

運用報告書 (全体版)

グローバル・アロケーション・オープン Bコース (年4回決算・為替ヘッジなし)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合	
信託期間	2013年10月21日から2028年9月15日まで。	
運用方針	投資信託証券を主要投資対象として、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	グローバル・アロケーション・オープンBコース(年4回決算・為替ヘッジなし)	投資信託証券。
	ブラックロック・グローバル・ファンズ・アロケーション・ファンド・クラスX米ドル建投資証券 国内マネー・マザーファンド	世界中のさまざまな資産(株式・債券など)国・地域・セクターなどから投資魅力度が高いと判断する資産。 本邦通貨建ての公社債。
運用方法	以下の投資信託証券への投資を通じて、世界各国の様々な資産への分散投資と為替取引で得られる収益の獲得による投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 ルクセンブルグ籍外国投資法人 ブラックロック・グローバル・ファンズ・アロケーション・ファンド・クラスX(以下「アロケーション・ファンド」といいます。)米ドル建投資証券 国内証券投資信託(親投資信託) 国内マネー・マザーファンド受益証券 各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向等を勘案して決定するものとし、アロケーション・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。アロケーション・ファンドへの投資に係る指図権限を、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。	
組入制限	グローバル・アロケーション・オープンBコース(年4回決算・為替ヘッジなし) 国内マネー・マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として次の方針に基づき収益の分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。分配金額は、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

第41期 <決算日 2023年12月15日>
第42期 <決算日 2024年3月15日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「グローバル・アロケーション・オープンBコース(年4回決算・為替ヘッジなし)」は、2024年3月15日に第42期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2
<https://www.am-one.co.jp/>

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

グローバル・アロケーション・オープンBコース（年4回決算・為替ヘッジなし）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資証券組入比率	債券組入率比	純資産額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率			
第17作成期	33期(2021年12月15日)	円 10,605	円 250	% 2.1	% 95.9	% 0.1	百万円 57,205
	34期(2022年3月15日)	10,064	0	△5.1	96.2	0.3	53,813
第18作成期	35期(2022年6月15日)	10,465	250	6.5	93.0	0.2	55,183
	36期(2022年9月15日)	10,609	500	6.2	93.7	0.2	55,581
第19作成期	37期(2022年12月15日)	10,140	150	△3.0	96.8	0.2	53,520
	38期(2023年3月15日)	9,886	0	△2.5	96.1	0.2	51,850
第20作成期	39期(2023年6月15日)	10,620	250	10.0	95.9	0.2	55,204
	40期(2023年9月15日)	10,778	250	3.8	90.7	0.2	57,402
第21作成期	41期(2023年12月15日)	10,631	250	1.0	96.0	0.2	56,892
	42期(2024年3月15日)	10,912	750	9.7	96.1	0.2	57,951

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入率」は実質比率を記載しております。

(注3) 「投資証券組入率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注4) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基準価額		投資証券組入比率	債券組入率比
		騰落率	騰落率		
第41期	(期首) 2023年9月15日	円 10,778	% -	% 90.7	% 0.2
	9月 末	10,547	△2.1	97.8	0.2
	10月 末	10,356	△3.9	97.8	0.2
	11月 末	10,944	1.5	98.6	0.2
	(期末) 2023年12月15日	10,881	1.0	96.0	0.2
第42期	(期首) 2023年12月15日	10,631	-	96.0	0.2
	12月 末	10,749	1.1	98.3	0.2
	2024年1月 末	11,202	5.4	98.4	0.2
	2月 末	11,630	9.4	98.1	0.2
	(期末) 2024年3月15日	11,662	9.7	96.1	0.2

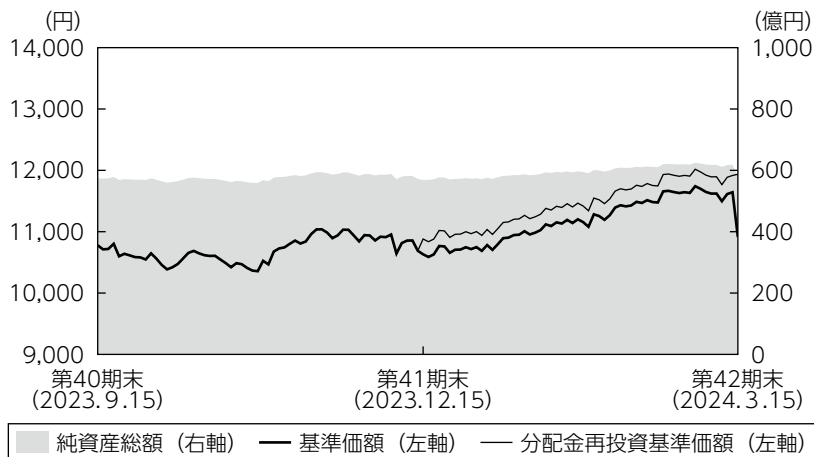
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入率」は実質比率を記載しております。

(注3) 「投資証券組入率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■第41期～第42期の運用経過（2023年9月16日から2024年3月15日まで）

基準価額等の推移



第41期首：10,778円
第42期末：10,912円
(既払分配金1,000円)
騰落率：10.7%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 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たもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。主として組み入れている「ブラックロック・グローバル・ファンズ - グローバル・アロケーション・ファンド - クラスX（米ドル建て）」（以下、「アロケーション・ファンド」といいます。）の価格上昇と、円安・米ドル高傾向がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

世界主要国の株式市場は上昇しました。米国では、高金利長期化観測から軟調な展開となりました。2023年10月下旬にかけては、イスラエル情勢への警戒感が燻る中、長期金利が大幅に上昇し、株価は大きく下落しました。その後は、インフレ減速などから、F R B（米連邦準備理事会）の早期利下げ観測を受けた金利低下を好感し、上昇傾向となりました。日本、欧州も米国と同様な動きとなりましたが、作成期末にかけては、日本は日銀によるマイナス金利政策の解除観測から一時円高に振れたことを嫌気し、小幅下落しました。

世界主要国の債券市場は、まちまちの展開となりました。米国金利は、堅調な雇用市場などによる高金利長期化観測や米国債の需給悪化懸念などから上昇傾向となりました。2023年11月以降は、米経済指標の下振れを受けて低下したものの、年明け以降は上昇に転じ、作成期首とほぼ変わらない水準となりました。国内金利は、日銀の金融政策の早期正常化を巡る思惑が交錯する中、米国金利と同様な動きとなりました。欧州金利もほぼ同様な動きとなりましたが、景気減速懸念から低下しました。

為替市場では円は対米ドル、対ユーロで下落しました。日銀のマイナス金利解除観測が燻る中、F R Bの高金利長期化見通しから円安・米ドル高が進展しました。2023年12月末にかけては、米経済指標の下振れなどから米長期金利が低下したことから円高傾向となりました。その後は、米国の早期利下げ期待が後退し、再び円安・米ドル高となりました。作成期末にかけては、日銀によるマイナス金利政策の解除観測から一時円高に振れる場面もありました。ユーロは、ユーロ圏景気の減速懸念や米国金利の動きなどから米ドルに対して一進一退で推移したものの、円に対しては上昇しました。

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響により、概ねマイナス圏で推移しましたが、作成期末にかけては、マイナス金利政策が近く解除されるとの見方を背景に、プラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

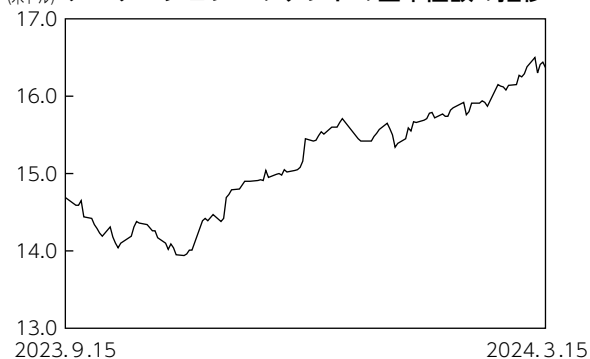
●当ファンド

当ファンドは、アロケーション・ファンドの組入比率を高位に維持しました。また、国内マネー・マザーファンドに少額投資を行い、組入比率を維持しました。

●アロケーション・ファンド

世界各国のさまざまな資産（株式、債券など）、国・地域、セクターなどから、投資魅力度が高いと判断される資産に分散投資を行いました。当作成期は、株式部門では長期的な成長分野と、経済の継続的な回復から恩恵を受け質が高いと判断する景気循環分野へ、バランスをとって投資を行いました。また、債券部門では、金利上昇リスクを抑制する一方、社債や証券化商品などの多様な資産への投資を通じて利回りの確保を目指しました。

(米ドル) アロケーション・ファンドの基準価額の推移



※基準価額は、当作成期間における分配金を再投資したものとみなして計算しています。

●国内マネー・マザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第41期	第42期
	2023年9月16日 ~2023年12月15日	2023年12月16日 ~2024年3月15日
当期分配金（税引前）	250円	750円
対基準価額比率	2.30%	6.43%
当期の収益	105円	750円
当期の収益以外	144円	-円
翌期繰越分配対象額	631円	912円

- (注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。
- (注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。
- (注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、アロケーション・ファンドの組入比率を高位に維持し、世界各国の株式や債券などさまざまな資産への分散投資で得られる収益の獲得を目指します。

●アロケーション・ファンド

世界中のさまざまな資産（株式・債券など）、国・地域、セクターなどから、投資魅力度が高いと判断する資産を発掘します。多くの資産および個別銘柄（証券）に分散投資をすることで、株式投資より低いリスクで、競争力のあるリターンを獲得を目指します。投資環境に応じて株式や債券などの各資産への配分比率や個別銘柄（証券）への投資を機動的に変更することで、中長期的なトータルリターンの最大化を目指します。

●国内マネー・マザーファンド

日銀は2024年3月の金融政策決定会合で、マイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策の解除を決定しました。声明文で日銀は「現時点の経済・物価見通しを前提にすれば、当面、緩和的な金融環境が継続すると考えている。」としており、今後はプラス圏ながらも金利は低位で推移するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第41期～第42期		項目の概要
	(2023年9月16日 ～2024年3月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	113円	1.028%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,943円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(69)	(0.629)	
(販売会社)	(42)	(0.383)	
(受託会社)	(2)	(0.016)	
(b) その他費用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(0)	(0.000)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	113	1.029	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

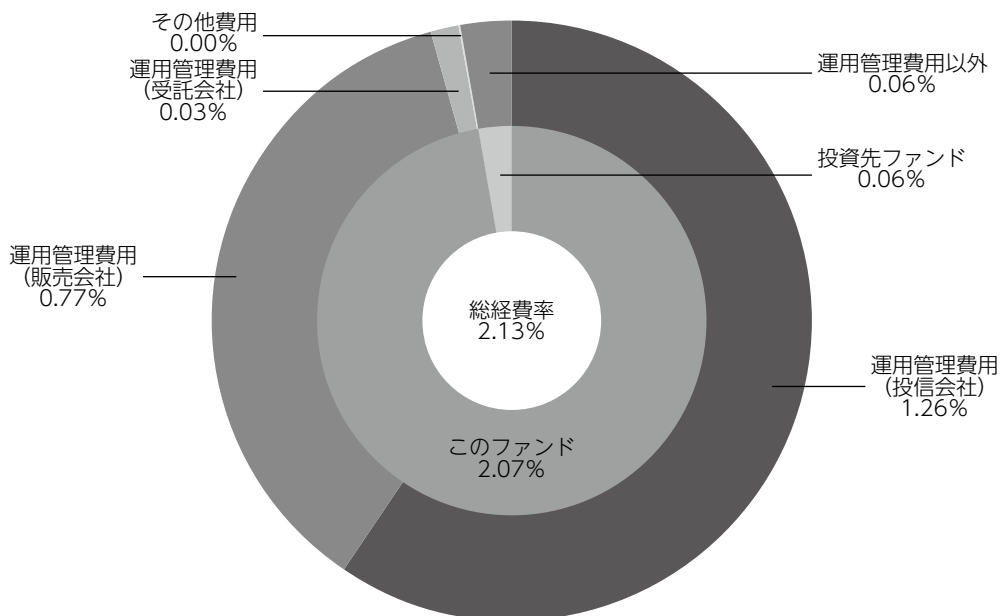
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.13%です。



総経費率 (①+②+③)	2.13%
①このファンドの費用の比率	2.07%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用および「ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンド・クラスX」（以下「アロケーション・ファンド」という場合があります。）への投資の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社（ブラックロック・ジャパン株式会社）に対する報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.75%（税抜））が含まれます。

(注6) ②の費用には、直接の投資運用会社報酬などはありません。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■**売買及び取引の状況**（2023年9月16日から2024年3月15日まで）
投資証券

		第 41 期 ~ 第 42 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外 国	ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスX米ドル建投資証券	千□ 2,702.78476	千アメリカ・ドル 40,000	千□ 3,819.24002	千アメリカ・ドル 60,800

(注) 金額は受渡代金です。

■**親投資信託受益証券の設定、解約状況**（2023年9月16日から2024年3月15日まで）
期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■**利害関係人との取引状況等**（2023年9月16日から2024年3月15日まで）
期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■**組入資産の明細**

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 20 作 成 期 末				
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスX米ドル建投資証券	千□ 24,017.86525	千□ 22,901.40999	千アメリカ・ドル 374,896	千円 55,705,808	% 96.1
合 計	24,017.86525	22,901.40999	374,896	55,705,808	96.1

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 親投資信託残高

	第 20 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内マネー・マザーファンド	千□ 188,580	千□ 188,580	千円 189,976

■投資信託財産の構成

2024年3月15日現在

項 目	第 21 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	55,705,808	89.2
国 内 マ ネ ー ・ マ ー フ ァ ン ド	189,976	0.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,532,091	10.5
投 資 信 託 財 産 総 額	62,427,876	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、55,705,808千円、89.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年3月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=148.59円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月15日)、(2024年3月15日)現在

項 目	第 41 期 末	第 42 期 末
(A) 資 産	58,685,052,524円	63,467,346,917円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,896,010,957	6,532,091,215
投 資 証 券(評価額)	54,599,027,503	55,705,808,754
国 内 マ ネ ー ・ マ ー フ ァ ン ド(評価額)	190,014,064	189,976,348
未 収 入 金	-	1,039,470,600
(B) 負 債	1,792,966,952	5,515,411,603
未 払 金	-	1,039,675,000
未 払 収 益 分 配 金	1,337,874,814	3,983,115,620
未 払 解 約 金	158,910,102	186,640,222
未 払 信 託 報 酬	295,898,427	305,690,171
そ の 他 未 払 費 用	283,609	290,590
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	56,892,085,572	57,951,935,314
元 本	53,514,992,574	53,108,208,276
次 期 繰 越 損 益 金	3,377,092,998	4,843,727,038
(D) 受 益 権 総 口 数	53,514,992,574口	53,108,208,276口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,631円	10,912円

(注) 第40期末における元本額は53,260,853,172円、当作成期間(第41期～第42期)中における追加設定元本額は3,072,709,114円、同解約元本額は3,225,354,010円です。

■損益の状況

[自 2023年9月16日] [自 2023年12月16日]
[至 2023年12月15日] [至 2024年3月15日]

項 目	第 41 期	第 42 期
(A) 配 当 等 収 益	△72,094円	△30,826円
受 取 利 息	1,486	592
支 払 利 息	△73,580	△31,418
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	858,859,237	5,717,363,607
売 買 益	2,774,935,980	5,754,967,257
売 買 損	△1,916,076,743	△37,603,650
(C) 信 託 報 酬 等	△296,215,109	△305,992,797
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	562,572,034	5,411,339,984
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,367,405,234	1,538,335,860
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,784,990,544	1,877,166,814
(配 当 等 相 当 額)	(736,155,038)	(772,225,118)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,048,835,506)	(1,104,941,696)
(G) 合 計(D+E+F)	4,714,967,812	8,826,842,658
(H) 収 益 分 配 金	△1,337,874,814	△3,983,115,620
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	3,377,092,998	4,843,727,038
追 加 信 託 差 損 益 金	1,784,990,544	1,877,166,814
(配 当 等 相 当 額)	(736,155,030)	(772,225,118)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,048,835,514)	(1,104,941,696)
分 配 準 備 積 立 金	1,592,176,739	2,966,591,453
繰 越 損 益 金	△74,285	△31,229

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、第41期から第42期までは239,995,490円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第 41 期	第 42 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	562,646,319	5,411,299,431
(c) 収 益 調 整 金	1,784,990,544	1,877,166,814
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,367,405,234	1,538,407,642
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	4,715,042,097	8,826,873,887
(f) 1万口当たり当期分配対象額	881.07	1,662.05
(g) 分 配 金	1,337,874,814	3,983,115,620
(h) 1万口当たり分配金	250	750

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 41 期	第 42 期
1 万口当たり分配金	250円	750円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、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）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎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、その後の受益者毎の個別元本となります。

ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスX

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ルクセンブルグ籍外国投資法人／米ドル建投資証券
運 用 方 針	世界中のさまざまな資産（株式・債券など）、国・地域、セクターなどから、投資魅力度が高いと判断する資産を発掘します。 多くの資産および銘柄（証券）に分散投資をすることで、株式投資より低いリスクで、競争力のあるリターンを獲得を目指します。 投資環境に応じて株式や債券などの各資産への配分比率や個別銘柄（証券）への投資比率を機動的に変更することで、中長期的なトータルリターンの最大化を目指します。
主 な 投 資 制 限	純資産総額の10%を超える借り入れは行わないこととします。 同一発行体の証券への投資は、原則として純資産総額の10%以下とします。
決 算 日	8月末
主 な 関 係 法 人	管理会社：ブラックロック（ルクセンブルグ） エス・エー 投資運用会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー 保管受託銀行：ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ
信 託 報 酬 等	ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスXにおいて、管理会社および投資運用会社への報酬はかかりません。 （ただし、各コースの委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社が受ける報酬から、各コースの投資顧問会社であるブラックロック・ジャパン株式会社に投資顧問報酬が支払われます。そして、その投資顧問報酬から、ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスXの投資運用会社などへの報酬が支払われます。）ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスXの上記報酬制度は変更される場合があります。
その他の費用・手数料	有価証券売買時の売買手数料、計算にかかる報酬、登録および名義書換代行事務会社報酬、税務顧問、法律顧問、ファンド監査人などへの報酬、取締役の報酬、保管受託銀行への報酬などがブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスXから支払われます。これらは定率でないため事前に概算料率や上限額などを表示することができません。
収 益 分 配 方 針	原則として、年1回、経費控除後の利子配当等収益を分配します。 ※分配原資が無い場合など分配を行わない場合もあります。
設 定 日	1997年1月3日（他の既存クラスを含めた当初の設定日）

「ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドークラスX」は、「ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンド」を構成する個別クラスとなっております。

「ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

ブラックロック・グローバル・ファンズ・グローバル・アロケーション・ファンドの内容

(1) 純資産計算書

2023年8月31日現在

(2) 損益及び純資産変動計算書

2023年8月31日終了年度

区分	金額 (米ドル)
資産	
有価証券ポートフォリオ (取得価額)	13,458,543,875
未実現利益	871,003,215
有価証券ポートフォリオ (市場価額)	14,329,547,090
銀行預金	158,627,288
ブローカーによる債権	17,414,768
未収利息及び未収配当金	59,867,209
投資売却による未収入金	6,856,498
ファンド投資証券発行による未収入金	12,046,295
先物取引にかかる未実現利益	690,180
差金決済取引にかかる未実現利益	261,087
買建オプション/スワップションの市場価額	59,165,050
その他の資産	1,250,122
資産合計	14,645,725,587
負債	
銀行への債務	6,812
ブローカーへの債務	6,802,009
未払収益分配金	28,764,337
投資購入による未払金	20,284,797
ファンド投資証券償還による未払金	17,773,502
外国為替予約取引にかかる未実現損失	57,488,077
スワップの市場価額	1,122,104
売建オプション/スワップションの市場価額	36,531,297
その他の負債	21,675,756
負債合計	190,448,691
純資産合計	14,455,276,896

区分	金額 (米ドル)
純資産期首残高	15,096,811,718
収益	
現金および現金同等物利息	7,871,309
債券利息 (源泉徴収後純額)	259,728,067
スワップ金利	33,911,443
差金決済取引金利	6,085,802
市場金利連動型普通預金金利	9,485,987
集団投資スキーム (CIS) による収入、源泉徴収後純額	244,153
配当金 (源泉徴収後純額)	132,026,774
差金決済取引配当金、源泉徴収後純額	21,162
有価証券貸付による収入	3,580,255
管理費の払戻し	27,921
その他払戻し	60,690
収益合計	453,043,563
費用	
スワップ金利	20,617,760
差金決済取引配当金、源泉徴収後純額	4,527,005
年間サービス料	26,727,093
貸出コミットメント料	45,211
保管及び預託報酬	1,794,818
分配費用	14,088,725
税金	6,379,364
管理会社報酬	181,432,387
費用合計	255,612,363
純利益 (損失)	197,431,200
投資にかかる実現純利益 (損失)	(32,087,780)
TBA有価証券取引契約にかかる実現純利益 (損失)	(19,687,135)
差金決済取引にかかる実現純利益 (損失)	(25,171,502)
先物取引にかかる実現純利益 (損失)	(66,106,311)
オプション/スワップション取引にかかる実現純利益 (損失)	68,578,153
スワップ取引にかかる実現純利益 (損失)	(129,249,995)
外国為替予約取引にかかる実現純利益 (損失)	1,249,433
その他の取引による外国為替にかかる実現純利益 (損失)	14,730,566
当期実現純利益 (損失)	(187,744,571)
投資にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	708,298,430
TBA有価証券取引契約にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	1,164,722
差金決済取引にかかる未実現純利益 (損失) の純変動額	(1,568,236)
先物取引にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	32,457,417
オプション/スワップション取引にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	7,951,698
スワップ取引にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	38,830,171
外国為替予約取引にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	53,364,185
その他の取引による外国為替にかかる未実現利益 (損失) の純変動額	1,598,251
当期末実現利益 (損失) の純変動額	842,096,638
営業による純資産の増加 (減少) 額	851,783,267
投資証券の変動額	
投資証券発行による受取純額	1,844,669,591
投資証券買戻しによる支払純額	(3,309,238,264)
投資証券の変動による純資産の増加 (減少) 額	(1,464,568,673)
公表済配当金	(28,749,416)
純資産期末残高	14,455,276,896

(3) 投資有価証券明細表

2023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他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
ファンド				カナダ			
	アイルランド			279,043	Barrick Gold	4,564,576	0.03
150,000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	6,676,500	0.05	59,886	Brookfield*	2,050,194	0.01
1,474,946	iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF	13,160,206	0.09	594,289	Comcast	22,113,494	0.15
	ファンド合計	19,836,706	0.14	63,259	Canadian National Railway	7,179,460	0.05
普通/優先株式 (証券) およびワラント				2,661,062	Enbridge*	94,179,642	0.65
オーストラリア				8,883	George Weston	992,926	0.01
63,078	AGL Energy*	453,125	0.00	196,385	Lions Gate Entertainment	1,520,020	0.01
274,257	BHP	7,967,622	0.05	10,698	Loblaw	940,068	0.01
17,503	CSL	3,101,173	0.02	65,012	Metro*	3,332,155	0.02
300,913	Endeavour*	1,072,043	0.01	147,133	Pembina Pipeline*	4,612,392	0.03
711,593	Medibank Pvt	1,687,024	0.01	92,053	Rogers Communications*	3,792,057	0.03
367,508	Metcash*	887,941	0.01	78,188	Royal Bank of Canada	7,123,196	0.05
332,908	Origin Energy	1,878,239	0.01	34,104	Shopify	2,211,825	0.02
270,012	Qantas Airways	1,033,663	0.01	929,135	Suncor Energy*	31,613,144	0.22
595,950	South32	1,312,494	0.01	161,385	Teck Resources	6,750,735	0.05
		19,393,324	0.13	42,052	TELUS	745,080	0.00
ベルギー						193,720,964	1.34
34,352	KBC	2,263,782	0.02	ケイマン諸島			
7,287	UCB	654,300	0.00	522,600	Alibaba	6,010,284	0.04
		2,918,082	0.02	96,800	ASMPT	969,484	0.01
バミューダ				263,350	Baidu	4,680,747	0.03
359,304	Bunge*	41,208,576	0.29	262,500	CK Asset	1,449,227	0.01
7,440	Credicorp	1,065,296	0.01	107,600	JD Health International*	580,326	0.00
162,700	Hongkong Land	577,585	0.00	79,278	JD.com	1,301,930	0.01
151,362	Invesco	2,395,304	0.02	64,680	Lavoro (Wts 27/12/2027)	50,450	0.00
132,000	Orient Overseas International	1,770,552	0.01	187,600	Li Auto	3,865,389	0.03
		47,017,313	0.33	168,430	Meituan	2,759,571	0.02
ブラジル				4,194,945	Microport Cardioflow Medtech	1,000,200	0.01
2,356,691	Ambev	6,725,431	0.04	513,000	SITC International	956,277	0.01
117,988	Bradespar	544,818	0.00	701,900	Tencent	29,085,575	0.20
1,455,060	Cia Energetica de Minas Gerais	3,688,718	0.03	53,900	Trip.com	2,126,318	0.02
3,381,184	Cielo	2,594,136	0.02	473,000	Want Want China	313,002	0.00
134,498	Cosan	490,565	0.00	1,532,000	WH	789,150	0.01
567,764	Embraer	2,228,725	0.02			55,937,930	0.40
42,672	Engie Brasil Energia	367,146	0.00	中国			
511,132	Lojas Renner	1,668,212	0.01	2,930,000	Agricultural Bank of China	1,004,937	0.01
138,628	Petroreconcavo	651,942	0.01	10,100	Anhui Gujing Distillery	168,003	0.00
204,853	Telefonica Brasil	1,754,220	0.01	1,188,000	BYD	37,232,086	0.26
120,978	Transmissora Alianca de Energia Eletrica	848,372	0.01	4,307,000	China Construction Bank	2,306,446	0.01
		21,562,285	0.15	365,500	China Merchants Bank	1,444,668	0.01
				7,510,000	China Tower	727,734	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
中国 (続き)			
170,600	COSCO SHIPPING Energy Transportation	310,700	0.00
270,200	Dongfang Electric	623,194	0.00
3,307,000	Industrial & Commercial Bank of China	1,517,944	0.01
103,700	JA Solar Technology	396,678	0.00
1,659,900	LONGi Green Energy Technology	6,057,486	0.04
321,840	Ningbo Deye Technology	4,079,097	0.03
117,400	Nongfu Spring*	659,376	0.01
2,316,000	PetroChina*	1,671,376	0.01
144,450	Pharmaron Beijing*	337,045	0.00
270,000	Shanghai Fosun Pharmaceutical	635,499	0.00
35,100	Shanxi Xinghuaacun Fen Wine Factory	1,167,772	0.01
566,568	Trina Solar	2,646,192	0.02
		<u>62,986,233</u>	<u>0.43</u>
キュラソー			
165,799	Schlumberger	9,755,613	0.07
デンマーク			
1,688	AP Moller - Maersk*	3,097,837	0.02
26,348	DSV	4,981,188	0.04
189,102	Novo Nordisk	35,180,523	0.24
11,472	Novozymes*	497,902	0.00
		<u>43,757,450</u>	<u>0.30</u>
フィンランド			
32,678	Elisa*	1,611,731	0.01
32,347	Kesko	634,162	0.01
71,207	Kone	3,279,504	0.02
		<u>5,525,397</u>	<u>0.04</u>
フランス			
344,387	Accor	12,412,355	0.09
1,274,816	BNP Paribas	83,055,487	0.57
144,479	Bollere	847,243	0.01
62,608	Carrefour	1,202,974	0.01
960,680	Cie de Saint-Gobain	62,568,379	0.43
106,802	Dassault Systemes	4,252,587	0.03
260,016	EssilorLuxottica*	49,616,296	0.34
4,908	Hermes International	10,209,985	0.07
75,466	Kering*	40,811,329	0.28
68,690	La Francaise des Jeux SAEM	2,495,093	0.02
21,440	L' Oreal	9,546,407	0.07
81,308	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton*	70,042,493	0.48
3,542	Remy Cointreau*	555,296	0.00
317,167	Sanofi	34,242,269	0.24
13,755	Schneider Electric	2,379,987	0.02
33,787	SCOR*	1,055,723	0.01
101,275	Societe Generale*	2,894,731	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
フランス (続き)			
7,892	Teleperformance*	1,096,414	0.01
332,221	TotalEnergies	20,970,492	0.14
335,990	Vinci	37,779,967	0.26
		<u>448,035,507</u>	<u>3.10</u>
ドイツ			
604,248	Bayer	33,381,929	0.23
90,709	Bayerische Motoren Werke	9,607,203	0.07
10,881	Brenntag*	886,813	0.01
11,111	Carl Zeiss Meditec	1,121,581	0.01
1,097,322	Commerzbank	12,149,402	0.08
30,505	Continental	2,279,008	0.01
151,017	Dr Ing hc F Porsche*	16,704,015	0.11
50,846	Fresenius	1,639,508	0.01
79,385	LANXESS*	2,517,532	0.02
676,218	Mercedes-Benz	49,822,816	0.34
34,612	Merck	6,267,449	0.04
636,022	SAP	89,692,573	0.62
49,622	SAP	7,000,176	0.05
16,405	Scout24	1,132,698	0.01
485,115	Siemens	73,337,875	0.51
62,723	Symrise	6,577,812	0.04
849,909	Telefonica Deutschland*	1,628,898	0.01
40,938	United Internet*	787,043	0.01
33,039	Volkswagen	4,071,333	0.03
120,519	Zalando	3,798,477	0.03
		<u>324,404,141</u>	<u>2.24</u>
ガーンジー			
480,079	Genius Sports*	3,202,127	0.02
香港			
3,460,600	AIA	31,415,968	0.22
146,500	BOC Hong Kong	407,205	0.00
21,500	BYD Electronic International	99,646	0.00
66,800	Hang Seng Bank	851,717	0.01
826,000	Lenovo	934,163	0.01
221,500	MTR	924,920	0.00
		<u>34,633,619</u>	<u>0.24</u>
インド			
29,061	Bajaj Auto	1,619,612	0.01
19,433	Eicher Motors	783,224	0.01
81,264	HCL Technologies	1,150,597	0.01
439,628	Indian Oil	473,157	0.00
53,648	Kotak Mahindra Bank	1,139,723	0.01
17,896	Tata Consultancy Services	725,643	0.00
		<u>5,891,956</u>	<u>0.04</u>

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
インドネシア			
3,776,800	Bank Central Asia	2,275,255	0.02
アイルランド			
48,003	Allegion	5,479,062	0.04
6,644	Aon	2,229,461	0.02
27,705	Johnson Controls International	1,642,906	0.01
77,274	Kingspan	6,522,601	0.04
19,320	Linde	7,511,809	0.05
63,858	Seagate Technology	4,477,084	0.03
7,881	Trane Technologies	1,624,432	0.01
33,039	Willis Towers Watson	6,899,534	0.05
		<u>36,386,889</u>	<u>0.25</u>
イスラエル			
186,456	Nice*	36,897,778	0.26
イタリア			
306,459	Enel*	2,073,415	0.02
105,441	FinecoBank Banca Fineco	1,458,571	0.01
11,386,019	Intesa Sanpaolo*	30,771,839	0.21
359,871	Snam*	1,868,257	0.01
1,085,116	UniCredit*	26,789,266	0.19
		<u>62,961,348</u>	<u>0.44</u>
日本			
6,700	AGC	234,389	0.00
50,400	Alfresa*	860,030	0.01
84,300	Aozora Bank*	1,650,759	0.01
348,200	Astellas Pharma	5,275,831	0.04
15,800	Bank of Kyoto	910,456	0.01
115,100	BayCurrent Consulting*	3,947,839	0.03
700	Capcom	29,422	0.00
47,900	Coca-Cola Bottlers Japan	622,204	0.00
10,900	East Japan Railway*	613,929	0.00
1,329,500	FANUC	37,777,801	0.26
19,000	Heiwa	288,988	0.00
924,700	Honda Motor*	29,755,157	0.21
256,052	Hoya	28,302,288	0.20
23,800	Ito En	701,681	0.01
2,466,600	Japan Airlines	50,646,697	0.35
330,100	Japan Post Bank*	2,639,129	0.02
14,000	Jeol*	445,418	0.00
41,300	Kakaku.com*	490,271	0.00
25,900	Kamigumi*	581,600	0.00
66,700	Kawasaki Heavy Industries*	1,706,348	0.01
135,500	Kawasaki Kisen Kaisha*	4,529,801	0.03
33,600	Kewpie*	557,835	0.00

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
日本 (続き)			
139,319	Keyence	57,689,354	0.40
465,900	Komatsu*	13,229,006	0.09
197,300	Kose*	16,320,738	0.11
13,300	Kyocera	680,493	0.01
260,800	Lixil*	3,255,651	0.02
27,300	Mani	354,430	0.00
303,400	Mazda Motor*	3,181,284	0.02
35,700	Medipal*	609,920	0.00
34,100	MEIJI*	852,063	0.01
46,400	Mitsubishi Heavy Industries	2,625,487	0.02
667,400	Mitsubishi Motors*	2,615,169	0.02
8,881,700	Mitsubishi UFJ Financial*	70,704,799	0.49
793,400	Mitsui*	29,487,528	0.20
118,400	Mitsui OSK Lines*	3,269,560	0.02
22,900	Money Forward*	859,406	0.00
29,900	NET One Systems	584,068	0.00
154,200	Nihon M&A Center*	854,692	0.01
126,100	Nintendo*	5,407,060	0.04
270,000	Nippon Yusen	7,178,818	0.05
175,800	Nomura Research Institute*	5,033,855	0.04
5,100	Oracle Japan	354,877	0.00
13,100	Otsuka	582,153	0.00
207,400	Rakus	3,364,548	0.02
78,000	Santen Pharmaceutical	722,870	0.01
112,400	Sega Sammy*	2,236,772	0.02
55,600	SG*	800,400	0.01
6,600	Shimano*	966,371	0.01
109,200	Shin-Etsu Chemical*	3,480,982	0.03
99,100	Shiseido	4,011,328	0.03
57,200	Skylark	797,407	0.01
70,800	SMC*	34,199,863	0.24
80,100	SoftBank*	915,241	0.01
39,900	Stanley Electric*	698,465	0.00
18,300	Suzuken*	540,655	0.00
564,700	Sysmex	29,947,594	0.21
158,700	Takeda Pharmaceutical*	4,894,938	0.03
100,800	Terumo*	3,043,553	0.02
40,300	Tokyo Electron*	5,948,977	0.04
50,700	TOTO*	1,385,834	0.01
2,439,600	Toyota Motor*	41,980,057	0.29
10,000	Yakult Honsha*	522,322	0.00
223,900	ZOZO*	4,457,166	0.03
		<u>543,213,627</u>	<u>3.76</u>
ジャージー			
297,414	Aptiv	30,297,564	0.21

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	ジャージー (続き)		
67,045	Experian	2,365,261	0.02
13,937	Ferguson*	2,283,491	0.02
7,005,143	Glencore	37,398,413	0.26
		<u>72,344,729</u>	<u>0.51</u>
	リベリア		
52,049	Royal Caribbean Cruises*	5,165,863	0.04
	ルクセンブルク		
40,249	ArcelorMittal	1,076,415	0.01
	メキシコ		
158,614	Fomento Economico Mexicano	1,864,548	0.01
53,742	Grupo Aeroportuario del Sureste	1,557,268	0.01
231,625	Grupo Financiero Banorte	2,049,063	0.02
1,831,992	Wal-Mart de Mexico	7,479,911	0.05
		<u>12,950,790</u>	<u>0.09</u>
	オランダ		
291,137	ABN AMRO Bank*	4,341,601	0.03
16,263	Adyen	13,746,802	0.10
154,386	ASML	102,828,467	0.71
31,782	BE Semiconductor Industries*	3,703,338	0.03
315,555	CNH Industrial	4,377,071	0.03
55,667	Ferrari	17,852,953	0.12
6,586,334	ING Groep*	94,567,671	0.65
120,519	Koninklijke Vopak	4,339,809	0.03
70,943	LyondellBasell Industries	7,051,025	0.05
15,374	NXP Semiconductors	3,171,195	0.02
170,215	STMicroelectronics	8,113,650	0.06
		<u>264,093,582</u>	<u>1.83</u>
	ノルウェー		
279,829	Equinor	8,634,883	0.06
	サウジアラビア		
10,393	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services	673,351	0.01
51,208	Saudi Arabian Oil	476,495	0.00
144,560	Saudi Telecom	1,534,001	0.01
		<u>2,683,847</u>	<u>0.02</u>
	シンガポール		
21,100	DBS*	519,807	0.00
1,971,100	Genting Singapore	1,275,945	0.01
227,100	Keppel	1,165,982	0.01
388,100	NETLINK NBN TRUST	248,356	0.00
96,100	Oversea-Chinese Banking	892,241	0.01
9,519,143	Seatrium	1,021,130	0.01
227,900	Singapore Airlines*	1,158,288	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	シンガポール (続き)		
394,400	Singapore Technologies Engineering	1,111,673	0.00
777,700	Singapore Telecommunications	1,369,318	0.01
346,000	Wilmar International	967,572	0.01
		<u>9,730,312</u>	<u>0.07</u>
	南アフリカ		
17,944	Anglo American Platinum*	628,814	0.00
17,039	Capitec Bank	1,439,872	0.01
64,510	Kumba Iron Ore*	1,417,915	0.01
		<u>3,486,601</u>	<u>0.02</u>
	韓国		
142,824	Amorepacific	14,468,798	0.10
10,204	DB Insurance	630,729	0.00
16,282	Fila	466,872	0.00
71,077	GS Engineering & Construction	781,350	0.01
22,132	Hana Financial	662,244	0.01
558,543	HD Hyundai Infracore	4,449,750	0.03
6,739	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering	630,690	0.00
28,565	Hyundai Marine & Fire Insurance	653,748	0.00
129,009	KB Financial	5,280,414	0.04
27,958	Meritz Financial	1,157,028	0.01
22,304	NCSOFT	4,243,961	0.03
13,569	Samsung C&T	1,074,843	0.01
123,576	Samsung Electronics	6,254,764	0.05
18,520	Samsung Fire & Marine Insurance	3,453,891	0.02
283,260	SK Hynix	26,102,567	0.18
		<u>70,311,649</u>	<u>0.49</u>
	スペイン		
7,049	Aena SME	1,113,517	0.01
1,810,699	Cellnex Telecom	69,818,658	0.48
36,117	Endesa*	758,033	0.01
83,093	Industria de Diseno Textil	3,204,880	0.02
		<u>74,895,088</u>	<u>0.52</u>
	スウェーデン		
567,746	Assa Abloy	12,890,968	0.09
80,810	Atlas Copco*	1,078,529	0.01
74,763	Epiroc	1,443,280	0.01
24,961	Getinge	437,134	0.00
35,192	Industrivarden	926,798	0.01
579,291	Nibe Industrier	4,355,339	0.03
127,369	SKF	2,092,803	0.01
762,363	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3,938,567	0.03
1,802,376	Telia*	3,661,176	0.02
		<u>30,824,594</u>	<u>0.21</u>
	スイス		
653,085	Alcon	54,866,857	0.38

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	スイス (続き)		
	530 Barry Callebaut*	929,531	0.01
261,334	Chubb	52,867,868	0.36
2,828	Cie Financiere Richemont (Wts 22/11/2023)	2,674	0.00
198,920	Clariant	3,315,299	0.02
88,031	Coca-Cola HBC	2,572,207	0.02
4,645	DSM-Firmenich*	429,573	0.00
4,237	Flughafen Zurich*	879,821	0.00
2,313	Geberit	1,201,009	0.01
17,437	Kuehne + Nagel International*	5,249,604	0.04
50,518	Lonza	28,118,652	0.19
1,082,954	Nestle*	130,880,118	0.91
134,695	Novartis	13,664,570	0.09
83,557	Roche	24,800,999	0.17
1,934	Swisscom*	1,181,147	0.01
290,037	TE Connectivity	38,548,818	0.27
838,996	Transocean*	6,896,547	0.05
		<u>366,405,294</u>	<u>2.53</u>
	台湾		
312,000	ASE Technology	1,156,044	0.01
695,000	Chunghwa Telecom	2,531,516	0.02
631,000	Compal Electronics	632,060	0.00
1,748,000	Eva Airways	1,728,980	0.01
423,000	Far EasTone Telecommunications	937,741	0.01
117,000	Lite-On Technology	503,320	0.01
64,000	MediaTek	1,416,795	0.01
488,000	Quanta Computer	3,884,505	0.03
291,000	Taiwan Mobile	851,622	0.00
3,081,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	53,113,139	0.37
536,000	Wistron	1,969,194	0.01
29,000	Wiwynn	1,420,563	0.01
		<u>70,145,479</u>	<u>0.49</u>
	英国		
63,393	Anglo American	1,704,438	0.01
243,045	AstraZeneca	16,723,926	0.11
307,436	AstraZeneca	41,910,623	0.29
605,628	Auto Trader	4,675,441	0.03
9,982,733	BAE Systems	128,039,739	0.89
12,619,428	Barclays	23,774,768	0.16
546,271	BP	3,396,270	0.02
71,393	British American Tobacco	2,395,570	0.02
95,935	Burberry	2,690,057	0.02
1,111,214	Compass	28,338,278	0.20
563,725	Direct Line Insurance	1,161,592	0.01
385,936	Dowlais*	558,213	0.00
144,124	GSK	2,557,418	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	英国 (続き)		
25,763	Hikma Pharmaceuticals	718,486	0.00
436,055	Kingfisher	1,296,787	0.01
331,651	Legal & General*	927,020	0.01
9,036,287	Lloyds Banking	4,874,611	0.03
83,312	London Stock Exchange	8,626,262	0.06
44,434	National Grid	561,916	0.00
1,004,155	NatWest	2,960,805	0.02
163,418	Pearson	1,752,133	0.01
892,855	RELX	29,223,790	0.20
526,074	Shell*	32,706,021	0.23
2,840,288	Shell*	88,317,421	0.61
102,061	Spirax-Sarco Engineering	13,151,236	0.09
85,213	Standard Chartered*	775,586	0.01
1,565,419	Unilever	80,894,204	0.56
		<u>524,712,611</u>	<u>3.62</u>
	米国		
64,979	3M	6,994,989	0.05
624,922	Abbott Laboratories	65,241,857	0.45
119,520	AbbVie	17,761,867	0.12
88,011	Activision Blizzard	8,097,012	0.05
22,265	Adobe	12,417,636	0.09
340,210	Advanced Micro Devices	36,538,554	0.25
169,728	Air Products and Chemicals	50,197,056	0.35
158,358	Albemarle*	31,489,488	0.22
53,622	Allstate	5,839,972	0.04
1,818,994	Alphabet	250,711,943	1.73
1,363,958	Amazon.com	187,898,855	1.30
60,461	American Airlines*	892,404	0.01
37,868	American International	2,212,627	0.01
248,256	American Tower †	45,314,168	0.31
9,759	Amgen	2,507,966	0.01
68,773	ANSYS	21,835,427	0.15
25,128	APA	1,099,601	0.01
1,465,863	Apple †	275,670,196	1.91
222,776	Applied Materials	33,850,813	0.23
579,723	Archer-Daniels-Midland	46,569,148	0.33
15,208	Assurant	2,114,368	0.01
461,453	Astra Space	122,055	0.00
155,036	AT&T	2,296,083	0.02
58,775	Atlas Energy Solutions	1,247,793	0.01
21,477	Atlassian	4,416,316	0.03
40,626	Autodesk	9,033,597	0.06
1,803	AutoZone	4,612,363	0.03
17,835	Ball*	969,867	0.01
16,068	Berkshire Hathaway	5,806,012	0.04

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
11,914	Boeing	2,737,361	0.02
6,099	Booking	18,921,538	0.13
477,407	Booz Allen Hamilton	54,830,194	0.38
1,468,614	Boston Scientific	79,980,718	0.55
126,908	Cadence Design Systems	30,643,206	0.21
73,972	California Resources*	4,114,323	0.03
20,223	Campbell Soup*	856,849	0.01
77,170	Cano Health (Wts 3/6/2026)	3,936	0.00
100,904	Cano Health (Wts 6/7/2025)	5,146	0.00
18,994	Cencora	3,375,804	0.02
77,713	Centene	4,892,033	0.03
452,611	CF Industries	34,801,260	0.24
69,823	Charter Communications*	30,576,190	0.21
11,965	Chesapeake Energy*	1,054,715	0.01
28,253	Chevron	4,543,082	0.03
4,185	Chipotle Mexican Grill	8,127,270	0.06
29,253	Cigna	8,227,406	0.06
9,339	Cintas	4,725,720	0.03
33,614	Citigroup	1,395,989	0.01
387,410	Citigroup Capital XIII	11,335,616	0.08
16,654	Clorox	2,602,188	0.02
23,784	CME	4,816,974	0.03
85,038	Coca-Cola	5,132,894	0.04
75,238	Colgate-Palmolive	5,560,840	0.04
691,806	Comcast	32,694,752	0.23
430,078	ConocoPhillips	51,106,169	0.35
47,292	Constellation Brands	12,310,581	0.09
112,513	Costco Wholesale	61,218,323	0.42
106,727	Crowdstrike	17,156,365	0.11
15,138	Crown*	1,406,926	0.01
4,087	Cummins	947,775	0.01
107,261	CVS Health	7,142,510	0.05
249,206	Datadog	23,903,840	0.17
46,589	Deere	19,288,312	0.13
20,895	Dell Technologies	1,175,135	0.01
865,047	Delta Air Lines	37,153,769	0.25
163,747	Dexcom	16,867,578	0.12
34,628	DR Horton	4,107,227	0.03
47,925	Duke Energy*	4,317,563	0.03
372,647	Dynatrace	18,047,294	0.13
57,932	eBay	2,597,671	0.02
36,447	Edison International*	2,557,122	0.02
355,759	Edwards Lifesciences	27,596,226	0.19
25,910	Electronic Arts	3,123,710	0.02
128,209	Element Solutions*	2,666,747	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
110,903	Eli Lilly	60,885,747	0.42
50,722	EOG Resources	6,490,894	0.04
130,945	EQT*	5,616,231	0.04
22,290	Equitrans Midstream*	215,321	0.00
109,375	Equity Residential	7,133,437	0.05
31,564	Estee Lauder	5,211,532	0.04
114,734	Eversource Energy	7,410,669	0.05
92,280	EVgo (Wts 15/9/2025)	53,476	0.00
11,983	Expedia	1,302,552	0.01
27,984	Exxon Mobil	3,101,747	0.02
226,251	F5	36,937,738	0.26
4,048	FactSet Research Systems	1,763,147	0.01
4,785	Fair Isaac	4,352,532	0.03
55,441	Fastenal	3,218,905	0.02
104,131	Fidelity National Information Services	5,863,617	0.05
1,875	First Citizens BancShares	2,556,187	0.02
22,836	First Solar	4,306,641	0.03
110,909	Floor & Decor	11,205,136	0.08
629,942	Ford Motor	7,653,795	0.05
395,642	Fortinet	24,233,073	0.17
1,034,860	Fortive*	81,940,215	0.57
982,950	Freeport-McMoRan	39,612,885	0.27
37,660	General Mills*	2,562,763	0.02
490,401	General Motors	16,448,050	0.11
89,054	Gilead Sciences	6,842,910	0.04
19,240	Goldman Sachs	6,353,240	0.05
182,670	Green Plains*	5,693,824	0.04
40,053	Halliburton	1,557,261	0.01
69,306	Hartford Financial Services	4,983,101	0.03
19,944	HCA Healthcare	5,581,927	0.04
273,470	Healthpeak Properties	5,659,461	0.04
3,217	Hershey	696,255	0.00
89,191	Hewlett Packard Enterprise	1,541,666	0.01
208,391	Hilton Worldwide	31,283,657	0.22
79,631	Hippo (Wts 2/8/2026)	1,513	0.00
179,100	Humana	84,490,425	0.58
7,829	Illinois Tool Works*	1,952,240	0.02
158,732	Informatica*	3,317,499	0.02
236,452	Ingersoll Rand	16,527,995	0.11
30,530	Innovid (Wts 31/12/2027)	2,137	0.00
7,326	Insulet	1,438,021	0.01
21,452	International Flavors & Fragrances	1,523,736	0.01
79,417	International Paper	2,772,447	0.02
41,837	Intuit	22,635,072	0.16
129,207	Intuitive Surgical †	41,366,913	0.29

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
265,743	Johnson & Johnson	42,978,615	0.30
477,655	JPMorgan Chase	70,602,186	0.49
19,322	Kellogg	1,182,120	0.01
1,008,529	Kenvue	23,377,702	0.16
146,156	Keurig Dr Pepper	4,941,534	0.03
60,554	Keysight Technologies	8,059,132	0.06
27,945	Kimberly-Clark	3,625,025	0.03
137,330	Kinder Morgan	2,384,736	0.02
52,150	KLA	26,155,832	0.18
13,782	Kraft Heinz	456,873	0.00
36,256	Kroger	1,681,916	0.01
6,277	Lam Research	4,362,954	0.03
93,167	Las Vegas Sands	5,156,794	0.04
68,942	Lennar	8,197,893	0.06
88,538	Liberty Media-Liberty Live	2,970,450	0.02
92,150	Liberty Media-Liberty Live*	3,064,909	0.02
354,155	Liberty Media-Liberty SiriusXM	8,687,422	0.06
368,601	Liberty Media-Liberty SiriusXM*	8,912,772	0.06
178,087	Lightning Emotors (Wts 15/12/2025)	3,778	0.00
101,820	Lincoln National	2,623,901	0.02
21,926	Lowe' s*	5,064,687	0.03
316,560	LPL Financial	74,002,232	0.51
3,921	Lululemon Athletica	1,495,469	0.01
62,659	M/I Homes*	6,119,905	0.04
102,878	Marathon Oil	2,717,008	0.02
45,057	Marathon Petroleum	6,382,774	0.04
21,092	MarketAxess	5,101,733	0.04
612,669	Marsh & McLennan	120,401,712	0.83
49,863	Marvell Technology	2,916,487	0.02
91,939	Masco	5,457,499	0.04
39,394	Masimo*	4,521,840	0.03
289,998	Mastercard	120,198,371	0.83
139,947	McDonald' s	39,589,607	0.27
16,165	McKesson	6,774,752	0.05
3,261	MercadoLibre	4,408,872	0.03
664,263	Merck	73,009,146	0.50
37,620	Meritage Homes*	5,201,341	0.04
39,583	Meta Platforms	11,821,858	0.08
99,706	MetLife	6,318,369	0.04
4,441	Mettler-Toledo International	5,438,537	0.04
174,928	MGM Resorts International*	7,721,322	0.06
31,962	Microchip Technology	2,634,308	0.02
488,526	Micron Technology	34,323,837	0.24
1,073,701	Microsoft †	353,312,051	2.44
1,755,970	Mirion Technologies	15,066,222	0.11

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
196,836	Mirion Technologies*	1,688,853	0.01
18,715	Moderna	2,149,418	0.01
13,766	Moody' s	4,649,467	0.03
68,519	Morgan Stanley*	5,848,097	0.04
78,649	Mr Cooper*	4,454,679	0.03
3,933	MSCI	2,144,193	0.02
106,851	Nasdaq	5,659,897	0.04
3,921	Netflix	1,707,595	0.01
72,100	New York Community Bancorp*	879,620	0.01
1,065,811	NextEra Energy	71,974,217	0.50
102,318	NIKE	10,492,711	0.07
13,078	Nucor	2,242,223	0.02
154,780	NVIDIA	76,955,068	0.53
309	NVR	1,962,156	0.01
155,458	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	3,109	0.00
11,670	Omnicom*	941,769	0.01
705	O' Reilly Automotive	664,907	0.00
120,628	Otis Worldwide	10,442,766	0.07
9,549	PACCAR	793,617	0.01
98,165	Palo Alto Networks*	23,726,481	0.16
94,598	Park Hotels & Resorts*	1,223,152	0.01
23,665	Paycom Software	7,004,840	0.05
431,980	Peloton Interactive	2,730,114	0.02
83,248	PepsiCo	14,895,565	0.10
595,560	Pfizer	21,380,604	0.15
27,250	Phillips 66	3,084,428	0.02
224,852	Progressive*	30,168,393	0.21
41,926	Public Service Enterprise	2,596,058	0.02
148,080	Rockwell Automation*	46,230,575	0.31
179,877	Rollins	7,175,294	0.05
41,610	RXO*	769,369	0.00
49,449	S&P Global	19,446,314	0.14
269,022	Salesforce	60,971,146	0.42
5,911	Sarcos Technology & Robotics	6,502	0.00
338,691	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	8,501	0.00
167,667	Sarcos Technology & Robotics (Wts 24/9/2026)	4,209	0.00
36,365	Sealed Air	1,355,687	0.01
1,151,360	Sempra	82,114,995	0.57
2,186	ServiceNow	1,295,599	0.01
534,112	Sonder	267,056	0.00
28,679	Southern Copper	2,333,897	0.02
303,988	Starbucks	30,088,732	0.21
607,300	Sun Country	8,927,310	0.06
12,396	Symbotic	493,113	0.00
57,001	Synchrony Financial	1,853,103	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
76,926	Tapestry	2,556,251	0.02
356,024	Tesla	91,580,053	0.64
16,123	Texas Capital Bancshares	1,002,689	0.01
3,114	Texas Instruments	527,543	0.00
128,393	Thermo Fisher Scientific	72,150,446	0.50
379,250	TJX	35,126,135	0.24
36,382	Travelers	5,884,425	0.04
258,300	Uber Technologies	12,083,274	0.08
693,382	United Airlines	34,599,762	0.23
276,223	United Parcel Service	47,532,454	0.33
115,781	United States Steel*	3,573,002	0.02
252,390	UnitedHealth	123,671,100	0.85
261,825	Valero Energy	33,880,155	0.23
84,920	VeriSign	17,858,676	0.12
67,409	Verisk Analytics	16,338,593	0.11
2,363	Vertex Pharmaceuticals	821,284	0.01
132,293	Visa*	32,672,402	0.23
146,549	Vulcan Materials	31,947,682	0.22
108,523	Walgreens Boots Alliance*	2,784,700	0.02
251,518	Walmart	40,723,279	0.28
556,689	Walt Disney	46,990,118	0.33
41,987	WEC Energy	3,584,430	0.02
187,458	Wells Fargo	7,811,375	0.05
3,520	Wells Fargo	4,075,280	0.03
32,645	Western Digital	1,483,062	0.01
109,802	Williams*	3,830,443	0.03
59,784	Xcel Energy	3,466,276	0.02
12,043	Yum China	648,154	0.00
7,564	Yum! Brands	986,648	0.01
117,940	Zoetis	22,763,599	0.16
78,600	Zscaler	11,958,204	0.08
		<u>4,830,847,846</u>	<u>33.39</u>
	普通/優先株式 (証券) およびワラント合計	8,308,786,421	57.48

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
債券				
		アルゼンチン		
USD	21,885,365	Argentine Republic Government International Bond 0.75% 9/7/2030	7,391,344	0.05
USD	2,291,190	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	748,589	0.00
USD	26,992,679	Argentine Republic Government International Bond 3.625% 9/7/2035*	8,098,749	0.06
USD	8,980,835	Argentine Republic Government International Bond 4.25% 9/1/2038	3,166,238	0.02
			19,404,920	0.13
		オーストラリア		
AUD	328,974,000	Australia Government Bond 1% 21/11/2031	169,183,417	1.17
		オーストリア		
EUR	6,339,000	Benteler International 9.375% 15/5/2028	7,017,184	0.05
USD	978,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	783,847	0.00
USD	1,331,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	1,049,946	0.01
			8,850,977	0.06
		パハマ		
USD	528,000	Intercorp Peru 3.875% 15/8/2029	448,171	0.01
		バーレーン		
USD	1,102,000	Bahrain Government International Bond 5.45% 16/9/2032*	991,618	0.01
USD	850,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047*	785,073	0.00
			1,776,691	0.01
		ベルギー		
GBP	900,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1,106,740	0.01
GBP	900,000	KBC 1.25% 21/9/2027	982,674	0.00
			2,089,414	0.01
		バミューダ		
USD	453,000	Inkia Energy 5.875% 9/11/2027	436,468	0.00
USD	1,020,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	897,483	0.01
			1,333,951	0.01
		ブラジル		
USD	1,105,000	Banco do Brasil 6.25% 18/4/2030*	1,097,431	0.01
USD	789,000	Banco Votorantim 4.5% 24/9/2024	772,920	0.00
BRL	404,357,000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	75,235,235	0.52
BRL	109,247,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	22,010,371	0.15
BRL	238,448,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	48,115,124	0.34
USD	1,305,000	BRF 4.875% 24/1/2030	1,129,302	0.01
			148,360,383	1.03
		イギリス領ヴァージン諸島		
USD	514,000	Fortune Star BVI 6.85% 2/7/2024*	469,346	0.00
USD	900,000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032*	746,060	0.01
USD	352,000	New Metro Global 4.5% 2/5/2026*	95,311	0.00
USD	585,000	RKPF Overseas 2020 A 5.2% 12/1/2026	214,590	0.00
USD	261,078	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	254,652	0.00
USD	417,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	313,732	0.00
			2,093,691	0.01

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		カナダ		
CAD	104,431,000	Canadian Government Bond 0.25% 1/3/2026	69,676,547	0.48
USD	2,405,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	2,366,772	0.02
USD	3,466,000	First Quantum Minerals 6.875% 15/10/2027	3,376,958	0.02
USD	3,092,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	3,090,099	0.03
USD	470,000	First Quantum Minerals 8.625% 1/6/2031	478,828	0.00
USD	638,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	637,049	0.00
USD	6,195,000	Rogers Communications 2.95% 15/3/2025	5,913,364	0.04
USD	1,632,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	1,392,394	0.01
GBP	900,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027*	1,024,269	0.01
			87,956,280	0.61
		ケイマン諸島		
USD	828,928	AGL CLO 5 6.988% 20/7/2034	805,681	0.01
USD	1,153,674	AGL CLO 5 7.288% 20/7/2034	1,140,214	0.01
USD	725,000	AIMCO CLO Series 2017-A 6.638% 20/4/2034	718,258	0.01
USD	278,501	AIMCO CLO Series 2018-A 6.97% 17/4/2031	276,288	0.00
USD	318,000	Allegro CLO IV 7.12% 15/1/2030	315,081	0.00
USD	250,000	Allegro CLO XI 7.432% 19/1/2033	247,472	0.00
USD	1,081,525	Apidos CLO XV 6.598% 20/4/2031	1,077,510	0.01
USD	250,000	Apidos CLO XXXI 7.12% 15/4/2031	247,955	0.00
USD	400,000	Atrium XIII 7.107% 21/11/2030	396,929	0.00
USD	279,432	BlueMountain CLO 2014- 2 7.338% 20/10/2030	272,650	0.00
USD	250,000	Canyon CLO 2020-3 7.27% 15/1/2034	247,281	0.00
USD	250,000	CARLYLE US CLO 2018- 1 7.088% 20/4/2031	247,193	0.00
USD	541,794	Catskill Park CLO 6.938% 20/4/2029	544,734	0.01
USD	692,352	Chenango Park CLO 7.12% 15/4/2030	685,759	0.01
USD	387,293	CIFC Funding 2017-III 7.388% 20/7/2030	385,388	0.00
USD	250,000	CIFC Funding 2018-II 6.628% 20/4/2031	248,937	0.00
USD	405,000	CK Hutchison International 23 4.75% 21/4/2028	394,806	0.00
USD	405,000	CK Hutchison International 23 4.875% 21/4/2033	390,460	0.00
USD	204,845	Clear Creek CLO 6.788% 20/10/2030	204,050	0.00
USD	692,561	Cook Park CLO 6.97% 17/4/2030	683,921	0.01
USD	1,305,000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	1,299,692	0.01
USD	350,000	Fantasia 7.95% 5/7/2022***	16,779	0.00
USD	399,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023***	19,950	0.00
USD	319,000	Fantasia 9.875% 19/10/2023	15,950	0.00
USD	352,000	Fantasia 10.875% 9/1/2023***	17,600	0.00
USD	2,470,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022***	123,500	0.00
USD	956,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023***	47,800	0.00
USD	250,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6.608% 20/4/2034	248,203	0.00
USD	400,000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6.888% 20/4/2030	393,247	0.00
USD	1,082,000	IHS 5.625% 29/11/2026	934,350	0.01
USD	778,000	IHS 6.25% 29/11/2028	626,131	0.00
USD	658,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	661,981	0.01
USD	450,000	Madison Park Funding XIII 7.082% 19/4/2030	448,760	0.00
USD	418,056	Madison Park Funding XLI 6.957% 22/4/2027	416,141	0.00

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
ケイマン諸島 (続き)			
USD	275,277 Madison Park Funding XXVI 6.831% 29/7/2030	274,562	0.00
USD	652,000 MAF Global 6.375% 20/3/2026	634,601	0.00
USD	758,000 Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	634,833	0.01
USD	200,000 MGM China 5.25% 18/6/2025	192,417	0.00
USD	378,000 MGM China 5.875% 15/5/2026	361,891	0.00
USD	250,000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.982% 19/10/2031	245,089	0.00
USD	292,000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7.038% 20/7/2031	289,691	0.00
USD	236,204 Palmer Square CLO 2018- 1 6.602% 18/4/2031	235,319	0.00
USD	370,796 Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7.439% 23/8/2031	365,823	0.00
USD	653,058 Pikes Peak CLO 1 6.787% 24/7/2031	648,934	0.01
USD	400,000 Pikes Peak CLO 8 6.758% 20/7/2034	397,753	0.00
USD	241,914 Rockford Tower CLO 2018- 1 6.741% 20/5/2031	241,128	0.00
USD	402,000 Sands China 4.3% 8/1/2026*	376,594	0.00
USD	590,000 Sands China 4.875% 18/6/2030	515,619	0.00
USD	640,000 Sands China 5.65% 8/8/2028	602,736	0.01
USD	2,006,000 Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	2,107,800	0.01
USD	2,591,000 Seagate HDD Cayman 8.5% 15/7/2031	2,716,161	0.02
USD	4,030,000 Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	4,468,001	0.03
USD	3,669,000 Shelf Drilling North Sea 10.25% 31/10/2025	3,684,113	0.02
USD	1,148,550 Transocean 8.75% 15/2/2030	1,180,305	0.01
USD	1,126,000 Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	1,158,374	0.01
USD	1,075,805 Trinitas CLO XIV 7.613% 25/1/2034	1,063,443	0.01
USD	627,088 Trinitas CLO XIV 8.613% 25/1/2034	625,800	0.01
USD	249,139 Voya CLO 2013-3 6.721% 18/10/2031	247,990	0.00
USD	822,000 Wynn Macau 5.625% 26/8/2028	722,090	0.01
		38,791,718	0.26
チリ			
USD	1,782,000 Chile Government International Bond 4.34% 7/3/2042*	1,532,573	0.01
USD	913,000 Empresa Nacional del Petroleo 3.75% 5/8/2026*	858,891	0.01
USD	725,000 Empresa Nacional del Petroleo 6.15% 10/5/2033*	717,627	0.00
USD	907,000 Engie Energia Chile 3.4% 28/1/2030*	760,220	0.01
		3,869,311	0.03
コロンビア			
USD	3,588,000 Colombia Government International Bond 3.125% 15/4/2031*	2,767,245	0.02
EUR	479,000 Colombia Government International Bond 3.875% 22/3/2026	500,593	0.00
USD	1,424,000 Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,314,153	0.01
USD	2,315,000 Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026*	2,234,183	0.02
USD	1,655,000 Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	1,712,859	0.01
USD	1,784,000 Ecopetrol 4.125% 16/1/2025	1,728,607	0.01
USD	890,000 Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	622,462	0.01
USD	1,403,000 Ecopetrol 8.875% 13/1/2033	1,420,537	0.01
USD	709,000 Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029*	598,042	0.00
USD	1,693,000 SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024*	1,674,385	0.01
		14,573,066	0.10

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		コスタリカ		
USD	748,000	Costa Rica Government International Bond 6.55% 3/4/2034	754,698	0.01
		コートジボワール		
EUR	504,000	Ivory Coast Government International Bond 5.875% 17/10/2031	458,458	0.00
USD	3,040,000	Ivory Coast Government International Bond 6.375% 3/3/2028	2,881,282	0.02
			3,339,740	0.02
		チェコ共和国		
CZK	403,320,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	16,646,356	0.12
CZK	415,750,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	19,483,396	0.13
			36,129,752	0.25
		ドミニカ共和国		
USD	978,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6.75% 30/3/2029	956,572	0.01
USD	1,861,000	Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030	1,627,370	0.01
USD	3,004,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	2,548,413	0.02
USD	1,631,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	1,596,725	0.01
USD	1,161,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	1,170,392	0.01
USD	515,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031*	511,722	0.00
			8,411,194	0.06
		エジプト		
USD	978,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	495,782	0.01
USD	864,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	460,551	0.00
			956,333	0.01
		フランス		
GBP	900,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027*	954,029	0.00
EUR	2,900,000	BNP Paribas 2.125% 23/1/2027	2,980,655	0.02
GBP	900,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	1,069,487	0.01
EUR	5,512,000	Chrome Holdco 5% 31/5/2029	4,723,684	0.03
EUR	9,782,000	Forvia 2.75% 15/2/2027	9,689,609	0.07
EUR	21,789,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	21,835,204	0.15
GBP	900,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024*	1,087,990	0.01
GBP	900,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	1,031,294	0.01
			43,371,952	0.30
		ドイツ		
EUR	14,568,000	Adler Pelzer 9.5% 1/4/2027	14,481,931	0.10
EUR	6,140,000	APCOA Parking 8.663% 15/1/2027	6,625,924	0.05
EUR	365,895,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	373,653,691	2.59
EUR	266,280,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.3% 15/2/2033*	285,148,098	1.97
EUR	5,377,000	Douglas 6% 8/4/2026	5,586,691	0.04
EUR	1	Kirk Beauty SUN 8.25% 1/10/2026	1	0.00
EUR	9,782,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027*	9,691,095	0.07
EUR	4,900,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	5,054,035	0.03
EUR	3,163,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	2,969,332	0.02
			703,210,798	4.87
		グアテマラ		
USD	1,554,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	1,257,318	0.01

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		グアテマラ (続き)		
USD	579,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	456,310	0.00
USD	851,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	810,816	0.01
USD	1,505,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029*	1,433,934	0.01
USD	725,000	Guatemala Government Bond 6.6% 13/6/2036	728,262	0.00
			4,686,640	0.03
		香港		
USD	700,000	AIA 2.7% 7/4/2026*	609,542	0.01
USD	500,000	AIA 4.95% 4/4/2033	490,407	0.00
USD	645,000	Bank of East Asia 5.825% 21/10/2025	498,163	0.00
USD	306,000	Yanlord Land HK 5.125% 20/5/2026	175,185	0.00
			1,773,297	0.01
		ハンガリー		
USD	1,729,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	1,692,553	0.01
USD	290,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/3/2024*	289,504	0.00
			1,982,057	0.01
		インド		
USD	210,000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	187,529	0.00
USD	470,000	Indian Railway Finance 3.249% 13/2/2030*	407,878	0.00
USD	300,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	279,174	0.00
USD	700,000	REC 2.75% 13/1/2027	633,318	0.01
USD	300,000	REC 5.625% 11/4/2028	296,380	0.00
			1,804,279	0.01
		インドネシア		
USD	820,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026*	763,686	0.01
USD	1,743,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027*	1,681,821	0.01
USD	3,400,000	Indonesia Government International Bond 4.65% 20/9/2032*	3,289,238	0.02
IDR	388,189,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	27,055,981	0.19
IDR	294,964,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	22,009,581	0.15
USD	510,000	Pertamina Geothermal Energy 5.15% 27/4/2028	504,263	0.00
USD	1,813,000	Pertamina Persero 3.65% 30/7/2029*	1,660,874	0.01
USD	905,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027*	885,742	0.01
			57,851,186	0.40
		アイルランド		
EUR	116,000	Avoca CLO XV 4.713% 15/4/2031	121,400	0.00
EUR	1,524,000	Dell Bank International 0.5% 27/10/2026	1,479,794	0.01
EUR	404,000	Harvest CLO XVIII 4.863% 15/10/2030	426,484	0.00
EUR	410,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5.546% 21/1/2035	433,742	0.00
EUR	280,000	OAK Hill European Credit Partners VI 4.905% 20/1/2032	296,058	0.00
EUR	472,000	OCP Euro CLO 2017-2 5.013% 15/1/2032	502,047	0.01
USD	512,813	Prodigy Finance CM2021- 1 7.929% 25/7/2051	508,566	0.01
USD	298,886	Prodigy Finance CM2021- 1 9.179% 25/7/2051	297,426	0.00
USD	442,484	Prodigy Finance CM2021- 1 11.329% 25/7/2051	444,580	0.00
EUR	250,000	Voya Euro CLO II 5.333% 15/7/2035	263,215	0.00
			4,773,312	0.03

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		マン島		
USD	1,469,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	1,221,914	0.01
USD	1,070,000	Gohl Capital 4.25% 24/1/2027	997,079	0.01
			2,218,993	0.02
		イスラエル		
USD	730,000	Bank Leumi Le-Israel 7.129% 18/7/2033	722,609	0.00
USD	1,641,000	Energian Israel Finance 8.5% 30/9/2033*	1,663,563	0.01
USD	1,303,000	Leviathan Bond 6.75% 30/6/2030*	1,223,478	0.01
			3,609,650	0.02
		イタリア		
EUR	13,130,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	13,882,004	0.09
EUR	2,005,000	Castor 6% 15/2/2029	1,871,891	0.01
EUR	6,400,000	Castor 8.776% 15/2/2029	6,567,512	0.05
EUR	13,500,000	Forno d' Asolo 9.098% 30/4/2027	13,218,702	0.09
EUR	6,765,000	Marcolin 6.125% 15/11/2026	6,775,198	0.05
EUR	6,914,000	Shiba Bidco 4.5% 31/10/2028*	6,712,848	0.05
			49,028,155	0.34
		日本		
EUR	1,737,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026*	1,789,748	0.01
USD	1,505,000	Rakuten 10.25% 30/11/2024*	1,519,952	0.01
EUR	2,758,000	Takeda Pharmaceutical 2.25% 21/11/2026	2,850,272	0.02
			6,159,972	0.04
		ジャージー		
USD	1,632,000	Aptiv / Aptiv 3.25% 1/3/2032	1,384,252	0.01
EUR	3,187,000	Kane Bidco 5% 15/2/2027	3,297,663	0.02
GBP	5,786,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	6,709,933	0.04
			11,391,848	0.07
		ヨルダン		
USD	670,000	Jordan Government International Bond 4.95% 7/7/2025	654,205	0.00
		ルクセンブルグ		
USD	570,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	5,700	0.00
EUR	4,738,000	Becton Dickinson Euro Finance 3.553% 13/9/2029	5,065,814	0.04
EUR	17,000,000	BK LC Lux Finco1 5.25% 30/4/2029*	17,869,259	0.12
USD	11,206,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	10,636,893	0.08
EUR	7,733,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	4,516,399	0.03
USD	1,014,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	853,991	0.00
USD	1,286,081	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031*	835,232	0.01
USD	629,996	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	409,145	0.00
USD	573,000	MHP Lux 6.25% 19/9/2029	317,665	0.00
USD	400,000	MHP Lux 6.95% 3/4/2026	234,272	0.00
USD	1,174,500	Millicom International Cellular 5.125% 15/1/2028*	1,057,784	0.01
USD	1,438,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1,324,125	0.01
USD	202,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024	200,180	0.00
EUR	5,376,000	Sani/Ikos Financial 1 5.625% 15/12/2026	5,381,188	0.04
			48,707,647	0.34

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		マレーシア		
USD	600,000	CIMB Bank 2.125% 20/7/2027	536,358	0.00
USD	730,000	Dua Capital 2.78% 11/5/2031	616,857	0.00
USD	885,000	Khazanah Capital 4.876% 1/6/2033	863,149	0.01
USD	895,000	Khazanah Global Sukuk 4.687% 1/6/2028	881,526	0.01
USD	800,000	TNB Global Ventures Capital 4.851% 1/11/2028	784,552	0.01
			3,682,442	0.03
		モーリシャス		
USD	223,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	200,308	0.00
USD	630,000	Diamond II 7.95% 28/7/2026	620,643	0.00
USD	360,000	HTA 7% 18/12/2025	341,647	0.00
USD	652,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	642,220	0.01
USD	262,000	India Green Power 4% 22/2/2027	232,090	0.00
			2,036,908	0.01
		メキシコ		
USD	815,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2027	719,686	0.01
USD	1,378,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032*	822,438	0.00
USD	1,722,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	1,711,728	0.01
MXN	2,613,200,000	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	141,314,742	0.98
MXN	645,539,900	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	34,107,684	0.24
MXN	891,090,700	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	48,475,551	0.33
MXN	3,074,136,800	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	16,908,722	0.12
MXN	9,485,316,300	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	51,399,968	0.36
USD	2,175,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/5/2031	1,801,052	0.01
USD	1,601,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	1,518,909	0.01
USD	305,000	Mexico Government International Bond 6.338% 4/5/2053*	304,085	0.00
USD	310,000	Mexico Government International Bond 6.35% 9/2/2035	321,965	0.00
EUR	343,000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/2/2024	366,859	0.00
USD	792,000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/1/2025*	749,553	0.01
USD	1,957,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	1,417,944	0.01
USD	1,631,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027*	1,432,671	0.01
USD	2,251,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	1,704,232	0.01
USD	1,747,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029*	1,563,146	0.01
USD	1,205,000	Trust Fibra Uno 4.869% 15/1/2030	1,052,893	0.01
			307,693,828	2.13
		モロッコ		
USD	758,000	Morocco Government International Bond 5.95% 8/3/2028	759,069	0.01
		オランダ		
USD	590,000	Braskem Netherlands Finance 7.25% 13/2/2033*	561,392	0.00
USD	652,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	652,688	0.00
GBP	900,000	Cooperatieve Rabobank 1.875% 12/7/2028*	981,725	0.00
EUR	6,550,000	Dufry One 2.5% 15/10/2024*	6,964,619	0.05
USD	1,210,000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	1,225,367	0.01
USD	470,000	Greenko Dutch 3.85% 29/3/2026*	425,453	0.00
EUR	2,800,000	ING Groep 2.125% 23/5/2026	2,926,965	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
オランダ* (続き)			
GBP	900,000 ING Groep 3% 18/2/2026	1,060,434	0.01
USD	829,000 MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	732,152	0.01
USD	934,000 MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	824,885	0.01
USD	862,000 MEGlobal 4.25% 3/11/2026	827,934	0.01
EUR	2,863,000 Mercedes-Benz International Finance 1.375% 26/6/2026*	2,935,985	0.02
USD	652,000 Metinvest 7.65% 1/10/2027	406,027	0.00
USD	840,000 Minejesa Capital 4.625% 10/8/2030*	761,548	0.01
USD	1,632,000 NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,431,770	0.01
USD	3,738,000 NXP / NXP Funding / NXP USA 4.4% 1/6/2027	3,596,405	0.02
USD	2,992,000 NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	2,843,926	0.02
EUR	6,048,000 Sigma Holdco 5.75% 15/5/2026*	5,669,351	0.04
EUR	1,656,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	1,545,728	0.01
EUR	23,281,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	23,152,926	0.16
EUR	5,532,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029	6,161,118	0.04
EUR	2,893,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.875% 15/9/2031	3,292,718	0.02
USD	700,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8.125% 15/9/2031	742,598	0.01
USD	1,644,000 Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	1,553,781	0.01
GBP	400,000 Volkswagen Financial Services 1.875% 3/12/2024	480,422	0.00
GBP	400,000 Volkswagen Financial Services 4.25% 9/10/2025	486,991	0.01
EUR	25,365,000 Ziggo 2.875% 15/1/2030*	22,806,623	0.16
		95,051,531	0.66
ナイジェリア			
USD	1,575,000 Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047*	1,081,789	0.01
USD	1,050,000 Nigeria Government International Bond 8.375% 24/3/2029	925,323	0.00
		2,007,112	0.01
オマーン			
USD	1,631,000 Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047*	1,535,203	0.01
USD	1,957,000 Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048*	1,892,488	0.01
USD	781,000 Oman Sovereign Sukuk 4.397% 1/6/2024*	769,101	0.01
USD	652,000 OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	624,427	0.00
		4,821,219	0.03
パナマ			
USD	652,000 Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	489,313	0.00
USD	2,115,000 Panama Government International Bond 3.16% 23/1/2030*	1,840,610	0.01
USD	794,000 Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	747,539	0.01
USD	1,802,000 Panama Government International Bond 6.4% 14/2/2035	1,850,490	0.01
USD	1,445,000 Panama Government International Bond 6.853% 28/3/2054	1,472,166	0.01
		6,400,118	0.04
パラグアイ			
USD	1,381,000 Paraguay Government International Bond 5.6% 13/3/2048	1,186,804	0.01
ペルー			
USD	1,732,000 Financiera de Desarrollo 4.75% 15/7/2025*	1,698,685	0.01
USD	3,061,000 Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032*	2,311,361	0.02

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		ペルー (続き)		
USD	1,606,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	1,363,486	0.01
			5,373,532	0.04
		フィリピン		
USD	800,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	519,192	0.00
USD	756,000	Rizal Commercial Banking 6.5% 27/8/2025	692,526	0.00
			1,211,718	0.00
		ポーランド		
EUR	920,000	Republic of Poland Government International Bond 4.25% 14/2/2043	975,706	0.01
USD	692,000	Republic of Poland Government International Bond 4.875% 4/10/2033*	671,887	0.00
USD	1,058,000	Republic of Poland Government International Bond 5.5% 4/4/2053	1,031,116	0.01
			2,678,709	0.02
		ルーマニア		
EUR	1,044,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031*	862,906	0.01
EUR	1,880,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	1,707,614	0.01
EUR	1,787,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029*	1,711,144	0.01
USD	1,722,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	1,692,330	0.01
			5,973,994	0.04
		サウジアラビア		
USD	2,008,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030*	1,959,838	0.01
USD	1,523,000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1,356,041	0.01
			3,315,879	0.02
		セネガル		
USD	1,022,000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/5/2033*	838,357	0.01
		シンガポール		
USD	250,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028	245,602	0.00
USD	500,000	BOC Aviation 3.5% 18/9/2027*	466,845	0.00
USD	745,000	Continuum Energy Aura 9.5% 24/2/2027	740,820	0.00
USD	500,000	DBS 3.3% 27/2/2025	474,533	0.00
USD	836,784	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039*	742,960	0.01
USD	1,882,000	Pfizer Investment Enterprises 4.75% 19/5/2033	1,853,839	0.01
USD	656,000	Theta Capital 8.125% 22/1/2025	529,746	0.01
USD	200,000	TML 4.35% 9/6/2026	184,562	0.00
			5,238,907	0.03
		南アフリカ		
ZAR	238,000,884	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	11,365,670	0.08
ZAR	24,577,105	Republic of South Africa Government Bond 8.25% 31/3/2032	1,111,333	0.01
ZAR	99,876,273	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044*	3,868,651	0.02
ZAR	566,637,510	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	23,105,021	0.16
ZAR	518,166,988	Republic of South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026	28,854,860	0.20
USD	1,419,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029*	1,252,225	0.01
USD	2,265,000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1,506,769	0.01
USD	1,370,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 20/4/2032*	1,215,724	0.01
			72,280,253	0.50

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
韓国			
USD	1,410,000 GS Caltex 5.375% 7/8/2028	1,399,947	0.01
USD	200,000 Korea National Oil 4.75% 3/4/2026*	196,756	0.00
USD	200,000 Korea National Oil 4.875% 3/4/2028	197,562	0.00
USD	730,000 LG Chem 2.375% 7/7/2031*	587,474	0.01
USD	467,000 POSCO 5.625% 17/1/2026*	467,432	0.00
USD	504,000 POSCO 5.75% 17/1/2028	507,684	0.00
USD	200,000 POSCO 5.875% 17/1/2033	206,239	0.00
USD	750,000 SK Hynix 2.375% 19/1/2031	581,539	0.01
USD	1,900,000 SK Hynix 6.375% 17/1/2028	1,922,743	0.01
		6,067,376	0.04
スペイン			
USD	777,333 Al Candelaria Spain 7.5% 15/12/2028*	722,360	0.00
GBP	3,100,000 Banco Santander 3.125% 6/10/2026	3,636,338	0.03
EUR	2,700,000 Banco Santander 3.625% 27/9/2026	2,894,917	0.02
EUR	188,861,000 Spain Government Bond 2.55% 31/10/2032	191,276,710	1.32
EUR	18,049,000 Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046	16,497,879	0.12
EUR	165,320,000 Spain Government Bond 3.15% 30/4/2033	174,903,280	1.21
EUR	13,935,000 Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	13,211,390	0.09
EUR	18,712,000 Spain Government Bond 3.9% 30/7/2039	20,361,384	0.14
GBP	1,800,000 Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	2,252,801	0.02
		425,757,059	2.95
スウェーデン			
GBP	900,000 Swedbank 1.375% 8/12/2027	974,361	0.01
EUR	16,053,000 Verisure 3.25% 15/2/2027*	15,705,094	0.11
EUR	1,603,000 Verisure 3.875% 15/7/2026	1,642,417	0.01
EUR	1,660,000 Verisure 7.125% 1/2/2028*	1,824,728	0.01
EUR	3,262,000 Verisure 9.25% 15/10/2027	3,773,804	0.03
EUR	9,192,000 Verisure Midholding 5.25% 15/2/2029*	8,711,754	0.06
		32,632,158	0.23
スイス			
USD	3,048,000 Credit Suisse 2.95% 9/4/2025	2,893,688	0.02
USD	3,025,000 Credit Suisse 5% 9/7/2027	2,939,206	0.02
USD	2,777,000 Credit Suisse 7.95% 9/1/2025	2,831,047	0.02
EUR	5,840,000 UBS 0.65% 14/1/2028	5,607,684	0.04
		14,271,625	0.10
タイ			
USD	372,000 Bangkok Bank 3.733% 25/9/2034	316,390	0.00
USD	500,000 Bangkok Bank 5% 23/9/2025*	473,500	0.00
USD	550,000 GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031	437,660	0.00
USD	564,000 Kasikornbank 3.343% 2/10/2031	506,097	0.01
USD	262,000 Krung Thai Bank 4.4% 25/3/2026	238,420	0.00
USD	600,000 Minor International 2.7% 19/4/2026	547,770	0.01
USD	201,000 Muang Thai Life Assurance 3.552% 27/1/2037	178,608	0.00
		2,698,445	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	ウクライナ		
USD	2,397,000 Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	649,132	0.01
USD	978,000 Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	317,850	0.00
USD	1,370,000 Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2026	399,355	0.00
USD	1,079,000 VF Ukraine PAT via VFU Funding 6.2% 11/2/2025	798,460	0.01
		2,164,797	0.02
	アラブ首長国連邦		
USD	341,000 Abu Dhabi National Energy 4.696% 24/4/2033	335,032	0.00
USD	1,002,000 MDGH GMTN RSC 4.375% 22/11/2033	947,391	0.01
		1,282,423	0.01
	英国		
EUR	3,106,000 Barclays 0.877% 28/1/2028	2,987,188	0.02
GBP	900,000 Barclays 3% 8/5/2026	1,043,698	0.01
GBP	900,000 Barclays 3.25% 12/2/2027	1,024,514	0.01
EUR	11,535,000 BCP V Modular Services Finance 6.75% 30/11/2029	9,316,675	0.07
GBP	8,806,000 BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	9,181,507	0.06
GBP	1,643,000 BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	2,057,830	0.01
GBP	4,935,000 Boparan Finance 7.625% 30/11/2025	4,214,036	0.03
EUR	3,586,000 BP Capital Markets 2.519% 7/4/2028	3,693,092	0.03
GBP	9,803,000 Deuce Finco 5.5% 15/6/2027	10,694,543	0.07
GBP	1,000,000 HSBC 1.75% 24/7/2027	1,114,570	0.01
EUR	2,773,000 HSBC 3.019% 15/6/2027	2,895,567	0.02
EUR	3,233,000 INEOS Finance 3.375% 31/3/2026*	3,316,936	0.02
EUR	3,111,000 INEOS Finance 6.625% 15/5/2028*	3,350,844	0.02
USD	6,536,000 INEOS Finance 6.75% 15/5/2028*	6,248,216	0.05
GBP	900,000 Informa 3.125% 5/7/2026	1,051,949	0.00
GBP	4,843,000 Inspired Entertainment Financing 7.875% 1/6/2026	5,858,175	0.04
GBP	1,800,000 Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	2,186,590	0.01
GBP	5,895,000 Marks & Spencer 3.75% 19/5/2026*	6,925,115	0.05
EUR	4,020,000 National Grid 0.163% 20/1/2028*	3,706,789	0.02
GBP	900,000 NatWest 2.875% 19/9/2026	1,054,898	0.01
GBP	900,000 NatWest 3.125% 28/3/2027	1,045,274	0.01
GBP	18,068,000 Punch Finance 6.125% 30/6/2026*	20,010,909	0.14
GBP	900,000 Santander UK 3.625% 14/1/2026	1,063,016	0.01
GBP	83,525,396 United Kingdom Gilt 0.5% 22/10/2061	31,308,473	0.22
GBP	160,970,000 United Kingdom Gilt 1.25% 22/7/2027*	180,620,103	1.25
USD	1,161,000 Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	761,558	0.01
USD	500,000 Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2024*	430,375	0.00
GBP	9,782,000 Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	11,327,539	0.08
		328,489,979	2.28
	米国		
USD	2,640,000 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	2,328,909	0.02
EUR	2,771,000 AbbVie 1.375% 17/5/2024	2,950,299	0.02
USD	9,155,000 AbbVie 2.6% 21/11/2024	8,827,840	0.06
USD	988,959 AccessLex Institute 5.953% 25/5/2036	961,461	0.01
USD	1,206,000 Affinity Interactive 6.875% 15/12/2027	1,070,637	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
USD	425,000 Alexander Funding Trust II 7.467% 31/7/2028	429,662	0.00
USD	1,769,000 Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,733,275	0.01
USD	11,736,000 Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	11,762,054	0.08
EUR	7,005,000 American Tower 0.45% 15/1/2027	6,679,904	0.05
USD	6,695,000 American Tower 5.25% 15/7/2028	6,590,216	0.05
USD	1,632,000 Amgen 2% 15/1/2032	1,281,036	0.01
USD	1,605,000 Amgen 2.3% 25/2/2031	1,325,714	0.01
USD	4,943,000 Amgen 3.35% 22/2/2032	4,315,730	0.03
USD	9,986,000 Amgen 5.15% 2/3/2028	9,968,629	0.07
GBP	900,000 Amgen 5.5% 7/12/2026*	1,135,152	0.01
USD	970,000 Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	970,940	0.01
EUR	9,782,000 Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	8,815,156	0.06
USD	5,690,000 AREIT 2022-CRE7 7.556% 17/6/2039	5,692,237	0.04
USD	305,000 Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	311,091	0.00
GBP	1,770,000 AT&T 2.9% 4/12/2026	2,032,327	0.01
GBP	900,000 AT&T 5.5% 15/3/2027*	1,112,370	0.01
USD	842,000 Azul Investments 5.875% 26/10/2024	774,640	0.01
USD	756,000 Azul Secured Finance 11.93% 28/8/2028*	752,866	0.01
USD	460,000 BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033	409,741	0.00
USD	1,210,000 BANK 2017-BNK9 3.538% 15/11/2054	1,112,828	0.01
USD	783,000 Bank of America 1.898% 23/7/2031	618,706	0.00
USD	2,317,000 Bank of America 1.922% 24/10/2031	1,816,090	0.01
EUR	2,844,000 Bank of America 1.949% 27/10/2026	2,939,246	0.02
USD	3,641,000 Bank of America 2.496% 13/2/2031	3,028,660	0.02
USD	2,552,000 Bank of America 2.592% 29/4/2031	2,124,558	0.01
USD	189,655 Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 6.129% 25/11/2035	173,068	0.00
USD	209,101 Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5.769% 25/10/2036	194,651	0.00
USD	2,951,000 BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.629% 15/3/2037	2,252,295	0.02
EUR	2,217,000 Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025*	2,232,814	0.02
USD	3,692,000 Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027	3,493,155	0.02
USD	610,912 BHMS 2018-ATLS 6.857% 15/7/2035	600,449	0.00
USD	1,715,558 BHMS 2018-ATLS 7.507% 15/7/2035	1,648,765	0.01
USD	2,648,000 Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	2,636,468	0.02
USD	4,247,000 Broadcom 1.95% 15/2/2028	3,682,664	0.03
USD	1,870,000 Broadcom 2.45% 15/2/2031	1,508,360	0.01
USD	1,605,000 Broadcom 4.15% 15/11/2030	1,467,767	0.01
USD	2,289,000 Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,173,310	0.01
USD	2,281,200 BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,058,903	0.01
USD	5,393,000 Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9.75% 15/7/2028	5,373,358	0.04
USD	860,545 CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7.575% 15/12/2037	849,869	0.01
USD	1,986,000 Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	1,710,939	0.01
USD	527,428 CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3.911% 13/11/2050	426,692	0.00
USD	1,661,000 CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,552,099	0.01
USD	670,000 Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	679,048	0.00
EUR	2,840,000 Citigroup 1.25% 6/7/2026	2,922,547	0.02

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
GBP	1,372,000 Citigroup 1.75% 23/10/2026	1,538,160	0.01
USD	2,148,000 Citigroup 2.561% 1/5/2032	1,730,854	0.01
USD	3,264,000 Citigroup 2.572% 3/6/2031	2,697,681	0.02
USD	2,979,000 Citigroup 2.666% 29/1/2031	2,497,590	0.02
USD	802,000 Citigroup 3.98% 20/3/2030	737,209	0.01
USD	1,223,900 Citigroup CCommercial Mortgage Trust 2018-C6 4.412% 10/11/2051	1,154,155	0.01
USD	6,657,000 Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	6,843,419	0.05
USD	3,330,000 Cloud Software 6.5% 31/3/2029	2,978,560	0.02
EUR	1,666,000 Comcast 0.25% 14/9/2029	1,481,746	0.01
USD	2,220,256 COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	2,154,477	0.02
USD	1,270,000 Concentrix 6.6% 2/8/2028	1,243,544	0.01
USD	2,580,000 Concentrix 6.65% 2/8/2026	2,581,773	0.02
EUR	8,101,000 Coty 3.875% 15/4/2026*	8,549,461	0.06
USD	644,000 Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	642,198	0.00
USD	2,696,000 Crown Castle 2.9% 15/3/2027	2,473,245	0.02
USD	402,545 CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4.798% 15/11/2048	362,059	0.00
USD	4,695,000 CSC 5.25% 1/6/2024	4,459,794	0.03
USD	5,958,000 CSC 5.5% 15/4/2027	5,141,846	0.04
USD	771,000 DAE Funding 1.55% 1/8/2024	737,747	0.01
USD	390,000 DAE Funding 2.625% 20/3/2025*	367,023	0.00
USD	593,946 DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.409% 15/5/2035	592,015	0.00
USD	1,200,964 DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.906% 15/5/2035	1,178,059	0.01
USD	5,354,649 DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7.606% 15/5/2035	5,219,043	0.04
USD	1,341,475 DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 6.811% 19/12/2030	1,330,248	0.01
USD	1,010,000 DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 7.211% 19/12/2030	999,874	0.01
USD	2,204,000 Dell International / EMC 4% 15/7/2024	2,171,451	0.01
USD	2,884,000 Dell International / EMC 5.25% 1/2/2028	2,874,596	0.02
USD	3,327,000 DISH Network 0% 15/12/2025	2,158,859	0.02
EUR	2,798,000 Duke Energy 3.1% 15/6/2028	2,888,106	0.02
USD	3,652,000 Earthstone Energy 8% 15/4/2027*	3,728,345	0.03
USD	8,288,000 Elevance Health 3.65% 1/12/2027	7,813,173	0.05
USD	2,968,000 Elevance Health 4.9% 8/2/2026	2,927,326	0.02
USD	2,034,000 Emerald Debt Merger Sub 6.625% 15/12/2030	2,001,582	0.01
USD	655,000 EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2027	661,357	0.00
USD	700,000 EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	718,691	0.00
USD	3,245,000 Equinix 1% 15/9/2025	2,959,600	0.02
USD	3,387,000 Equinix 1.55% 15/3/2028	2,858,997	0.02
USD	2,335,000 Equinix 2.9% 18/11/2026	2,156,997	0.01
USD	11,876,000 EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	11,812,530	0.08
USD	1,055,346 Fannie Mae-Aces 3.866% 25/9/2030	995,763	0.01
EUR	2,958,000 Fidelity National Information Services 1.5% 21/5/2027	2,945,996	0.02
USD	35,443,780 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.941% 25/5/2029	1,220,241	0.01
USD	31,539,450 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.132% 25/10/2030	1,756,634	0.01
USD	4,873,647 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.528% 25/7/2030	360,140	0.00
USD	22,579,134 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.644% 25/1/2030	1,723,621	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
USD	9,628,434 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.697% 25/4/2030	776,541	0.01
USD	5,508,048 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.813% 25/4/2030	465,644	0.00
USD	1,530,711 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8.688% 25/1/2042	1,521,151	0.01
USD	2,204,000 Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	2,195,856	0.02
USD	1,102,000 Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	1,085,740	0.01
USD	3,945,000 Frontier Communications 5.875% 15/10/2027*	3,594,929	0.02
USD	5,945,000 Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	5,708,053	0.04
USD	7,070,000 Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	6,863,538	0.05
USD	6,385,000 Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	5,955,481	0.04
USD	3,810,000 Frontier North 6.73% 15/2/2028	3,475,349	0.02
USD	6,367,781 FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.894% 17/8/2037	6,399,632	0.05
USD	254,000 Full House Resorts 8.25% 15/2/2028*	226,223	0.00
USD	823,000 GCI 4.75% 15/10/2028	714,878	0.01
USD	662,000 Gen Digital 6.75% 30/9/2027	662,350	0.00
USD	4,602,000 Gen Digital 7.125% 30/9/2030	4,642,746	0.04
EUR	4,691,000 General Mills 0.125% 15/11/2025	4,698,851	0.03
EUR	3,663,000 General Mills 0.45% 15/1/2026	3,667,807	0.03
USD	3,325,000 General Motors Financial 5.4% 6/4/2026	3,285,772	0.02
EUR	1,377,000 Global Payments 4.875% 17/3/2031	1,494,405	0.01
EUR	3,236,000 Goldman Sachs 0.25% 26/1/2028*	2,975,936	0.02
USD	3,244,000 Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,910,176	0.02
USD	3,264,000 Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	2,544,031	0.02
USD	2,407,000 Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	1,949,570	0.01
GBP	900,000 Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028*	1,187,029	0.01
USD	3,602,965 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	2,753,806	0.02
USD	11,074,000 GoTo 5.5% 1/9/2027	6,488,079	0.04
USD	667,000 GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028	647,244	0.00
USD	4,197,000 HCA 3.5% 1/9/2030	3,668,003	0.03
USD	5,133,000 HCA 5.375% 1/2/2025	5,099,319	0.04
USD	4,011,000 HCA 5.625% 1/9/2028	4,000,578	0.03
USD	546,920 Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 3.076% 10/8/2038	449,649	0.00
USD	1,684,000 Independence Plaza Trust 2018- INDP 3.911% 10/7/2035	1,567,875	0.01
EUR	2,721,000 International Business Machines 3.375% 6/2/2027	2,920,202	0.02
USD	772,280 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-WPT 8.055% 5/7/2033	651,596	0.00
GBP	2,250,000 JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	2,632,462	0.02
EUR	2,960,000 JPMorgan Chase 1.09% 11/3/2027	2,974,253	0.02
USD	3,264,000 JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	2,555,470	0.02
GBP	549,000 Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	658,327	0.01
USD	1,333,000 Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	1,220,443	0.01
USD	2,048,000 Lightning eMotors 7.5% 15/5/2024	921,600	0.01
USD	10,668,000 Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	6,456,850	0.04
USD	1,632,000 Lowe' s 2.625% 1/4/2031	1,370,350	0.01
USD	7,438,000 Lowe' s 4.8% 1/4/2026	7,347,950	0.05
USD	13,761,000 Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	13,535,747	0.09
USD	1,752,000 Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	1,526,813	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
EUR	3,595,000 Morgan Stanley 1.342% 23/10/2026*	3,659,722	0.03
USD	866,000 Morgan Stanley 2.239% 21/7/2032	681,292	0.00
USD	327,000 Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	275,267	0.00
USD	4,538,000 Morgan Stanley 3.62% 17/4/2025*	4,468,347	0.03
USD	6,196,000 Morgan Stanley Bank 4.754% 21/4/2026	6,108,558	0.04
USD	395,094 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015- C24 4.468% 15/5/2048	337,984	0.00
USD	2,057,000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016- C32 3.72% 15/12/2049	1,920,011	0.01
USD	1,299,000 Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	1,121,315	0.01
EUR	1,984,000 Nasdaq 4.5% 15/2/2032	2,190,158	0.02
USD	3,024,000 Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	2,554,728	0.02
USD	3,475,000 Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	3,161,816	0.02
USD	428,000 Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	408,059	0.00
EUR	5,362,000 Netflix 3.625% 15/5/2027*	5,743,972	0.04
USD	2,974,000 Netflix 4.875% 15/4/2028	2,927,415	0.02
USD	1,384,000 New Home 8.25% 15/10/2027	1,325,533	0.01
USD	3,562,000 Northern States Power 4.5% 1/6/2052	3,079,680	0.02
USD	2,805,000 NRG Energy 7% 15/3/2033	2,771,284	0.02
USD	1,968,000 Olympus Water US 7.125% 1/10/2027*	1,841,453	0.01
USD	11,580,000 Olympus Water US 9.75% 15/11/2028	11,675,442	0.08
USD	2,070,000 Oncor Electric Delivery 4.1% 15/11/2048	1,698,321	0.01
USD	5,974,000 ONEOK Partners 4.9% 15/3/2025	5,878,754	0.04
USD	4,065,000 Oracle 2.3% 25/3/2028	3,576,406	0.02
USD	5,808,000 Oracle 2.875% 25/3/2031	4,908,741	0.04
USD	2,571,000 Oracle 2.95% 1/4/2030	2,227,320	0.02
USD	133,000 Pacific Gas and Electric 3.25% 16/2/2024	131,375	0.00
USD	3,248,000 Pacific Gas and Electric 3.3% 1/12/2027	2,892,602	0.02
USD	1,265,000 Pacific Gas and Electric 6.1% 15/1/2029	1,249,732	0.01
USD	1,632,000 Pacific Gas and Electric 6.4% 15/6/2033	1,615,297	0.01
USD	545,000 Palomino Funding Trust I 7.233% 17/5/2028	552,012	0.00
USD	3,600,000 Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,977,740	0.02
USD	2,957,000 Penske Truck Leasing / PTL Finance 5.75% 24/5/2026	2,935,157	0.02
USD	557,000 Periana 5.95% 19/4/2026*	531,244	0.00
USD	8,963,000 Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027*	6,797,539	0.05
EUR	2,739,000 PPG Industries 1.875% 1/6/2025	2,866,646	0.02
EUR	1,884,000 Procter & Gamble 4.875% 11/5/2027*	2,147,617	0.02
USD	1,025,000 Prologis 2.25% 15/1/2032	823,230	0.01
USD	1,357,000 Rain Carbon 12.25% 1/9/2029	1,403,125	0.01
USD	6,812,000 Rand Parent 8.5% 15/2/2030*	6,503,172	0.05
USD	9,475,028 Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7.867% 25/10/2039	9,481,628	0.07
USD	3,745,000 Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	3,726,594	0.03
USD	4,173,000 RingCentral 8.5% 15/8/2030	4,116,936	0.03
USD	5,325,000 Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	5,239,326	0.03
USD	728,000 Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	717,893	0.00
USD	3,656,000 Sabre GLBL 11.25% 15/12/2027	3,487,683	0.02
USD	326,000 Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	292,147	0.00

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
USD	1,272,000 Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028*	1,154,664	0.02
USD	1,796,000 Sasol Financing USA 8.75% 3/5/2029*	1,762,325	0.01
USD	558,000 Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	537,279	0.00
USD	1,723,000 Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,633,856	0.01
USD	2,654,000 Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,635,240	0.02
USD	562,000 SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	424,681	0.00
USD	860,000 SK Battery America 2.125% 26/1/2026	771,411	0.01
USD	7,349,990 SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.175% 15/10/2041	7,778,304	0.05
USD	7,193,108 SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	5,984,472	0.04
USD	1,499,000 Southern California Edison 1.1% 1/4/2024	1,458,033	0.01
USD	3,584,000 Southern California Edison 5.3% 1/3/2028	3,593,986	0.03
USD	6,575,000 Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025*	6,497,468	0.04
USD	715,000 Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	744,729	0.01
USD	5,513,000 Sprint 7.875% 15/9/2023	5,509,334	0.04
USD	1,360,625 Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	1,346,808	0.01
USD	324,000 Steel Dynamics 5% 15/12/2026	317,887	0.00
USD	526,000 Stem 0.5% 1/12/2028	321,148	0.00
USD	4,256,000 Tenneco 8% 17/11/2028	3,502,092	0.02
EUR	2,978,000 Thermo Fisher Scientific 1.375% 12/9/2028	2,902,688	0.02
USD	3,787,000 T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	3,084,392	0.02
USD	2,434,000 T-Mobile USA 3.5% 15/4/2031	2,126,114	0.01
USD	2,579,000 T-Mobile USA 4.95% 15/3/2028	2,540,518	0.02
USD	2,919,915 Topaz Solar Farms 5.75% 30/9/2039	2,763,685	0.02
USD	217,000,000 United States Treasury Bill 0% 5/9/2023	216,873,958	1.50
USD	94,000,000 United States Treasury Bill 0.00% 12/9/2023	93,849,532	0.65
USD	50,000,000 United States Treasury Bill 0% 19/9/2023	49,868,219	0.34
USD	116,000,000 United States Treasury Bill 0% 21/9/2023	115,660,055	0.80
USD	72,000,000 United States Treasury Bill 0% 28/9/2023	71,714,542	0.50
USD	18,000,000 United States Treasury Bill 0% 3/10/2023*	17,915,146	0.12
USD	50,000,000 United States Treasury Bill 0% 5/10/2023	49,750,352	0.34
USD	118,000,000 United States Treasury Bill 0% 10/10/2023	117,325,680	0.81
USD	100,000,000 United States Treasury Bill 0% 12/10/2023	99,396,104	0.69
USD	1,186,000 United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	1,173,161	0.01
USD	18,591,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	18,560,540	0.13
USD	111,120,200 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024*, †	131,528,176	0.91
USD	178,516,800 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2024*	230,262,646	1.59
USD	61,108,000 United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/7/2032	57,608,859	0.40
USD	22,961,000 United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042*, †	17,077,244	0.12
USD	55,520,200 United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042 †	47,402,539	0.33
USD	27,945,800 United States Treasury Note/Bond 3.375% 15/8/2042 †	24,253,898	0.17
USD	219,770,000 United States Treasury Note/Bond 4% 30/6/2028*, †	216,894,103	1.50
USD	292,652,100 United States Treasury Note/Bond 4% 31/7/2028*	290,525,801	2.01
USD	43,135,600 United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052*, †	41,649,444	0.29
USD	4,006,000 Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	3,992,792	0.03
USD	2,381,000 USB Capital IX 6.59% 2/10/2023	1,794,226	0.01

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
	米国 (続き)		
GBP	900,000 Verizon Communications 1.125% 3/11/2028*	903,057	0.01
USD	7,003,000 Verizon Communications 2.55% 21/3/2031	5,762,606	0.04
GBP	238,000 Verizon Communications 4.073% 18/6/2024	297,718	0.00
EUR	2,587,000 Verizon Communications 4.25% 31/10/2030	2,835,561	0.02
USD	395,000 Viasat 5.625% 15/9/2025	373,062	0.00
USD	3,568,000 Viasat 5.625% 15/4/2027	3,188,731	0.02
USD	1,550,000 Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,510,824	0.01
USD	7,002,000 Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	6,746,716	0.05
USD	3,286,000 VMware 1.4% 15/8/2026	2,909,765	0.02
USD	1,632,000 VMware 2.2% 15/8/2031	1,272,809	0.01
USD	1,350,000 VNDO Trust 2016-350P 4.033% 10/1/2035	1,180,037	0.01
EUR	2,955,000 Wells Fargo 1.375% 26/10/2026	2,947,013	0.02
EUR	4,515,000 Wells Fargo 1.5% 24/5/2027	4,458,955	0.03
USD	5,938,000 Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	5,758,568	0.04
USD	2,000,000 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015- C28 3.872% 15/5/2048	1,877,353	0.01
USD	796,545 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017- C38 3.903% 15/7/2050	660,664	0.00
USD	1,318,000 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018- 1745 3.874% 15/6/2036	1,114,821	0.01
USD	2,226,000 Welltower 4% 1/6/2025	2,157,191	0.01
USD	175,000 Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	172,781	0.00
USD	9,250,000 Xerox 5% 15/8/2025	8,828,061	0.06
		<hr/>	<hr/>
		2,550,837,981	17.65
	ウルグアイ		
USD	1,774,000 Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034*	1,905,728	0.01
	債券合計	<hr/>	<hr/>
		5,376,205,649	37.18
コマーシャルペーパー			
	フランス		
USD	12,174,000 Societe Generale 0% 6/3/2024	11,813,984	0.08
	ドイツ		
USD	33,182,000 Bayer 0% 1/9/2023	33,171,944	0.23
	スイス		
USD	8,710,000 UBS (London Branch) 0% 18/6/2024	8,307,701	0.06
USD	8,710,000 UBS (London Branch) 0% 25/6/2024	8,298,307	0.06
		<hr/>	<hr/>
		16,606,008	0.12
	米国		
USD	16,241,000 3M 0% 7/9/2023	16,221,958	0.11
USD	31,041,000 AT&T 0% 19/12/2023	30,501,484	0.21
USD	5,475,000 AT&T 0% 20/12/2023	5,378,949	0.04
USD	33,182,000 AT&T 0% 23/1/2024	32,416,289	0.22
USD	42,335,000 AT&T 0% 21/2/2024	41,156,206	0.28
USD	6,130,000 Enel Finance America 0% 6/9/2023	6,123,498	0.04
USD	9,580,000 General Motors 0% 22/1/2024	9,354,040	0.06

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		米国 (続き)		
USD	7,052,000	General Motors 0% 25/1/2024	6,882,109	0.05
USD	10,895,000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	10,824,124	0.08
USD	5,748,000	HSBC USA 0% 20/11/2023	5,675,048	0.04
USD	5,750,000	HSBC USA 0% 24/6/2024	5,462,455	0.04
USD	9,025,000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8,562,424	0.06
USD	8,630,000	HSBC USA 0% 12/8/2024	8,123,787	0.06
			<u>186,682,371</u>	<u>1.29</u>
		コマーシャルペーパー合計	<u>248,274,307</u>	<u>1.72</u>
譲渡性預金				
		米国		
USD	22,730,000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	<u>22,721,561</u>	<u>0.16</u>
		譲渡性預金合計	<u>22,721,561</u>	<u>0.16</u>
		公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品合計	<u>13,975,824,644</u>	<u>96.68</u>

その他の譲渡性のある有価証券

数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
普通/優先株式 (証券) およびワラント			
9,488,465	オーストラリア Quintis Pty**	61	0.00
609	ケイマン諸島 Marco Polo Investment**	-	0.00
2,463	インド Think & Learn Pvt**	1,860,851	0.01
3,482	Think & Learn Pvt**	2,630,727	0.02
		4,491,578	0.03
413,408	英国 10X Future Technologies**	7,955,180	0.06
63,622	米国 Aiven**	5,370,333	0.04
21,376	Breeze Aviation**	6,730,234	0.05
188,149	ByteDance**	32,679,567	0.23
45,635	Caresyntax**	4,360,424	0.03
6,574	Caresyntax**	526,906	0.00
5,179	Caresyntax (Wts 21/6/2033)**	494,802	0.00
488,757	Databricks**	26,104,511	0.18
136,950	Databricks**	7,314,499	0.05
1,209,710	Deep Instinct**	8,528,455	0.06
82,654	Deep Instinct (Wts 20/9/2032)**	491,791	0.00
1,172,341	Deep Instinct Series D-4**	8,265,004	0.06
24,969	Epic Games**	16,342,710	0.11
941,683	eXo Imaging**	2,467,209	0.02
420,195	Fanatics**	30,527,167	0.21
157,436	Farmer' s Business Network**	3,838,290	0.03
23,814	Farmer' s Business Network**	580,585	0.00
25,662	FLYR (Wts 31/12/2049)**	348,233	0.00
235,953	GM Cruise**	4,990,406	0.03
144,403	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)**	651,257	0.01
22,921	Hawkeye 360 ATM (Wts 7/7/2033)**	52,718	0.00
57,303	Hawkeye 360 MGR (Wts 7/7/2033)**	258,437	0.00
448,109	Hawkeye 360 Series D1**	4,041,943	0.03
6,145,462	Included Health**	7,067,281	0.05
3,924,026	JumpCloud**	10,202,468	0.07
258,097	JumpCloud**	671,052	0.00
216,912	Latch (Wts 4/6/2026)	-	0.00
592,242	Lessen**	5,300,566	0.04
206,148	Lessen Series C**	1,845,025	0.01
760,471	Loadsmart**	8,502,066	0.06
95,378	Loadsmart**	1,066,326	0.01
107,909	Lookout**	280,563	0.00
1,919,121	Lookout Series F**	8,827,957	0.06
231,287	Mountain Digital**	2,444,703	0.02
561,098	Mythic**	6	0.00
4,980	NCB Warrant**	-	0.00
24,103	Neon Payments**	12,397,860	0.09
652,238	NMC Health**	-	0.00
750,669	Noodle**	3,903,479	0.03
129,448	Psiquantum**	3,650,434	0.03
261,161	Relativity Space**	4,147,237	0.03
3,662	Salt Pay**	2,124,253	0.01

	数量	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 %
		米国 (続き)		
	134,315	SambaNova Systems**	10,660,582	0.07
	46,362	SambaNova Systems**	3,679,752	0.03
	167,805	Snorkel AI**	1,579,045	0.01
	46,853	Snorkel AI**	440,887	0.00
	337,227	Source Global**	9,557,013	0.06
	24,317	Source Global**	923,560	0.01
	1,121,246	Ursa Major Technologies**	3,576,775	0.02
	137,361	Ursa Major Technologies Series D**	454,665	0.00
	1,197,196	Verge Genomics**	7,733,886	0.05
	178,954	Versa Networks (Wts 7/10/2032)**	493,913	0.01
	1,451,933	Versa Networks Series E**	4,500,992	0.03
			<u>280,997,827</u>	<u>1.94</u>
		普通/優先株式 (証券) およびワラント合計	<u>293,444,646</u>	<u>2.03</u>
債券				
		オーストラリア		
USD	19,413,818	Quintis Australia Pty 7.5% 1/10/2026**	12,436,492	0.09
USD	17,943,829	Quintis Australia Pty 0% 1/10/2028**	2	0.00
			<u>12,436,494</u>	<u>0.09</u>
		ケイマン諸島		
CNY	103,700,000	Fresh Express Delivery 0% 18/10/2010**,***	-	0.00
		インド		
USD	19,051,000	REI Agro 5.5% 13/11/2014**,***	2	0.00
		国際		
EUR	8,182,400	Natra Foods 0% 13/10/2029**	8,600,479	0.06
		米国		
USD	2,090,000	Calpine Escrow 0% 31/12/2049**	-	0.00
USD	4,863,154	FLYR 10% 20/1/2027**	4,498,418	0.03
USD	9,949,610	FLYR 8% 10/8/2027**	9,742,658	0.07
USD	15,179,097	Lessen 0% 5/1/2028**	14,230,403	0.10
USD	10,933,346	Pioneer Midco 10.5% 18/11/2030**	10,769,346	0.07
			<u>39,240,825</u>	<u>0.27</u>
		債券合計	<u>60,277,800</u>	<u>0.42</u>
		その他の譲渡性のある有価証券合計	<u>353,722,446</u>	<u>2.45</u>
		ポートフォリオ合計	<u>14,329,547,090</u>	<u>99.13</u>
		その他の純資産	125,729,806	0.87
		純資産合計 (米ドル)	<u>14,455,276,896</u>	<u>100.00</u>

* 当該有価証券は貸付有価証券です。

† 当該投資は関連当事者のファンドへの投資です。

** 当該有価証券は公正価値修正の対象です。

† 当該有価証券は、担保として差し入れられたものまたは保証が付与されたものです。

'A'、'B'、'C'、'H'：議決権や転売権等に特定の規定が設けられた株式です。※

(Pref) 優先株式 (優先証券) です。※

(Defaulted) デフォルト銘柄です。※

(Restricted) 取引等の制限がかかっている銘柄です。※

(FRN) 変動利付債です。※

(Perpetual) 永久債です。なお、記号の直前にある日付は発行体が債券を償還する可能性のある日を表します。※

'144A'：米国の適格機関投資家向け私募証券市場において発行された証券です。※

※はアセットマネジメントOneにて追記しました。

(4) 外国為替予約取引明細表
2023年8月31日現在

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益／(損失) (米ドル)
AUD	342,358,442	USD	232,514,105	Barclays	20/9/2023	(10,620,251)
BRL	175,263,019	USD	35,364,071	Citigroup	14/9/2023	151,211
BRL	434,725,908	USD	86,981,714	Barclays	20/9/2023	1,024,965
CAD	136,011,631	USD	101,830,472	JP Morgan	20/9/2023	(1,269,158)
CHF	229,688,160	USD	254,959,207	HSBC Bank	20/9/2023	5,554,054
CNH	73,105,000	USD	10,347,781	Citigroup	14/9/2023	(294,270)
CNH	299,818,594	USD	42,310,321	Barclays	20/9/2023	(1,066,019)
CNH	256,565,678	USD	36,307,834	Bank of America	20/9/2023	(1,013,584)
CNH	148,095,000	USD	20,557,863	JP Morgan	14/9/2023	(191,614)
CNH	265,171,065	USD	36,721,814	JP Morgan	20/9/2023	(243,772)
CNH	264,904,600	USD	37,255,149	State Street	20/9/2023	(813,762)
COP	55,837,798,000	USD	13,742,424	Bank of America	14/9/2023	(189,595)
CZK	709,533,768	USD	32,408,359	HSBC Bank	14/9/2023	(421,019)
CZK	388,002,782	USD	18,129,421	UBS	14/9/2023	(637,403)
DKK	378,702,264	USD	54,969,062	BNP Paribas	20/9/2023	219,320
EUR	399,411,768	USD	431,643,898	Citigroup	20/9/2023	2,031,781
EUR	79,888,203	USD	88,182,008	JP Morgan	20/9/2023	(1,440,522)
EUR	18,390,000	USD	20,431,382	Citibank	14/9/2023	(469,577)
EUR	64,322,488	USD	70,881,401	HSBC Bank	20/9/2023	(1,040,948)
GBP	24,272,196	EUR	28,108,341	HSBC Bank	20/9/2023	251,248
GBP	37,645,271	USD	47,114,069	JP Morgan	20/9/2023	610,432
HUF	9,109,764,911	USD	25,836,708	JP Morgan	14/9/2023	98,690
HUF	5,520,114,152	USD	15,712,666	Goldman Sachs	20/9/2023	(16,472)
IDR	231,054,423,828	USD	15,449,462	Citigroup	20/9/2023	(281,610)
IDR	307,679,865,000	USD	20,525,675	JP Morgan	14/9/2023	(325,863)
INR	4,112,737,000	USD	49,648,400	Citigroup	14/9/2023	29,434
JPY	13,346,394,198	EUR	89,761,645	JP Morgan	20/9/2023	(5,910,989)
JPY	134,065,777,511	USD	974,591,472	UBS	20/9/2023	(54,953,698)
JPY	4,193,150,318	USD	29,848,204	JP Morgan	20/9/2023	(1,084,865)
KRW	74,148,133,571	USD	56,601,197	UBS	20/9/2023	(494,139)
KRW	13,344,080,000	USD	10,230,327	Citigroup	14/9/2023	(133,592)
MXN	518,410,474	USD	29,538,692	State Street	20/9/2023	1,352,084
MXN	1,378,410,156	USD	78,107,956	JP Morgan	20/9/2023	4,028,035
MXN	18,390,114	USD	1,049,614	Morgan Stanley	20/9/2023	46,207
MYR	36,803,160	USD	8,151,319	Barclays	14/9/2023	(213,900)
NOK	741,622,471	CHF	62,231,601	Goldman Sachs	20/9/2023	(904,789)
NOK	108,370,078	USD	9,855,709	Deutsche Bank	14/9/2023	324,181
NZD	12,625,121	USD	7,713,696	JP Morgan	20/9/2023	(204,628)
PLN	61,210,000	USD	14,687,463	Bank of America	14/9/2023	164,427
PLN	94,943,874	USD	22,824,802	Barclays	20/9/2023	204,557
SGD	13,869,490	USD	10,329,617	JP Morgan	14/9/2023	(64,288)
SGD	37,493,709	USD	27,998,635	JP Morgan	20/9/2023	(240,579)
THB	894,222,200	USD	25,889,467	HSBC Bank	14/9/2023	(327,682)
THB	703,665,000	USD	20,410,185	Citigroup	14/9/2023	(295,573)
TWD	1,613,158,500	USD	52,520,218	State Street	20/9/2023	(1,857,572)
USD	130,737,035	HKD	1,020,337,188	UBS	20/9/2023	539,804
USD	24,992,725	CZK	551,019,440	Deutsche Bank	14/9/2023	151,558

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益／(損失) (米ドル)
USD	89,447,767	MXN	1,580,080,930	JP Morgan	14/9/2023	(4,803,498)
USD	24,692,737	ZAR	476,550,643	State Street	14/9/2023	(646,865)
USD	17,884,337	IDR	266,222,658,292	UBS	14/9/2023	406,275
USD	46,145,257	INR	3,819,835,139	Citigroup	20/9/2023	6,030
USD	1,836,244	EUR	1,696,498	State Street	14/9/2023	(5,254)
USD	19,874,482	SEK	213,859,133	Deutsche Bank	20/9/2023	255,486
USD	30,318,705	NOK	326,441,556	Deutsche Bank	20/9/2023	(351,852)
USD	66,244,835	CNH	470,298,580	BNP Paribas	20/9/2023	1,548,592
USD	475,818	EUR	438,375	Royal Bank of Canada	14/9/2023	(25)
USD	507,156	EUR	464,812	Citigroup	14/9/2023	2,616
USD	36,882,838	MXN	644,626,024	Goldman Sachs	20/9/2023	(1,528,804)
USD	44,323,303	ZAR	840,338,982	Citigroup	14/9/2023	(359,996)
USD	9,344,257	IDR	139,703,177,381	Morgan Stanley	14/9/2023	172,457
USD	180,773,545	AUD	262,728,302	Bank of America	20/9/2023	10,490,624
USD	94,361,190	BRL	460,831,743	Morgan Stanley	20/9/2023	1,069,599
USD	188,606,890	GBP	147,852,501	Deutsche Bank	20/9/2023	1,168,025
USD	1,088,863,677	EUR	992,660,030	Barclays	20/9/2023	11,047,381
USD	235,196,879	JPY	32,596,993,885	Morgan Stanley	20/9/2023	11,594,499
USD	12,993,007	BRL	63,509,688	HSBC Bank	14/9/2023	123,409
USD	7,511,759	ZAR	139,081,633	Société Générale	20/9/2023	120,288
USD	88,110,110	MXN	1,543,431,583	Citigroup	20/9/2023	(3,859,093)
USD	37,095,897	BRL	178,485,713	Goldman Sachs	20/9/2023	962,935
USD	103,865,023	EUR	93,746,426	JP Morgan	20/9/2023	2,076,472
USD	10,274,039	SGD	13,869,490	Citigroup	14/9/2023	8,709
USD	46,227,632	INR	3,802,685,000	Barclays	14/9/2023	294,923
USD	36,887,003	JPY	5,257,264,790	Citigroup	20/9/2023	824,263
USD	66,240,699	GBP	51,538,539	JP Morgan	20/9/2023	903,114
USD	44,601,794	GBP	34,113,967	Citigroup	20/9/2023	1,354,077
USD	29,837,765	EUR	26,459,191	Bank of America	20/9/2023	1,108,748
USD	29,709,094	NOK	298,071,341	Bank of America	20/9/2023	1,704,038
USD	10,758,236	NOK	108,370,078	Barclays	14/9/2023	578,346
USD	103,950,587	MXN	1,771,422,798	HSBC Bank	20/9/2023	(1,604,039)
USD	33,034,625	CZK	725,472,783	Barclays	14/9/2023	328,720
USD	12,002,031	HUF	4,202,283,000	Bank of America	14/9/2023	38,178
USD	20,775,095	BRL	99,436,459	JP Morgan	14/9/2023	625,299
USD	373,946	EUR	336,528	Morgan Stanley	14/9/2023	8,655
ZAR	722,340,081	USD	38,508,579	Morgan Stanley	20/9/2023	(119,931)
ZAR	182,326,000	USD	10,121,575	HSBC Bank	14/9/2023	(426,764)
BRL	18,177,000	USD	3,714,747	Barclays	14/9/2023	(31,361)
CLP	4,873,925,000	USD	5,621,597	BNP Paribas	14/9/2023	75,997
CLP	3,229,345,000	USD	3,732,190	Barclays	14/9/2023	42,898
CLP	3,229,345,000	USD	3,741,132	JP Morgan	14/9/2023	33,957
COP	39,017,305,000	USD	8,889,794	BNP Paribas	17/5/2024	95,459
COP	30,779,837,000	USD	7,433,131	Citigroup	14/9/2023	37,685
COP	30,756,444,000	USD	7,402,095	BNP Paribas	29/9/2023	25,612
HUF	1,982,864,000	USD	5,615,747	Citigroup	14/9/2023	29,445
IDR	199,747,050,676	USD	13,027,265	Deutsche Bank	14/9/2023	86,537
INR	2,429,474,500	USD	29,281,361	JP Morgan	20/9/2023	63,905
INR	770,819,000	USD	9,333,079	BNP Paribas	14/9/2023	(22,341)

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益／(損失) (米ドル)
SEK	859,500,000	USD	79,036,883	UBS	20/9/2023	(188,125)
USD	29,960,488	IDR	455,597,560,240	Morgan Stanley	20/9/2023	52,226
USD	11,587,710	IDR	176,654,645,000	Citigroup	14/9/2023	(10,028)
USD	10,156,538	BRL	49,635,000	Goldman Sachs	14/9/2023	98,506
USD	13,420,500	PLN	54,854,000	JP Morgan	14/9/2023	110,820
USD	14,777,041	MXN	256,165,500	Citigroup	14/9/2023	(503,139)
USD	18,371,256	MXN	313,605,794	Barclays	14/9/2023	(335,219)
USD	17,101,040	CNH	123,974,000	Citigroup	14/9/2023	51,948
USD	10,165,124	EUR	9,290,000	Goldman Sachs	14/9/2023	81,102
USD	10,165,640	CNH	73,910,000	JP Morgan	14/9/2023	1,425
USD	10,024,761	COP	40,575,220,000	Citigroup	14/9/2023	176,431
USD	9,336,517	COP	39,017,305,000	BNP Paribas	17/10/2023	(38,803)
USD	5,692,755	THB	201,700,000	BNP Paribas	14/9/2023	(72,940)
USD	43,561,630	JPY	6,344,799,327	Royal Bank of Canada	20/9/2023	38,837
USD	25,989,992	BRL	129,040,545	Citigroup	14/9/2023	(158,773)
USD	49,847,229	JPY	7,250,608,449	Barclays	20/9/2023	110,946
ZAR	328,749,000	USD	17,427,248	Citigroup	14/9/2023	53,305
未実現純損失						<u>(35,217,796)</u>
AUD Hedged Share Class						
AUD	271,883,860	USD	177,066,646	BNY Mellon	15/9/2023	(881,761)
USD	6,292,130	AUD	9,758,716	BNY Mellon	15/9/2023	(31,641)
未実現純損失						<u>(913,402)</u>
CHF Hedged Share Class						
CHF	27,663,274	USD	31,673,211	BNY Mellon	15/9/2023	(314,063)
USD	1,060,227	CHF	929,498	BNY Mellon	15/9/2023	6,551
未実現純損失						<u>(307,512)</u>
CNH Hedged Share Class						
CNY	226,979,016	USD	31,442,335	BNY Mellon	15/9/2023	(226,095)
USD	3,648,668	CNY	26,360,827	BNY Mellon	15/9/2023	23,288
未実現純損失						<u>(202,807)</u>
EUR Hedged Share Class						
EUR	1,687,048,350	USD	1,850,973,592	BNY Mellon	15/9/2023	(19,633,013)
USD	68,176,842	EUR	62,480,681	BNY Mellon	15/9/2023	352,424
未実現純損失						<u>(19,280,589)</u>
GBP Hedged Share Class						
GBP	114,920,136	USD	146,219,045	BNY Mellon	15/9/2023	(533,216)
USD	6,237,980	GBP	4,905,498	BNY Mellon	15/9/2023	19,212
未実現純損失						<u>(514,004)</u>
HKD Hedged Share Class						
HKD	227,917,464	USD	29,197,710	BNY Mellon	15/9/2023	(121,974)
USD	5,094,268	HKD	39,915,123	BNY Mellon	15/9/2023	2,252
未実現純損失						<u>(119,722)</u>

通貨	買建金額	通貨	売建金額	契約相手	満期日	未実現利益／(損失) (米ドル)
JPY Hedged Share Class						
JPY	3,384,849,727	USD	23,755,069	BNY Mellon	15/9/2023	(553,936)
USD	778,500	JPY	112,869,772	BNY Mellon	15/9/2023	4,869
未実現純損失						(549,067)
PLN Hedged Share Class						
PLN	38,315,487	USD	9,432,003	BNY Mellon	15/9/2023	(135,796)
USD	328,435	PLN	1,344,839	BNY Mellon	15/9/2023	2,145
未実現純損失						(133,651)
SGD Hedged Share Class						
SGD	89,964,376	USD	66,832,427	BNY Mellon	15/9/2023	(243,278)
USD	2,296,124	SGD	3,110,614	BNY Mellon	15/9/2023	(6,259)
未実現純損失						(249,537)
ZAR Hedged Share Class						
USD	158	ZAR	3,023	BNY Mellon	15/9/2023	(2)
ZAR	90,902	USD	4,821	BNY Mellon	15/9/2023	12
未実現純利益						10
未実現純損失合計						(57,488,077)
(米ドル原資産エクスポージャー--9,451,760,978米ドル)						

(5) 先物取引明細表
2023年8月31日現在

契約数量	通貨	銘柄	満期日	原資産エクスポージャー (米ドル)	未実現利益／(損失) (米ドル)
2,019	EUR	Euro BOBL	September 2023	254,164,226	(175,284)
(69)	EUR	Euro BUXL	September 2023	9,990,978	206,617
(625)	EUR	Euro-BTP	September 2023	78,597,501	(212,801)
358	EUR	Euro-OAT	September 2023	49,603,891	(438,904)
536	JPY	Nikkei 225 Index	September 2023	119,775,330	915,213
(288)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	September 2023	289,566,612	1,219,132
87	CAD	S&P/TSX 60 Index	September 2023	15,737,532	292,152
39	EUR	Dax Index	September 2023	16,988,615	(196,755)
92	EUR	EURO STOXX 50 Index	September 2023	4,328,975	(9,482)
(916)	GBP	FTSE 100 Index	September 2023	87,064,332	1,419,527
437	USD	MSCI Emerging Markets Index	September 2023	21,528,805	(475,497)
(1,561)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	September 2023	485,986,130	(12,090,665)
(165)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	September 2023	15,808,650	(246,675)
2,947	USD	S&P 500 E-Mini Index	September 2023	668,342,762	15,678,683
1,657	EUR	EURO STOXX Banks Index	September 2023	10,125,851	777,529
(85)	USD	US Long Bond (CBT)	December 2023	10,332,812	(107,588)
432	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	December 2023	47,904,750	263,977
(153)	USD	US Ultra 10 Year Note	December 2023	17,745,609	(182,154)
(2,076)	USD	US Ultra Bond (CBT)	December 2023	268,777,125	(6,227,116)
514	GBP	Long Gilt	December 2023	62,114,368	521,055
(467)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	December 2023	49,877,789	(240,784)
合計				2,584,362,643	690,180

(6) スワップ明細表
2023年8月31日現在

種類	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS USD	305,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(8,538)	7,910
CDS USD	605,000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(4,354)	24,255
CDS USD	764,388	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2027	(24,104)	(11,834)
CDS USD	390,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2027	44,586	131,895
CDS USD	985,000	Fund receives default protection on Borgwarner; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(27,596)	(15,765)
CDS USD	540,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	58,394	182,624
CDS USD	990,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(49,119)	107,270
CDS USD	220,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	22,612	74,402
CDS USD	320,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	30,620	108,221
CDS USD	380,000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	(11,080)	27,114
CDS USD	615,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(49,441)	66,637
CDS USD	70,511,631	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.37; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2026	23,029	(1,080,643)
CDS USD	(15,189,391)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.39.V1; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	583,922	503,805
CDS USD	(36,892,177)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.39.V1; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	505,183	564,748
CDS EUR	(15,833,329)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.38.V1; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	1,410,892	844,816
CDS USD	4,340,000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	(88,346)	(128,413)
CDS USD	390,000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	44,537	131,895
CDS USD	630,000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(18,555)	44,952
CDS USD	1,580,000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	6,191	73,594
CDS USD	342,657	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	2,002	15,960
CDS USD	318,672	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	1,863	14,843
CDS USD	3,260,000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(88,844)	(16,574)
CDS USD	3,255,000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(53,181)	(5,954)
CDS EUR	9,900,000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(450,892)	(110,929)
CDS EUR	5,840,000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(258,681)	(65,437)
CDS USD	764,389	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(24,104)	(11,834)
CDS USD	1,021,223	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(31,184)	(15,811)
CDS USD	1,260,000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	(85,560)	(113,492)
CDS USD	570,000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(25,065)	(52,019)
CDS USD	(33,871,714)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.33.V1; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2024	(325,304)	312,769
IFS EUR	11,180,000	Fund provides default protection CPTFEMU + Obps; and receives Fixed 2.693%	Goldman Sachs	15/8/2032	(255,712)	(255,712)
IRS BRL	154,497,000	Fund receives Fixed 9.98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(77,728)	(77,728)
IRS BRL	22,044,207	Fund receives Fixed 11.5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	117,764	117,764
IRS BRL	33,551,158	Fund receives Fixed 11.82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	223,489	223,489
IRS BRL	22,095,109	Fund receives Fixed 11.27%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	2/1/2026	89,439	89,439
IRS BRL	113,105,027	Fund receives Fixed 9.965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(206,038)	(206,038)
IRS BRL	701,231,454	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12.615%	Citibank	2/1/2024	(23,854)	(23,854)
IRS BRL	17,029,082	Fund receives Fixed 11.76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	107,926	107,926
IRS BRL	110,099,446	Fund receives Fixed 9.95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(210,841)	(210,841)
IRS BRL	165,268,000	Fund receives Fixed 10.1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	1,313	1,313
IRS KRW	27,526,486,255	Fund receives Fixed 3.3725%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(163,329)	(163,329)
IRS KRW	27,526,486,256	Fund receives Fixed 3.384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(156,561)	(156,561)
IRS KRW	27,522,357,489	Fund receives Fixed 3.391%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(152,419)	(152,419)
IRS ZAR	592,884,931	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8.22%	Goldman Sachs	20/9/2026	(265,598)	(265,598)

種類	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益 / (損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 141,437,775	Fund receives Fixed 10.005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(292,061)	(292,061)
IRS	GBP 51,315,000	Fund receives Fixed 4.86%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Goldman Sachs	20/6/2028	83,902	83,902
IRS	EUR 60,014,000	Fund receives Fixed 2.34%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	19/1/2033	(1,066,070)	(1,066,070)
IRS	MXN 775,152,164	Fund receives Fixed 8.17%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Goldman Sachs	10/6/2033	(1,821,757)	(1,821,757)
IRS	USD 99,369,997	Fund receives Fixed 3.7565%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	9/8/2033	(592,403)	(592,403)
IRS	ZAR 225,749,716	Fund receives Fixed 9.895%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	462,398	462,398
IRS	ZAR 112,874,858	Fund receives Fixed 9.896%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	231,595	231,595
IRS	ZAR 112,874,857	Fund receives Fixed 9.9175%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	240,114	240,114
IRS	USD 13,573,500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2.613%	Goldman Sachs	2/5/2042	2,051,741	2,082,647
IRS	BRL 17,779,514	Fund receives Fixed 11.775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	114,119	114,119
IRS	BRL 109,845,909	Fund receives Fixed 10.025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(159,051)	(159,051)
IRS	BRL 31,266,700	Fund receives Fixed 11.83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	209,958	209,958
IRS	BRL 109,964,132	Fund receives Fixed 9.99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(183,201)	(183,201)
TRS	USD 15,259,000	Fund receives iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(108,739)	(144,651)
TRS	USD 15,915,247	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(122,742)	(139,106)
TRS	USD 166,890	Fund receives JPM EMBIG DIV CORE + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 75bps	JP Morgan	20/9/2023	(857,258)	(857,258)
TRS	USD 8,152,304	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	72,909	91,905
TRS	USD 25,000,000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	(33,727)	(58,008)
TRS	USD 10,000,000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	15,346	37,968
合計 (米ドル原資産エクスポージャー-1,116,503,228米ドル)					(1,617,193)	(1,122,104)

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

(7) 買建オプション明細表

2023年8月31日現在

契約数量	コール/ プット	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
36,612,000	プット	OTC USD/INR	Citibank	USD 82	9/10/2023	(30,443)	45,893
145,392,721	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.099	25/9/2023	1,087,434	2,309,796
120,773,063	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.6	12/9/2023	(364,840)	259,557
2,820,300	プット	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1.06	20/10/2023	488,060	957,535
80,640,000	コール	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7.81	13/11/2023	38,344	187,206
1,992,995	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239.439	10/11/2023	17,355	147,178
3,320,329	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239.3	10/11/2023	23,662	246,734
1,329,992	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239.43	10/11/2023	22,559	98,257
6,555	コール	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15,700	15/9/2023	(295,539)	907,303
416	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	(232,917)	42,432
697	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(664,749)	5,925
358	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(9,800)	4,475
270	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12.5	15/9/2023	(15,480)	5,400
330	コール	Albemarle	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(195,402)	14,850
1,239	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 100	15/9/2023	(542,023)	89,827
564	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(21,279)	7,050
1,496	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	1,357,277	1,974,720
1,672	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	819,083	1,417,020
1,330	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(167,884)	615,125
1,384	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	15/9/2023	(477,025)	86,500
1,842	コール	Apple	Exchange Traded	USD 195	15/9/2023	(839,453)	144,597
832	コール	Apple	Exchange Traded	USD 200	15/9/2023	(335,022)	22,880
1,958	コール	Apple	Exchange Traded	USD 205	15/9/2023	(520,297)	22,517
522	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	370,353	657,720
1,288	コール	Archer-Daniels-Midland	Exchange Traded	USD 82.5	15/9/2023	(170,311)	51,520
4,313	コール	Barclays	Exchange Traded	GBP 1.6	15/9/2023	(183,872)	13,668
493	プット	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(260,664)	9,121
4,326	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(578,512)	10,815
826	コール	Edwards Lifesciences	Exchange Traded	USD 85	15/9/2023	(223,524)	8,260
187	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	1,039,008	1,314,610
245	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	1,827,850	2,203,775
289	コール	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(231,651)	21,819
5,768	コール	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(295,331)	5,768
1,730	コール	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(263,730)	4,325
331	コール	Humana	Exchange Traded	USD 450	15/9/2023	520,995	830,810
83	コール	Humana	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	13,421	132,385
2,497	コール	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	(477,398)	8,740
1,728	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 60	15/9/2023	(438,069)	23,328
729	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 62.5	15/9/2023	(184,454)	4,739
4,031	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(716,426)	18,140
671	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(696,624)	17,111
979	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(1,155,108)	39,649
1,252	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 365	15/9/2023	(1,266,208)	21,910
1,251	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	5,504,739	8,628,772

契約数量	コール/ プット	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/ (損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
89	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	9,719	238,742
89	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 485	15/9/2023	(60,039)	210,040
747	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(730,569)	1,155,982
427	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 470	15/9/2023	351,323	1,447,530
412	プット	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 210	15/9/2023	(438,514)	4,944
2,503	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(399,802)	6,258
3,069	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 42.5	15/9/2023	(321,395)	4,604
522	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(6,123)	2,088
633	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 14	15/9/2023	(8,143)	1,583
159	プット	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(4,926)	1,590
429	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	3,808	12,656
175	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 230	15/9/2023	(151,542)	56,437
175	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 240	15/9/2023	(133,680)	14,175
238	プット	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57.5	15/9/2023	(10,219)	714
233	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(32,499)	1,049
2,182	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(1,521,081)	94,917
378	コール	Starbucks	Exchange Traded	USD 105	15/9/2023	(96,551)	3,213
1,340	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(10,358)	10,050
565	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(10,017)	4,238
132	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 275	15/9/2023	(121,885)	45,870
132	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 280	15/9/2023	(199,949)	33,990
502	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 290	15/9/2023	(881,627)	70,782
830	コール	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	(16,375)	251,075
2,773	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(551,076)	70,711
1,058	コール	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(226,886)	202,312
541	コール	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	116,650	1,311,925
319	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	136,459	319,000
1,661	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	377,364	971,685
1,294	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(371,029)	39,467
149	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(9,123)	2,608
80	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 22.5	15/9/2023	(1,678)	800
729	コール	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(161,384)	6,327
416	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	(114,698)	6,448
412	プット	Zscaler	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(170,869)	184,370
565	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(30,922)	7,628
82	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108.5	22/9/2023	(19,986)	8,328
1,641	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	118,595	635,887
8,706	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 110	20/10/2023	(1,599,554)	831,423
347	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(8,851)	9,543
2,468	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	438,786	1,789,300
985	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 140	20/10/2023	98,766	480,187
1,974	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(614,638)	573,447
987	コール	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	767,074	1,149,855
1,317	コール	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	620,011	1,056,892
829	コール	Bunge	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	607,502	978,220
2,468	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 125	20/10/2023	(152,350)	445,474

契約数量	コール/ プット	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/ (損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
313	コール	Equitrans Midstream	Exchange Traded	USD 12	20/10/2023	(11,340)	1,565
823	プット	Fortinet	Exchange Traded	USD 55	20/10/2023	(174,665)	49,380
2,496	コール	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	(535,632)	142,272
2,007	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(229,253)	61,213
2,823	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	655,572	1,171,545
492	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 345	20/10/2023	(12,580)	265,680
414	コール	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 320	20/10/2023	(20,543)	335,340
24,620	コール	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	2,222,446	9,294,050
208	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(83,617)	64,376
2,588	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	103,716	976,970
567	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(8,635)	8,505
2,479	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(211,267)	302,438
330	コール	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 530	20/10/2023	(350,371)	84,315
1,409	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	37,047	602,347
106	コール	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	242,203	675,220
412	コール	Humana	Exchange Traded	USD 520	17/11/2023	(515,919)	206,000
8,478	コール	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(167,313)	487,485
545	コール	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(271,788)	80,387
1,345	コール	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	48,599	662,412
1,120	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	1,423	20,720
416	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 440	15/12/2023	1,796,193	3,565,120
569	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(8,097)	8,535
2,556	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 47	19/1/2024	(170,559)	24,282
4,258	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 50	19/1/2024	(169,872)	23,419
638	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	22,187	35,728
563	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	8,035	21,113
合計 (米ドル原資産エクスポージャー-959,684,079米ドル)						(2,070,206)	57,564,543

(8) 売建オプション明細表
2023年8月31日現在

契約数量	コール/ プット	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/(損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
(145,392,721)	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.079	25/9/2023	(244,900)	(716,520)
(120,773,063)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.2	12/9/2023	168,888	(5,025)
(40,290,000)	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.11	20/10/2023	28,529	(81,795)
(1,992,995)	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262.243	10/11/2023	16,407	(45,668)
(3,320,329)	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262.09	10/11/2023	27,259	(76,743)
(1,329,992)	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262.232	10/11/2023	(4)	(30,493)
(660)	プット	Albemarle	Exchange Traded	USD 180	15/9/2023	191,414	(36,300)
(1,239)	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	204,349	(9,293)
(2,994)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(882,422)	(1,332,330)
(2,509)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(96,089)	(421,512)
(2,660)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	434,297	(51,870)
(1,938)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	234,851	(6,783)
(1,449)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	119,209	(44,195)
(1,044)	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	(248,982)	(493,290)
(454)	コール	CF Industries	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	66,781	(4,540)
(493)	コール	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	123,675	(40,919)
(493)	プット	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	68,151	(740)
(4,326)	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	141,766	(4,326)
(245)	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(1,158,778)	(1,240,312)
(289)	プット	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(142,255)	(232,645)
(5,768)	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(379,126)	(510,468)
(1,730)	プット	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(145,940)	(295,830)
(165)	コール	Humana	Exchange Traded	USD 490	15/9/2023	59,535	(30,938)
(2,497)	コール	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 170	15/9/2023	90,711	(3,746)
(336)	コール	KLA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	179,404	(23,520)
(1,728)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	106,523	(18,144)
(729)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	8,751	(73,264)
(4,031)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 41	15/9/2023	122,021	(62,480)
(825)	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	85,652	(4,538)
(1,095)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	529,796	(6,023)
(669)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	15/9/2023	201,548	(21,074)
(671)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	193,281	(146,278)
(178)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	125,892	(45,390)
(178)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 560	15/9/2023	171,055	(30,616)
(418)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 600	15/9/2023	324,442	(16,511)
(658)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 540	15/9/2023	458,467	(250,040)
(845)	プット	NVIDIA	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	1,067,097	(23,660)
(412)	コール	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 260	15/9/2023	62,816	(22,866)
(412)	プット	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	173,914	(2,060)
(5,572)	プット	Pfizer	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	119,961	(108,654)
(350)	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 250	15/9/2023	149,621	(7,350)
(2,182)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	623,393	(27,275)
(264)	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 305	15/9/2023	133,222	(15,972)
(753)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	234,385	(50,075)
(830)	コール	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	29,026	(12,450)
(499)	プット	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 70	15/9/2023	56,771	(4,491)
(2,773)	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42.5	15/9/2023	297,460	(37,436)

契約数量	コール/ プット	銘柄	契約相手	行使価格	満期日	未実現利益/ (米ドル)	(損失)	時価 (米ドル)
(1,058)	プット	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	212,326		(22,670)
(637)	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	341,918		(172,627)
(729)	プット	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	64,232		(32,428)
(831)	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 95	15/9/2023	115,871		(4,571)
(412)	コール	Zscaler	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	57,378		(102,382)
(412)	プット	Zscaler	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	96,930		(60,770)
(565)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	9,475		(2,260)
(3,282)	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	(35,219)		(346,251)
(820)	プット	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 95	20/10/2023	147,540		(149,240)
(8,706)	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	415,880		(174,120)
(2,468)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(116,568)		(624,404)
(2,468)	プット	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	227,720		(87,614)
(1,969)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 155	20/10/2023	(24,082)		(169,334)
(1,974)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	258,981		(87,843)
(2,430)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	196,723		(184,680)
(1,641)	コール	Apple	Exchange Traded	USD 200	20/10/2023	(178,371)		(253,534)
(1,895)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	246,837		(82,432)
(829)	コール	Bunge	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	(83,948)		(145,075)
(2,468)	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	79,641		(75,274)
(2,468)	プット	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	282,015		(159,186)
(823)	コール	Fortinet	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	33,553		(28,805)
(823)	プット	Fortinet	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	27,792		(8,230)
(2,496)	コール	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	226,448		(33,696)
(1,664)	プット	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 38	20/10/2023	(35,328)		(178,048)
(2,007)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 40	20/10/2023	(5,799)		(103,360)
(2,823)	プット	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52.5	20/10/2023	193,101		(57,871)
(985)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 370	20/10/2023	21,935		(124,602)
(246)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	20/10/2023	49,266		(56,457)
(414)	コール	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 350	20/10/2023	22,917		(49,680)
(414)	プット	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 270	20/10/2023	56,851		(48,645)
(24,620)	コール	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 190	20/10/2023	(239,566)		(1,711,090)
(2,479)	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 57.5	20/10/2023	87,433		(40,904)
(2,479)	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 37.5	20/10/2023	55,206		(45,862)
(330)	コール	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 560	20/10/2023	128,293		(17,820)
(330)	プット	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 450	20/10/2023	(14,762)		(122,925)
(1,409)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	96,348		(210,645)
(106)	プット	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	125,380		(98,580)
(412)	コール	Humana	Exchange Traded	USD 560	17/11/2023	194,779		(51,500)
(412)	プット	Humana	Exchange Traded	USD 440	17/11/2023	(77,141)		(327,540)
(8,478)	プット	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	40,403		(148,365)
(545)	プット	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(97,597)		(242,525)
(931)	コール	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 82.5	17/11/2023	45,405		(9,310)
(931)	プット	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 65	17/11/2023	(23,955)		(137,322)
(1,345)	プット	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(40,964)		(175,522)
(416)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 530	15/12/2023	(884,933)		(1,649,440)
(416)	プット	NVIDIA	Exchange Traded	USD 310	15/12/2023	389,485		(71,344)
(461)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(793,364)		(1,914,533)
合計		(米ドル原資産エクスポージャー-366,058,609米ドル)				6,028,289		(17,327,764)

(9) 買建スワップション明細表
2023年8月31日現在

	額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現損失 (米ドル)	時価 (米ドル)
USD	405,809,161	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 8/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 8/9/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	(2,982,308)	635,136
USD	205,910,683	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.65% Fixed semi-annually from 14/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/9/2024	Citibank	12/9/2023	(1,347,871)	29,672
USD	61,700,555	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(473,316)	6,714
USD	13,320,000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40. V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(30,063)	22,484
USD	12,290,000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40. V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	BNP Paribas	20/9/2023	(38,492)	9,930
USD	13,305,000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40. V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(64,411)	8,102
USD	8,860,000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40. V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	(25,611)	10,095
USD	56,250,298	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2.81% Fixed semi-annually from 25/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 25/9/2024	Morgan Stanley	21/9/2023	(1,050,129)	65
USD	24,511,164	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2.8% Fixed semi-annually from 26/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/9/2024	Morgan Stanley	22/9/2023	(607,829)	36
USD	113,325,463	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2.75% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(476,659)	20,085
USD	41,424,423	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3.65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	223,130	768,474
USD	36,229,829	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 4.82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(530,144)	27,102
USD	36,229,829	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2.82% Fixed semi-annually from 9/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/11/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(396,697)	13,387
USD	28,169,866	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2.85% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	(1,112,399)	49,225
合計	(米ドル原資産エクスポージャー—343,272,013米ドル)				(8,912,799)	1,600,507

(10) 売建スワップション明細表
2023年8月31日現在

額面価額	銘柄	契約相手	満期日	未実現利益/(損失) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (205,910,683)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/9/2024; and pays 3.3% Fixed semi-annually from 14/3/2024	Citibank	12/9/2023	547,317	(406)
USD (61,700,555)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3.1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	117,217	(14)
USD (13,305,000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	7,523	(2,788)
USD (8,860,000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	2,444	(2,429)
USD (96,857,671)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.93% Fixed semi-annually from 4/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 4/10/2024	Goldman Sachs	2/10/2023	37,924	(669,137)
USD (135,424,226)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.5% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Goldman Sachs	13/10/2023	(2,564,638)	(3,966,279)
USD (302,911,482)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4.05% Fixed semi-annually from 18/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/10/2024	Goldman Sachs	16/10/2023	(2,983,327)	(3,839,052)
USD (272,119,467)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4.25% Fixed semi-annually from 19/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 19/10/2024	Citibank	17/10/2023	(1,677,173)	(2,534,349)
USD (56,662,731)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.3% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(94,925)	(295,133)
USD (113,325,463)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 23/10/2024; and pays 2.45% Fixed annually from 23/4/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	306,057	(5,588)
USD (209,364,224)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4.4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 31/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	401,050	(520,153)
USD (207,122,114)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	151,893	(262,351)
USD (41,424,423)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Goldman Sachs	1/11/2023	322,737	(228,208)
USD (112,679,426)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4.75% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	38,203	(345,693)
USD (281,698,657)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/11/2024; and pays 2.75% Fixed semi-annually from 16/5/2024	Citibank	14/11/2023	967,759	(16,212)
USD (49,188,000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 18/12/2024; and pays 2.4% Fixed semi-annually from 18/6/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	881,065	(14,156)
USD (49,188,000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.6% Fixed semi-annually from 18/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/12/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	(377,517)	(1,336,682)
USD (103,523,246)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4.5% Fixed semi-annually from 9/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/1/2025	Citibank	5/1/2024	231,417	(414,568)
USD (281,591,969)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3.79% Fixed semi-annually from 1/10/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/4/2025	JP Morgan	27/3/2024	(1,847,122)	(4,750,335)
合計 (米ドル原資産エクスポージャー—987,956,843米ドル)				(5,532,096)	(19,203,533)

(11) 差金決済取引明細表
2023年8月31日現在

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	オーストラリア		
(91,299)	Brambles	JP Morgan	(41,619)
(446,350)	Computershare	JP Morgan	(6,802)
(229,434)	Evolution Mining	JP Morgan	3,058
(30,204)	Fortescue Metals	JP Morgan	(187)
(46,896)	IDP Education	JP Morgan	(8,241)
(83,227)	IGO	JP Morgan	(24,478)
(136,330)	Lendlease	JP Morgan	48,230
(11,078)	Macquarie	JP Morgan	186
(57,949)	Mineral Resources	JP Morgan	(59,132)
(144,282)	Pilbara Minerals	JP Morgan	67,396
(91,341)	Santos	JP Morgan	17,424
(116,788)	Suncorp	JP Morgan	22,895
(14,684)	Woodside Energy	JP Morgan	17,985
			<u>36,715</u>
	ベルギー		
(4,320)	D' ieteren	Citibank	3,815
(7,004)	D' ieteren	JP Morgan	67,801
			<u>71,616</u>
	バミューダ		
(6,891)	Arch Capital	Citibank	(15,780)
			<u>(15,780)</u>
	ブラジル		
(298,858)	Alpargatas	JP Morgan	28,433
(89,414)	Banco BTG Pactual	JP Morgan	14,709
(365,537)	BRF	JP Morgan	53,352
(177,796)	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	Citibank	44,306
(7,288,912)	Hapvida Participacoes e Investimentos	JP Morgan	895,160
(281,069)	Localiza Rent a Car	JP Morgan	207,733
(49,517)	Suzano	Citibank	(10,852)
			<u>1,232,841</u>
	カナダ		
(17,699)	Brookfield Asset Management	Citibank	(35,900)
(20,141)	Cenovus Energy	JP Morgan	(7,834)
(25,893)	Great-West Lifeco	JP Morgan	32,350
(25,701)	Intact Financial	JP Morgan	115,450
(10,495)	Intact Financial	Citibank	(7,853)
(79,815)	Power of Canada	JP Morgan	51,852
(90,213)	Power of Canada	Citibank	(98,426)
(27,399)	Restaurant Brands International	Citibank	(25,370)
(19,471)	Restaurant Brands International	JP Morgan	77,634
			<u>101,903</u>
	ケイマン諸島		
(170,800)	Sands China	JP Morgan	60,681
			<u>60,681</u>

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
中国			
(2,100,000)	China Southern Airlines	JP Morgan	115,615
(407,279)	China Vanke	Citibank	3,613
(490,000)	Flat Glass	JP Morgan	134,070
(82,800)	Fuyao Glass Industry	JP Morgan	(5,103)
(6,000)	Fuyao Glass Industry	Citibank	220
(438,500)	Li Ning	JP Morgan	307,575
(100,000)	Li Ning	Citibank	3,044
(1,540,000)	PICC Property & Casualty	JP Morgan	(34,935)
(755,250)	Shandong Gold Mining	JP Morgan	(31,400)
(3,756,200)	Xiaomi	JP Morgan	(117,495)
(1,060,000)	Xiaomi	Citibank	(117,297)
(684,500)	XPeng	Citibank	(731,427)
(115,400)	XPeng	JP Morgan	(41,810)
(191,100)	Zhuzhou CRRC Times Electric	JP Morgan	27,597
(204,200)	Zhuzhou CRRC Times Electric	Citibank	(50,073)
(131,800)	ZTE	Citibank	2,963
			<u>(534,843)</u>
デンマーク			
(24,976)	Tryg	Citibank	(14,555)
			<u>(14,555)</u>
フィンランド			
(102,710)	Metso	JP Morgan	(60,675)
(75,467)	Metso	Citibank	(37,177)
(86,377)	Nordea Bank	Citibank	(12,919)
			<u>(110,771)</u>
フランス			
(23,709)	Pernod Ricard	JP Morgan	353,762
(19,305)	Sartorius Stedim Biotech	JP Morgan	5,069
			<u>358,831</u>
ドイツ			
(35,363)	Delivery Hero	JP Morgan	142,653
(79,270)	HelloFresh	JP Morgan	(374,352)
(15,143)	HelloFresh	Citibank	(48,581)
(9,161)	HOCHTIEF	JP Morgan	(89,008)
(2,436)	Sartorius	Citibank	(71,539)
(12,313)	Sartorius	JP Morgan	(356,904)
(15,632)	Talanx	JP Morgan	(79,587)
(220,684)	Vonovia	Citibank	(588,567)
			<u>(1,465,885)</u>
香港			
(469,500)	China Overseas Land & Investment	Citibank	(66,168)
(1,513,000)	Sino Biopharmaceutical	JP Morgan	26,001
			<u>(40,167)</u>
アイルランド			
(19,125)	James Hardie Industries	JP Morgan	8,783
			<u>8,783</u>

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	イタリア		
(111,338)	Nexi	Citibank	(24,087)
(1,618,527)	Telecom Italia	JP Morgan	(52,900)
(11,238,558)	Telecom Italia	Citibank	(128,059)
			<u>(205,046)</u>
	日本		
(3,100)	Advantest	Citibank	22,069
(25,200)	Advantest	JP Morgan	788
(372,400)	ENEOS	Citibank	(60,750)
(24,300)	Fujitsu General	JP Morgan	35,373
(17,200)	Hitachi	Citibank	(38,351)
(8,900)	Lasertec	Citibank	(40,501)
(71,500)	MatsukiyoCocokara	Citibank	120,796
(131,900)	Mercari	JP Morgan	143,312
(24,200)	Mercari	Citibank	(35,669)
(37,100)	Mitsubishi Estate	Citibank	(27,164)
(32,100)	Mitsui Fudosan	JP Morgan	(23,576)
(12,500)	NEC	Citibank	(18,579)
(174,400)	Olympus	JP Morgan	470,248
(71,700)	Olympus	Citibank	(82,948)
(5,900)	Open House	Citibank	(7,095)
(43,500)	Park24	JP Morgan	3,390
(1,390,200)	Rakuten	JP Morgan	40,923
(87,800)	Recruit	Citibank	(207,227)
(10,900)	RENOVA	Citibank	(1,696)
(69,000)	RENOVA	JP Morgan	35,240
(62,100)	SBI	JP Morgan	37,825
(14,400)	Socionext	JP Morgan	(100,875)
(22,500)	SoftBank	JP Morgan	66,971
(17,200)	SoftBank	Citibank	14,314
(10,600)	Sony	Citibank	(4,970)
(42,400)	Square Enix	JP Morgan	48,311
(171,300)	SUMCO	Citibank	9,039
(51,700)	SUMCO	JP Morgan	23,339
(21,300)	Sumitomo	JP Morgan	4,231
(11,100)	TDK	Citibank	(21,317)
			<u>405,451</u>
	ルクセンブルク		
(207,764)	InPost	JP Morgan	(75,859)
(27,818)	Reinet Investments	JP Morgan	25,833
			<u>(50,026)</u>
	マレーシア		
(478,405)	Lynas Rare Earths	JP Morgan	(51,685)
			<u>(51,685)</u>
	メキシコ		
(5,809,371)	America Movil	Citibank	(118,662)
			<u>(118,662)</u>

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	オランダ		
(15,470)	Heineken	Citibank	(15,377)
(34,447)	Koninklijke Philips	JP Morgan	(79,071)
(126,191)	Koninklijke Philips	Citibank	(28,369)
			<u>(122,817)</u>
	ノルウェー		
(3,245)	Aker	Citibank	(940)
(74,445)	Aker BP	Citibank	(17,317)
(13,485)	Nordic Semiconductor	JP Morgan	19,281
(32,981)	Nordic Semiconductor	Citibank	3,044
(26,598)	Salmar	Citibank	(112,252)
			<u>(108,184)</u>
	ポーランド		
(24,945)	Bank Polska Kasa Opieki	JP Morgan	34,386
(39,578)	KGHM Polska Miedz	Citibank	(44,200)
(203)	LPP	Citibank	(58,361)
(45,166)	ORLEN	JP Morgan	80,474
			<u>12,299</u>
	シンガポール		
(112,145)	Sea	JP Morgan	1,622,294
			<u>1,622,294</u>
	南アフリカ		
(45,055)	Sasol	JP Morgan	2,026
			<u>2,026</u>
	韓国		
(67,436)	Kakao	Citibank	2,506
(26,096)	Kakao	JP Morgan	76,966
(1,101)	LG Chem	Citibank	(13,244)
(7,016)	LG Electronics	JP Morgan	22,782
(17,159)	Lotte Energy Materials	JP Morgan	31,091
(757)	LS	JP Morgan	(161)
(3,407)	POSCO	JP Morgan	(34,783)
(15,943)	POSCO Future M	JP Morgan	(12,096)
(7,268)	SK	JP Morgan	46,228
(8,668)	SK Innovation	JP Morgan	82,179
(499)	SK Innovation	JP Morgan	(2,011)
			<u>199,457</u>
	スウェーデン		
(51,148)	Electrolux	Citibank	20,991
(46,105)	EQT	Citibank	14,270
(30,449)	Essity	Citibank	(18,851)
(328,437)	Fastighets Balder	Citibank	(153,142)
(30,436)	Sagax	Citibank	(35,726)
(66,844)	Securitas	JP Morgan	(791)
			<u>(173,249)</u>

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	スイス		
(37,620)	Bachem	JP Morgan	145,497
(3,759)	Cie Financiere Richemont	JP Morgan	24,885
(207,377)	SIG	Citibank	(371,694)
(9,925)	Straumann	Citibank	(16,103)
(7,583)	Tecan	JP Morgan	(142,558)
(142,889)	UBS	JP Morgan	(695,591)
			<u>(1,055,564)</u>
	台湾		
(72,000)	Powerchip Semiconductor Manufacturing	JP Morgan	1,612
			<u>1,612</u>
	英国		
(596,643)	Centrica	JP Morgan	(88,591)
(360,658)	Ocado	JP Morgan	(26,593)
(157,501)	Rentokil Initial	Citibank	(45,611)
			<u>(160,795)</u>
	米国		
(11,026)	Aflac	Citibank	(20,839)
(20,669)	Air Transport Services	JP Morgan	21,082
(3,951)	Airbnb	JP Morgan	31,687
(1,114)	Align Technology	JP Morgan	(17,378)
(1,950)	Arista Networks	Citibank	(20,642)
(4,392)	Avery Dennison	JP Morgan	(28,601)
46,887	Banc of California	JP Morgan	35,301
(28,094)	Bank of America	JP Morgan	65,880
(21,750)	Bank of Hawaii	JP Morgan	33,930
(22,352)	BankUnited	JP Morgan	81,808
(16,262)	Banner	JP Morgan	65,698
(41,626)	Blackstone	Citibank	(311,427)
(9,276)	Block	JP Morgan	29,773
(104,819)	Boston Properties	JP Morgan	85,190
(3,983)	Brandywine Realty Trust	JP Morgan	(518)
(20,935)	Broadridge Financial Solutions	JP Morgan	(202,416)
(5,516)	Broadridge Financial Solutions	Citibank	(53,505)
(4,507)	Capital One Financial	JP Morgan	51,019
(27,820)	Celanese	Citibank	(235,620)
(6,579)	Celanese	JP Morgan	(9,327)
(28,326)	Charles River Laboratories International	JP Morgan	(121,634)
(5,975)	Charles River Laboratories International	Citibank	(59,631)
(31,216)	Charles Schwab	JP Morgan	181,365
(15,208)	Church & Dwight	Citibank	(52,163)
(27,516)	Church & Dwight	JP Morgan	(17,610)
(152,616)	Cloudflare	JP Morgan	158,721
(32,774)	Community Bank System	JP Morgan	215,653
(84,268)	Constellation Energy	Citibank	64,284
(5,482)	CoStar	JP Morgan	(1,590)

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	米国 (続き)		
(9,685)	Crown Castle	JP Morgan	3,297
(4,652)	Darden Restaurants	JP Morgan	35,960
(5,261)	Discover Financial Services	Citibank	(8,944)
(15,159)	DXC Technology	JP Morgan	(1,946)
(2,671)	Enphase Energy	JP Morgan	15,170
(6,621)	EPAM Systems	JP Morgan	(94,873)
(7,805)	Equifax	Citibank	(130,344)
(5,802)	Equifax	JP Morgan	(54,771)
(28,956)	FB Financial	JP Morgan	110,033
(8,893)	Fiserv	JP Morgan	22,686
(3,627)	Ford Motor	Citibank	(1,016)
(24,993)	Frontier Communications Parent	JP Morgan	55,235
(83,006)	Gen Digital	Citibank	(8,076)
(3,638)	Generac	JP Morgan	(31,746)
(26,350)	Glacier Bancorp	JP Morgan	86,428
(34,972)	Hasbro	Citibank	(116,312)
(154,632)	Huntington Bancshares	JP Morgan	139,169
(25,762)	Illumina	Citibank	(124,189)
(22,013)	Independent Bank	JP Morgan	38,633
(11,275)	International Business Machines	JP Morgan	(24,520)
(13,086)	Iron Mountain	Citibank	(52,606)
(31,736)	Iron Mountain	JP Morgan	(88,543)
(31,343)	J M Smucker	JP Morgan	95,596
(26,885)	Kimco Realty	Citibank	(10,754)
(26,840)	KKR	JP Morgan	(33,803)
(44,269)	KKR	Citibank	(136,229)
(40,494)	Lamb Weston	Citibank	(73,777)
(15,078)	Lamb Weston	JP Morgan	35,132
(1,132)	Martin Marietta Materials	JP Morgan	12,860
57	MercadoLibre	Citibank	6,228
(57)	MercadoLibre	JP Morgan	(1,347)
(10,325)	Mosaic	Citibank	(2,403)
(223,272)	Newell Brands	Citibank	(68,098)
(53,280)	Newell Brands	JP Morgan	7,726
(12,799)	Occidental Petroleum	Citibank	2,816
(27,909)	OceanFirst Financial	JP Morgan	35,724
(136)	Old Dominion Freight Line	Citibank	(2,877)
(3,475)	Old Dominion Freight Line	JP Morgan	(59,266)
(6,022)	ON Semiconductor	JP Morgan	7,461
(19,157)	Oracle	Citibank	(83,525)
(7,621)	Oracle	JP Morgan	(41,484)
(41,404)	Pacific Premier Bancorp	JP Morgan	116,345
(71,376)	PacWest Bancorp	JP Morgan	(46,644)
(434,028)	Palantir Technologies	JP Morgan	865,886
(406,018)	Paramount Global	Citibank	(266,526)

数量	銘柄	契約相手	未実現利益／(損失) (米ドル)
	米国 (続き)		
(7,637)	PayPal	JP Morgan	(13,478)
(4,146)	Pool	JP Morgan	29,214
(12,334)	Prosperity Bancshares	JP Morgan	49,089
(6,465)	QUALCOMM	JP Morgan	22,687
(18,519)	Quanta Services	Citibank	(95,743)
(6,277)	Ralph Lauren	JP Morgan	89,755
(7,514)	Raymond James Financial	Citibank	(18,484)
(24,045)	Raymond James Financial	JP Morgan	82,234
(11,636)	Realty Income	JP Morgan	3,057
(22,872)	Republic Services	Citibank	14,638
(3,168)	Republic Services	JP Morgan	4,784
(28,174)	Revvity	JP Morgan	32,930
(5,684)	Revvity	Citibank	(30,921)
(15,130)	Sabre	JP Morgan	4,085
(45,598)	Simmons First National	JP Morgan	74,781
(6,483)	Simon Property	JP Morgan	36,436
(32,332)	Snowflake	JP Morgan	(33,302)
(210,835)	Southwest Airlines	Citibank	(19,258)
(20,076)	STERIS	JP Morgan	(134,500)
(62,931)	Take-Two Interactive Software	Citibank	(126,794)
(11,174)	Targa Resources	JP Morgan	(37,768)
(6,916)	Teledyne Technologies	Citibank	(99,106)
(53,288)	Truist Financial	JP Morgan	98,316
(15,292)	Tyson Foods	JP Morgan	19,934
(180,045)	Valley National Bancorp	JP Morgan	150,214
(29,031)	Washington Federal	JP Morgan	90,286
(30,509)	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	61,323
(14,689)	Xerox	JP Morgan	(4,847)
(10,031)	Zions Bancorp	JP Morgan	28,789
			374,607
合計 (米ドル原資産エクスポージャー—414,987,986米ドル)			261,087

(12) SPAC PIPE コミットメント取引契約明細表
2023年8月31日現在

数量	銘柄	コミットメント額 (米ドル)	未実現利益／(損失) (米ドル)
	米国		
5,447,000	FLYR	5,447,000	—
合計		5,447,000	—

国内マネー・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2024年1月15日）

（計算期間 2023年1月17日～2024年1月15日）

国内マネー・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	主として本邦通貨建ての短期公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行います。
主要投資対象	本邦通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

■最近3期の運用実績

決算期	基準 価額	期騰落		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
		騰	落			
14期(2022年1月17日)	円 10,091	% △0.0		% 11.7	% -	百万円 385
15期(2023年1月16日)	10,083	△0.1		64.6	-	387
16期(2024年1月15日)	10,076	△0.1		61.4	-	602

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

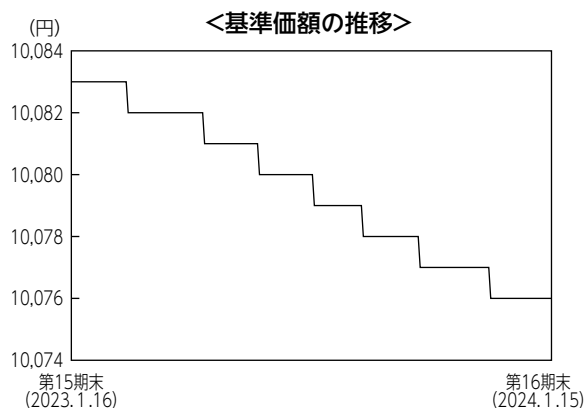
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 1 月16日	円 10,083	% -	% -	64.6	64.6
1 月 末	10,083	0.0	-	64.6	64.6
2 月 末	10,082	△0.0	-	64.6	64.6
3 月 末	10,082	△0.0	-	64.6	64.6
4 月 末	10,081	△0.0	-	64.6	64.6
5 月 末	10,081	△0.0	-	64.6	64.6
6 月 末	10,080	△0.0	-	60.6	60.6
7 月 末	10,079	△0.0	-	60.6	60.6
8 月 末	10,078	△0.0	-	61.4	61.4
9 月 末	10,078	△0.0	-	61.4	61.4
10 月 末	10,077	△0.1	-	61.4	61.4
11 月 末	10,076	△0.1	-	61.4	61.4
12 月 末	10,076	△0.1	-	61.4	61.4
(期 末) 2024年 1 月15日	10,076	△0.1	-	61.4	61.4

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年1月17日から2024年1月15日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は1万口あたり10,076円となり、前期末の同10,083円から0.07%下落しました。

基準価額の主な変動要因

基準価額の変動要因として、保有債券からの利息収入などのプラス要因はありましたが、マイナス金利による影響が大きく、前期末比で基準価額は下落しました。

投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

今後の運用方針

日銀は2023年12月の金融政策決定会合で、マイナス金利政策を含む金融緩和政策を維持しました。日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成への確信は持てないとしており、引き続き緩和的な金融政策を維持するものと見られます。そのため、今後も安定的な運用を目指し、公社債などへの投資につとめます。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2023年1月17日から2024年1月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	内 国債証券	370,365	(250,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年1月17日から2024年1月15日まで)

期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期 末		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 370	百万円 50	% 13.5	百万円 -	百万円 -	% -

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■ 組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	当 期				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	370,000	370,161	61.4	-	-	-	61.4
合 計	370,000	370,161	61.4	-	-	-	61.4

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘 柄	当 期			期 末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円		
(国債証券)					
435回 利付国庫債券(2年)	0.0050	50,000	50,015	2024/04/01	
436回 利付国庫債券(2年)	0.0050	60,000	60,027	2024/05/01	
437回 利付国庫債券(2年)	0.0050	60,000	60,035	2024/06/01	
438回 利付国庫債券(2年)	0.0050	80,000	80,036	2024/07/01	
441回 利付国庫債券(2年)	0.0050	60,000	60,015	2024/10/01	
442回 利付国庫債券(2年)	0.0050	60,000	60,030	2024/11/01	
合 計	-	370,000	370,161	-	-

■投資信託財産の構成

2024年1月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 370,161	% 61.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	232,311	38.6
投 資 信 託 財 産 総 額	602,473	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	602,473,325円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	232,308,544
国 債 証 券(評価額)	370,161,584
未 収 利 息	2,664
前 払 費 用	533
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	602,473,325
元 本	597,957,003
次 期 繰 越 損 益 金	4,516,322
(D) 受 益 権 総 口 数	597,957,003口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,076円

(注1) 期首元本額 384,050,119円
追加設定元本額 222,222,223円
一部解約元本額 8,315,339円

(注2) 期末における元本の内訳

世界高配当株セレクト (目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジなしコース	272,756,011円
世界高配当株セレクト (目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジありコース	21,814,391円
グローバル・アロケーション・オープン Aコース (年1回決算・為替ヘッジなし)	39,526,080円
グローバル・アロケーション・オープン Bコース (年4回決算・為替ヘッジなし)	188,580,850円
グローバル・アロケーション・オープン Cコース (年1回決算・限定為替ヘッジ)	5,939,129円
グローバル・アロケーション・オープン Dコース (年4回決算・限定為替ヘッジ)	4,945,108円
豪州インフラ関連好配当資産ファンド (毎月決算型)	44,446,526円
豪州インフラ関連好配当資産ファンド (年2回決算型)	19,753,462円
豪州インフラ関連好配当資産ファンド為替ヘッジあり (毎月決算型)	97,723円
豪州インフラ関連好配当資産ファンド為替ヘッジあり (年2回決算型)	97,723円
期末元本合計	597,957,003円

■損益の状況

当期 自2023年1月17日 至2024年1月15日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	△49,753円
受 取 利 息	15,881
支 払 利 息	△65,634
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△341,902
売 買 損	△341,902
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△391,655
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	3,195,890
(E) 解 約 差 損 益 金	△65,690
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,777,777
(G) 合 計(C+D+E+F)	4,516,322
次 期 繰 越 損 益 金(G)	4,516,322

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。