027	8,215,457	0.47
USD 9,890,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2 'Series 2018-2A A' '144A' 3.47% 17/5/2027	10,054,028	0.57
USD 4,760,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-3 'Series 2018-3A A' '144A' 3.55% 15/8/2027	4,865,857	0.28
USD 635,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	656,905	0.04
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 'Series 2015-C1 A4' 3.505% 15/4/2050	1,759,336	0.10
USD 4,385,000	CSWF 2018-TOP 'Series 2018- TOP A' '144A' FRN 15/8/2035	4,398,421	0.25
USD 2,215,000	CSX Corp 3.7% 30/10/2020	2,249,252	0.13
USD 1,594,000	CVS Health Corp 3.35% 9/3/2021	1,625,533	0.09
USD 2,235,000	CVS Health Corp 4.3% 25/3/2028	2,440,189	0.14
USD 1,490,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 3.35% 4/5/2021	1,515,013	0.09

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 465,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 4.42% 15/6/2021	479,117	0.03
USD 7,060,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 5.45% 15/6/2023	7,672,557	0.44
USD 1,575,000	Delta Air Lines Inc 2.6% 4/12/2020	1,580,006	0.09
USD 2,115,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,115,591	0.12
USD 1,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	1,035,630	0.06
USD 2,800,000	Discovery Communications LLC 3.3% 15/5/2022	2,878,267	0.16
USD 1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,311,686	0.07
USD 830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	831,904	0.05
USD 2,790,000	Dominion Energy Inc (Step-up coupon) 2.715% 15/8/2021	2,812,590	0.16
USD 530,924	Drive Auto Receivables Trust 'Series 2018-4 A3' 3.04% 15/11/2021	531,662	0.03
USD 1,560,000	DTE Energy Co 3.7% 1/8/2023	1,645,601	0.09
USD 3,600,000	Duke Energy Corp 1.8% 1/9/2021	3,579,084	0.20
USD 2,835,000	Duke Energy Corp 3.95% 15/10/2023	3,021,821	0.17
USD 2,005,000	Enbridge Energy Partners LP 5.2% 15/3/2020	2,035,538	0.12
USD 1,250,000	Energy Transfer Operating LP 3.6% 1/2/2023	1,284,411	0.07
USD 7,620,000	Energy Transfer Operating LP 4.15% 1/10/2020	7,734,365	0.44
USD 435,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	466,518	0.03
USD 3,000,000	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5% 1/10/2022	3,186,513	0.18
USD 1,400,000	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5.75% 1/9/2020	1,432,982	0.08
USD 145,931	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A2' '144A' 1.74% 22/2/2022	145,857	0.01
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A3' '144A' 2.04% 22/2/2022	3,837,412	0.22
USD 428,371	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2017-1 A2' '144A' 2.13% 20/7/2022	428,203	0.02
USD 6,583,755	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2018-1 A2' '144A' 2.87%20/10/2023	6,615,267	0.38
USD 2,338,119	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd 'Series 2018-RS06 A' '144A' FRN 15/6/2035	2,342,411	0.13
USD 2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,130,180	0.12
USD 1,800,000	Exelon Generation Co LLC 5.2% 1/10/2019	1,804,158	0.10
USD 2,400,000	Express Scripts Holding Co 2.6% 30/11/2020	2,412,218	0.14
USD 1,426,914	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017-C02 2M1' FRN 25/9/2029	1,429,641	0.08
USD 2,253,234	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017-C04 2M1' FRN 25/11/2029	2,255,659	0.13
USD 1,075,486	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017-C07 2M1' FRN 25/5/2030	1,075,595	0.06
USD 1,550,034	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017-C07 1M1' FRN 28/5/2030	1,550,244	0.09
USD 64,847	Fannie Mae Pool 'AB4997' 3% 1/4/2027	66,789	0.00
USD 1,119	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	1,154	0.00
USD 14,386	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	14,836	0.00
USD 1,638,653	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	1,684,286	0.10
USD 77,929	Fannie Mae Pool 'AL7139' 3% 1/7/2030	80,256	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 53,478	Fannie Mae Pool 'AL7227' 3% 1/8/2030	55,075	0.00
USD 656,832	Fannie Mae Pool 'AL9376' 3% 1/8/2031	675,204	0.04
USD 63,343	Fannie Mae Pool 'AL9378' 3% 1/9/2031	65,237	0.00
USD 383,937	Fannie Mae Pool 'AL9899' 3% 1/3/2032	394,731	0.02
USD 29,322	Fannie Mae Pool 'AS5622' 3% 1/8/2030	30,199	0.00
USD 102,795	Fannie Mae Pool 'AS5728' 3% 1/9/2030	105,993	0.01
USD 945,478	Fannie Mae Pool 'AS5794' 3% 1/9/2030	973,749	0.06
USD 96,598	Fannie Mae Pool 'AS8604' 3% 1/1/2032	99,369	0.01
USD 2,238,045	Fannie Mae Pool 'AS8980' 4.5% 1/3/2047	2,393,275	0.14
USD 7,336,400	Fannie Mae Pool 'AS9610' 4.5% 1/5/2047	7,854,180	0.45
USD 75,350	Fannie Mae Pool 'AU0967' 3% 1/8/2028	77,597	0.00
USD 3,056,397	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	3,123,859	0.18
USD 693,238	Fannie Mae Pool 'AX5552' 3% 1/10/2031	713,621	0.04
USD 355,340	Fannie Mae Pool 'AY4218' 3% 1/5/2030	365,966	0.02
USD 877,490	Fannie Mae Pool 'AY6268' 3% 1/3/2030	903,797	0.05
USD 124,714	Fannie Mae Pool 'AZ4080' 3% 1/12/2031	128,405	0.01
USD 634,744	Fannie Mae Pool 'AZ5005' 3% 1/12/2030	653,657	0.04
USD 91,672	Fannie Mae Pool 'AZ5798' 3% 1/9/2030	94,155	0.01
USD 38,855	Fannie Mae Pool 'BA0776' 3% 1/9/2030	39,969	0.00
USD 29,756	Fannie Mae Pool 'BA2882' 3% 1/11/2030	30,644	0.00
USD 722,608	Fannie Mae Pool 'BA5803' 3% 1/12/2030	743,884	0.04
USD 628,263	Fannie Mae Pool 'BC0853' 3% 1/4/2031	647,084	0.04
USD 103,653	Fannie Mae Pool 'BC1707' 3% 1/1/2031	106,740	0.01
USD 42,120	Fannie Mae Pool 'BC1774' 3% 1/1/2031	43,379	0.00
USD 96,382	Fannie Mae Pool 'BC4017' 3% 1/3/2031	99,268	0.01
USD 100,535	Fannie Mae Pool 'BC4263' 3% 1/5/2031	103,532	0.01
USD 77,661	Fannie Mae Pool 'BC7657' 3% 1/4/2031	79,972	0.00
USD 30,856	Fannie Mae Pool 'BD1996' 3% 1/8/2031	31,776	0.00
USD 90,616	Fannie Mae Pool 'BD4404' 3% 1/7/2031	93,047	0.01
USD 586,974	Fannie Mae Pool 'BD6154' 3% 1/11/2031	602,031	0.03
USD 609,771	Fannie Mae Pool 'BE3155' 3% 1/1/2032	625,655	0.04
USD 834,044	Fannie Mae Pool 'BE6942' 3% 1/2/2032	857,414	0.05
USD 53,062	Fannie Mae Pool 'BH2512' 3% 1/7/2032	54,556	0.00
USD 742,267	Fannie Mae Pool 'BH4308' 3% 1/6/2032	764,091	0.04
USD 28,673	Fannie Mae Pool 'BH5232' 3% 1/7/2032	29,420	0.00
USD 803,530	Fannie Mae Pool 'BH5623' 3% 1/6/2032	826,974	0.05
USD 436,563	Fannie Mae Pool 'BH6399' 3% 1/11/2032	448,841	0.03
USD 489,082	Fannie Mae Pool 'BH6518' 3% 1/9/2032	501,539	0.03
USD 2,847,671	Fannie Mae Pool 'BJ2716' 4% 1/4/2033	3,025,141	0.17
USD 27,188	Fannie Mae Pool 'BJ2995' 3% 1/1/2033	28,025	0.00
USD 136,365	Fannie Mae Pool 'BJ3883' 3% 1/1/2033	140,118	0.01
USD 124,312	Fannie Mae Pool 'BJ4268' 3% 1/12/2032	127,719	0.01
USD 35,283	Fannie Mae Pool 'BJ4734' 3% 1/12/2032	36,250	0.00
USD 66,408	Fannie Mae Pool 'BJ5289' 3% 1/2/2033	68,275	0.00
USD 818,224	Fannie Mae Pool 'BJ9249' 4.5%1/6/2048	901,727	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 61,322	Fannie Mae Pool 'BK7893' 3% 1/10/2033	63,048	0.00
USD 583,907	Fannie Mae Pool 'BK9849' 4% 1/9/2033	626,291	0.04
USD 723,538	Fannie Mae Pool 'BM1775' 4.5% 1/7/2047	778,693	0.04
USD 8,321,472	Fannie Mae Pool 'BM3280' 4.5% 1/11/2047	8,911,218	0.51
USD 385,919	Fannie Mae Pool 'BM3947' 3% 1/1/2033	396,742	0.02
USD 2,669,204	Fannie Mae Pool 'BM5082' 4.5% 1/11/2048	2,941,591	0.17
USD 6,915,278	Fannie Mae Pool 'BM5568' 4.5% 1/2/2049	7,695,921	0.44
USD 997,587	Fannie Mae Pool 'BN5294' 4% 1/2/2034	1,063,705	0.06
USD 80,720	Fannie Mae Pool 'BN5357' 4% 1/3/2034	84,314	0.01
USD 513,299	Fannie Mae Pool 'BN5360' 4% 1/3/2034	545,516	0.03
USD 1,752,103	Fannie Mae Pool 'BN5404' 4.5% 1/4/2049	1,949,912	0.11
USD 215,942	Fannie Mae Pool 'BN6416' 3.5% 1/4/2034	227,759	0.01
USD 1,057,406	Fannie Mae Pool 'BN6570' 3.5% 1/4/2034	1,115,124	0.06
USD 885,011	Fannie Mae Pool 'CA0780' 3% 1/11/2032	910,918	0.05
USD 450,038	Fannie Mae Pool 'CA1095' 3% 1/2/2033	463,721	0.03
USD 2,116,418	Fannie Mae Pool 'CA1937' 4% 1/6/2033	2,252,917	0.13
USD 616,296	Fannie Mae Pool 'CA3287' 4% 1/3/2034	648,285	0.04
USD 25,075,305	Fannie Mae Pool 'FM1245' 4% 1/9/2033	26,299,788	1.50
USD 27,442	Fannie Mae Pool 'MA0909' 3% 1/11/2021	28,123	0.00
USD 675,874	Fannie Mae Pool 'MA2561' 3% 1/3/2031	696,021	0.04
USD 123,981	Fannie Mae Pool 'MA2684' 3% 1/7/2031	127,674	0.01
USD 41,532	Fannie Mae Pool 'MA3090' 3% 1/8/2032	42,646	0.00
USD 2,427,453	Fannie Mae-Aces 'Series 2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	58,353	0.00
USD 220,097,522	Fannie Mae-Aces 'Series 2014- M13 X2' FRN 25/8/2024	1,183,178	0.07
EUR 560,000	FedEx Corp 0.45% 5/8/2025	630,108	0.04
EUR 2,385,000	Fidelity National Information Services Inc 0.4% 15/1/2021	2,658,547	0.15
EUR 795,000	Fidelity National Information Services Inc 0.75% 21/5/2023	906,313	0.05
USD 990,000	Fifth Third Bancorp 2.6% 15/6/2022	1,003,149	0.06
USD 1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,356,140	0.08
EUR 595,000	Fiserv Inc 0.375% 1/7/2023	669,220	0.04
USD 1,345,000	Fiserv Inc 2.75% 1/7/2024	1,376,555	0.08
USD 2,470,000	Florida Power & Light Co FRN 6/5/2022	2,470,853	0.14
USD 11,462,000	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-B 'Series 2018-B A4' 3.38% 15/3/2024	11,906,192	0.68
USD 3,000,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-5 A1' 1.95% 15/11/2021	2,998,149	0.17
USD 3,850,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2017-2 A1' 2.16% 15/9/2022	3,856,737	0.22
USD 5,515,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.597% 4/11/2019	5,518,817	0.31
USD 3,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	3,517,057	0.20
USD 408,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.339% 28/3/2022	410,021	0.02
USD 1,517,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.813% 12/10/2021	1,543,447	0.09
USD 1,895,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.085% 7/1/2021	1,952,332	0.11
USD 6,000,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18/3/2024	6,442,126	0.37

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,493,454	Freddie Mac Gold Pool 'G15602' 2.5% 1/11/2027	6,609,409	0.38
USD 2,551,167	Freddie Mac Gold Pool 'G16763' 4% 1/2/2034	2,712,510	0.15
USD 3,307,036	Freddie Mac Gold Pool 'G16789' 4% 1/2/2034	3,528,398	0.20
USD 2,601,892	Freddie Mac Gold Pool 'G16792' 4% 1/3/2034	2,793,428	0.16
USD 622,050	Freddie Mac Gold Pool 'G61047' 4.5% 1/7/2047	676,480	0.04
USD 30,506,607	Freddie Mac Gold Pool 'G67720' 4.5% 1/3/2049	33,550,351	1.91
USD 107,352,101	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series K040 X1' FRN 25/9/2024	3,366,009	0.19
USD 3,346,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ05 A2' 2.158% 25/10/2021	3,355,721	0.19
USD 2,890,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ18 A2' 3.065% 25/8/2022	2,989,402	0.17
USD 6,516,620	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	6,664,837	0.38
USD 3,363,913	Freddie Mac REMICS 'Series 4459 BN' 3% 15/8/2043	3,490,150	0.20
USD 3,996,346	Freddie Mac REMICS 'Series 4748 HC' 3% 15/1/2044	4,069,869	0.23
USD 3,026,097	Freddie Mac REMICS 'Series 4286 MP' 4% 15/12/2043	3,207,150	0.18
USD 254,709	Freddie Mac REMICS 'Series 3986 M' 4.5% 15/9/2041	271,087	0.02
USD 190,528	Freddie Mac REMICS 'Series 3959 MA' 4.5% 15/11/2041	204,412	0.01
USD 4,782,342	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	4,800,010	0.27
USD 1,682,782	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-HQA3 M1' FRN 25/4/2030	1,682,878	0.10
USD 1,015,000	General Electric Co 5.5% 8/1/2020	1,024,076	0.06
USD 4,261,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	4,310,855	0.25
USD 895,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 5/1/2023	909,282	0.05
USD 2,435,000	General Motors Financial Co Inc 3.7% 24/11/2020	2,467,779	0.14
USD 3,190,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 1/3/2021	3,266,095	0.19
USD 1,610,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	1,668,970	0.10
USD 470,000	Gilead Sciences Inc 3.25% 1/9/2022	487,589	0.03
USD 3,731,144	Gosforth Funding 2018-1 plc 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 25/8/2060	3,725,331	0.21
USD 8,569,637	Government National Mortgage Association 'Series 2012-120 IO' FRN 16/2/2053	418,719	0.02
USD 4,578,852	Government National Mortgage Association 'Series 2018-36 AM' 3% 20/7/2045	4,681,209	0.27
USD 13,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	13,598,796	0.77
USD 2,130,000	Great Wolf Trust 2017-WOLF 'Series 2017-WOLF A' '144A' FRN 15/9/2034	2,130,856	0.12
USD 4,530,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	4,523,768	0.26
USD 3,375,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K A' '144A' FRN 15/7/2032	3,367,544	0.19
USD 2,495,000	GS Mortgage Securities Trust 2011-GC5 'Series 2011-GC5 AS' '144A' FRN 10/8/2044	2,622,157	0.15
USD 4,925,576	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ7 'Series 2012-GCJ7 A4' 3.377% 10/5/2045	5,024,217	0.29
USD 2,925,756	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 'Series 2013-GC16 AAB' 3.813% 10/11/2046	3,042,812	0.17

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,955,603	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 'Series 2013-GC16 A3' 4.244% 10/11/2046	4,263,003	0.24
USD 3,495,242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 'Series 2014-GC18 A4' 4.074% 10/1/2047	3,780,578	0.22
USD 6,361,000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS3 'Series 2016-GS3 AAB' 2.777% 10/10/2049	6,555,757	0.37
USD 4,290,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 25/7/2027	4,285,210	0.24
USD 3,450,000	Halliburton Co 3.5% 1/8/2023	3,593,834	0.20
USD 1,940,000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 2.15% 26/2/2020	1,936,328	0.11
USD 1,293,000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5.125% 15/4/2022	1,399,948	0.08
USD 3,350,000	Hewlett Packard Enterprise Co 3.6% 15/10/2020	3,398,484	0.19
USD 4,544,911	Holmes Master Issuer Plc 'Series 2018-2A A2' '144A' FRN 15/10/2054	4,543,516	0.26
EUR 2,920,000	Honeywell International Inc 1.3% 22/2/2023	3,405,437	0.19
USD 2,475,000	Huntington National Bank/The 2.375% 10/3/2020	2,477,274	0.14
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,282,178	0.19
USD 1,290,000	Huntington National Bank/The 3.125% 1/4/2022	1,322,235	0.08
USD 1,710,000	Hyundai Capital America '144A' 1.75% 27/9/2019	1,709,350	0.10
USD 1,575,000	Hyundai Capital America '144A' 2.55% 3/4/2020	1,579,922	0.09
USD 1,750,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 19/10/2028	1,746,623	0.10
EUR 470,000	Illinois Tool Works Inc 0.25% 5/12/2024	529,913	0.03
USD 3,930,000	International Business Machines Corp 3% 15/5/2024	4,087,833	0.23
EUR 1,000,000	International Flavors & Fragrances Inc 0.5% 25/9/2021	1,119,454	0.06
USD 3,151,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	3,255,396	0.19
USD 1,455,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.5% 1/10/2020	1,474,895	0.08
USD 500,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.75% 1/10/2021	513,611	0.03
USD 900,000	ITC Holdings Corp 2.7% 15/11/2022	913,441	0.05
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018- BCON 'Series 2018-BCON A' '144A' 3.735% 5/1/2031	3,985,878	0.23
USD 620,000	John Deere Capital Corp 2.6% 7/3/2024	635,888	0.04
USD 4,647,997	John Deere Owner Trust 2017-B 'Series 2017-B A3' 1.82% 15/10/2021	4,640,277	0.26
USD 4,892,468	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012- CIBX 'Series 2012-CBX A4' 3.483% 15/6/2045	5,018,996	0.29
USD 3,499,359	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013- C16 'Series 2013-C16 ASB' 3.674% 15/12/2046	3,609,050	0.21
USD 5,320,789	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013- LC11 'Series 2013-LC11 ASB' 2.554% 15/4/2046	5,372,118	0.31
USD 646,174	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014- C20 'Series 2014-C20 A2' 2.872% 15/7/2047	645,551	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,889,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016- JP2 ' Series 2016-JP2 ASB ' 2.713% 15/8/2049	3,989,458	0.23
USD 3,931,694	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 ' Series 2016-2 A1 ' ' 144A ' FRN 25/6/2046	3,942,655	0.22
USD 4,531,122	JP Morgan Mortgage Trust 2017-1 ' Series 2017-1 A4 ' ' 144A ' FRN 25/1/2047	4,679,331	0.27
USD 11,619,420	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 ' Series 2017-3 1A6 ' ' 144A ' FRN 25/8/2047	11,835,466	0.67
USD 7,292,224	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17 ' Series 2013-C17 ASB ' 3.705% 15/1/2047	7,572,920	0.43
USD 3,829,957	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ' Series 2014-C23 ASB ' 3.657% 15/9/2047	3,982,067	0.23
USD 1,055,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 ' Series 2014-C26 ASB ' 3.288% 15/1/2048	1,089,517	0.06
USD 3,380,000	JPMorgan Chase & Co FRN 18/6/2022	3,386,572	0.19
USD 6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	6,208,229	0.35
USD 2,305,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	2,419,897	0.14
USD 1,800,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	1,911,611	0.11
USD 2,800,000	JPMorgan Chase & Co 3.25% 23/9/2022	2,900,904	0.17
USD 1,410,000	JPMorgan Chase Bank NA FRN 1/2/2021	1,412,681	0.08
USD 7,100,000	JPMorgan Chase Bank NA FRN 26/4/2021	7,142,867	0.41
USD 900,000	Keurig Dr Pepper Inc 4.057% 25/5/2023	955,721	0.05
USD 3,000,000	KeyBank NA/Cleveland OH 2.25% 16/3/2020	3,002,775	0.17
USD 2,715,000	Kinder Morgan Inc/DE ' 144A ' 5% 15/2/2021	2,811,606	0.16
USD 1,745,000	Kraft Heinz Foods Co 3.5% 6/6/2022	1,784,532	0.10
USD 1,690,000	Kraft Heinz Foods Co ' 144A ' 4.875% 15/2/2025	1,747,749	0.10
USD 2,205,000	L3Harris Technologies Inc ' 144A ' 4.4% 15/6/2028	2,502,023	0.14
USD 6,790,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.81% 21/12/2026	6,963,069	0.40
USD 2,043,479	LFRR ' 2015-1 ' ' 144A ' 4% 30/10/2027	2,035,894	0.12
USD 2,075,000	Lowe ' s Cos Inc 3.65% 5/4/2029	2,251,957	0.13
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust 2013-650M ' Series 2013-650M A ' ' 144A ' 3.843% 12/10/2032	1,402,564	0.08
EUR 970,000	Mastercard Inc 1.1% 1/12/2022	1,118,978	0.06
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2017-B ' Series 2017-BA A ' ' 144A ' FRN 16/5/2022	9,833,441	0.56
USD 4,595,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2018-BA ' Series 2018-BA A ' ' 144A ' FRN 15/5/2023	4,597,186	0.26
EUR 700,000	Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 9/4/2024	792,533	0.05
EUR 310,000	Metropolitan Life Global Funding I 2.375% 11/1/2023	372,654	0.02
USD 3,851,490	Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 ' Series 2016-1 A1 ' ' 144A ' FRN 25/4/2057	3,858,654	0.22
USD 1,540,436	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 ' Series 2013-C10 ASB ' FRN 15/7/2046	1,587,555	0.09
USD 3,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 ' Series 2013-C13 A4 ' 4.039% 15/11/2046	3,752,089	0.21
USD 3,691,287	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9 ' Series 2013-C9 AAB ' 2.657% 15/5/2046	3,727,865	0.21
USD 572,540	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 ' Series 2014-C19 A2 ' 3.101% 15/12/2047	572,412	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,740,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 'Series 2014-C18 ASB' 3.621% 15/10/2047	3,880,007	0.22
USD 5,385,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 ASB' 3.383% 15/10/2048	5,612,536	0.32
USD 1,687,353	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	1,800,069	0.10
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-MP 'Series 2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	5,074,156	0.29
USD 888,400	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	899,583	0.05
USD 1,434,766	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	1,448,457	0.08
USD 71,376	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	71,426	0.00
USD 4,439,048	Navient Private Education Loan Trust 2018-B 'Series 2018-BA A1' '144A' FRN 15/12/2059	4,437,830	0.25
USD 897,000	Navient Student Loan Trust 2018- EA 'Series 2018-EA A2' '144A' 4% 15/12/2059	959,108	0.05
USD 2,795,000	NetApp Inc 2% 27/9/2019	2,793,772	0.16
USD 12,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	12,861,932	0.73
USD 839,853	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 'Series 2016-3A A1B' '144A' FRN 25/9/2056	860,359	0.05
USD 3,772,996	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 'Series 2018-1A A1A' '144A' FRN 25/12/2057	3,949,767	0.23
USD 4,550,000	Newfield Exploration Co 5.625% 1/7/2024	5,008,714	0.29
USD 3,995,000	Newfield Exploration Co 5.75% 30/1/2022	4,270,247	0.24
USD 3,890,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 2.403% 1/9/2021	3,912,508	0.22
USD 2,925,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' 2.125% 3/3/2020	2,920,799	0.17
USD 79,425	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	82,415	0.00
USD 525,000	NRG Energy Inc '144A' 3.75% 15/6/2024	543,196	0.03
USD 560,000	Occidental Petroleum Corp 2.6% 13/8/2021	563,537	0.03
USD 2,765,000	Occidental Petroleum Corp 2.7% 15/8/2022	2,788,865	0.16
USD 1,720,000	OFSI Fund VI Ltd 'Series 2014-6A BR' FRN 20/3/2025	1,695,015	0.10
USD 7,525,000	OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.43% 16/12/2024	7,671,824	0.44
USD 1,415,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.3% 14/3/2029	1,445,113	0.08
USD 575,000	Parker-Hannifin Corp 2.7% 14/6/2024	588,248	0.03
USD 1,450,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.7% 14/3/2023	1,463,428	0.08
USD 4,635,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 4.125% 1/8/2023	4,911,599	0.28
USD 1,075,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 4.25% 17/1/2023	1,141,234	0.07
USD 9,405,000	PFS Financing Corp 'Series 2017- C A' '144A' FRN 15/10/2021	9,394,514	0.54
USD 1,490,000	PFS Financing Corp 'Series 2016- BA A' '144A' 1.87% 15/10/2021	1,490,997	0.09
USD 3,630,000	PFS Financing Corp 'Series 2018- B A' '144A' 2.89% 15/2/2023	3,667,626	0.21

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,830,000	PFS Financing Corp 'Series 2018- D A' '144A' 3.19% 17/4/2023	2,880,362	0.16
USD 9,430,000	PFS Financing Corp 'Series 2018- F A' '144A' 3.52% 15/10/2023	9,714,768	0.55
EUR 270,000	Philip Morris International Inc 0.125% 3/8/2026	294,995	0.02
USD 1,445,000	Pricoa Global Funding I '144A' 2.45% 21/9/2022	1,460,734	0.08
EUR 210,000	Procter & Gamble Co/The 0.625% 30/10/2024	242,769	0.01
EUR 345,000	Procter & Gamble Co/The 2% 16/8/2022	408,222	0.02
USD 680,000	QUALCOMM Inc 2.9% 20/5/2024	701,817	0.04
USD 385,937	RAIT 2017-FL7 Trust 'Series 2017- FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	385,689	0.02
USD 812,000	Rockwell Collins Inc 2.8% 15/3/2022	825,860	0.05
USD 2,200,000	Roper Technologies Inc 3.65% 15/9/2023	2,317,108	0.13
USD 1,125,000	Ryder System Inc 2.5% 1/9/2024	1,133,823	0.06
USD 2,400,000	Ryder System Inc 2.65% 2/3/2020	2,402,677	0.14
USD 3,000,000	Ryder System Inc 2.8% 1/3/2022	3,044,078	0.17
USD 885,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	889,166	0.05
USD 890,000	Ryder System Inc 2.875% 1/6/2022	907,951	0.05
USD 1,640,000	Ryder System Inc 3.75% 9/6/2023	1,727,626	0.10
USD 782,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	873,036	0.05
USD 1,054,452	Santander Drive Auto Receivables Trust 2018-3 ' Series 2018-3 A3' 3.03% 15/2/2022	1,055,602	0.06
USD 550,000	Santander Holdings USA Inc 3.4% 18/1/2023	565,775	0.03
USD 1,535,000	Santander Holdings USA Inc 3.7% 28/3/2022	1,581,545	0.09
USD 5,290,000	Santander Holdings USA Inc 4.45% 3/12/2021	5,518,454	0.31
USD 2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	2,751,674	0.16
USD 2,755,000	Sempra Energy 1.625% 7/10/2019	2,752,885	0.16
USD 3,134,026	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 'Series 2017-CH1 A2' '144A' FRN 25/8/2047	3,196,077	0.18
USD 1,500,565	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2 'Series 2017-CH2 A10' '144A' FRN 25/12/2047	1,517,071	0.09
USD 770,000	Sesac Finance LLC 'Series 2019-1 A2' '144A' 5.216% 25/7/2049	785,985	0.05
USD 8,050,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 'Series 2005-A A4' FRN 15/12/2038	7,853,952	0.45
USD 6,898,399	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 'Series 2005-B A4' FRN 15/6/2039	6,776,211	0.39
USD 2,098,407	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 'Series 2007-A A4A' FRN 16/12/2041	2,049,131	0.12
USD 1,407,617	SLM Private Education Loan Trust 2011-B 'Series 2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,422,305	0.08
USD 220,787	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 'Series 2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	221,867	0.01
USD 1,323,292	SLM Student Loan Trust 2013-4 'Series 2013-4 A' FRN 25/6/2043	1,310,621	0.07
USD 1,948,496	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-C A2A' '144A' 2.75% 15/7/2027	1,963,228	0.11
USD 1,599,488	SMB Private Education Loan Trust 2016-A 'Series 2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	1,618,963	0.09
USD 1,864,830	SMB Private Education Loan Trust 2016-B 'Series 2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	1,870,742	0.11

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	4,436,796	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 'Series 2017-A A2B' '144A' FRN 15/9/2034	4,452,114	0.25
USD	2,150,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 'Series 2019-A A2A' '144A' 3.44% 15/7/2036	2,261,241	0.13
USD	383,954	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC 'Series 2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	384,046	0.02
USD	579,974	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC 'Series 2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	583,153	0.03
USD	3,031,082	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC 'Series 2015-D A2' '144A' 2.72% 27/10/2036	3,063,048	0.17
USD	1,208,213	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC 'Series 2016-A A2' '144A' 2.76% 26/12/2036	1,222,431	0.07
USD	844,414	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC 'Series 2016-C A2B' '144A' 2.36% 27/12/2032	849,692	0.05
USD	816,656	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC 'Series 2016-D A2B' '144A' 2.34% 25/4/2033	821,182	0.05
USD	5,257,719	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC 'Series 2016-E A2B' '144A' 2.49% 25/1/2036	5,299,334	0.30
USD	496,162	Sofi Professional Loan Program 2017-C LLC 'Series 2017-C A2A' '144A' 1.75% 25/7/2040	495,832	0.03
USD	21,000,000	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC 'Series 2017-D A2FX' '144A' 2.65% 25/9/2040	21,341,758	1.22
USD	3,362,478	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 'Series 2018-B A1FX' '144A' 2.64% 25/8/2047	3,377,246	0.19
USD	4,425,000	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 'Series 2018-C A2FX' '144A' 3.59% 25/1/2048	4,691,850	0.27
USD	4,375,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 'Series 2018-D A2FX' '144A' 3.6% 25/2/2048	4,617,659	0.26
USD	82,836	Soundview Home Loan Trust 2003- 2 'Series 2003-2 A2' FRN 25/11/2033	84,192	0.01
USD	4,570,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	4,604,572	0.26
USD	2,700,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,861,082	0.16
USD	620,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	679,038	0.04
USD	2,625,000	Springleaf Funding Trust 2017-A 'Series 2017-AA A' '144A' 2.68% 15/7/2030	2,628,898	0.15
USD	520,313	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	522,341	0.03
USD	2,975,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20/3/2025	3,157,219	0.18
USD	960,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.5% 15/2/2020	972,082	0.06
USD	390,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	399,750	0.02
USD	5,560,000	SunTrust Bank/Atlanta GA FRN 26/10/2021	5,643,444	0.32
USD	290,000	SunTrust Banks Inc 2.7% 27/1/2022	293,778	0.02
USD	1,140,000	Synchrony Financial 2.85% 25/7/2022	1,154,415	0.07
USD	420,000	Total System Services Inc 3.75% 1/6/2023	439,106	0.03
USD	1,350,000	Total System Services Inc 4% 1/6/2023	1,425,014	0.08
USD	2,461,731	Towd Point Mortgage Trust 2016-3 'Series 2016-3 A1' '144A' FRN 25/4/2056	2,456,255	0.14

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	3,339,774	Towd Point Mortgage Trust 2016-4 'Series 2016-4 A1' '144A' FRN 25/7/2056	3,331,011	0.19
USD	2,500,000	Toyota Auto Receivables 2018-C Owner Trust 'Series 2018-C A4' 3.13% 15/2/2024	2,580,283	0.15
USD	1,750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 25/7/2029	1,749,231	0.10
USD	13,880,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/6/2020	13,845,300	0.79
USD	41,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 31/7/2020*†	40,936,738	2.33
USD	40,000,000	United States Treasury Note/Bond 2.5% 31/5/2020	40,190,625	2.29
USD	1,000,000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/8/2020	1,008,301	0.06
EUR	705,000	United Technologies Corp 1.125% 15/12/2021	800,851	0.05
EUR	365,000	United Technologies Corp 1.15% 18/5/2024	424,712	0.02
USD	5,190,000	United Technologies Corp 3.35% 16/8/2021	5,321,306	0.30
USD	2,295,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	2,432,273	0.14
USD	1,329,668	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,334,004	0.08
EUR	410,000	Verizon Communications Inc 0.5% 2/6/2022	461,995	0.03
USD	6,850,000	Verizon Communications Inc 2.946% 15/3/2022	7,022,260	0.40
USD	3,169,650	Voya CLO 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A A1R' '144A' FRN 25/7/2026	3,167,106	0.18
USD	735,000	Waste Management Inc 2.95% 15/6/2024	763,698	0.04
USD	2,300,000	WEC Energy Group Inc 3.375% 15/6/2021	2,350,345	0.13
EUR	485,000	Wells Fargo & Co 1.125% 29/10/2021	552,089	0.03
USD	2,825,000	Wells Fargo & Co 2.5% 4/3/2021	2,841,680	0.16
USD	1,195,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	1,222,821	0.07
USD	2,215,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	2,357,440	0.13
USD	8,000,000	Wells Fargo Bank NA FRN 23/7/2021	8,086,176	0.46
USD	3,875,913	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 ' Series 2014- LC16 ASB' 3.477% 15/8/2050	4,001,314	0.23
USD	500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22 ' Series 2015- LC22 ASB' 3.571% 15/9/2058	525,911	0.03
USD	1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 ' Series 2015- NXS1 A5' 3.148% 15/5/2048	1,665,874	0.10
USD	3,438,623	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 'Series 2012-C8 AFL' '144A' FRN 15/8/2045	3,454,147	0.20
USD	5,458,003	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 'Series 2014- C21 ASB' 3.393% 15/8/2047	5,599,422	0.32
USD	315,361	Wheels SPV 2 LLC 'Series 2017- 1A A2' '144A' 1.88% 20/4/2026	315,339	0.02
USD	2,400,000	Williams Cos Inc/The 3.7% 15/1/2023	2,489,916	0.14
USD	1,765,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/11/2021	1,817,493	0.10
USD	2,000,000	WRKCo Inc 3.75% 15/3/2025	2,111,436	0.12
USD	3,205,000	Xerox Corp 3.5% 20/8/2020	3,225,031	0.18
USD	719,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	742,628	0.04
			1,387,554,923	78.99
債券合計			1,629,538,866	92.76
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計			1,641,490,060	93.44

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
	米国		
USD 350,000	Structured Asset Receivables Trust 'Series 2003-2A CTFS' 0.649% 31/12/2049	-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		-	0.00
投資有価証券合計		1,641,490,060	93.44
その他の純資産		115,211,514	6.56
純資産合計(米ドル)		1,756,701,574	100.00

† 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券。詳細については注記14を参照のこと。

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2019年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	1,229,000	USD	828,440	JP Morgan	5/9/2019	(356)
CAD	27,554,000	USD	20,725,085	Bank of America	5/9/2019	49,083
GBP	10,302,000	USD	12,562,267	State Street	5/9/2019	22,745
USD	872,436	AUD	1,265,000	Goldman Sachs	5/9/2019	20,096
USD	20,975,912	CAD	27,557,000	RBS Plc	5/9/2019	199,483
USD	455,921	EUR	410,000	ANZ	5/9/2019	2,953
USD	691,151	EUR	616,000	Bank of America	5/9/2019	10,594
USD	6,723,266	EUR	6,027,000	Goldman Sachs	5/9/2019	64,627
USD	232,094	EUR	207,000	State Street	5/9/2019	3,400
USD	852,234	EUR	762,000	Citibank	5/9/2019	10,374
USD	54,754,876	EUR	48,987,000	BNP Paribas	5/9/2019	633,960
USD	1,716,716	EUR	1,540,000	HSBC Bank Plc	5/9/2019	15,321
USD	13,069,804	GBP	10,705,000	Goldman Sachs	5/9/2019	(7,517)
CAD	5,772,274	EUR	3,920,000	Deutsche Bank	18/9/2019	17,696
EUR	3,920,000	CAD	5,762,286	Morgan Stanley	18/9/2019	(10,164)
JPY	466,234,560	USD	4,400,000	Toronto Dominion	18/9/2019	(2,651)
JPY	476,418,984	USD	4,460,000	Bank of America	18/9/2019	33,405
JPY	481,379,529	USD	4,470,000	State Street	18/9/2019	70,191
SEK	83,237,480	USD	8,930,000	JP Morgan	18/9/2019	(436,849)
USD	4,460,000	JPY	475,607,710	Bank of America	18/9/2019	(25,753)
USD	4,470,000	JPY	480,743,583	Royal Bank of Canada	18/9/2019	(64,193)
USD	4,460,000	SEK	41,753,735	JP Morgan	18/9/2019	199,650
USD	4,470,000	SEK	42,069,119	State Street	18/9/2019	177,470
USD	829,152	AUD	1,229,000	JP Morgan	3/10/2019	346
USD	20,734,754	CAD	27,554,000	Bank of America	3/10/2019	(48,884)
USD	12,578,035	GBP	10,302,000	State Street	3/10/2019	(22,650)
未実現純評価益						912,377
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	147,251,208	USD	165,315,764	BNY Mellon	12/9/2019	(2,542,201)
USD	1,229,846	EUR	1,105,921	BNY Mellon	12/9/2019	7,354
未実現純評価損						(2,534,847)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	556,105	USD	402,499	BNY Mellon	12/9/2019	(1,441)
未実現純評価損						(1,441)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 388,834,994米ドル)						(1,623,911)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2019年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエク スポージャー (米ドル)	未実現評価益/ (損) (米ドル)
(1)	EUR	Euro Bund	2019年9月	197,850	(571)
(148)	EUR	Euro Schatz	2019年9月	18,405,988	(39,921)
(221)	EUR	Euro BOBL	2019年9月	33,249,588	(407,233)
(109)	CAD	Canadian 10 Year Bond	2019年12月	11,937,060	23,009
3,002	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2019年12月	648,338,187	(211,899)
12	USD	US Ultra Bond (CBT)	2019年12月	2,364,000	13,525
(24)	USD	US Long Bond (CBT)	2019年12月	3,962,250	(8,907)
(45)	USD	US Ultra 10 Year Note	2019年12月	6,489,844	2,622
(175)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2019年12月	23,020,703	21,111
(961)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2019年12月	115,139,813	28,801
合計				863,105,283	(579,463)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2019年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	10,028	2,741
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(5,035)	(3,214)
CDS	USD 18,619,200	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(120,453)	(1,274,363)
CDS	USD (19,700,000)	ファンドはCDX.NA.IG.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	22,171	424,273
CDS	USD (750,000)	ファンドはConagra Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	1,040	10,294
CDS	USD (1,358,000)	ファンドはConagra Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	1,860	18,638
CDS	USD (1,500,000)	ファンドはConagra Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	4,235	20,587
CDS	USD 207,000	ファンドはKraft Heinz Foods Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(2,314)	1,063
CDS	USD 1,032,000	ファンドはKraft Heinz Foods Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(12,474)	5,302
CDS	USD (788,869)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	243	29,218
CDS	USD 844,970	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(1,784)	(32,481)
CDS	USD (898,113)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	1,902	33,264
CDS	USD 842,012	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(1,080)	(32,367)
CDS	USD (144,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	(602)	9,856
CDS	USD (8,640,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(90,537)	591,352
CDS	USD (9,835,200)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	20/12/2022	88,507	673,155
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはKroger Co/TheIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	7,914	14,786

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (2,500,000)	ファンドはKroger Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	21,115	32,741
CDS	USD (15,097,500)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	266,979	1,037,659
CDS	USD 2,800,000	ファンドはCBS Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(30,725)	(50,148)
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(3,789)	(2,741)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	11,250	3,214
CDS	EUR 993,000	ファンドはBritish American Tobacco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(16,829)	(20,042)
CDS	EUR 1,489,000	ファンドはBritish American Tobacco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(31,417)	(32,041)
CDS	EUR 993,000	ファンドはBritish American Tobacco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(20,951)	(21,368)
CDS	USD 433,463	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(1,178)	(3,517)
CDS	USD 770,010	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(4,568)	1,353
CDS	USD 809,717	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(4,944)	21,026
CDS	USD 809,717	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(6,668)	21,026
CDS	USD 770,010	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(5,961)	1,353
CDS	USD 770,010	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,256)	1,353
CDS	USD 866,927	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(2,033)	(7,034)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	8,734	(14,199)
CDS	USD (3,627,000)	ファンドはCampbell Soup Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	37,794	66,839
CDS	USD 1,570,850	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,105)	40,790

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 809,716	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,294)	21,026
CDS	USD 770,010	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,278)	1,353
CDS	USD 866,927	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(2,416)	(7,034)
CDS	USD 604,915	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,449)	7,346
CDS	USD 604,915	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,354)	7,346
CDS	USD (1,437,657)	ファンドはAnadarko Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	(34,607)	(388)
CDS	USD (479,220)	ファンドはAnadarko Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	(10,361)	(129)
CDS	USD (1,916,877)	ファンドはAnadarko Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	(41,547)	(518)
CDS	USD (1,666,246)	ファンドはAnadarko Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	(36,030)	(450)
CDS	USD 8,958,652	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(39,301)	(223,524)
CDS	USD (7,500,000)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	15,432	215,430
CDS	USD 604,915	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(6,619)	7,346
CDS	USD 604,915	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(7,917)	7,346
CDS	USD 866,927	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(3,160)	(7,034)
CDS	USD 433,463	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(1,181)	(3,517)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはLowe's Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(8,997)	(56,343)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはPfizer Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(2,889)	(60,044)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはMondelēz International Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(6,587)	(52,211)

スワップ 2019年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはAllstate Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(1,897)	(64,950)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはAmerican International Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	3,068	(23,973)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(527)	(47,872)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはConocoPhillipsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	8,199	(33,746)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはKinder Morgan Inc/DEに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(1,376)	(26,168)
IRS	GBP 35,120,000	ファンドは0.705%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/7/2021	41,244	41,244
IRS	CAD 59,200,000	ファンドは1.64%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2021	(1,349)	(5,115)
IRS	USD 44,240,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.545%の固定金利を支払う	Bank of America	21/8/2021	(6,425)	(8,241)
IRS	USD 37,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	273,200	273,200
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 326,975,290米ドル)					212,651	1,528,748

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

事後通告証券契約 2019年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
米国			
USD 5,250,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2 9/19 ' 2% TBA	5,239,752	0.30
USD 32,302,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 10/19 ' 2.5% TBA	32,705,812	1.86
USD 19,353,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 10/19 ' 3% TBA	19,833,845	1.13
USD 5,855,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 10/19 ' 4% TBA	6,094,473	0.35
USD 85,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 9/19 ' 4% TBA	88,150,971	5.02
USD 5,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 9/19 ' 4.5% TBA	5,140,568	0.29
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 157,165,421米ドル)		157,165,421	8.95

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2020年6月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,632,948,234円
負債総額	602,171円
純資産総額(-)	1,632,346,063円
発行済数量	1,733,819,903口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9415円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等

該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典

該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行

投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

6 受益権の譲渡

投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

8 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

9 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権に係る投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、換金の受付、換金代金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に当たって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

2017年12月7日付で、資本金を2,435百万円から3,120百万円に増額しました。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分の承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行ないます。

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

当社における適切な経営戦略の構築、業務執行体制の構築および業務運営の推進を目的として、エグゼクティブ委員会を設置します。また、その他各種委員会を設置し、業務の能率的運営および責任体制の確立を図っています。

運用の意思決定機構

投資委員会

・投資委員会にて運用にかかる投資方針、パフォーマンスおよびリスク管理に関する重要事項を審議します。

運用担当部署

・各運用担当部署では、投資委員会の決定にしたがい、ファンドの個別の運用計画を策定し、各部署の投資プロセスを通して運用を行ないます。

ポートフォリオ・マネジャー

・ポートフォリオ・マネジャーは、策定された運用計画に基づき、個別銘柄を選択し売買に関する指図を行ないます。

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2020年6月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	163	8,427,535
単位型株式投資信託	26	235,889
合計	189	8,663,424

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1963年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度(自2019年1月1日 至2019年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

3．財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

		第32期 (2018年12月31日現在)	第33期 (2019年12月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		23,891	20,388
立替金		2	26
前払費用		151	175
未収入金	2	11	30
未収委託者報酬		1,588	1,696
未収運用受託報酬		2,291	2,268
未収収益	2	1,402	1,832
その他流動資産		18	0
流動資産計		29,359	26,418
固定資産			
有形固定資産			
建物附属設備	1	1,484	1,240
器具備品	1	380	475
有形固定資産計		1,864	1,716
無形固定資産			
ソフトウェア		8	5
無形固定資産計		8	5
投資その他の資産			
投資有価証券		11	49
長期差入保証金		1,119	1,120
前払年金費用		696	800
長期前払費用		27	45
繰延税金資産		848	824
投資その他の資産計		2,702	2,839
固定資産計		4,575	4,561
資産合計		33,935	30,980

	第32期 (2018年12月31日現在)	第33期 (2019年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	97	94
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	74
未払手数料	515	487
その他未払金	1,184	985
未払費用	2	
未払消費税等	97	117
未払法人税等	440	363
為替予約	3	-
前受金	78	97
賞与引当金	1,939	2,017
役員賞与引当金	142	139
早期退職慰労引当金	42	10
流動負債計	5,661	5,493
固定負債		
退職給付引当金	60	67
資産除去債務	781	782
固定負債計	842	850
負債合計	6,503	6,344
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	17,127	14,330
利益剰余金合計	17,464	14,666
株主資本合計	27,432	24,634
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	1
評価・換算差額等合計	0	1
純資産合計	27,431	24,636
負債・純資産合計	33,935	30,980

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第32期 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	第33期 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,639	5,643
運用受託報酬	1	8,523	7,545
その他営業収益	1	13,511	13,290
営業収益計		27,674	26,480
営業費用			
支払手数料		1,856	1,632
広告宣伝費		191	167
調査費			
調査費		363	381
委託調査費	1	4,164	3,587
調査費計		4,528	3,968
委託計算費		84	82
営業雑経費			
通信費		59	53
印刷費		11	82
諸会費		34	43
営業雑経費計		106	178
営業費用計		6,767	6,029
一般管理費			
給料			
役員報酬		406	482
給料・手当		4,213	4,441
賞与		2,359	2,343
給料計		6,979	7,268
退職給付費用		275	308
福利厚生費		940	977
事務委託費	1	2,568	2,339
交際費		66	57
寄付金		3	2
旅費交通費		238	233
租税公課		245	257
不動産賃借料		804	875
水道光熱費		72	76
固定資産減価償却費		315	404
のれん償却額		42	-
資産除去債務利息費用		3	0
諸経費		424	312
一般管理費計		12,980	13,114
営業利益		7,926	7,335

	第32期 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	第33期 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
営業外収益		
その他	1	1
営業外収益計	1	1
営業外費用		
為替差損	26	32
固定資産除却損	-	3
その他	-	0
営業外費用計	26	36
経常利益	7,901	7,300
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	84	36
特別損失計	84	36
税引前当期純利益	7,817	7,263
法人税、住民税及び事業税	2,491	2,338
法人税等調整額	61	22
当期純利益	5,387	4,902

(3)【株主資本等変動計算書】

第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価証 券評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2018年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
当期変動額											
当期純利益						5,387	5,387	5,387			5,387
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									0	0	0
当期変動額合計	-	-	-	-	-	5,387	5,387	5,387	0	0	5,387
2018年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431

第33期 (自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価証 券評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2019年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431
当期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
当期純利益						4,902	4,902	4,902			4,902
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,797	2,797	2,797	1	1	2,795
2019年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法
 - 有価証券
 - 其他有価証券
 - 時価のあるもの
 - 決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定)を採用しております。
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法
 - 時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却方法
 - (1) 有形固定資産
 - 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。
 - (2) 無形固定資産
 - 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
 - のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間(5～9年)に基づく定額法によっております。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金の計上方法
 - 債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
 - (2) 退職給付引当金の計上方法
 - 旧退職金制度
 - 適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。
 - 確定拠出年金制度
 - 確定拠出年金制度(DC)による退職年金制度を有しております。
 - 確定給付年金制度
 - キャッシュ・バランス型の年金制度(CB)の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。
 - 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。
 - 過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(9年)による定額法により費用処理しております。
 - 数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(9年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

(3) 賞与引当金の計上方法

従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(4) 役員賞与引当金の計上方法

役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(5) 早期退職慰労引当金の計上方法

早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(未適用の会計基準等)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2018年3月30日)

「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
建物附属設備	1,525 百万円	1,769 百万円
器具備品	950 百万円	1,104 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
未収入金	- 百万円	3 百万円
未収収益	554 百万円	917 百万円
未払金	1,168 百万円	969 百万円
未払費用	385 百万円	445 百万円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく事業年度末の借入未実行残高は次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
その他営業収益	5,680 百万円	5,554 百万円
委託調査費	704 百万円	698 百万円
事務委託費	864 百万円	954 百万円
運用受託報酬	149 百万円	225 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式(株)	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年3月28日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2018年12月31日	2019年3月29日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（2018年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	23,891	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	1,588	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	2,291	-
(4) 未収収益	1,402	1,402	-
(5) 長期差入保証金	1,119	1,112	6
資産計	30,293	30,287	6
(1) 未払手数料	515	515	-
(2) 未払費用	1,039	1,039	-
負債計	1,554	1,554	-

当事業年度（2019年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	20,388	20,388	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	1,696	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	2,268	-
(4) 未収収益	1,832	1,832	-
(5) 長期差入保証金	1,120	1,116	4
資産計	27,306	27,302	4
(1) 未払手数料	487	487	-
(2) 未払費用	1,102	1,102	-
負債計	1,590	1,590	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年12月31日)

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	-	-	-
(4) 未収収益	1,402	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	56	11
合計	29,174	1,051	56	11

当事業年度(2019年12月31日)

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	20,388	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	-	-	-
(4) 未収収益	1,832	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	57	11
合計	26,186	1,051	57	11

(有価証券関係)

前事業年度 (2018年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	11	12	0
合計		11	12	0

当事業年度 (2019年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	49	47	1
合計		49	47	1

(退職給付関係)

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度(確定拠出年金制度及び確定給付年金制度)を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、から の三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,832
勤務費用	269
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	11
退職給付の支払額	138
過去勤務費用の発生額	47
退職給付債務の期末残高	1,934

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
年金資産の期首残高	2,621
期待運用収益	23
数理計算上の差異の発生額	113
事業主からの拠出額	303
退職給付の支払額	138
年金資産の期末残高	2,696

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2018年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,874
年金資産	2,696
非積立型制度の退職給付債務	821
	60
未積立退職給付債務	761
未認識数理計算上の差異	73
未認識過去勤務費用	52
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635
退職給付引当金	60
前払年金費用	696
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
勤務費用	269
利息費用	7
期待運用収益	23
数理計算上の差異の費用処理額	44
過去勤務費用の処理額	8
確定給付制度に係る退職給付費用合計	200
特別退職金	84
合計	285

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券77%、株式20%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

当事業年度（自 2019年1月1日 至 2019年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,934
勤務費用	290
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	14
退職給付の支払額	204
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,047

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
年金資産の期首残高	2,696
期待運用収益	26
数理計算上の差異の発生額	132
事業主からの拠出額	328
退職給付の支払額	204
年金資産の期末残高	2,979

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (2019年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,979
年金資産	2,979
非積立型制度の退職給付債務	999
	67
未積立退職給付債務	931
未認識数理計算上の差異	157
未認識過去勤務費用	41
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732
退職給付引当金	67
前払年金費用	800
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
勤務費用	290
利息費用	11
期待運用収益	26
数理計算上の差異の費用処理額	33
過去勤務費用の処理額	10
確定給付制度に係る退職給付費用合計	231
特別退職金	36
合計	267

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2019年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券76%、株式21%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	167	191
賞与引当金	591	617
資産除去債務	239	239
未払事業税	83	72
早期退職慰労引当金	13	3
退職給付引当金	18	20
有形固定資産	3	1
その他	96	45
繰延税金資産合計	1,213	1,191
繰延税金負債		
退職給付引当金	213	245
資産除去債務に対応する除去費用	152	121
その他	-	0
繰延税金負債合計	365	366
繰延税金資産の純額	848	824

(注) 前事業年度及び当事業年度における繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	848	824

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (2018年12月31日)		当事業年度 (2019年12月31日)	
法定実効税率	30.9	%	30.6	%
(調整)				
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0		1.9	
損金不算入ののれん償却額	0.2		-	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.1		-	
所得拡大促進税制による税額控除	1.9		-	
その他	0.8		0.0	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.1	%	32.5	%

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間約5年と見積り、割引率は0.16%~0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
期首残高	262	781
有形固定資産の取得に伴う増加額	75	-
見積りの変更による増加額	440	-
時の経過による調整額	3	0
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	781	782

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 (2018年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	164	-	3	3
	合計	164	-	3	3

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度 (2019年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	79	-	0	0
	買建 英債券	0	-	0	0
合計		79	-	0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,639	8,523	13,511	27,674

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,237	11,293	3,143	27,674

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,830	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,458	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年1月1日 至 2019年12月31日）

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,643	7,545	13,290	26,480

(2) 地域ごとの情報

売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
12,538	11,197	2,744	26,480

（注） 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,779	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,314	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用 受託報酬	149	未収収益	554
							受入 手数料	5,680		
							委託 調査費	704	未払費用	385
							事務 委託費	864	その他未払金	165
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	その他未払金	1,002

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用 受託報酬	225	未収収益	917
							受入 手数料	5,554		
							委託 調査費	698	未払費用	445
							事務 委託費	954	その他未払金	74
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	未収入金	3
									その他未払金	894

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,458	未収収益	330
							委託調査費	37	未払費用	4
							事務委託費	8		

当事業年度 (自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,314	未収収益	360
							委託調査費	145	未払費用	9
							事務委託費	28		

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

- ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)
 ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)
 ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
1株当たり純資産額	1,828,761 円 92 銭	1,642,418 円 94 銭
1株当たり当期純利益金額	359,180 円 40 銭	326,833 円 15 銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
当期純利益 (百万円)	5,387	4,902
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	5,387	4,902
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2019年1月1日 至2019年12月31日)を対象としております。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行ないました。
2007年12月27日	事業を営むことの目的を変更するため、定款変更を行ないました。
2008年7月1日	グループ会社の1つであるパークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社を吸収合併し、それに伴い資本金の額を変更いたしました。
2008年7月1日	株式取扱規則に関する記述を追加するため、定款変更を行ないました。
2009年6月22日	本店所在地変更のため、定款変更を行ないました。
2009年12月2日	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 商号変更(「ブラックロック・ジャパン株式会社」に変更)および定款変更を行ないました。
2011年4月1日	グループ会社であるブラックロック証券株式会社を吸収合併し、それに先立ち定款変更および資本金の額の変更を行ないました。
2013年10月5日	MGPA Japan LLCより不動産投資関連の事業を譲受し、それに先立ち定款変更を行ないました。
2014年12月1日	決算期を3月31日から12月31日に変更するため、定款変更を行ないました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(2020年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 株式会社日本カストディ銀行
- ・資本金 : 51,000百万円(2020年7月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2020年3月末現在)	事業の内容
藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社*	3,000	
株式会社SBI証券	48,323	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社伊予銀行*	20,948	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。

* 四国アライアンス証券株式会社および株式会社伊予銀行は、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・償還金の支払いに関する事務等を行ない、新規の募集および販売の取扱いは行ないません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社（受託者）として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下の通り提出されております。

2020年1月17日	臨時報告書
2020年3月19日	有価証券報告書、有価証券届出書
2020年4月16日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2020年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田中素子
--------------------	-------	------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中島紀子
--------------------	-------	------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2019年1月1日から2019年12月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2019年12月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年8月5日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2019年12月21日から2020年6月22日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2020年6月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。