野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）

運用報告書(全体版)

第８期（決算日2024年12月６日）

作成対象期間（2023年12月７日～2024年12月６日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2017年８月25日以降、無期限とします。	
運用方針	円建ての外国投資信託であるPIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。	
主な投資対象	野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）受益証券および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）	PIMCO バミューダ・インカム・ファンド（M）受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を実質的な主要投資対象とします。
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	株式への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目２番１号

●サポートダイヤル
0120-753104 〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時
●ホームページ
https://www.nomura-am.co.jp/

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	円	%	%	%	%	百万円
４期(2020年12月７日)	10,704	10	4.4	0.0	－	98.8	238,909
５期(2021年12月６日)	10,882	10	1.8	0.0	－	96.9	311,864
６期(2022年12月６日)	9,808	0	△9.9	0.0	－	99.0	295,396
７期(2023年12月６日)	9,808	0	0.0	0.0	－	98.9	270,956
８期(2024年12月６日)	10,058	0	2.5	0.0	－	98.9	238,743

＊基準価額の騰落率は分配金込み。
＊当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
＊当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

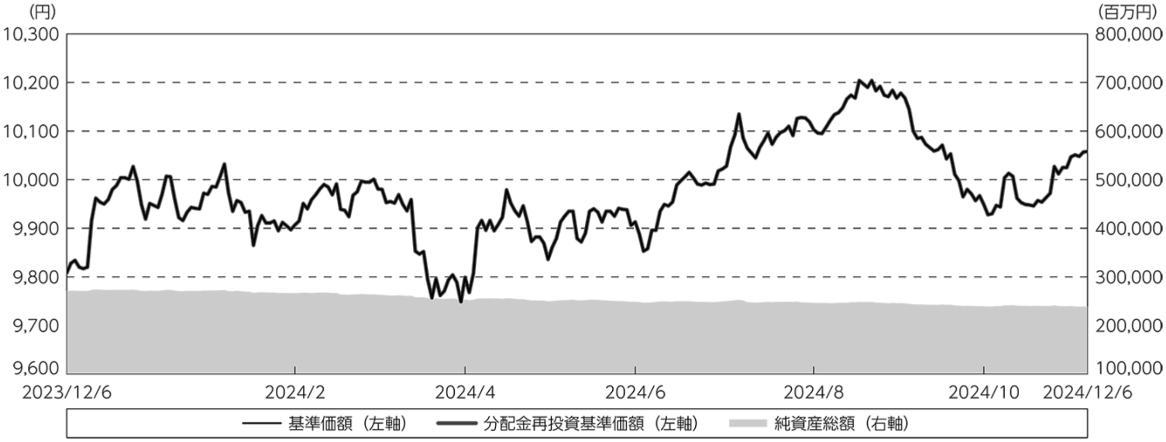
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
（期首）	円	%	%	%	%
2023年12月６日	9,808	－	0.0	－	98.9
12月末	9,997	1.9	0.0	－	99.2
2024年１月末	9,985	1.8	0.0	－	99.1
２月末	9,907	1.0	0.0	－	99.4
３月末	9,981	1.8	0.0	－	99.3
４月末	9,799	△0.1	0.0	－	99.2
５月末	9,861	0.5	0.0	－	99.5
６月末	9,913	1.1	0.0	－	99.5
７月末	10,028	2.2	0.0	－	99.4
８月末	10,103	3.0	0.0	－	99.6
９月末	10,184	3.8	0.0	－	99.4
10月末	9,949	1.4	0.0	－	99.0
11月末	10,025	2.2	0.0	－	99.1
（期末） 2024年12月６日	10,058	2.5	0.0	－	98.9

＊騰落率は期首比です。
＊当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期　首： 9,808円
期　末：10,058円（既払分配金（税込み）：0円）
騰落率：　　2.5%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2023年12月６日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
（注）上記騰落率は、小数点以下第２位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

　実質的に投資している債券等および派生商品等からのインカムゲイン（利息収入）
　実質的に投資している債券等および派生商品等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
　為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

○投資環境

　米国10年国債利回りは、2023年12月に、FOMC（米連邦公開市場委員会）後に公表された2024年末の政策金利見通しの中央値が前回から引き下げられたことを受け、FRB（米連邦準備制度理事会）が2024年に複数回の利下げを行なう可能性を反映するかたちで利回りは低下（価格は上昇）しました。2024年１月から４月にかけては、１月の米雇用統計において市場予想を上回る雇用者数や賃金の伸びが示されたことや、１月の米CPI（消費者物価指数）上昇率が市場予想を上回ったことなどを受け、FRBによる利下げ観測が後退する中で、利回りは上昇（価格は下落）しました。５月から６月にかけては、４月・５月の米CPIや米小売売上高の伸びが市場予想を下回り、FRBによる利下げ期待が高まったことなどを背景に利回りは低下基調で推移しました。８月も、７月の米雇用統計において、非農業部門の雇用者数が市場予想を下回ったことで労働市場の軟化と景気の減速が意識され、FRBによる利下げ幅が想定よりも拡大するとの見方が強まったことなどから利回りは低下しました。10月は、９月の米雇用統計で非農業部門の雇用者数が市場予想を大幅に上回ったことなどを背景に、利回りは上昇基調で推移しましたが、11月以降は米大統領選で勝利したトランプ氏が中期的な財政赤字の縮小を訴えるベッセント氏を新政権の財務長官に指名し、米国の債務膨張への過度な懸念が後退したこと等を受けて、利回りは低下基調で推移しました。当作成期間では利回りは小幅に上昇となりました。

　新興国債券は、2023年12月に、FOMCにおける最新の経済見通しで2024年に複数回の利下げが示唆されたことなどから米金利が急低下したこと、良好な市場心理などを背景にスプレッド（利回り格差）が縮小したことなどから上昇しました。2024年に入っても、１月から９月にかけては、リスク資産が堅調に推移したことなどを背景に概ね上昇基調で推移しました。10月は、９月の米雇用統計において雇用者数の伸びが市場予想を大きく上回り、労働市場の底堅さが意識され米金利が上昇したことなどを背景に下落しました。11月以降は、米大統領選で勝利したトランプ次期米大統領が新政権の財務長官を指名し、市場に配慮した政策運営が進められるとの期待から米金利が低下したことなどを背景に上昇基調で推移し、当作成期間では上昇となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド　Aコース（野村SMA・EW向け）]

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

[PIMCOバミューダ・インカム・ファンドAークラスN（JPY）]

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

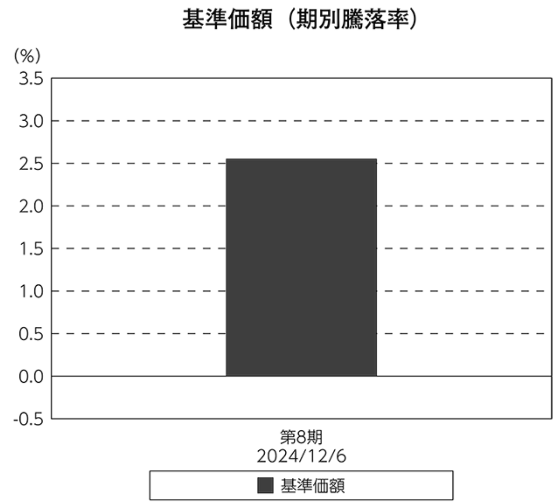
［野村マネーポートフォリオ　マザーファンド］

残存１年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、決定しました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項目	第８期 2023年12月７日～ 2024年12月６日
当期分配金	－
(対基準価額比率)	－%
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	3,711

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド　Aコース（野村SMA・EW向け）]

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

[PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）]

世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等を主要投資対象とし、インカムゲインの最大化と長期的な値上がり益の獲得を図ることを目的としたポートフォリオを維持して運用を行ないます。また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、組入資産について、原則として米ドルを売り、円を買う為替取引を行ないます。

国ごとの経済状況およびそれに伴う金融政策の方向性の相違を投資テーマと捉え、次のような戦略を実行しています。

金利戦略については、保有するリスク性資産の価格変動の影響を和らげる適切な金利リスク量を見極め、市場環境に応じて機動的に調整しています。米国における大統領選挙と次期政権にかかる報道などを背景とした米国金利の変化に合わせて金利リスクの調整を行ないました。その他の地域では、インフレの落ち着き等を背景に、今後の積極的な利下げを予想している英国の金利リスクを買い持ちとする一方、追加利上げ等が見込まれる日本の金利リスクは売り持ちとしています。

セクター戦略については、リスクオフ時に底堅い値動きが期待され、かつ魅力的な利回りを提供する米政府系住宅ローン担保証券を引き続き選好しています。一方、金利リスクの調整等を目的とした債券の売り建てにより、米政府関連債は組み入れ比率がマイナスとなっています。ハイイールド社債やバンクローンについては組み入れを抑制しつつも厳選した銘柄に投資しています。住宅価格の上昇の恩恵を受け、今後も安定的な元利払いが期待される米国非政府系住宅ローン担保証券への投資を継続しています。新興国については、バリュエーション（投資価値評価）を見極めつつメキシコやブラジル、南アフリカ等への分散投資を継続しています。

[野村マネーポートフォリオ マザーファンド]
　残存１年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図ります。

　今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

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

○１万口当たりの費用明細

（2023年12月７日～2024年12月６日）

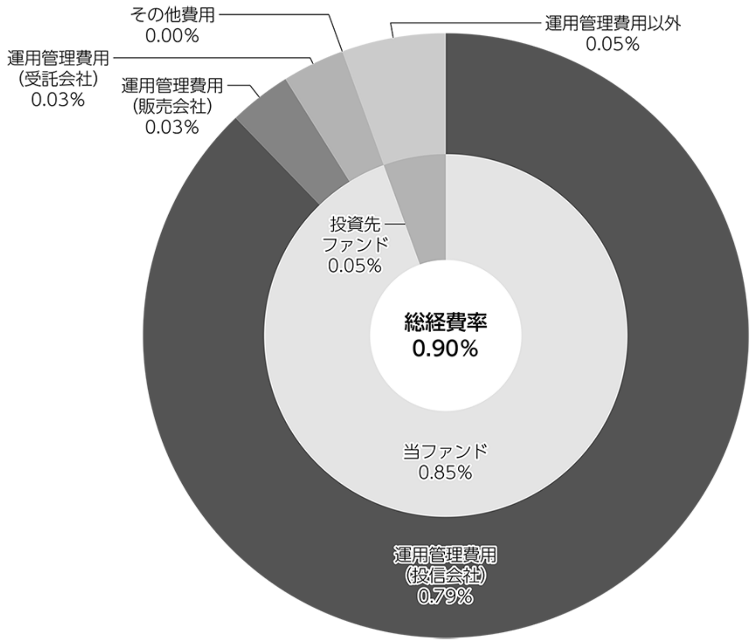
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	86	0.858	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(79)	(0.792)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（販売会社）	(3)	(0.033)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（受託会社）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) その他費用	0	0.002	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	86	0.860	
期中の平均基準価額は、9,977円です。			

＊期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
＊各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
＊その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
＊各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
＊各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

◯総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.90％です。



（単位：％）

総経費率（①＋②＋③）	0.90
①当ファンドの費用の比率	0.85
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	0.05

（注）当ファンドの費用は１万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注）当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
（注）投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。
（注）各比率は、年率換算した値です。
（注）投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（マザーファンドを除く。）です。
（注）当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
（注）当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。
（注）当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
（注）投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。
（注）投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。
（注）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

（2023年12月７日～2024年12月６日）

投資信託証券

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国内	PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）	2,994,122	21,049,790	7,860,222	55,210,471

＊金額は受け渡し代金。
＊金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2023年12月７日～2024年12月６日）

利害関係人との取引状況

＜野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド　Aコース（野村SMA・EW向け）＞
該当事項はございません。

＜野村マネーポートフォリオ マザーファンド＞

区分	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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	41	17	41.5	－	－	－

平均保有割合　0.0％

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

（2024年12月６日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首（前期末）	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	口	口	千円	%
PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA－クラスN（JPY）	38,421,621	33,555,521	236,130,201	98.9
合計	38,421,621	33,555,521	236,130,201	98.9

＊比率は、純資産総額に対する評価額の比率。
＊評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘　　　　　　柄	期首(前期末)	当　　期　　末	
	口　　数	口　　数	評　価　額
	千口	千口	千円
野村マネーポートフォリオ マザーファンド	9	9	9

＊口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2024年12月６日現在）

項　　　　　　目	当　　期　　末	
	評　　価　　額	比　　　　率
	千円	%
投資信託受益証券	236,130,201	98.1
野村マネーポートフォリオ マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	4,569,621	1.9
投資信託財産総額	240,699,831	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2024年12月６日現在）

項　　目	当期末
	円
(A) 資産	240,699,831,197
コール・ローン等	4,265,756,450
投資信託受益証券(評価額)	236,130,201,277
野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額)	9,980
未収入金	303,835,588
未収利息	27,902
(B) 負債	1,956,422,608
未払金	16,269,544
未払解約金	881,777,835
未払信託報酬	1,055,668,448
その他未払費用	2,706,781
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	238,743,408,589
元本	237,356,518,488
次期繰越損益金	1,386,890,101
(D) 受益権総口数	237,356,518,488口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,058円

（注）期首元本額は276,268,759,383円、期中追加設定元本額は36,265,532,003円、期中一部解約元本額は75,177,772,898円、１口当たり純資産額は1.0058円です。

（注）投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,269,694,218円。

○損益の状況 （2023年12月７日～2024年12月６日）

項　　目	当　期
	円
(A) 配当等収益	5,787,069,343
受取配当金	5,783,764,539
受取利息	3,395,026
支払利息	△ 90,222
(B) 有価証券売買損益	1,785,353,656
売買益	2,356,880,601
売買損	△ 571,526,945
(C) 信託報酬等	△ 2,195,539,714
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	5,376,883,285
(E) 前期繰越損益金	△ 8,800,358,256
(F) 追加信託差損益金	4,810,365,072
(配当等相当額)	(52,297,141,742)
(売買損益相当額)	(△47,486,776,670)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	1,386,890,101
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	1,386,890,101
追加信託差損益金	4,810,365,072
(配当等相当額)	(52,297,141,742)
(売買損益相当額)	(△47,486,776,670)
分配準備積立金	35,790,861,560
繰越損益金	△39,214,336,531

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

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

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

（注）分配金の計算過程（2023年12月７日～2024年12月６日）は以下の通りです。

項　　目	当　期 2023年12月７日～ 2024年12月６日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,109,237,921円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	52,297,141,742円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	31,681,623,639円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	88,088,003,302円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	3,711円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	0円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「http://www.nomura-am.co.jp/」から「https://www.nomura-am.co.jp/」に変更する所要の約款変更を行ないました。　＜変更適用日：2024年７月４日＞

2024年11月５日より、ファンドの設定解約の申込締切時間を以下の記載のとおり変更いたしました。

原則、午後３時30分までに、販売会社が受付けた分を当日のお申込み分とします。
（販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。）

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

2023年10月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	英領バミューダ諸島籍円建て外国投資信託
運用方針	PIMCO バミューダ・インカム・ファンド（M）受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等に実質的に投資を行ない、インカムゲインの最大化と長期的な値上がり益の獲得を目指します。
投資対象	世界各国（新興国を含みます。）の債券等（国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券、ハイ・イールド債券、企業向け貸付債権（バンクローン）等）および派生商品等
管理会社 投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受託会社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ（バミューダ）リミテッド
管理事務代行会社 保管受託銀行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名義書換事務受託会社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン（ルクセンブルグ）エス・シー・エー

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

PIMCOバミューダ・インカム・ファンドA

運用計算書
2023年10月31日に終了した期間

（金額単位：千米ドル）

収益：		
受取利息（外国税額控除後）	$	23,195
受取配当（外国税額控除後）		0
雑収入		0
収益合計		23,195
費用：		
投資顧問報酬 －W（USD）		142
運用報酬 －M（JPY 投資顧問）		777
運用報酬 －M（USD 投資顧問）		276
運用報酬 －P（JPY）		204
運用報酬 －R（USD）		122
運用報酬 －S（USD）		82(1)
運用報酬 －T（JPY）		4,430
運用報酬 －U2（JPY）		273
運用報酬 －X（JPY）		28
管理報酬 －R（USD）		37
管理報酬 －S（USD）		25(1)
管理報酬 －W（USD）		44
分配支払手数料 －M（JPY 投資顧問）		674
分配支払手数料 －M（USD 投資顧問）		239
分配支払手数料 －P（JPY）		204
代理店報酬 －M（JPY 投資顧問）		52
代理店報酬 －M（USD 投資顧問）		18
支払利息		2,673
費用合計		10,300
純投資損益		12,895
当期実現損益：		
投資有価証券（外国税額控除後）＊		(128)
関連投資		231,638
上場金融デリバティブ商品		0
店頭金融デリバティブ商品		(570,750)
外貨通貨		3,475
当期実現損益		(335,765)
当期未実現評価損益：		
投資有価証券		21
関連投資		299,928
上場金融デリバティブ商品		0
店頭金融デリバティブ商品		73,407
外貨建資産および負債		74
当期未実現評価損益		373,430
当期損益		37,665
運用の結果による純資産の増減額	$	50,560
＊外国税	$	0

※金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

(1) 2022年12月21日（設定日）から2023年10月31日までの期間

（単位：千　1口単位を除く）

期末純資産総額		
N（JPY）	$	3,915,624
N（USD）		2,557,554
期末現在発行済受益証券数		
N（JPY）		87,363
N（USD）		42,125
期末1口当たり純資産価格		
N（JPY）	$	44.82
N（USD）		60.71

※PIMCO バミューダ・インカム・ファンド（M）の期末純資産額は10,269,127千米ドル。

組入資産の明細

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

		額面金額（単位：千）		2023年10月31日 評価額（単位：千）
投資有価証券 3.4%				
短期金融商品 3.4%				
定期預金 0.0%				
Bank of Nova Scotia				
4.830% due 11/01/2023	$	27	$	27
Brown Brothers Harriman & Co.				
4.830% due 11/01/2023		2		2
Citibank N.A.				
4.830% due 11/01/2023		113		113
DBS Bank Ltd.				
4.830% due 11/01/2023		97		97
JPMorgan Chase Bank N.A.				
4.830% due 11/01/2023		206		206
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
(0.370%) due 11/01/2023	¥	2		0
4.830% due 11/01/2023	$	11		11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
(0.370%) due 11/01/2023	¥	9		0
4.830% due 11/01/2023	$	262		262
				718
米財務省証券 3.4%				
5.334% due 11/14/2023 (a)		14,000		13,973
5.355% due 11/21/2023 (a)		21,261		21,199
5.365% due 12/12/2023 (a)		13,000		12,922
5.372% due 01/18/2024 (b)		7,800		7,710
5.374% due 12/07/2023 (a)		5,600		5,570
5.377% due 12/14/2023 (b)		26,200		26,035
5.385% due 01/25/2024 (a)		22,700		22,416
5.396% due 11/24/2023 (a)		9,200		9,169
5.405% due 01/04/2024 (a)		20,600		20,406
5.405% due 01/11/2024 (b)		154,700		153,085
5.414% due 01/23/2024 (a)		18,000		17,780
5.414% due 01/16/2024 (a)		10,700		10,580
5.431% due 01/30/2024 (a)		10,300		10,163
5.441% due 02/06/2024 (a)		17,300		17,052
				348,060
短期金融商品合計				**348,778**
（取得原価 $348,759）				
投資有価証券合計				**348,778**
（取得原価 $348,759）				

	口数 (単位:千)	評価額 (単位:千)
関連投資 97.8%		
その他の投資会社 97.8%		
PIMCO バミューダ・インカム・ファンド(M) **(取得原価 $10,020,480)**	693,561	10,181,475
関連投資合計 **(取得原価 $10,020,480)**		**10,181,475**
投資合計 101.2% **(取得原価 $10,369,239)**		$ **10,530,253**
金融デリバティブ商品 (1.2%) **(取得原価またはプレミアム $0)**		**(123,895)**
その他の資産および負債 (0.0%)		**(667)**
純資産 100.0%		$ **10,405,691**

投資有価証券明細表に対する注記(金額単位:千米ドル)

(a) クーポンは最終利回りである。
(b) クーポンは加重平均最終利回りである。

◎店頭金融デリバティブ商品

2023年10月31日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産		未実現評価損益 負債	
BPS	11/2023	JPY	1,610,831	$	10,811	$	175	$	0
BPS	11/2023	$	1,754	JPY	262,091		0		(23)
BPS	11/2023		2,751		409,559		0		(44)
BPS	11/2023		2,470		367,656		0		(40)
JPM	11/2023	JPY	300,970	$	2,012		25		0
JPM	11/2023	$	778	JPY	116,391		0		(10)
JPM	11/2023		45		6,799		0		(1)
MYI	11/2023	JPY	141,586	$	935		0		0
MYI	11/2023	$	2,979	JPY	450,909		0		0
MYI	11/2023		125		18,978		0		0
						$	200	$	(118)

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

						未実現評価損益	
取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		資産	負債
AZD	11/2023	$	51,176	JPY	7,606,046	$ 0	$ (953)
BOA	11/2023	JPY	1,030,945	$	6,875	68	0
BOA	11/2023	$	1,911	JPY	283,637	0	(38)
BPS	11/2023	JPY	1,144,916	$	7,683	123	0
BPS	11/2023		3,767,140		25,167	292	0
BPS	11/2023	$	7,597	JPY	1,144,916	0	(37)
CBK	11/2023	JPY	112,987,492	$	751,417	5,354	0
CBK	12/2023	$	635,353	JPY	95,219,229	0	(3,205)
DUB	11/2023	JPY	282,100,651	$	1,869,628	6,901	0
DUB	11/2023	$	1,291,052	JPY	191,043,295	0	(29,582)
DUB	12/2023		1,869,628		280,681,417	0	(6,221)
GLM	11/2023	JPY	3,566,356	$	23,994	445	0
GLM	11/2023	$	52,569	JPY	7,798,910	0	(1,072)
JPM	11/2023	JPY	6,555,452	$	43,301	15	0
JPM	11/2023	$	140,639	JPY	20,885,896	0	(2,728)
JPM	12/2023		43,301		6,522,486	1	0
MBC	11/2023	JPY	637,972	$	4,277	64	0
MBC	11/2023	$	3,679	JPY	546,680	0	(70)
MYI	11/2023	JPY	34,492,948	$	228,170	411	0
MYI	11/2023	$	34,144	JPY	5,073,696	0	(642)
MYI	12/2023		120,636		18,160,488	0	(71)
SCX	11/2023	JPY	1,185,857	$	7,934	103	0
SSB	11/2023		60,546,400		400,000	209	0
SSB	12/2023	$	400,000	JPY	60,242,184	0	(60)
TOR	11/2023	JPY	85,314,933	$	568,577	5,237	0
TOR	11/2023	$	4,749,153	JPY	704,953,574	0	(94,304)
TOR	12/2023		568,577		84,882,758	0	(5,051)
UAG	11/2023	JPY	357,791,315	$	2,377,747	15,231	0
UAG	12/2023	$	2,377,747	JPY	355,986,844	0	(14,397)
						$ 34,454	$ (158,431)
外国為替先渡し契約合計						**$ 34,654**	**$ (158,549)**

PIMCO バミューダ・インカム・ファンド(M)
組入資産の明細
(金額の単位は千*、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

2023年10月31日

		額面金額(単位:千)		評価額(単位:千)
投資有価証券 148.7%				
バンクローン 4.3%				
AAdvantage Loyality IP Ltd.				
10.427% due 04/20/2028	$	9,453	$	9,600
AmSurg LLC				
13.258% due 04/29/2027		78,267		91,831
16.695% due 04/28/2028 (b)		39,584		36,017
Azalea TopCo, Inc.				
9.184% due 07/24/2026		818		778
Carnival Corp.				
7.618% due 06/30/2025	EUR	11,263		11,919
8.689% due 10/18/2028	$	2,290		2,252
Cengage Learning, Inc.				
10.405% due 07/14/2026		11,893		11,783
Charter Communications Operating LLC				
7.074-7.133% due 02/01/2027		3,069		3,065
DIRECTV Financing LLC				
10.439% due 08/02/2027		7,101		6,923
Envalior Finance GmbH				
9.448% due 03/29/2030	EUR	10,900		10,686
10.883% due 03/29/2030	$	19,602		18,070
Envision Healthcare Corp.				
13.250% due 07/10/2026		23,591		23,591
Finastra USA, Inc.				
2.579% due 09/13/2029 (c)		614		603
12.582% due 09/13/2029		6,161		6,053
GTCR W Merger Sub LLC				
8.334% due 09/20/2030		9,200		9,146
iHeartCommunications, Inc.				
8.439% due 05/01/2026		49,324		42,248
Iqvia, Inc.				
5.868% due 03/07/2024	EUR	3,900		4,123
Lealand Finance Co. BV				
3.000-6.439% due 06/30/2025	$	613		337
8.439% due 06/28/2024		261		190
Poseidon Bidco SAS				
9.222% due 09/30/2028	EUR	39,600		42,014
Pug LLC				
8.939% due 02/12/2027	$	780		738
Sigma Holdco BV				
7.413% due 07/02/2025	EUR	1,820		1,920
Sotera Health Holdings LLC				
8.395% due 12/11/2026	$	3,362		3,340
SS&C Technologies Holdings, Inc.				
7.189% due 04/16/2025		2,824		2,825
SVF II Finco (Cayman) LP				
5.000% due 12/21/2025		32,083		30,109
Syniverse Holdings LLC				
12.390% due 05/13/2027		24,909		22,192
Team Health Holdings, Inc.				
8.189% due 02/06/2024		1,685		1,650
TransDigm, Inc.				
8.640% due 02/22/2027		786		787
8.640% due 08/24/2028		24,180		24,180
U.S. Renal Care, Inc.				
10.446% due 06/20/2028		3,155		1,956
United AirLines, Inc.				
9.189% due 04/21/2028		2,439		2,438
Westmoreland Coal Co.				
8.000% due 03/15/2029		349		260
Windstream Services LLC				
9.424% due 02/23/2027		4,920		4,846
11.674% due 09/21/2027		8,020		7,450
バンクローン合計				**435,920**
(取得原価 $444,839)				
社債・約束手形 15.6%				
銀行・金融 7.4%				
AGFC Capital Trust I				
7.405% due 01/15/2067		2,200		1,157
AIB Group PLC				
5.250% due 10/23/2031	EUR	4,060		4,326
6.608% due 09/13/2029	$	5,200		5,088
Armor Holdco, Inc.				
8.500% due 11/15/2029		200		175
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates				
5.849% due 06/15/2050		7,900		6,006
Aroundtown S.A.				
5.375% due 03/21/2029		11,300		8,843
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2.528% due 11/18/2027		43,530		36,373
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1.875% due 01/09/2026	EUR	7,100		6,735
2.625% due 04/28/2025		1,000		996
3.625% due 09/24/2024		900		929
6.750% due 03/02/2026		12,961		13,648
7.708% due 01/18/2028		1,200		1,111
8.000% due 01/22/2030		5,237		5,217
8.500% due 09/10/2030		2,000		1,992

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Banco de Credito del Peru S.A.			
4.650% due 09/17/2024	PEN	16,400	4,133
Banco Santander S.A. (d)			
6.527% due 11/07/2027	$	11,000	11,022
6.607% due 11/07/2028		8,400	8,413
Bank of Nova Scotia			
4.900% due 06/04/2025 (e)(f)		1,124	1,029
Barclays PLC			
4.972% due 05/16/2029		2,600	2,394
6.490% due 09/13/2029		8,500	8,290
6.692% due 09/13/2034		9,900	9,368
7.437% due 11/02/2033		400	399
BPCE S.A.			
6.714% due 10/19/2029		19,000	18,741
7.003% due 10/19/2034		11,600	11,278
Brandywine Operating Partnership LP			
3.950% due 11/15/2027		2,000	1,659
4.550% due 10/01/2029		1,500	1,149
CA Immobilien Anlagen AG			
1.000% due 10/27/2025	EUR	3,400	3,214
CaixaBank S.A.			
6.208% due 01/18/2029	$	5,400	5,214
6.840% due 09/13/2034		7,800	7,376
CIFI Holdings Group Co. Ltd. (b)			
4.375% due 04/12/2027		300	17
4.450% due 08/17/2026		500	32
5.950% due 10/20/2025		200	15
6.000% due 07/16/2025		200	14
6.450% due 11/07/2024		600	39
Corestate Capital Holding S.A. (g)			
8.000% due 12/31/2026	EUR	8,491	6,066
10.000% due 12/31/2026		1,300	1,374
Corsair International Ltd.			
8.802% due 01/28/2027		10,000	10,411
9.152% due 01/28/2029		4,100	4,247
Country Garden Holdings Co. Ltd. (b)			
2.700% due 07/12/2026	$	2,100	92
3.125% due 10/22/2025		3,400	147
3.875% due 10/22/2030		1,700	78
CPI Property Group S.A.			
2.750% due 05/12/2026	EUR	2,100	1,850
Credit Suisse AG			
0.495% due 02/02/2024	$	5,200	5,116
5.500% due 08/20/2026	EUR	14,000	15,202
7.500% due 02/15/2028	$	10,500	10,907
Credit Suisse Group AG AT1 Claim (b)		9,046	995
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl			
2.125% due 11/19/2025	EUR	433	418
CTP NV			
1.250% due 06/21/2029		7,500	5,937
1.500% due 09/27/2031		8,200	6,001

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Deutsche Bank AG			
1.375% due 02/17/2032		8,500	6,708
1.750% due 11/19/2030		6,200	5,286
2.129% due 11/24/2026	$	1,200	1,084
3.035% due 05/28/2032		700	522
3.547% due 09/18/2031		7,400	5,815
3.961% due 11/26/2025		3,127	3,016
6.720% due 01/18/2029		2,900	2,848
EPR Properties			
4.750% due 12/15/2026		256	234
4.950% due 04/15/2028		1,132	987
G City Europe Ltd.			
4.250% due 09/11/2025	EUR	400	376
GLP Capital LP			
5.250% due 06/01/2025	$	650	635
5.300% due 01/15/2029		3,142	2,873
Goodman U.S. Finance Three LLC			
3.700% due 03/15/2028		2,324	2,070
Highwoods Realty LP			
3.050% due 02/15/2030		200	150
HSBC Holdings PLC			
2.848% due 06/04/2031		3,300	2,591
3.973% due 05/22/2030		14,100	12,187
5.402% due 08/11/2033		400	360
6.254% due 03/09/2034		29,500	28,014
Hudson Pacific Properties LP			
3.250% due 01/15/2030		100	64
3.950% due 11/01/2027		500	384
5.950% due 02/15/2028		2,200	1,733
InCaps Funding I Ltd.			
7.671% due 06/01/2033		6,069	5,705
KBC Group NV			
6.324% due 09/21/2034		5,500	5,211
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3.250% due 11/12/2025	EUR	1,400	1,322
Kilroy Realty LP			
4.250% due 08/15/2029	$	300	250
Lloyds Banking Group PLC			
7.875% due 06/27/2029 (e)(f)	GBP	1,706	1,829
Nationwide Building Society			
3.960% due 07/18/2030	$	5,600	4,867
4.302% due 03/08/2029		12,500	11,366
4.500% due 11/01/2026 (d)	EUR	12,400	13,186
NatWest Group PLC			
4.445% due 05/08/2030	$	17,600	15,610
5.076% due 01/27/2030		16,500	15,150
6.016% due 03/02/2034		15,900	14,817
New Metro Global Ltd.			
4.500% due 05/02/2026		1,000	173
4.625% due 10/15/2025		200	46
4.800% due 12/15/2024		1,400	441

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5.500% due 02/15/2024		575	571
Preferred Term Securities XVIII Ltd.			
6.051% due 09/23/2035		68	67
Preferred Term Securities XXIV Ltd.			
5.971% due 03/22/2037		763	686
6.051% due 03/22/2037		4,829	3,622
Preferred Term Securities XXV Ltd.			
5.961% due 06/22/2037		18,320	15,939
Preferred Term Securities XXVI Ltd.			
5.971% due 09/22/2037		27,065	22,734
Santander Holdings USA, Inc.			
4.500% due 07/17/2025		1,007	968
Santander UK Group Holdings PLC			
2.469% due 01/11/2028		1,000	864
3.823% due 11/03/2028		3,400	2,993
6.534% due 01/10/2029		9,900	9,690
6.750% due 06/24/2024 (e)(f)	GBP	16,610	19,749
7.482% due 08/29/2029		4,800	5,976
Seazen Group Ltd.			
6.000% due 08/12/2024	$	700	301
Societe Generale S.A.			
6.446% due 01/10/2029		8,050	7,868
6.691% due 01/10/2034		15,100	14,150
Sunac China Holdings Ltd.			
7.000% due 07/09/2025		800	128
SVB Financial Group			
3.125% due 06/05/2030 (b)		100	57
U.S. Capital Funding VI Ltd.			
5.948% due 07/10/2043		23,084	17,602
UBS Group AG			
3.091% due 05/14/2032		2,850	2,193
3.750% due 03/26/2025		6,200	5,972
3.869% due 01/12/2029		31,650	28,346
4.194% due 04/01/2031		9,150	7,826
5.959% due 01/12/2034		15,900	14,830
6.301% due 09/22/2034		4,900	4,643
6.327% due 12/22/2027		10,000	9,902
6.442% due 08/11/2028		3,360	3,326
6.537% due 08/12/2033		22,110	21,257
7.750% due 03/01/2029	EUR	3,540	4,151
9.016% due 11/15/2033	$	4,350	4,875
UniCredit SpA			
7.830% due 12/04/2023		72,590	72,690
Unique Pub Finance Co. PLC			
7.395% due 03/28/2024	GBP	344	414
Uniti Group LP			
6.500% due 02/15/2029	$	2,280	1,483
10.500% due 02/15/2028		6,545	6,307
VICI Properties LP			
3.500% due 02/15/2025		4,784	4,567

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.750% due 02/15/2027	4,300	3,873
4.125% due 08/15/2030	5,684	4,694
4.250% due 12/01/2026	3,600	3,326
4.625% due 12/01/2029	3,600	3,117
Voyager Aviation Holdings LLC		
8.500% due 05/09/2026 (b)	4,421	2,404
		757,304
工業 3.2%		
Air Canada 2020-2 Class A Pass-Through Trust		
5.250% due 04/01/2029	1,869	1,791
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
4.800% due 08/15/2027	3,270	3,119
Amdocs Ltd.		
2.538% due 06/15/2030	4,000	3,150
American Airlines 2013-1 Class A Pass-Through Trust		
4.000% due 07/15/2025	78	73
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust		
3.700% due 10/01/2026	1,849	1,672
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust		
3.375% due 05/01/2027	1,381	1,221
American Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust		
3.575% due 01/15/2028	1,467	1,340
American Airlines 2016-2 Class AA Pass-Through Trust		
3.200% due 06/15/2028	767	678
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust		
3.350% due 10/15/2029	337	297
BAT Capital Corp.		
6.343% due 08/02/2030	1,200	1,165
6.421% due 08/02/2033	1,000	943
7.081% due 08/02/2053	1,100	982
Boeing Co.		
5.705% due 05/01/2040	5,728	5,071
5.805% due 05/01/2050	4,500	3,878
5.930% due 05/01/2060	9,900	8,338
British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust		
3.300% due 12/15/2032	85	72
Broadcom, Inc.		
2.450% due 02/15/2031	7,900	6,065
3.137% due 11/15/2035	4,435	3,130
3.469% due 04/15/2034	4,513	3,440
Carvana Co. (g)		
12.000% due 12/01/2028	11,453	8,536
13.000% due 06/01/2030	17,180	12,729
14.000% due 06/01/2031	20,329	15,161
Community Health Systems, Inc.		
5.625% due 03/15/2027	21,336	17,351
8.000% due 03/15/2026	8,401	7,691
CoStar Group, Inc.		
2.800% due 07/15/2030	2,000	1,554

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
CVS Pass-Through Trust			
5.773% due 01/10/2033		129	125
7.507% due 01/10/2032		515	525
8.353% due 07/10/2031		514	532
Energy Transfer LP			
4.950% due 05/15/2028		424	401
Exela Intermediate LLC			
11.500% due 04/15/2026 (g)		541	92
Ford Foundation			
2.815% due 06/01/2070		1,940	989
Greene King Finance PLC			
3.593% due 03/15/2035	GBP	1,956	2,016
4.064% due 03/15/2035		532	556
5.106% due 03/15/2034		131	147
7.139% due 12/15/2034		4,156	3,915
GTCR W-2 Merger Sub LLC			
7.500% due 01/15/2031	$	900	889
Imperial Brands Finance PLC			
3.500% due 07/26/2026		1,900	1,771
JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust			
4.000% due 11/15/2032		6,106	5,408
Market Bidco Finco PLC			
4.750% due 11/04/2027	EUR	17,800	16,152
Massachusetts Institute of Technology			
4.678% due 07/01/2114	$	65	50
5.600% due 07/01/2111		103	96
Mitchells & Butlers Finance PLC			
6.013% due 12/15/2028	GBP	820	922
6.022% due 12/15/2030	$	373	346
Nissan Motor Co. Ltd.			
3.522% due 09/17/2025		8,300	7,852
4.345% due 09/17/2027		8,700	7,869
4.810% due 09/17/2030		2,250	1,912
NMG Holding Co., Inc.			
7.125% due 04/01/2026		11,900	11,142
ONEOK, Inc.			
5.800% due 11/01/2030		800	770
6.050% due 09/01/2033		3,500	3,356
6.625% due 09/01/2053		2,900	2,713
Oracle Corp.			
3.850% due 04/01/2060		899	540
PeaceHealth Obligated Group			
3.218% due 11/15/2050		3,100	1,735
Roadster Finance DAC			
2.375% due 12/08/2027	EUR	1,000	889
Rolls-Royce PLC			
4.625% due 02/16/2026		3,514	3,672
5.750% due 10/15/2027	GBP	3,199	3,672
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
11.500% due 06/01/2025	$	2,410	2,549

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Russian Railways Via RZD Capital PLC			
7.487% due 03/25/2049 (b)	GBP	6,300	4,969
Sands China Ltd.			
4.300% due 01/08/2026	$	1,800	1,671
5.375% due 08/08/2025		2,300	2,228
5.650% due 08/08/2028		2,400	2,222
Syngenta Finance NV			
4.892% due 04/24/2025		800	782
Times Square Hotel Trust			
8.528% due 08/01/2026		823	813
U.S. Renal Care, Inc.			
10.625% due 06/28/2028		2,342	1,446
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust			
2.700% due 05/01/2032		1,288	1,049
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			
5.875% due 10/15/2027		20,509	20,217
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3.875% due 08/15/2029		7,400	6,165
3.875% due 11/01/2033		16,500	12,486
4.125% due 08/15/2031		5,000	4,025
Venture Global LNG, Inc.			
8.125% due 06/01/2028		7,600	7,384
8.375% due 06/01/2031		8,400	8,022
9.500% due 02/01/2029		46,750	47,524
9.875% due 02/01/2032		15,550	15,777
Veritas U.S., Inc.			
7.500% due 09/01/2025		1,950	1,598
			331,428
公益事業 5.0%			
Altice Financing S.A.			
5.750% due 08/15/2029		11,389	8,820
Altice France S.A.			
8.125% due 02/01/2027		2,744	2,316
Charter Communications Operating LLC			
3.900% due 06/01/2052		9,800	5,536
3.950% due 06/30/2062		2,600	1,389
4.400% due 12/01/2061		7,100	4,137
Constellation Oil Services Holding S.A.			
3.000% due 12/31/2026 (g)		387	273
DISH DBS Corp.			
5.250% due 12/01/2026		11,110	8,983
5.750% due 12/01/2028		11,110	8,089
Enel Finance America LLC			
7.100% due 10/14/2027		1,000	1,023
Enel Finance International NV			
7.500% due 10/14/2032		600	621
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
2.250% due 11/22/2024	EUR	100	82
2.949% due 01/24/2024		450	381

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
4.950% due 03/23/2027	$	1,800	1,251
4.950% due 02/06/2028		1,000	695
5.150% due 02/11/2026		5,700	4,275
7.288% due 08/16/2037		500	390
8.625% due 04/28/2034		2,372	2,163
Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC			
1.500% due 02/17/2027	EUR	31,800	20,504
2.950% due 04/15/2025		5,000	3,964
2.950% due 01/27/2029	$	23,200	13,340
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6.500% due 03/15/2030		70,143	61,763
Netflix, Inc.			
3.875% due 11/15/2029	EUR	3,065	3,181
Noble Finance II LLC			
8.000% due 04/15/2030	$	2,072	2,073
NPC Ukrenergo			
6.875% due 11/09/2028		1,200	324
Pacific Gas & Electric Co.			
2.100% due 08/01/2027		1,910	1,618
2.500% due 02/01/2031		2,600	1,929
2.950% due 03/01/2026		8,508	7,813
3.000% due 06/15/2028		11,288	9,559
3.150% due 01/01/2026		15,753	14,585
3.250% due 06/01/2031		3,800	2,952
3.300% due 03/15/2027		3,838	3,443
3.300% due 12/01/2027		14,666	12,779
3.400% due 08/15/2024		6,570	6,421
3.450% due 07/01/2025		12,102	11,478
3.500% due 06/15/2025		8,068	7,678
3.500% due 08/01/2050		4,660	2,597
3.750% due 02/15/2024		10,188	10,121
3.750% due 07/01/2028		13,613	11,944
3.750% due 08/15/2042		418	258
3.850% due 11/15/2023		1,830	1,828
3.950% due 12/01/2047		2,200	1,315
4.000% due 12/01/2046		3,144	1,904
4.200% due 03/01/2029		9,900	8,635
4.250% due 03/15/2046		5,219	3,299
4.300% due 03/15/2045		3,000	1,944
4.400% due 03/01/2032		7,300	6,003
4.450% due 04/15/2042		4,333	2,933
4.500% due 07/01/2040		36,242	25,754
4.500% due 12/15/2041		743	490
4.550% due 07/01/2030		50,195	43,469
4.600% due 06/15/2043		1,794	1,230
4.650% due 08/01/2028		100	90
4.750% due 02/15/2044		2,707	1,888
4.950% due 07/01/2050		25,950	18,136
5.250% due 03/01/2052		7,300	5,292
Petroleos de Venezuela S.A. (b)			
5.375% due 04/12/2027		11,932	1,647

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
5.500% due 04/12/2037		10,372	1,365
6.000% due 05/16/2024		8,283	1,093
6.000% due 11/15/2026		13,183	1,691
9.000% due 11/17/2023		400	53
9.750% due 05/17/2035		4,730	700
Petroleos Mexicanos			
5.950% due 01/28/2031		5,319	3,809
6.700% due 02/16/2032		58,087	42,867
6.950% due 01/28/2060		6,116	3,468
7.690% due 01/23/2050		1,570	971
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			
4.263% due 06/01/2036		3,600	3,148
4.377% due 06/01/2039		3,990	3,407
4.451% due 12/01/2047		7,700	6,063
Prosus NV			
1.985% due 07/13/2033	EUR	5,600	3,873
2.085% due 01/19/2030		4,200	3,382
3.061% due 07/13/2031	$	9,600	6,919
4.193% due 01/19/2032		4,000	3,074
4.987% due 01/19/2052		1,300	803
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			
9.250% due 07/06/2024		499	504
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
9.750% due 01/06/2027		443	459
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			
8.200% due 04/06/2028		2,101	2,121
Sprint Capital Corp.			
8.750% due 03/15/2032		2,200	2,479
Sprint LLC			
7.125% due 06/15/2024		3,992	4,017
7.625% due 03/01/2026		839	862
Sprint Spectrum Co. LLC			
5.152% due 03/20/2028		2,482	2,443
System Energy Resources, Inc.			
2.140% due 12/09/2025		6,100	5,555
Topaz Solar Farms LLC			
4.875% due 09/30/2039		5,109	4,602
5.750% due 09/30/2039		7,292	6,633
Valaris Ltd.			
8.375% due 04/30/2030		1,666	1,636
Viasat, Inc.			
6.500% due 07/15/2028		2,700	1,917
Windstream Escrow LLC			
7.750% due 08/15/2028		13,507	10,723
			517,242
社債・約束手形合計 **（取得原価　$1,896,675）**			**1,605,974**

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
転換社債等 0.4%			
Multiplan Corp.			
6.000% due 10/15/2027		5,700	3,802
Nationwide Building Society			
10.250% due 06/20/2166	GBP	7,405	10,221
Stichting AK Rabobank Certificaten			
6.500% due 03/29/2170 (f)	EUR	30,963	29,586
転換社債等合計			**43,609**
（取得原価 $67,905）			
地方債・約束手形 0.1%			
Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
6.630% due 02/01/2035	$	605	599
6.725% due 04/01/2035		286	283
7.350% due 07/01/2035		467	476
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022			
0.000% due 11/01/2043		12,731	6,350
Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			
2.246% due 06/01/2029		1,600	1,332
3.000% due 06/01/2046		635	560
Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (b)			
6.050% due 07/01/2032		800	202
6.125% due 07/01/2040		3,000	757
地方債・約束手形合計			**10,559**
（取得原価 $12,129）			
米国政府機関債 52.4%			
Fannie Mae			
0.765% due 05/25/2048 (h)		2,065	207
3.000% due 04/01/2037		611	546
3.000% due 09/01/2049		188	152
3.000% due 03/01/2050		16,878	13,664
3.000% due 10/01/2051		1,350	1,084
3.000% due 12/01/2051		204	164
3.000% due 01/01/2052		194	156
3.000% due 02/01/2052		10,310	8,273
3.000% due 03/01/2052		23,085	18,518
3.000% due 04/01/2052		25,731	20,639
3.000% due 05/01/2052		8,343	6,695
3.000% due 06/01/2052		9,332	7,485
3.000% due 07/01/2052		6,806	5,459
3.000% due 08/01/2052		10,442	8,379
3.000% due 09/01/2052		164	132
3.000% due 05/01/2053		111	89
3.500% due 08/01/2042		18	16
3.500% due 09/01/2047		166	142
3.500% due 03/01/2048		49	42
3.500% due 04/01/2051		676	578
3.500% due 02/01/2052		977	816

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
3.500% due 03/01/2052	1,590	1,330
3.500% due 04/01/2052	2,751	2,301
3.500% due 05/01/2052	2,950	2,467
3.500% due 07/01/2052	3,348	2,793
3.500% due 09/01/2052	981	819
4.000% due 07/01/2040	5	5
4.000% due 12/01/2041	46	40
4.000% due 07/01/2042	36	31
4.000% due 08/01/2042	541	476
4.000% due 09/01/2042	125	109
4.000% due 10/01/2042	20	18
4.000% due 01/01/2043	5	4
4.000% due 11/01/2045	86	76
4.000% due 03/01/2047	27	24
4.000% due 04/01/2047	230	204
4.000% due 08/01/2047	3,707	3,278
4.000% due 10/01/2047	205	181
4.000% due 12/01/2047	80	71
4.000% due 01/01/2048	46	40
4.000% due 02/01/2048	514	454
4.000% due 07/01/2048	6,176	5,430
4.000% due 08/01/2048	3,627	3,190
4.000% due 09/01/2048	1,049	927
4.500% due 05/01/2033	13	12
4.500% due 02/01/2038	1	1
4.500% due 01/01/2041	156	138
4.750% due 06/01/2033	160	145
5.000% due 10/01/2035	60	59
5.000% due 12/01/2035	134	125
5.000% due 10/01/2036	5	5
5.000% due 05/01/2038	2	2
5.000% due 11/01/2039	6	6
5.500% due 07/01/2033	18	18
5.500% due 06/01/2035	657	624
5.500% due 04/01/2036	1	1
5.500% due 11/01/2036	1	1
5.500% due 03/01/2037	11	11
5.500% due 09/01/2037	4	4
5.500% due 02/01/2038	3	3
5.500% due 04/01/2038	11	11
6.000% due 08/01/2031	20	19
6.000% due 06/01/2032	1	1
6.000% due 09/01/2039	358	345
6.000% due 10/01/2047	8	7
6.000% due 01/01/2053	26,626	26,056
6.500% due 01/01/2037	1	1
6.500% due 10/01/2037	3	3
6.500% due 10/01/2053	6,847	6,815
7.000% due 09/01/2031	27	27
Fannie Mae, TBA (d)		
2.500% due 12/01/2053	146,000	112,203

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.000% due 11/01/2038	1,800	1,609
3.000% due 11/01/2053	0	0
3.000% due 12/01/2053	199,150	159,563
3.500% due 12/01/2053	652,683	544,157
4.000% due 12/01/2053	155,150	134,132
4.500% due 12/01/2053	101,800	90,950
5.000% due 12/01/2053	3,500	3,226
5.500% due 12/01/2053	286,200	271,420
6.000% due 12/01/2053	30,800	29,962
6.500% due 12/01/2053	35,100	34,867
Freddie Mac		
1.115% due 06/15/2042 (h)	30	3
3.000% due 11/01/2046	57	47
3.000% due 12/01/2047	1,779	1,469
3.000% due 03/01/2048	101	84
3.000% due 12/01/2051	187	151
3.000% due 03/01/2052	89	71
3.000% due 04/01/2052	538	432
3.000% due 05/01/2052	7,575	6,075
3.000% due 06/01/2052	203	163
3.000% due 07/01/2052	158	127
3.000% due 09/01/2052	99	79
3.000% due 10/01/2052	396	317
3.000% due 01/01/2053	242	194
3.000% due 03/01/2053	260	209
3.500% due 10/01/2039	108	94
3.500% due 10/01/2047	1,937	1,657
3.500% due 12/01/2047	601	513
3.500% due 03/01/2048	2,330	1,989
3.500% due 04/01/2048	836	714
3.500% due 10/01/2048	938	800
3.500% due 12/01/2048	2,300	1,966
3.500% due 03/01/2049	1,432	1,221
3.500% due 05/01/2051	75	63
3.500% due 04/01/2052	2,952	2,463
3.500% due 06/01/2052	2,323	1,939
3.500% due 07/01/2052	993	828
3.500% due 09/01/2052	33	27
3.500% due 11/01/2052	836	700
4.000% due 09/01/2033	1	1
4.000% due 08/01/2042	465	410
4.000% due 09/01/2042	656	578
4.000% due 12/01/2042	7	6
4.000% due 04/01/2047	296	262
4.000% due 05/01/2047	287	254
4.000% due 08/01/2047	522	462
4.000% due 08/01/2048	602	530
4.000% due 09/01/2048	245	216
4.000% due 12/01/2048	9,227	8,119
4.000% due 02/01/2049	3,684	3,241
4.000% due 03/01/2049	287	252
5.000% due 06/01/2034	65	64
5.000% due 08/01/2035	39	38
5.000% due 01/01/2037	2	2
5.000% due 01/01/2038	1	1
5.500% due 01/01/2035	257	252
5.500% due 05/01/2037	2	2
5.500% due 06/01/2037	90	88
5.750% due 05/01/2037	83	82
6.000% due 07/01/2037	40	40
6.000% due 01/01/2053	8,304	8,121
Ginnie Mae		
4.000% due 06/20/2041	1	1
4.000% due 04/20/2047	1,441	1,290
4.000% due 05/20/2047	26,657	23,925
4.000% due 06/20/2047	12,651	11,325
4.000% due 07/20/2047	10,939	9,792
4.000% due 02/20/2048	7,567	6,768
4.000% due 05/20/2049	26,126	23,437
4.000% due 02/20/2050	318	287
4.000% due 07/20/2050	156	140
4.000% due 08/20/2050	24	22
4.000% due 09/20/2050	1,893	1,698
4.000% due 10/20/2050	59,971	53,798
4.000% due 11/20/2052	252	222
4.500% due 10/20/2035	416	380
4.500% due 01/20/2040	76	69
4.500% due 03/20/2040	7	7
4.500% due 07/15/2040	1,105	1,032
4.500% due 07/20/2040	1,207	1,122
4.500% due 08/15/2040	1,317	1,239
4.500% due 08/20/2040	871	810
4.500% due 09/20/2040	3,628	3,371
4.500% due 10/20/2040	987	918
4.500% due 01/20/2041	4,678	4,348
4.500% due 02/20/2041	2,268	2,096
4.500% due 03/20/2041	8,736	8,093
4.500% due 04/15/2041	1,054	991
4.500% due 04/20/2041	926	861
4.500% due 06/20/2041	7,991	7,428
4.500% due 07/20/2041	2,066	1,920
4.500% due 09/20/2041	206	191
4.500% due 10/20/2041	1,179	1,083
4.500% due 12/20/2041	1,847	1,718
4.500% due 05/20/2043	438	407
4.500% due 07/20/2043	292	272
4.500% due 07/20/2053	103,767	93,851
4.500% due 08/20/2053	1,022	925
4.500% due 09/20/2053	299,110	270,538
5.000% due 08/20/2030	170	160
5.000% due 05/20/2040	262	246
5.000% due 04/20/2041	7	6

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
5.500% due 05/20/2038	7	7
5.500% due 06/20/2038	35	34
5.500% due 07/20/2038	34	32
5.500% due 08/20/2038	233	225
5.500% due 09/20/2038	72	69
5.500% due 10/20/2038	15	14
5.500% due 01/20/2039	10	10
5.500% due 02/20/2039	26	25
5.500% due 09/20/2039	50	48
5.500% due 10/20/2039	8	7
5.500% due 11/20/2039	212	204
5.500% due 12/20/2039	24	22
5.500% due 01/20/2040	187	176
5.500% due 06/20/2040	208	203
5.500% due 07/20/2040	470	443
5.500% due 07/20/2053	21,057	20,155
5.500% due 08/20/2053	18,417	17,627
Ginnie Mae, TBA (d)		
2.000% due 11/01/2053	19,000	14,653
2.500% due 12/01/2053	46,200	36,816
3.000% due 11/01/2053	147,100	121,256
3.000% due 12/01/2053	494,900	408,181
3.500% due 10/01/2053	182,700	155,733
3.500% due 12/01/2053	99,000	84,418
4.000% due 11/01/2053	513,000	450,979
4.000% due 12/01/2053	944,000	830,204
4.500% due 11/01/2053	177,660	160,530
4.500% due 12/01/2053	496,000	448,368
5.000% due 11/01/2041	277,000	257,751
5.500% due 11/01/2053	22,000	21,039
5.500% due 12/01/2053	247,000	236,155
米国政府機関債合計		**5,383,620**
（取得原価 $5,497,999）		
国庫債券 15.1%		
Treasury Inflation Protected Securities (i)		
0.125% due 07/15/2024	194,667	190,176
0.125% due 10/15/2024	141,986	137,773
0.125% due 04/15/2025	33,341	31,837
0.125% due 07/15/2030	54,737	46,922
0.125% due 01/15/2031	2,005	1,692
0.125% due 07/15/2031	7,606	6,371
0.250% due 01/15/2025	72,526	69,835
0.250% due 07/15/2029	148,070	131,114
0.250% due 02/15/2050	21,926	12,189
0.375% due 01/15/2027	5,903	5,486
0.375% due 07/15/2027	1,581	1,463
0.500% due 04/15/2024	96,682	95,057
0.625% due 01/15/2024	169,533	168,013
0.625% due 07/15/2032	91,088	78,043
0.625% due 02/15/2043	2,938	2,035
0.750% due 07/15/2028	34,682	32,098
0.750% due 02/15/2042	6,930	5,013
0.750% due 02/15/2045	18,905	13,052
0.875% due 01/15/2029	63,316	58,326
0.875% due 02/15/2047	22,131	15,330
1.000% due 02/15/2046	11,921	8,609
1.000% due 02/15/2048	25,897	18,280
1.000% due 02/15/2049	65,655	46,012
1.375% due 07/15/2033	117,671	106,538
1.375% due 02/15/2044	3,425	2,733
1.500% due 02/15/2053	26,958	21,153
2.125% due 02/15/2040	3,551	3,322
2.125% due 02/15/2041	1,963	1,832
U.S. Treasury Bonds		
2.250% due 08/15/2046	100	60
2.750% due 08/15/2047	2,830	1,865
3.000% due 08/15/2048	155	107
3.000% due 02/15/2049	77	53
3.125% due 05/15/2048	180	127
4.375% due 08/15/2043	33,800	30,151
U.S. Treasury Notes		
1.625% due 02/15/2026	2,200	2,040
2.000% due 02/15/2025	11,021	10,572
2.000% due 08/15/2025	1,400	1,326
2.000% due 11/15/2026	800	735
2.250% due 11/15/2024	12,300	11,906
2.250% due 02/15/2027	28,000	25,789
2.375% due 05/15/2029	32,200	28,297
2.625% due 02/15/2029	5,000	4,478
2.750% due 08/15/2032	150,100	126,999
2.875% due 05/15/2032	290	249
国庫債券合計		**1,555,058**
（取得原価 $1,734,056）		
モーゲージ担保証券 40.8%		
Accredited Mortgage Loan Trust		
6.384% due 07/25/2035	7,714	7,468
7.134% due 07/25/2035 (b)	2,206	1,765
ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
5.749% due 08/25/2036	3,308	3,105
6.234% due 01/25/2035	841	763
6.264% due 02/25/2034	1,389	1,402
6.339% due 08/25/2035	4,516	4,289
6.369% due 11/25/2034	1,120	1,090
6.609% due 02/25/2035	6,632	6,153
Adjustable Rate Mortgage Trust		
6.389% due 08/25/2035	3,175	2,764
AFC Home Equity Loan Trust		
6.249% due 06/25/2029	1,587	926

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Alternative Loan Trust			
4.140% due 08/25/2035 (b)		420	385
4.158% due 08/25/2036		5,426	4,855
5.268% due 09/25/2034		772	686
5.500% due 04/25/2034		8,776	8,291
5.500% due 06/25/2035		4,396	3,424
5.500% due 08/25/2035 (b)		49	40
5.500% due 09/25/2035		2,541	1,568
5.500% due 02/25/2036 (b)		14	8
5.644% due 09/20/2046		542	541
5.799% due 07/25/2036		3,895	3,842
5.819% due 08/25/2046 (b)		8,382	6,782
5.839% due 05/25/2036		12,205	10,255
5.874% due 03/20/2046		4,994	3,948
5.939% due 12/25/2046		13,414	10,764
5.979% due 07/25/2036		18,309	15,296
6.000% due 11/25/2036		1,701	960
6.000% due 07/25/2037 (b)		24,518	11,622
6.039% due 01/25/2036		5,261	4,498
6.094% due 12/20/2035		5,133	4,495
6.150% due 08/25/2035 (b)		367	285
7.000% due 10/25/2037		29,361	10,459
7.089% due 10/25/2034		2,026	1,953
Ameriquest Mortgage Securities Trust			
5.949% due 04/25/2036		656	652
6.054% due 03/25/2036		26,883	24,379
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
3.610% due 09/25/2032		104	106
6.459% due 01/25/2036		7,000	5,725
7.194% due 10/25/2034		9,913	8,989
Angel Oak Mortgage Trust			
6.500% due 12/25/2067		4,058	4,011
Argent Mortgage Loan Trust			
5.919% due 05/25/2035		18,802	16,781
Argent Securities Trust			
5.799% due 04/25/2036		7,677	2,458
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
4.131% due 09/25/2033		2,584	2,441
6.204% due 10/25/2035		36,400	31,230
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5.659% due 10/25/2036		10,129	8,252
6.099% due 03/25/2035		10,915	10,340
6.174% due 06/25/2035		6,550	6,181
6.414% due 06/25/2035 (b)		4,194	3,727
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
3.842% due 05/25/2036 (b)		46,467	41,083
Atrium Hotel Portfolio Trust			
7.062% due 06/15/2035		18,395	17,797
Austin Fairmont Hotel Trust			
7.182% due 09/15/2032		3,000	2,927

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Avon Finance			
0.000% due 12/28/2049	GBP	2,400	2,808
Banc of America Alternative Loan Trust (b)			
3.986% due 01/24/2024	$	52	42
6.000% due 07/25/2046		1,370	1,102
Banc of America Funding Trust			
4.129% due 02/20/2035		1,283	1,066
4.156% due 06/20/2036		4,044	3,205
4.429% due 01/20/2047 (b)		78	70
6.299% due 04/25/2037		7,934	6,646
BCAP LLC Trust			
4.229% due 04/26/2036		4,613	2,335
5.876% due 04/26/2037		2,725	1,250
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
4.703% due 11/25/2034		188	177
Bear Stearns Alternative-A Trust			
5.779% due 04/25/2037		5,937	5,046
5.859% due 11/25/2046		6,882	4,968
6.159% due 08/25/2035 (b)		4,527	4,166
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust			
1.161% due 05/25/2036 (h)		8,516	158
4.845% due 11/25/2035 (b)		2,773	2,599
5.224% due 06/25/2034		3,406	3,272
5.387% due 12/25/2035		9,275	7,956
5.438% due 09/25/2034		4,736	4,517
5.462% due 04/25/2036		3,944	3,916
5.739% due 06/25/2047		6,300	6,037
5.839% due 05/25/2036 (b)		13,454	4,102
5.844% due 07/25/2036		7,785	7,044
5.919% due 02/25/2037		2,089	4,655
6.054% due 02/25/2036 (b)		9,845	9,469
6.489% due 08/25/2037		15,783	13,308
7.464% due 03/25/2035		3,262	3,074
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5.500% due 11/25/2033		3,513	3,056
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
5.839% due 02/25/2037 (b)		4,876	4,369
Benchmark Mortgage Trust			
3.509% due 09/15/2048		47,290	41,029
3.899% due 03/15/2062		9,775	6,555
BHP Trust			
7.153% due 08/15/2036		10,500	10,283
7.950% due 08/15/2036		33,656	32,883
Bridgegate Funding PLC			
7.442% due 10/16/2062	GBP	12,821	15,532
8.192% due 10/16/2062		18,993	22,788
9.192% due 10/16/2062		9,971	11,992
10.192% due 10/16/2062		7,217	8,654
BSST Mortgage Trust			
8.185% due 02/15/2037	$	11,000	8,810

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
8.835% due 02/15/2037		24,700	18,963
9.835% due 02/15/2037		7,500	5,591
BX Commercial Mortgage Trust			
6.347% due 02/15/2039		6,805	6,614
BX Trust			
7.094% due 10/15/2036		16,400	15,715
7.336% due 10/15/2036		7,150	6,730
7.344% due 10/15/2036		25,610	24,145
9.944% due 07/15/2034		6,800	6,692
Canterbury Finance No.4 PLC			
6.042% due 05/16/2058	GBP	82,252	99,544
Carrington Mortgage Loan Trust			
6.609% due 02/25/2035	$	3,468	2,912
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			
6.040% due 01/25/2039 (b)		504	447
Centex Home Equity Loan Trust			
6.084% due 03/25/2035		1,952	1,925
Chase Home Lending Mortgage Trust			
3.250% due 03/25/2063		21,203	17,664
Chase Mortgage Finance Trust			
4.017% due 12/25/2035 (b)		3,694	3,154
ChaseFlex Trust			
5.739% due 07/25/2037		853	700
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
5.799% due 03/25/2035		298	281
CIM Trust			
3.250% due 10/25/2058		17,962	15,283
6.639% due 12/25/2067		4,642	4,598
CIT Mortgage Loan Trust			
6.789% due 10/25/2037		315	314
6.939% due 10/25/2037		28,585	27,688
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0.280% due 03/11/2047 (h)		25,400	0
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4.313% due 08/25/2036		3,773	3,468
4.507% due 07/25/2037 (b)		2,291	1,957
5.714% due 08/25/2036		15,222	6,195
5.719% due 12/25/2036		2,337	2,198
5.759% due 12/25/2036		9,652	5,304
5.764% due 01/25/2037 (b)		2,205	954
6.259% due 09/25/2037		12,220	10,065
7.250% due 05/25/2036 (b)		8,567	4,259
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
6.474% due 05/25/2035		10,698	9,722
7.939% due 07/25/2037		3,507	3,193
Commercial Mortgage Trust			
0.177% due 04/10/2047 (h)		33,000	5
3.633% due 02/10/2037		10,000	9,208
8.599% due 12/15/2038		8,575	7,709
Conseco Finance Corp.			
6.920% due 12/01/2030		805	800

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
7.500% due 03/01/2030	45,434	16,682
7.600% due 04/15/2026	4,902	1,114
Countrywide Asset-Backed Certificates		
5.939% due 08/26/2033	178	167
7.314% due 05/25/2035 (b)	4,282	4,123
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
0.000% due 06/25/2034	1	1
3.765% due 03/25/2037 (b)	3,573	3,079
4.295% due 10/20/2035 (b)	4,097	3,698
4.371% due 11/25/2037	4,383	3,917
4.703% due 11/25/2034	7	6
5.500% due 11/25/2035 (b)	5,427	2,885
6.000% due 07/25/2036	17,226	8,805
6.000% due 11/25/2037	3,330	1,277
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.		
7.889% due 01/25/2033	1,040	975
Credit Suisse Mortgage Capital		
3.000% due 01/29/2036	321	305
3.000% due 06/27/2037	1,039	1,010
5.755% due 11/27/2036	10,152	12,301
6.199% due 10/26/2036	131	107
Credit Suisse Mortgage Capital Trust		
0.000% due 01/25/2058	20	19
0.000% due 04/25/2058 (h)	1	1
3.431% due 11/10/2032	1,922	1,606
3.616% due 01/25/2058	17,606	13,598
4.390% due 06/25/2050	41,375	33,819
4.454% due 04/25/2058	27,655	24,088
5.556% due 06/01/2050	36,218	36,129
6.194% due 07/15/2032	2,303	2,194
6.444% due 07/15/2032	4,000	3,766
6.644% due 07/15/2032	2,400	2,238
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
7.480% due 03/25/2046	4,266	3,505
CWABS Asset-Backed Certificates Trust		
4.341% due 12/25/2034	6,805	6,216
5.579% due 06/25/2035 (b)	1,473	1,240
5.579% due 06/25/2037	12,462	11,213
5.579% due 07/25/2037 (b)	3,130	3,072
5.619% due 11/25/2047	2,027	2,223
5.633% due 06/25/2035	8,644	6,664
5.659% due 08/25/2037	25,800	22,270
5.669% due 10/25/2047	5,333	5,203
5.689% due 02/25/2036	1,031	952
5.859% due 01/25/2045	765	759
5.899% due 05/25/2037 (b)	10,937	10,133
5.919% due 05/25/2036	9,196	7,407
5.919% due 03/25/2037	27,139	24,503
5.919% due 03/25/2047 (b)	26,535	21,424
5.959% due 09/25/2046	5,600	5,070
5.964% due 08/25/2036	2,303	2,197

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
6.039% due 06/25/2036		858	848
6.139% due 03/25/2036 (b)		1,451	1,237
6.519% due 05/25/2036 (b)		2,262	1,537
6.534% due 06/25/2035		8,400	7,947
7.014% due 11/25/2034		7,394	7,166
7.389% due 08/25/2035		3,000	2,790
CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust			
6.789% due 08/25/2047		34,300	30,495
7.014% due 03/25/2035		16,905	16,185
7.839% due 02/25/2035 (b)		6,963	5,083
DBGS Mortgage Trust			
8.099% due 10/15/2036		15,000	8,342
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust			
5.759% due 03/25/2037		9,093	4,898
5.769% due 08/25/2037 (b)		18,540	14,508
5.939% due 09/25/2047		11,350	9,410
Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
4.460% due 10/25/2035 (b)		8,549	7,310
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
4.240% due 11/27/2036		812	807
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates			
4.051% due 06/27/2037		11,382	9,780
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
5.638% due 10/19/2036 (b)		7,097	5,680
6.108% due 09/19/2045		4,847	2,527
Ellington Loan Acquisition Trust			
6.539% due 05/25/2037		1,020	965
EMC Mortgage Loan Trust			
6.489% due 04/25/2042 (b)		5,437	5,398
Encore Credit Receivables Trust			
6.369% due 11/25/2035		6,510	5,821
Eurosail-UK PLC			
6.109% due 09/13/2045	GBP	3,605	4,173
6.289% due 06/13/2045		5,237	6,273
Extended Stay America Trust			
8.298% due 07/15/2038	$	15,158	14,849
FBR Securitization Trust			
6.114% due 10/25/2035		19,109	15,937
6.204% due 09/25/2035		7,327	7,013
FFMLT Trust			
6.369% due 11/25/2035		2,069	1,654
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4.330% due 04/25/2035		2,811	2,639
5.749% due 11/25/2036		59,328	45,737
5.759% due 04/25/2036		3,831	3,638
6.114% due 03/25/2034		2,412	2,313
6.129% due 01/25/2036		24,773	22,083
6.144% due 05/25/2036		56	55
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
0.000% due 05/25/2035 (b)(h)		1,162	21
5.500% due 05/25/2035 (b)		1,162	686
Fontainebleau Miami Beach Trust			
3.963% due 12/10/2036		33,098	31,391
Fremont Home Loan Trust			
5.719% due 02/25/2037		6,602	4,955
5.729% due 05/25/2036		6,191	5,946
6.099% due 01/25/2036		6,000	5,597
6.459% due 01/25/2035		6,493	5,200
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.129% due 10/25/2035		9,882	8,187
Glen Securities Finance DAC			
5.814% due 10/28/2038	EUR	4,383	4,565
6.814% due 10/28/2038		3,287	3,383
7.852% due 10/28/2038		1,607	1,656
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			
5.456% due 03/10/2051	$	11,781	10,098
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
5.999% due 11/25/2045		32	21
Grifonas Finance No.1 PLC			
4.212% due 08/28/2039	EUR	513	518
GS Mortgage Securities Corporation Trust			
4.591% due 10/10/2032	$	8,215	7,823
GSAA Home Equity Trust (b)			
6.182% due 11/25/2036		2,934	662
6.500% due 11/25/2037		20	8
GSAMP Trust			
5.579% due 03/25/2047		3,675	3,184
5.599% due 01/25/2037		16,585	9,373
5.959% due 06/25/2036		10,860	10,229
6.084% due 11/25/2035 (b)		5,636	4,885
6.414% due 08/25/2034		3,081	2,874
6.414% due 04/25/2035 (b)		5,325	4,827
7.239% due 06/25/2035		3,500	3,214
GSMSC Resecuritization Trust			
2.122% due 04/26/2037		44,351	11,193
5.614% due 09/26/2036		3,694	2,285
GSR Mortgage Loan Trust			
1.261% due 03/25/2037 (h)		7,490	549
5.739% due 03/25/2037		7,490	1,147
HarborView Mortgage Loan Trust			
4.038% due 06/19/2036 (b)		6,049	3,060
5.928% due 12/19/2036 (b)		772	711
6.008% due 02/19/2036		9,501	5,852
6.088% due 08/19/2045		7,547	5,589
Hawaii Hotel Trust			
7.032% due 05/15/2038		2,000	1,959
7.541% due 05/15/2038		12,500	12,225
Home Equity Asset Trust			
5.919% due 10/25/2036		23,475	13,588
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5.579% due 11/25/2036		11,236	10,041
5.679% due 04/25/2037		12,380	7,821

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.799% due 06/25/2036		2,039	1,872
5.979% due 06/25/2036		16,717	11,398
6.429% due 08/25/2035		3,660	3,588
HPLY Trust			
7.451% due 11/15/2036		4,675	4,528
7.801% due 11/15/2036		26,212	25,322
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5.539% due 07/25/2036		2,197	913
5.739% due 07/25/2036		8,971	3,744
5.814% due 05/25/2037		7,197	6,772
Impac CMB Trust			
6.119% due 01/25/2035		7,756	7,130
Impac Secured Assets Corp.			
5.999% due 03/25/2036 (b)		8,132	6,351
Impac Secured Assets Trust			
5.629% due 01/25/2037		1,986	1,567
IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust			
6.500% due 10/25/2037		8,467	4,234
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust			
3.894% due 06/25/2037 (b)		8,206	4,916
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust			
3.285% due 07/25/2037		17,978	15,515
3.342% due 04/25/2037		13,319	11,321
3.473% due 04/25/2037 (b)		6,519	5,701
3.546% due 03/25/2036 (b)		3,949	2,796
4.157% due 11/25/2036 (b)		10,927	7,428
5.799% due 02/25/2037 (b)		20,856	19,365
5.819% due 10/25/2036		4,825	1,963
6.039% due 07/25/2035		5,676	4,413
INTOWN Mortgage Trust			
9.019% due 08/15/2039		11,495	11,506
IXIS Real Estate Capital Trust			
6.204% due 12/25/2035		686	721
Jefferies Resecuritization Trust			
8.746% due 06/25/2047 (b)		431	348
JPMorgan Alternative Loan Trust			
3.896% due 03/25/2036 (b)		270	192
4.036% due 09/25/2036		8,788	7,263
5.730% due 03/25/2036 (b)		56	52
5.999% due 04/25/2047		1,536	1,445
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
4.128% due 07/05/2031		2,500	2,241
6.548% due 12/15/2036		3,700	2,794
7.235% due 10/05/2040		6,900	6,774
7.799% due 09/15/2029		1,740	1,193
7.964% due 11/15/2038		16,193	15,571
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
6.369% due 12/25/2035		12,010	11,443
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4.573% due 11/25/2036		1,976	1,824
5.589% due 12/25/2036		13,723	7,088

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.709% due 08/25/2036		8,600	7,511
5.709% due 06/25/2037		34,606	32,318
5.719% due 06/25/2037 (b)		22,826	18,699
5.844% due 05/25/2036		8,051	7,712
5.874% due 05/25/2036		16,179	14,897
JPMorgan Mortgage Trust			
4.686% due 01/25/2037 (b)		375	319
5.250% due 11/25/2063		987	913
5.739% due 10/25/2035 (b)		3,510	2,473
6.000% due 06/25/2037 (b)		3,266	1,298
JPMorgan Resecuritization Trust			
3.968% due 02/26/2037		1,850	1,657
Kentmere No.2 PLC			
0.000% due 01/28/2042	GBP	11,939	4,273
5.987% due 01/28/2042		40,807	49,412
6.587% due 01/28/2042		5,693	6,702
6.937% due 01/28/2042		4,066	4,778
7.387% due 01/28/2042		2,439	2,862
8.187% due 01/28/2042		1,626	1,908
10.187% due 01/28/2042		3,252	3,729
Kinbane DAC			
4.711% due 09/25/2062	EUR	53,317	55,976
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			
4.145% due 06/15/2045		2,557	2,557
Legacy Mortgage Asset Trust			
0.000% due 09/25/2059	$	18,019	5,150
0.000% due 09/25/2059 (h)		582,847	2,313
3.000% due 09/25/2059		93,500	85,921
4.151% due 09/25/2059		129,610	83,697
5.750% due 03/25/2060		30,590	30,000
6.250% due 05/25/2060		9,950	9,873
7.191% due 01/28/2070		14,554	14,570
7.250% due 11/25/2059		8,626	8,596
Lehman XS Trust			
5.639% due 02/25/2037 (b)		11,956	10,452
5.819% due 09/25/2036		4,609	3,649
5.819% due 12/25/2036		11,465	8,177
5.839% due 06/25/2046		9,022	7,373
5.959% due 02/25/2047		20,849	18,287
6.500% due 06/25/2046		4,527	3,527
7.139% due 10/25/2037		12,652	11,250
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5.819% due 02/25/2036		23,058	17,770
5.819% due 03/25/2046		32,775	11,617
LUXE Trust			
7.204% due 10/15/2038		1,710	1,674
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
8.689% due 03/25/2032		303	303
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3.849% due 04/25/2034		1	1
6.000% due 12/25/2046		7,328	6,538

	額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
Mastr Asset-Backed Securities Trust		
5.879% due 11/25/2036	24	14
5.994% due 01/25/2036	7,500	6,603
6.589% due 08/25/2037	14,253	11,589
Mastr Specialized Loan Trust		
6.159% due 02/25/2036	5,379	3,995
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust		
8.439% due 10/25/2037	13,130	12,180
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
4.926% due 02/25/2033	7	7
5.719% due 05/25/2037	18,801	9,287
5.719% due 10/25/2037	53,882	7,909
6.159% due 07/25/2034	4,729	4,058
6.234% due 09/25/2035	665	659
6.519% due 10/25/2035	518	508
MFA Trust		
6.775% due 10/25/2058	5,073	5,048
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust		
5.689% due 07/25/2036	4,737	4,004
5.699% due 02/25/2037	7,251	3,360
5.739% due 07/25/2036	44,061	15,856
5.919% due 06/25/2036	19,511	16,327
5.939% due 07/25/2036	43,845	15,776
5.979% due 03/25/2036	4,101	3,866
6.174% due 07/25/2035	4,929	4,727
6.439% due 03/25/2033	65	63
6.439% due 07/25/2037	253	245
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
0.771% due 11/15/2052 (h)	129,113	2,858
Morgan Stanley Capital I Trust		
2.428% due 04/05/2042	13,500	9,709
7.032% due 08/15/2033	2,619	1,506
7.827% due 12/15/2038	21,942	20,713
8.526% due 12/15/2038	40,574	37,466
Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust		
5.979% due 02/25/2036 (b)	18,224	15,765
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
5.949% due 02/25/2036	14,415	12,698
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust		
5.899% due 07/25/2036	9,969	3,961
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
3.275% due 11/25/2037	1,208	781
6.000% due 12/25/2035 (b)	480	184
Morgan Stanley Reremic Trust		
5.754% due 11/26/2036	5,003	4,135
Mortgage Loan Trust		
5.370% due 03/25/2034	3,310	2,981
MortgageIT Trust		
7.014% due 08/25/2035	299	274
MTN Commercial Mortgage Trust		
6.737% due 03/15/2039	1,120	1,097

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust			
3.790% due 11/15/2032		1,700	1,023
3.821% due 02/15/2039		2,900	2,531
New Century Home Equity Loan Trust			
6.564% due 10/25/2033		157	153
New York Mortgage Trust			
5.979% due 04/25/2035		565	522
Newgate Funding PLC			
5.741% due 12/15/2050	GBP	15,345	17,740
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust			
5.034% due 05/25/2035 (b)	$	2,780	1,356
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
6.204% due 05/25/2035		6,036	5,838
6.245% due 10/25/2036 (b)		21,460	4,846
Nomura Resecuritization Trust			
1.952% due 03/26/2037		5,464	4,442
NovaStar Mortgage Funding Trust			
5.639% due 09/25/2037		15,625	14,955
5.759% due 05/25/2036		4,708	4,565
5.759% due 10/25/2036		5,312	2,721
6.159% due 10/25/2035		848	835
NYO Commercial Mortgage Trust			
7.444% due 11/15/2038		30,130	22,865
7.994% due 11/15/2038		14,400	9,491
OBX Trust			
6.319% due 01/25/2062		10,517	10,413
6.520% due 07/25/2063		7,550	7,499
Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.189% due 07/25/2035		5,051	5,036
Option One Mortgage Loan Trust			
5.539% due 02/25/2037		17,611	8,665
5.559% due 03/25/2037		7,079	6,625
5.579% due 03/25/2037		33,857	27,990
5.719% due 07/25/2036		1,970	1,095
6.249% due 02/25/2035		3,416	2,606
Ownit Mortgage Loan Trust			
5.699% due 10/25/2037		3,641	3,411
5.759% due 10/25/2037		2,501	2,351
5.819% due 07/25/2037		2,795	2,790
5.979% due 03/25/2037		6,225	5,807
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.174% due 09/25/2035		3,376	3,218
6.219% due 09/25/2035 (b)		25,075	21,014
6.909% due 01/25/2035 (b)		2,000	1,445
7.464% due 12/25/2034		25,974	22,618
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
5.599% due 09/25/2036		26,232	4,993
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust			
3.437% due 11/25/2035		17,970	15,256
3.556% due 07/25/2035 (b)		9,601	6,979
5.749% due 11/25/2036 (b)		15,325	12,011

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Precise Mortgage Funding PLC			
0.000% due 12/12/2055	GBP	0	250
PRET LLC			
1.843% due 09/25/2051	$	36,709	33,071
8.232% due 09/25/2053		17,191	17,153
Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
8.497% due 10/25/2053 (d)		16,040	16,040
Prime Mortgage Trust			
6.000% due 04/25/2037		3,713	2,807
PRKCM Trust			
6.584% due 09/25/2058		9,307	9,248
PRPM LLC			
1.793% due 07/25/2026		8,562	8,006
PRPM Trust			
6.250% due 08/25/2068		8,200	8,072
Quest Trust			
6.864% due 03/25/2035		1,327	1,314
RAAC Trust			
6.144% due 02/25/2036 (b)		8,360	7,682
6.189% due 06/25/2047		21,346	14,966
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000% due 01/25/2037 (b)		2	1
Real Estate Asset Liquidity Trust			
2.419% due 06/12/2054	CAD	1,194	854
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5.612% due 04/25/2037	$	10,124	2,724
5.675% due 06/25/2037 (b)		3,910	1,006
6.159% due 11/25/2034		167	142
6.439% due 09/25/2037		33	27
Residential Accredit Securities Corporation Trust			
5.268% due 04/25/2034		1,162	1,012
5.659% due 02/25/2037		20,256	19,003
5.739% due 01/25/2037		36,046	25,552
5.934% due 04/25/2036		5,478	5,341
6.054% due 03/25/2036		6,180	5,538
6.414% due 09/25/2035		5,649	5,444
6.474% due 08/25/2035		2,060	1,998
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5.789% due 10/25/2036		14,675	13,617
6.039% due 02/25/2036		1,063	1,048
6.114% due 11/25/2035		8,981	8,664
6.119% due 12/25/2035		9,964	8,431
6.189% due 09/25/2035		7,021	6,784
Residential Mortgage Acceptance Corporation No.3 PLC			
0.000% due 02/15/2047	GBP	26,100	31,720
RESIMAC Bastille Trust			
6.372% due 09/05/2057	$	598	598
RMAC Securities No.1 PLC			
4.230% due 06/12/2044	EUR	3,720	3,674

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Saxon Asset Securities Trust			
1.922% due 03/25/2035 (b)	$	367	347
7.189% due 12/25/2037		2,648	2,411
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5.979% due 03/25/2036		4,673	4,021
6.264% due 10/25/2035		10,136	9,109
6.489% due 03/25/2035		5,127	4,906
Sequoia Mortgage Trust			
5.854% due 05/20/2035		1,008	859
5.974% due 06/20/2034		19	17
Sestante Finance Srl			
4.222% due 07/23/2046	EUR	7,845	7,837
SFO Commercial Mortgage Trust			
7.848% due 05/15/2038	$	885	687
8.348% due 05/15/2038		22,000	16,501
SG Mortgage Securities Trust			
5.799% due 02/25/2036		4,682	2,334
5.899% due 07/25/2036		8,095	1,698
Shamrock Residential DAC			
4.713% due 01/24/2061	EUR	19,491	20,446
5.113% due 02/24/2071		24,604	25,942
Soundview Home Loan Trust			
4.154% due 04/25/2035	$	2,319	2,127
5.859% due 06/25/2036 (b)		7,815	6,085
5.904% due 06/25/2036 (b)		49,916	39,853
5.919% due 07/25/2036		24,020	20,383
6.414% due 03/25/2036		8,102	7,004
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
6.414% due 12/25/2035		567	553
SREIT Trust			
6.893% due 10/15/2038		24,605	23,869
7.241% due 10/15/2038		20,425	19,743
Stratton Mortgage Funding PLC			
7.299% due 09/25/2051	GBP	2,000	2,406
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4.097% due 06/25/2037	$	1,507	1,352
5.041% due 07/25/2035 (b)		1,993	900
5.759% due 10/25/2035		5,328	4,757
6.200% due 05/25/2035 (b)		53	37
6.414% due 08/25/2035		8,667	7,332
Structured Asset Investment Loan Trust			
5.739% due 06/25/2036		5,118	4,683
5.939% due 06/25/2036		25,000	8,293
6.159% due 04/25/2035		3,571	3,451
6.239% due 02/25/2034		12,178	11,773
6.639% due 12/25/2034		2,200	2,164
Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
5.859% due 09/25/2047 (b)		18,876	15,170
5.879% due 05/25/2036		9,371	7,179

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
6.123% due 04/19/2035		1,318	1,209
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
6.108% due 09/19/2032		12	12
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
5.569% due 05/25/2036		5,123	4,851
5.689% due 05/25/2036		3,418	2,728
5.729% due 07/25/2036 (b)		9,526	8,821
5.749% due 07/25/2036		14,180	13,778
5.759% due 10/25/2036		8,263	5,536
5.939% due 04/25/2031		5,841	5,780
6.369% due 11/25/2035		3,185	3,175
Summerhill Residential			
0.000% due 03/24/2059	EUR	5	3
4.713% due 03/24/2059		121,196	127,947
5.113% due 03/24/2059		22,011	23,224
5.663% due 03/24/2059		17,746	18,718
6.263% due 03/24/2059		14,202	14,946
6.500% due 03/24/2059		6,568	5,181
7.000% due 03/24/2059		35,506	29,385
7.513% due 03/24/2059		8,521	8,960
8.863% due 03/24/2059		4,256	4,475
9.863% due 03/24/2059		4,256	4,475
Temple Quay No.1 PLC			
6.689% due 07/24/2085	GBP	58,277	70,553
7.189% due 07/24/2085		15,904	19,093
8.189% due 07/24/2085		14,681	17,627
Terwin Mortgage Trust			
6.819% due 03/25/2035	$	2,943	2,706
Tharaldson Hotel Portfolio Trust			
7.750% due 11/11/2034		4,718	4,606
Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC			
8.261% due 02/20/2054	GBP	16,900	20,505
Towd Point Mortgage Trust			
3.750% due 03/25/2058	$	3,080	2,987
3.750% due 09/25/2062		91,538	81,578
Truman Capital Mortgage Loan Trust			
5.699% due 03/25/2036		491	485
Verus Securitization Trust			
4.474% due 04/25/2067		29,167	27,139
5.811% due 05/25/2068		14,703	14,434
5.999% due 02/25/2068		4,974	4,897
6.443% due 08/25/2068		7,096	7,038
6.665% due 09/25/2068		19,177	19,038
Visio Trust			
6.598% due 10/25/2058		4,640	4,609
Wachovia Mortgage Loan Trust			
6.129% due 10/25/2035		2,862	2,490
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6.159% due 01/25/2045		360	312
6.354% due 08/25/2045		3,143	2,557

		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC			
0.000% due 12/21/2049	GBP	1	3,768
6.151% due 12/21/2049		21,173	25,727
6.870% due 12/21/2049		4,921	5,914
7.370% due 12/21/2049		2,460	2,940
7.870% due 12/21/2049		1,406	1,675
8.370% due 12/21/2049		1,406	1,648
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (b)			
5.500% due 11/25/2035	$	58	48
5.650% due 10/25/2046		9,705	7,646
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5.859% due 03/25/2037		658	638
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6.039% due 04/25/2034		3,311	3,150
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
6.389% due 10/25/2036 (b)		145	122
WFRBS Commercial Mortgage Trust			
0.481% due 03/15/2047 (h)		8,800	13
WSTN Trust			
6.297% due 07/05/2037		6,000	5,772
モーゲージ担保証券合計 **(取得原価 $4,663,284)**			**4,187,952**
資産担保証券 7.5%			
AASET Trust			
3.967% due 05/16/2042		23	20
ACHV ABS TRUST			
6.600% due 08/19/2030		525	525
AGL CLO 6 Ltd.			
6.877% due 07/20/2034		3,000	2,979
ALESCO Preferred Funding XI Ltd.			
6.112% due 12/23/2036		5,000	3,925
American Homes 4 Rent Trust			
6.231% due 10/17/2036		1,150	1,141
Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			
7.185% due 05/15/2037		3,146	3,095
AREIT LLC			
7.447% due 02/17/2028		2,900	2,901
Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion			
5.683% due 02/28/2032	EUR	1,411	1,472
Barings CLO Ltd.			
6.747% due 01/20/2032	$	14,700	14,590
BlueMountain CLO XXII Ltd.			
6.735% due 07/15/2031		3,863	3,855
BPCRE Ltd.			
7.735% due 01/16/2037		13,800	13,706
8.435% due 01/16/2037		3,468	3,442
9.135% due 01/16/2037		13,516	13,433

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6.699% due 07/27/2031		5,612	5,590
6.757% due 01/20/2032		12,400	12,330
Carlyle U.S. CLO Ltd.			
6.815% due 10/15/2035		19,200	19,095
Carvana Auto Receivables Trust			
5.710% due 07/10/2029		2,500	2,455
6.090% due 11/10/2026		2,445	2,442
Castlelake Aircraft Securitization Trust			
4.125% due 06/15/2043		1,112	1,012
Cedar Funding VII CLO Ltd.			
6.677% due 01/20/2031		2,357	2,353
CIFC Funding I Ltd.			
6.684% due 04/23/2029		5,130	5,109
CIFC Funding III Ltd.			
6.795% due 07/15/2036		12,000	11,930
6.874% due 10/22/2031		2,640	2,639
Cologix Canadian Issuer LP			
4.940% due 01/25/2052	CAD	1,800	1,174
CPS Auto Receivables Trust			
5.380% due 01/18/2028	$	1,000	982
6.040% due 07/16/2029		2,100	2,057
6.130% due 09/15/2026		13,341	13,381
Dewolf Park CLO Ltd.			
6.575% due 10/15/2030		3,617	3,608
Diamond Infrastructure Funding LLC			
1.760% due 04/15/2049		900	768
Elmwood CLO VIII Ltd.			
6.917% due 01/20/2034		6,600	6,574
FAB CBO BV			
4.941% due 08/20/2080 (b)	EUR	52	54
Finance of America Structured Securities Trust			
2.000% due 04/25/2073	$	5,198	5,016
3.000% due 09/25/2061		14,495	13,399
Galaxy Xxviii CLO Ltd.			
6.755% due 07/15/2031		9,809	9,770
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.			
5.000% due 03/12/2038	CAD	8,182	4,981
Goldentree Loan Management U.S. CLO 6 Ltd.			
6.736% due 04/20/2035	$	1,700	1,685
Goodgreen			
3.930% due 10/15/2053		4,058	3,693
Goodleap Sustainable Home Solutions Trust			
6.500% due 07/20/2055		877	854
Harley Marine Financing LLC			
6.682% due 05/15/2043		4,742	4,446
Humboldt Americas LLC			
0.000% due 10/31/2031	COP	62,570,000	14,021
KKR CLO 18 Ltd.			
6.597% due 07/18/2030	$	1,335	1,331

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
LCM XVII LP			
6.785% due 10/15/2031		33,700	33,579
LoanCore Issuer Ltd.			
6.749% due 07/15/2036		2,350	2,321
6.749% due 11/15/2038		19,100	18,624
Lockwood Grove CLO Ltd.			
6.810% due 01/25/2030		3,484	3,487
Magnetite XV Ltd.			
6.650% due 07/25/2031		30,132	30,034
MAN Euro CLO DAC			
TBD% due 10/15/2036 (d)	EUR	20,000	21,140
METAL LLC			
4.581% due 10/15/2042	$	10,563	6,510
MF1 LLC			
7.484% due 06/19/2037		22,100	22,080
7.969% due 09/17/2037		9,600	9,660
7.984% due 06/19/2037		8,236	8,215
MKS CLO Ltd.			
6.867% due 01/20/2031		13,039	13,047
MMcapS Funding XVII Ltd.			
6.021% due 12/01/2035		518	495
Nassau Ltd.			
6.805% due 07/15/2031		3,836	3,821
National Collegiate Student Loan Trust			
5.792% due 10/25/2033		2,336	2,301
Navient Private Education Loan Trust			
6.349% due 11/15/2068		1,194	1,181
7.599% due 12/15/2045		2,087	2,098
Nelnet Student Loan Trust			
6.235% due 09/25/2065		2,128	2,113
6.640% due 02/20/2041		6,296	6,230
Octagon Investment Partners 33 Ltd.			
6.867% due 01/20/2031		9,874	9,864
Octagon Loan Funding Ltd.			
6.821% due 11/18/2031		395	395
Pagaya AI Debt Trust			
7.179% due 04/15/2031		13,040	13,051
7.600% due 12/16/2030		5,506	5,523
7.625% due 04/15/2031		3,300	3,297
Palmer Square CLO Ltd.			
6.963% due 10/20/2033		23,100	23,096
Palmer Square European Loan Funding DAC			
TBD% due 05/15/2033 (d)	EUR	9,200	9,724
Rad CLO 1 Ltd.			
6.635% due 07/15/2031	$	11,124	11,100
Rockford Tower Europe CLO DAC			
4.933% due 12/20/2031	EUR	11,755	12,268
Sapphire Aviation Finance I Ltd.			
4.250% due 03/15/2040	$	9,365	7,822

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Saranac CLO III Ltd.			
7.258% due 06/22/2030		16,400	16,425
Saratoga Investment Corp. CLO Ltd.			
7.238% due 04/20/2033		15,000	14,928
SMB Private Education Loan Trust			
TBD% due 09/15/2053 (d)		20,504	20,585
0.000% due 02/16/2055		3	4,060
3.940% due 02/16/2055		20,138	18,587
4.550% due 02/16/2055		8,414	7,672
4.950% due 02/16/2055		2,185	1,944
5.950% due 02/16/2055		3,907	3,626
6.150% due 09/15/2053 (d)		12,645	12,695
6.770% due 02/16/2055		20,138	19,997
6.930% due 09/15/2053 (d)		5,933	5,956
7.540% due 09/15/2053 (d)		1,205	1,210
8.870% due 09/15/2053 (d)		2,505	2,513
Sound Point CLO XV Ltd.			
6.574% due 01/23/2029		318	319
Sound Point CLO XVIII Ltd.			
6.797% due 01/21/2031		5,111	5,082
Sound Point Euro CLO IV Funding DAC			
5.065% due 01/15/2035	EUR	20,000	20,829
Symphony CLO 39 Ltd.			
7.002% due 04/25/2034	$	24,800	24,799
Taberna Preferred Funding I Ltd.			
6.146% due 07/05/2035		3,045	2,771
Theorem Funding Trust			
6.060% due 12/15/2028		4,304	4,268
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
4.212% due 05/17/2032		326	302
TRESTLES CLO V Ltd.			
6.847% due 10/20/2034		8,025	7,941
Tropic CDO V Ltd.			
5.975% due 07/15/2036		10,163	9,400
TRTX Issuer Ltd.			
6.971% due 02/15/2039		4,500	4,382
TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
6.826% due 03/30/2039		17,495	16,926
7.229% due 09/20/2039		2,626	2,540
Upstart Pass-Through Trust			
3.800% due 04/20/2030		15,609	15,014
Upstart Securitization Trust			
5.500% due 06/20/2032		6,632	6,469
Venture 39 CLO Ltd.			
6.935% due 04/15/2033		4,600	4,569
Venture XVII CLO Ltd.			
6.535% due 04/15/2027		10,245	10,197
資産担保証券合計			**766,915**
（取得原価 $785,820）			

		額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
ソブリン債 6.6%			
Argentina Government International Bond			
0.750% due 07/09/2030		66,427	17,871
1.000% due 07/09/2029		4,943	1,330
3.500% due 07/09/2041		58,125	15,285
3.625% due 07/09/2035		51,459	12,427
3.625% due 07/09/2046		1,035	258
4.250% due 01/09/2038		25,740	7,786
Argentine Bonos del Tesoro			
15.500% due 10/17/2026	ARS	49,200	12
Asian Development Bank			
4.700% due 03/12/2024	MXN	18,100	976
Australia Government Bond			
1.750% due 06/21/2051	AUD	38,100	11,753
Autonomous City of Buenos Aires Argentina			
119.035% due 02/22/2028	ARS	76,810	103
126.571% due 03/29/2024		62,559	79
Israel Government International Bond			
3.800% due 05/13/2060	$	17,000	10,475
4.500% due 04/03/2120		3,800	2,513
5.000% due 10/30/2026	EUR	119,500	126,171
Mexico Government International Bond (i)			
2.750% due 11/27/2031	MXN	1,229,193	56,573
3.000% due 12/03/2026		119,106	5,976
4.000% due 11/30/2028		685,870	35,408
Peru Government International Bond			
5.400% due 08/12/2034	PEN	862	188
6.150% due 08/12/2032		674	161
6.950% due 08/12/2031		150	38
Provincia de Buenos Aires			
128.738% due 04/12/2025	ARS	399,853	424
Romania Government International Bond			
1.750% due 07/13/2030	EUR	12,200	9,855
2.125% due 03/07/2028		1,100	1,012
2.875% due 04/13/2042		7,300	4,552
5.500% due 09/18/2028		7,400	7,793
6.375% due 09/18/2033		14,800	15,436
Russia Government International Bond			
4.250% due 06/23/2027	$	28,400	15,336
4.375% due 03/21/2029		200	100
4.750% due 05/27/2026		23,800	16,145
5.100% due 03/28/2035		3,200	1,136
5.250% due 06/23/2047		82,400	30,076
5.625% due 04/04/2042		37,000	24,884
5.875% due 09/16/2043		13,200	8,307
7.150% due 11/12/2025	RUB	4,002,466	17,537
7.500% due 03/31/2030	$	4,748	3,111
7.950% due 10/07/2026	RUB	1,564,954	6,146
South Africa Government International Bond			
10.500% due 12/21/2026	ZAR	2,032,400	111,719

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
State Agency of Roads of Ukraine			
6.250% due 06/24/2030	$	1,200	312
Turkey Government International Bond			
4.250% due 03/13/2025		17,980	17,229
5.250% due 03/13/2030		29,000	24,021
6.125% due 10/24/2028		10,100	9,169
7.625% due 04/26/2029		30,900	29,481
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S			
8.250% due 01/24/2024		3,000	3,009
Ukraine Government International Bond			
4.375% due 01/27/2032	EUR	1,658	402
7.750% due 09/01/2025	$	4,390	1,358
Venezuela Government International Bond (b)			
6.000% due 12/09/2049		3,367	523
7.000% due 03/31/2038		1,883	324
7.650% due 04/21/2025		5,349	947
7.750% due 04/13/2024		1,200	187
8.250% due 10/13/2024		5,991	1,053
9.000% due 05/07/2049		3,161	566
9.250% due 09/15/2027		4,274	813
9.250% due 05/07/2028		6,512	1,224
11.750% due 10/21/2026		680	134
11.950% due 08/05/2031		6,000	1,176
ソブリン債合計			**670,880**
（取得原価 $866,448）			

	株	
普通株式 0.7%		
Cairo Mezz PLC	847,444	94
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	5,821
Constellation Oil Services Holding S.A.	421,249	46
Corestate Capital Holding S.A.	2,742,788	0
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.	5,318,911	8,685
iHeartMedia, Inc. Class A	1,246,745	2,930
iHeartMedia, Inc. Class B	967,427	2,046
Intelsat S.A.	966,065	26,837
National Bank of Greece S.A.	102,570	587
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	151,112	19,868
Serta Simmons Bedding LLC	56	1
SSB Manufacturing Co.	56	1
Stearns Holdings LLC	110,747	0
UBS Group AG	26,741	628
Voyager Aviation Holdings LLC	616	0
WestMet Group Holdings LLC	8,915	42
Westmoreland Mining Holdings LLC	8,837	53
Windstream Holdings II LLC	226,019	4,705
普通株式合計		**72,344**
（取得原価 $163,628）		

	株	評価額 （単位：千）
商業用不動産持分 0.2%		
CBL & Associates Properties, Inc.	6	124
Uniti Group, Inc.	81	374
VICI Properties, Inc.	760	21,217
商業用不動産持分合計		**21,715**
（取得原価 $6,172）		
株式リンク債 0.0%		
Intelsat Jackson Holdings S.A.		
12/31/2049	211	1,963
株式リンク債合計		**1,963**
（取得原価 $0）		
ワラント 0.0%		
Intelsat S.A.		
02/17/2027	26	72
Stearns Holdings LLC		
12/31/2049	1	0
ワラント合計		**72**
（取得原価 $20,656）		
優先証券 0.0%		
Cayenne Aviation LLC		
9.500%	3,693	0
優先証券合計		**0**
（取得原価 $1,210）		

		額面金額 （単位：千）	
短期金融商品 5.0%			
定期預金 0.5%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.000% due 11/01/2023	AUD	764	484
3.850% due 11/01/2023	NZD	2	1
4.830% due 11/01/2023	$	1	1
Bank of Nova Scotia			
4.080% due 11/01/2023	CAD	543	391
4.830% due 11/01/2023	$	593	593
BNP Paribas Bank			
(0.370%) due 11/01/2023	¥	68	1
0.550% due 11/01/2023	CHF	16	17
3.000% due 11/01/2023	AUD	501	317
3.330% due 11/01/2023	NOK	12	1
3.850% due 11/01/2023	NZD	1	0
4.420% due 11/01/2023	GBP	1	1
6.430% due 11/01/2023	ZAR	10,398	555

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.370%) due 11/01/2023	¥	3,630	24
2.750% due 11/01/2023	DKK	3	1
3.100% due 11/01/2023	EUR	1	1
4.420% due 11/01/2023	GBP	23	28
4.830% due 11/01/2023	$	42	42
Citibank N.A.			
4.830% due 11/01/2023		2,499	2,499
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 11/01/2023		2,137	2,137
DnB Bank ASA			
2.990% due 11/01/2023	SEK	4	0
HSBC Bank PLC			
3.100% due 11/01/2023	EUR	1,097	1,159
4.420% due 11/01/2023	GBP	66	80
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 11/01/2023	$	4,550	4,550
MUFG Bank Ltd.			
(0.370%) due 11/01/2023	¥	38,019	251
Royal Bank of Canada			
4.830% due 11/01/2023	$	1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
(0.370%) due 11/01/2023	¥	234,359	1,548
3.100% due 11/01/2023	EUR	10,789	11,404
4.830% due 11/01/2023	$	253	253
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
(0.370%) due 11/01/2023	¥	927,721	6,126
3.100% due 11/01/2023	EUR	4,002	4,230
4.420% due 11/01/2023	GBP	3,526	4,279
4.830% due 11/01/2023	$	5,810	5,810
			46,785
アルゼンチン短期国債 0.1%			
(32.511%) due 05/20/2024 (k)	ARS	551,156	797
(17.783%) due 11/23/2023 (j)		4,688,282	8,139
			8,936

		額面金額 （単位：千）	評価額 （単位：千）
日本短期国債 (j) 4.4%			
(0.234%) due 01/15/2024	¥	34,990,000	231,136
(0.216%) due 01/22/2024		34,000,000	224,605
			455,741
短期金融商品合計 **（取得原価 $518,529）**			**511,462**
投資有価証券合計 (a) 148.7% **（取得原価 $16,679,350）**			**$ 15,268,043**
金融デリバティブ商品 0.0% **（取得原価またはプレミアム $19,837）**			**1,772**
その他の資産および負債 **(48.7%)**			**(5,000,688)**
純資産 100.0%			**$ 10,269,127**

投資有価証券明細表に対する注記

(a) 2023年10月31日現在の地域別投資有価証券の配分は、米国が純資産の112.9%、英国が純資産の7.1%、その他の国が純資産の28.7%である。
(b) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
(c) この金額の全部または一部は未実行ローン・コミットメントである。未実行部分の金利は実行時に決定される。
(d) 発行日前取引（When-Issued取引）証券
(e) 偶発転換証券
(f) 永久債：記載の日付（該当する場合）は次回の償還日である。
(g) 現物払い有価証券
(h) 有価証券はインタレスト・オンリー（「IO」）またはIOストリップである。
(i) 証券の元本がインフレ率に応じて調整される。
(j) クーポンは加重平均最終利回りである。
(k) クーポンは最終利回りである。

●制限付証券

2023年10月31日現在
単位：千

発行体	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	純資産に占める市場価格の割合
Constellation Oil Services Holding S.A.	N/A	N/A	06/10/2022	$ 46	$ 46	0.00%
Corestate Capital Holding S.A.	N/A	N/A	08/22/2023	0	0	0.00%
Deutsche Bank AG	2.129%	11/24/2026	01/11/2023	1,094	1,084	0.01%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/21/2021	715	522	0.01%
Intelsat S.A.	N/A	N/A	08/02/2018	75,855	26,837	0.26%
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	N/A	N/A	09/25/2020	4,866	19,869	0.19%
Serta Simmons Bedding LLC	N/A	N/A	06/29/2023	94	1	0.00%
SSB Manufacturing Co.	N/A	N/A	06/29/2023	94	1	0.00%
WestMet Group Holdings LLC	N/A	N/A	07/03/2023	59	42	0.00%
Westmoreland Mining Holdings LLC	N/A	N/A	03/26/2019	44	53	0.00%
制限付証券合計				**$ 82,867**	**$ 48,455**	**0.47%**

◎借入およびその他の金融取引

2023年10月31日現在

●リバース・レポ取引

単位：千

取引相手	借入金利[1]	借入日	満期日	借入額[1]	リバース・レポ取引に係る未払金
BOS	3.500%	10/23/2023	11/03/2023	$ (833)	$ (834)
BOS	5.390%	10/20/2023	11/02/2023	(16,638)	(16,668)
BOS	5.390%	10/30/2023	11/03/2023	(1,943)	(1,943)
BOS	5.400%	10/24/2023	11/07/2023	(15,282)	(15,300)
BOS	5.410%	10/23/2023	11/06/2023	(1,871)	(1,874)
BOS	5.420%	10/31/2023	11/07/2023	(97,814)	(97,829)
DEU	5.400%	10/19/2023	11/02/2023	(110,599)	(110,814)
DEU	5.420%	10/31/2023	11/07/2023	(1,874)	(1,875)
GRE	5.410%	10/24/2023	11/07/2023	(53,897)	(53,961)
JML	4.500%	09/22/2023	11/03/2023	(514)	(517)
JPS	5.000%	10/31/2023	11/03/2023	(1,118)	(1,118)
JPS	5.380%	10/31/2023	11/01/2023	(30,758)	(30,763)
リバース・レポ取引合計					**$ (333,496)**

●セールバイバック取引

単位：千

取引相手	借入金利[1]	借入日	満期日	借入額[1]	セールバイバック取引に係る未払金[2]
BPS	5.490%	10/27/2023	11/02/2023	$ (60,544)	$ (60,590)
セールバイバック取引合計					**$ (60,590)**

●担保付借入として会計処理される取引

単位：千

	翌日物および継続	取引の契約上の残存期間 30日以下	取引の契約上の残存期間 31−90日	取引の契約上の残存期間 90日超	合計
リバース・レポ取引					
Non - U.S. Corporate Debt	$ 0	$ (516)	$ 0	$ 0	$ (516)
U.S. Corporate Debt	0	(1,952)	0	0	(1,952)
U.S. Government Debt	(30,763)	(300,265)	0	0	(331,028)
リバース・レポ取引合計	**$ (30,763)**	**$ (302,733)**	**$ 0**	**$ 0**	**$ (333,496)**
セールバイバック取引					
U.S. Government Debt	$ 0	$ (60,590)	$ 0	$ 0	$ (60,590)
セールバイバック取引合計	**$ 0**	**$ (60,590)**	**$ 0**	**$ 0**	**$ (60,590)**
借入合計	**$ (30,763)**	**$ (363,323)**	**$ 0**	**$ 0**	**$ (394,086)**
リバース・レポ取引およびセールバイバック取引に係る未払金					**$ (394,086)**

●売建有価証券

単位：千

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本金額	受取金	売建有価証券に係る未払金
BCY	Fannie Mae, TBA	3.000%	11/01/2053	$ 6,600	$ (5,296)	$ (5,282)
GSC	Fannie Mae, TBA	3.000%	11/01/2053	5,900	(4,715)	(4,721)
SAL	Fannie Mae, TBA	3.000%	11/01/2053	6,200	(4,966)	(4,962)
売建有価証券合計（0.1%）					**$ (14,977)**	**$ (14,965)**

[1] 2023年10月31日に終了した期間の借入平均残高は$16,571で、加重平均金利は5.176%であった。平均借入には、期中に保有されていた場合、セールバイバック取引およびリバース・レポ契約が含まれる可能性がある。

[2] セールバイバック取引に係る未払金には価格下落の繰延処理額$6が含まれる。

◎上場金融デリバティブ商品

2023年10月31日現在

●売建オプション
取引所先物契約に係るオプション

単位:千(契約数を除く)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム(受取額)	市場価格
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	$ 96.125	12/15/2023	263	$ (486)	$ (5)
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.375	12/15/2023	395	(823)	(5)
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	98.000	12/15/2023	417	(339)	(3)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.125	12/15/2023	203	(390)	(795)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.375	12/15/2023	54	(115)	(245)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.500	12/15/2023	4	(4)	(19)
売建オプション合計				**$ (2,157)**	**$ (1,072)**

●先物契約

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
3-Month SOFR December Futures	Long	03/2024	405	$ (1,834)	$ 0	$ (10)
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2025	212	1,268	21	0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2026	229	1,143	17	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2024	266	1,838	30	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2025	216	1,117	16	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2024	354	2,506	27	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2025	193	1,065	17	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2026	215	1,065	13	0
3-Month SOFR September Futures	Long	12/2023	658	(2,402)	4	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2024	247	1,601	28	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2025	175	875	13	0
Australia Government 10-Year Bond December Futures	Short	12/2023	694	2,965	417	0
Euro -Bund 10-Year Bond December Futures	Long	12/2023	284	(866)	102	0
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2023	131	(98)	0	(13)
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2023	6,136	(11,722)	0	(1,055)
U.S. Treasury 20-Year Bond December Futures	Short	12/2023	608	6,292	209	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note December Futures	Long	12/2023	3	(19)	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures	Short	12/2023	32	508	24	0
先物契約合計				**$ 5,302**	**$ 938**	**$ (1,079)**

●スワップ契約

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

単位：千

参照債務	受取固定金利	満期日	2023/10/31時点の信用スプレッド(2)		想定元本(3)	市場価格	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
Airbus SE	1.000%	06/20/2028	0.769%	EUR	600	$ 7	$ (7)	$ 0	$ (1)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2024	0.544%	$	18,700	75	74	1	0
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2025	0.772%		200	2	(1)	0	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2028	1.001%		2,600	3	28	0	0
Barclays Bank PLC	1.000%	12/20/2023	0.610%	EUR	7,200	13	4	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2024	0.443%	$	4,300	31	71	1	0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2025	0.552%		3,100	25	69	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2025	0.610%		3,100	29	79	1	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2024	0.863%		700	23	(4)	1	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2024	1.013%		5,500	274	(205)	10	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2025	1.194%		1,100	72	22	2	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2025	1.290%		8,400	673	346	35	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2026	1.505%		100	9	5	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2027	1.902%		100	10	5	1	0
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.194%		17,200	39	(45)	0	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2025	1.009%	EUR	13,400	14	852	0	(32)
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2026	1.460%		3,800	(42)	264	37	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2026	1.675%		26,300	(515)	729	181	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2024	0.684%	$	8,300	39	15	0	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2026	0.838%		2,500	14	(42)	1	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	06/20/2028	1.009%		8,000	7	19	1	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2028	1.060%		2,000	(3)	2	1	0
						$ 799	$ 2,280	$ 273	$ (33)

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

単位：千

インデックス／トランシェ	受取固定金利	満期日		想定元本(3)	市場価格(4)	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
CDX.EM-30 Index	1.000%	12/20/2023	$	35,445	$ 73	$ 1,174	$ 1	$ 0
CDX.EM-31 Index	1.000%	06/20/2024		19,350	116	867	25	0
CDX.EM-32 Index	1.000%	12/20/2024		8,670	54	419	11	0
CDX.EM-34 Index	1.000%	12/20/2025		46,828	(1,614)	76	93	0
CDX.EM-35 Index	1.000%	06/20/2026		92	(2)	1	0	0
CDX.EM-36 Index	1.000%	12/20/2026		100,464	(1,991)	2,467	217	0
CDX.EM-37 Index	1.000%	06/20/2027		1,372	(44)	69	3	0
CDX.EM-38 Index	1.000%	12/20/2027		11,900	(441)	568	24	0
CDX.EM-39 Index	1.000%	06/20/2028		6,000	(258)	151	10	0
CDX.EM-40 Index	1.000%	12/20/2028		59,300	(3,174)	(227)	116	0
CDX.HY-34 Index	5.000%	06/20/2025		3,060	94	(16)	6	0
CDX.HY-35 Index	5.000%	12/20/2025		980	35	(51)	3	0
CDX.HY-36 Index	5.000%	06/20/2026		58,898	1,994	(3,554)	179	0
CDX.HY-37 Index	5.000%	12/20/2026		12,936	438	(284)	41	0
CDX.HY-38 Index	5.000%	06/20/2027		2,842	70	85	22	0
CDX.HY-39 Index	5.000%	12/20/2027		7,029	96	174	8	0
CDX.HY-40 Index	5.000%	06/20/2028		300	3	(5)	1	0
CDX.HY-41 Index	5.000%	12/20/2028		100,800	(37)	(621)	291	0
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2026		300	4	(3)	0	0
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2027		1,000	14	6	1	0
CDX.IG-39 Index	1.000%	12/20/2027		400	5	0	0	0
CDX.IG-40 Index	1.000%	06/20/2028		2,600	31	(7)	2	0
CDX.IG-41 Index	1.000%	12/20/2028		238,200	2,467	(539)	189	0
iTraxx Europe Series 33 Index	1.000%	06/20/2025	EUR	16,540	206	(174)	0	(18)
					$ (1,861)	$ 576	$ 1,243	$ (18)

金利スワップ

単位：千

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本		市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
								資産	負債
支払	3-Month EURIBOR	2.100%	04/11/2024	EUR	71,800	$ 55	$ 55	$ 694	$ 0
支払	3-Month EURIBOR	2.100%	04/13/2024		108,200	82	82	29	0
支払	3-Month EURIBOR	2.250%	04/26/2024		70,000	176	176	19	0
支払	3-Month EURIBOR	2.250%	04/28/2024		65,600	175	175	17	0
支払	3-Month EURIBOR	2.250%	05/03/2024		69,500	(519)	(519)	13	0
支払	3-Month EURIBOR	2.100%	05/17/2024		63,400	(578)	(578)	14	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.410%	07/31/2028	ZAR	37,200	(15)	(15)	4	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.415%	07/31/2028		29,700	(11)	(11)	3	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.420%	07/31/2028		111,200	(41)	(41)	13	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.428%	07/31/2028		74,100	(26)	(26)	8	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.426%	08/01/2028		44,900	(16)	(16)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.460%	08/01/2028		75,900	(22)	(22)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.460%	08/02/2028		76,900	(22)	(22)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.464%	08/02/2028		77,100	(22)	(22)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.550%	08/03/2028		82,900	(8)	(8)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.380%	08/04/2028		39,800	(19)	(19)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.410%	08/04/2028		96,000	(39)	(39)	11	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.415%	08/04/2028		39,800	(16)	(16)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.421%	08/04/2028		40,700	(15)	(15)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.543%	08/04/2028		40,600	(4)	(4)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.360%	08/07/2028		76,600	(40)	(40)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.400%	08/07/2028		76,600	(33)	(33)	9	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.410%	08/07/2028		22,600	(9)	(9)	2	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	06/18/2024	AUD	28,000	2	(3,284)	0	(273)
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2024		39,200	(564)	(3,573)	0	(262)
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	12/17/2024		41,400	(212)	(4,828)	0	(395)
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025		38,850	(626)	(4,218)	0	(321)
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.750%	06/17/2026		3,870	(142)	(422)	0	(29)
支払	6-Month Australian Bank Bill	3.000%	03/21/2027		313,890	(11,395)	(39,719)	0	(2,806)
受取	6-Month EURIBOR	(0.453%)	12/29/2023	EUR	4,300	111	111	0	(2)
受取	6-Month EURIBOR	(0.425%)	06/28/2024		4,200	195	195	0	(2)
支払	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024		21,000	(754)	(754)	9	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.395%)	12/30/2024		1,900	130	130	0	(2)
受取	6-Month EURIBOR	(0.363%)	06/30/2025		3,500	292	292	0	(3)
受取	6-Month EURIBOR	(0.329%)	12/30/2025		2,300	232	232	0	(3)
受取	6-Month EURIBOR	(0.294%)	06/30/2026		1,100	125	125	0	(2)
支払	6-Month EURIBOR	1.000%	05/13/2027		56,700	(5,296)	(5,296)	91	0
支払	6-Month EURIBOR	3.370%	10/09/2028		21,800	105	105	46	0
支払	6-Month EURIBOR	3.450%	10/20/2028		20,300	180	180	42	0
受取	6-Month EURIBOR	(0.150%)	03/18/2030		123,000	25,997	22,436	0	(482)
受取	6-Month EURIBOR	0.150%	06/17/2030		26,800	5,583	5,602	0	(64)
支払	6-Month EURIBOR	2.000%	09/21/2032		194,130	(21,119)	(23,932)	616	0
支払	6-Month EURIBOR	2.547%	03/09/2033		46,800	(2,517)	(2,517)	127	0
支払	6-Month EURIBOR	3.270%	08/21/2033		12,000	(86)	(86)	34	0
受取(5)	6-Month EURIBOR	3.000%	03/20/2034		229,900	6,431	4,026	0	(675)
受取	6-Month EURIBOR	0.250%	03/18/2050		37,600	20,715	17,703	0	(265)
受取(5)	6-Month EURIBOR	0.830%	12/09/2052		186,200	14,708	13,606	0	(94)
支払	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.176%	04/27/2027	¥	3,890,000	(287)	(287)	0	(51)
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	(0.020%)	09/20/2028		67,650,000	16,757	15,171	909	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.000%	03/15/2029		75,360,000	21,332	20,588	1,456	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.400%	06/15/2032		6,300,000	2,263	2,254	207	0

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本		市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
								資産	負債
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042		3,350,000	4,005	2,983	35	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.711%	04/27/2042		1,020,000	994	994	59	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.140%	01/02/2025	BRL	4,400	(24)	(24)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.160%	01/02/2025		2,900	(15)	(15)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/02/2025		3,600	(16)	(16)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.000%	01/02/2025		9,800	(15)	(15)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.080%	01/02/2025		16,300	(18)	(18)	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.140%	01/02/2025		8,200	(7)	(7)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.145%	01/02/2025		8,000	(7)	(7)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.160%	01/02/2025		16,400	(13)	(13)	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	9.840%	01/02/2026		76,500	(371)	(371)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	9.865%	01/02/2026		38,600	(183)	(183)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	9.905%	01/02/2026		58,200	(266)	(266)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.018%	01/02/2026		145,800	(615)	(615)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.050%	01/02/2026		144,700	(596)	(596)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.070%	01/02/2026		143,400	(587)	(587)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.961%	01/04/2027		107,700	(645)	(645)	0	(4)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.000%	01/04/2027		26,000	(150)	(150)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.004%	01/04/2027		118,400	(689)	(689)	0	(4)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.053%	01/04/2027		223,400	(1,257)	(1,257)	0	(8)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.101%	01/04/2027		55,600	(302)	(302)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.220%	01/04/2027		5,300	(21)	(21)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.245%	01/04/2027		2,700	(10)	(10)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.260%	01/04/2027		2,700	(10)	(10)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.700%	01/04/2027		1,400	(1)	(1)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.715%	01/04/2027		5,900	(5)	(5)	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.870%	01/04/2027		14,100	1	1	0	(1)
支払(5)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.750%	12/20/2025	CAD	160,300	(1,849)	876	115	0
受取	IBMEXID	8.675%	04/03/2024	MXN	851,700	617	617	0	(1)
受取	IBMEXID	8.660%	04/04/2024		352,700	257	257	0	(1)
受取	IBMEXID	8.750%	04/05/2024		265,800	187	187	0	0
支払	IBMEXID	5.980%	08/26/2024		11,300	(28)	(17)	0	0
支払	IBMEXID	7.670%	03/05/2025		662,400	(1,652)	(426)	0	(45)
支払	IBMEXID	7.710%	03/07/2025		435,800	(1,071)	(2,400)	128	0
支払	IBMEXID	7.715%	03/07/2025		433,300	(1,064)	(2,390)	127	0
支払	IBMEXID	7.570%	03/18/2025		612,000	(1,547)	(3,091)	288	0
支払	IBMEXID	5.160%	06/06/2025		39,200	(187)	(187)	1	0
支払	IBMEXID	5.950%	01/30/2026		104,300	(547)	(381)	8	0
受取	IBMEXID	8.410%	03/31/2027		102,000	269	269	0	(6)
受取	IBMEXID	8.730%	04/06/2027		108,200	226	226	0	(6)
支払	IBMEXID	8.300%	06/16/2028		174,900	(547)	(458)	19	0
支払	IBMEXID	8.512%	07/24/2028		316,600	(842)	(842)	26	0
支払	IBMEXID	8.444%	07/25/2028		418,600	(1,171)	(1,171)	35	0
支払	IBMEXID	8.471%	07/26/2028		211,000	(577)	(577)	18	0
支払	IBMEXID	8.550%	07/27/2028		106,800	(274)	(274)	9	0
支払	IBMEXID	8.556%	07/27/2028		635,400	(1,622)	(1,622)	53	0
支払	IBMEXID	8.620%	07/28/2028		109,100	(263)	(263)	9	0
支払	IBMEXID	8.636%	07/28/2028		217,600	(518)	(518)	18	0
支払	IBMEXID	8.640%	07/28/2028		43,600	(103)	(103)	4	0
支払	IBMEXID	8.650%	07/28/2028		110,100	(259)	(259)	9	0
支払	IBMEXID	8.660%	07/28/2028		108,800	(253)	(253)	9	0
支払	IBMEXID	8.600%	07/31/2028		173,800	(424)	(418)	15	0
受取	IBMEXID	7.495%	01/14/2032		52,800	363	147	13	0
受取	IBMEXID	7.498%	01/15/2032		218,400	1,503	607	54	0
受取	IBMEXID	8.732%	03/30/2032		54,100	157	157	0	(9)
受取	IBMEXID	8.701%	03/31/2032		127,000	381	381	0	(21)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.270%	11/04/2023	$	2,801,300	(23,162)	(6,643)	0	(26)

変動金利支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	01/26/2024	26,500	(250)	(250)	0	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.700%	03/06/2024	59,600	(1,190)	(1,190)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	5.100%	05/22/2024	3,900,430	(12,060)	(5,906)	0	(303)
支払	Secured Overnight Financing Rate	5.400%	06/06/2024	2,242,310	(613)	757	0	(209)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.040%	06/20/2024	63,200	(871)	(871)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.060%	06/20/2024	252,800	(3,433)	(3,433)	0	(27)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.140%	06/22/2024	105,300	(1,356)	(1,356)	0	(11)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	07/21/2024	66,800	(1,582)	(1,582)	0	(9)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.052%	07/24/2024	66,800	(1,577)	(1,577)	0	(10)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.765%	07/27/2024	67,000	(1,780)	(1,780)	0	(11)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.993%	10/13/2024	31,700	(747)	(747)	0	(8)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.920%	10/17/2024	69,400	(1,672)	(1,672)	0	(17)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.018%	10/24/2024	28,100	(648)	(648)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.140%	10/25/2024	27,700	(605)	(605)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.190%	10/25/2024	27,700	(592)	(592)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.225%	10/25/2024	27,700	(582)	(582)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.973%	10/27/2024	27,600	(649)	(649)	0	(7)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.841%	10/31/2024	27,500	(678)	(678)	0	(7)
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.500%	12/18/2024	62,500	2,353	5,056	21	0
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	2.450%	12/20/2024	428,400	11,763	11,793	146	0
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	2.350%	01/17/2025	214,000	5,932	5,909	76	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.300%	03/16/2025	62,600	3,773	3,773	23	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.300%	03/18/2025	62,600	3,783	3,783	28	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.500%	05/22/2025	2,011,060	(26,164)	(20,336)	0	(1,009)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.900%	06/06/2025	1,156,360	(5,833)	(7,518)	0	(599)
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.000%	06/20/2025	117,800	6,669	9,082	65	0
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	1.600%	01/16/2026	167,700	10,055	7,921	115	0
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	2.300%	01/17/2026	120,700	5,675	5,649	84	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.928%	05/06/2026	25,800	2,784	2,784	22	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.940%	06/08/2026	35,000	3,719	3,719	32	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.500%	06/16/2026	251,400	29,158	25,308	196	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.030%	06/17/2026	43,000	4,447	4,447	38	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.010%	06/24/2026	39,800	4,123	4,123	36	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	12/15/2026	3,300	370	441	4	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.740%	12/16/2026	15,800	1,469	1,469	14	0

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.380%	01/04/2027	37,200	(3,867)	(3,867)	0	(34)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.570%	01/11/2027	21,300	(2,075)	(2,075)	0	(23)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.570%	01/12/2027	13,400	(1,305)	(211)	0	(14)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.425%	01/18/2027	25,400	(2,587)	(374)	0	(27)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.443%	01/18/2027	27,300	(2,767)	(2,767)	0	(25)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.350%	01/20/2027	19,000	1,979	1,979	21	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.418%	01/20/2027	12,700	(1,295)	(1,295)	0	(14)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.550%	01/20/2027	84,500	(8,253)	(7,961)	0	(92)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.560%	02/05/2027	28,000	3,107	3,107	26	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.580%	02/16/2027	26,400	(2,897)	(719)	0	(29)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.450%	02/17/2027	62,000	7,062	7,062	68	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.700%	02/17/2027	248,100	(26,263)	(25,330)	0	(273)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.420%	02/24/2027	46,300	5,304	5,304	51	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.650%	02/24/2027	154,200	(16,523)	(15,966)	0	(169)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.620%	04/18/2027	26,900	(3,092)	(3,092)	0	(26)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.783%	04/22/2027	20,100	(2,183)	(2,183)	0	(20)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.788%	05/03/2027	20,600	(2,231)	(2,231)	0	(20)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	51,050	(6,925)	(6,075)	0	(54)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	68,850	9,347	7,052	69	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.850%	08/30/2027	24,600	(1,605)	(1,605)	0	(26)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/07/2027	12,500	(721)	(721)	0	(14)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.955%	10/04/2027	25,100	(1,510)	(1,510)	0	(27)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/13/2027	25,200	1,040	1,040	29	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.500%	12/20/2027	259,700	(23,608)	(40,051)	0	(273)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.490%	01/09/2028	190,500	(16,162)	(5,999)	0	(199)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	03/10/2028	38,100	(1,476)	(1,476)	0	(45)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.280%	03/24/2028	73,200	(10,563)	(10,563)	0	(77)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.235%	05/12/2028	13,100	2,029	2,029	13	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	0.500%	06/16/2028	366,282	(67,527)	(11,766)	0	(377)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	06/21/2028	131,000	8,071	9,635	162	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.700%	07/21/2028	14,100	(1,205)	(1,205)	0	(17)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.675%	07/24/2028	14,400	(1,245)	(1,245)	0	(18)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.468%	07/27/2028	14,200	(1,359)	(1,359)	0	(17)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	09/05/2028	67,400	(2,347)	(2,347)	0	(87)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	12/15/2028	29,662	(4,597)	(5,266)	0	(36)

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	01/12/2029	14,850	2,230	2,230	18	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.700%	01/12/2029	54,000	(7,584)	(2,123)	0	(67)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.518%	01/20/2029	7,600	(1,133)	(1,133)	0	(9)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.630%	01/20/2029	10,600	(1,523)	(1,523)	0	(13)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.630%	01/26/2029	12,700	(1,819)	(1,819)	1,831	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.618%	02/09/2029	4,800	(772)	(772)	0	(6)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	6,100	(1,158)	(993)	0	(8)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	97,910	18,597	14,229	133	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2029	59,920	(9,005)	(5,288)	6	(58)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	06/19/2029	275,100	(25,328)	(57,045)	0	(391)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/08/2029	12,400	(980)	(980)	0	(19)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.100%	09/09/2029	12,400	(945)	(945)	0	(19)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	01/23/2030	14,000	2,249	2,249	21	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.870%	01/23/2030	14,000	2,154	2,154	21	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.470%	02/22/2030	39,200	(2,700)	(2,700)	0	(63)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.340%	02/23/2030	32,800	(2,522)	(2,522)	0	(52)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.610%	02/28/2030	14,100	2,553	2,553	21	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.525%	03/02/2030	14,000	(917)	(917)	0	(23)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.430%	03/17/2030	31,300	5,946	5,946	47	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/17/2030	9,500	1,959	1,764	14	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	06/21/2030	339,400	32,322	32,302	559	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	06/22/2030	98,200	(6,391)	(6,391)	0	(164)
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.678%	07/29/2030	12,400	2,919	2,919	0	(2,899)
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.674%	08/05/2030	12,000	2,991	2,991	17	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	08/22/2030	8,900	(404)	(404)	0	(15)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	12/16/2030	7,588	1,778	1,725	11	0
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2030	1,195,800	71,103	61,992	2,142	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	0.750%	06/16/2031	13,609	(3,593)	(2,341)	0	(19)
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.750%	06/16/2031	335,400	88,106	61,539	568	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.450%	07/16/2031	23,600	5,046	5,046	36	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.370%	07/19/2031	10,500	2,301	2,301	16	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.360%	07/20/2031	15,700	3,450	3,450	24	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.405%	09/07/2031	25,500	5,825	5,825	39	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	10/05/2031	15,500	(3,420)	(3,420)	0	(24)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.535%	10/15/2031	15,400	(3,354)	(3,354)	0	(24)

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.535%	10/22/2031	10,300	(2,239)	(2,239)	0	(16)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.545%	10/26/2031	10,300	(2,231)	(2,231)	2,192	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.735%	01/12/2032	10,100	(2,078)	(2,078)	0	(16)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.655%	01/24/2032	12,700	(2,679)	(2,679)	0	(20)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.768%	02/02/2032	9,600	(2,082)	(2,082)	0	(18)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.650%	02/08/2032	16,100	(3,574)	(3,574)	0	(30)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.000%	02/18/2032	23,000	(4,591)	(4,591)	0	(38)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.730%	02/24/2032	15,200	(3,276)	(3,276)	0	(29)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.765%	03/16/2032	5,300	(1,126)	(1,126)	0	(10)
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.385%	06/08/2032	10,400	1,699	1,699	21	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	55,640	(13,768)	(4,683)	188	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	45,970	11,386	9,630	86	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2032	78,300	(16,472)	(12,197)	0	(148)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	06/21/2032	12,800	3,054	2,630	22	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/06/2032	18,800	(2,086)	(2,086)	0	(39)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.610%	12/12/2032	10,100	811	811	22	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.350%	12/14/2032	5,000	510	510	11	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.400%	02/23/2033	31,600	(3,083)	(3,083)	0	(70)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.430%	02/27/2033	21,500	(2,044)	(2,044)	0	(48)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.370%	03/01/2033	20,800	(2,079)	(2,079)	0	(46)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.405%	03/01/2033	20,300	(1,971)	(1,971)	0	(45)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.300%	03/06/2033	20,200	(2,135)	(2,135)	0	(45)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.450%	03/07/2033	38,300	(3,575)	(3,575)	0	(85)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	05/22/2033	911,110	80,245	71,481	2,067	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.700%	06/06/2033	529,370	37,830	42,122	1,216	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.300%	06/14/2033	77,300	(8,019)	(8,019)	0	(175)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	06/21/2033	230	(29)	(28)	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	06/21/2033	366,140	46,817	45,285	818	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	06/21/2033	65,300	(5,704)	(5,704)	0	(149)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.650%	07/10/2033	37,000	(2,767)	(2,767)	0	(86)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	07/12/2033	31,800	(2,119)	(2,119)	0	(74)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.730%	08/03/2033	10,600	(718)	(718)	0	(25)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.735%	08/07/2033	12,100	(814)	(814)	0	(28)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.760%	08/23/2033	35,500	(2,299)	(2,299)	0	(83)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	08/30/2033	17,800	(1,092)	(1,092)	0	(42)

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.900%	08/30/2033	35,900	(1,913)	(1,913)	0	(85)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.030%	10/04/2033	33,900	(1,421)	(1,421)	0	(81)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.175%	10/10/2033	16,300	(492)	(492)	0	(40)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.150%	10/12/2033	16,300	(524)	(524)	0	(39)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.200%	10/18/2033	14,000	(392)	(392)	0	(34)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.220%	10/20/2033	16,400	(432)	(432)	0	(40)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.230%	10/23/2033	8,800	(224)	(224)	0	(21)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.255%	10/23/2033	8,800	(206)	(206)	0	(21)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.393%	10/25/2033	8,200	(102)	(102)	0	(20)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	10/31/2033	10,200	(79)	(79)	0	(25)
支払(5)	Secured Overnight Financing Rate	4.435%	11/01/2033	8,600	(76)	(76)	0	(76)
支払(5)	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	11/01/2033	16,900	(129)	(129)	0	(129)
支払(5)	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033	7,200	(589)	(17)	0	(17)
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.500%	06/20/2048	7,900	2,581	3,676	33	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.910%	10/17/2049	11,400	4,845	4,850	43	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.895%	10/18/2049	11,400	4,869	4,834	42	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.000%	01/15/2050	8,800	3,590	3,784	34	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.625%	01/16/2050	22,500	10,487	3,502	81	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	01/22/2050	47,500	21,191	19,434	174	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.625%	02/03/2050	42,500	20,340	17,516	154	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.875%	02/07/2050	2,700	1,187	1,167	10	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	06/17/2050	1,200	595	717	4	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.215%	10/13/2050	14,900	(8,029)	(8,029)	0	(50)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.144%	11/04/2050	9,000	(5,031)	(5,031)	0	(30)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	12/16/2050	128,700	69,199	56,021	431	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.485%	01/13/2051	13,900	(6,881)	(6,881)	0	(50)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.595%	01/13/2051	14,700	(7,020)	(7,020)	0	(54)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.523%	01/19/2051	8,900	(4,348)	(4,348)	0	(32)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.550%	01/21/2051	10,400	(5,033)	(5,033)	0	(38)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.590%	02/09/2051	98,800	(48,417)	(48,417)	0	(361)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/16/2051	386,100	208,398	142,941	1,456	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.945%	06/23/2051	22,200	9,568	9,568	84	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.785%	08/12/2051	13,100	6,046	6,046	50	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.815%	01/24/2052	2,500	(1,118)	(1,118)	0	(10)
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.867%	01/26/2052	2,500	(1,097)	(1,097)	1,087	0

変動金利 支払／受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日		想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052		96,100	41,758	32,698	409	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.080%	02/23/2053		11,200	(2,487)	(2,487)	0	(57)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.370%	07/12/2053		22,400	(3,741)	(3,741)	0	(118)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.550%	07/21/2053		3,600	(1,091)	(1,091)	0	(17)
支払	Secured Overnight Financing Rate	2.537%	07/24/2053		3,600	(1,098)	(1,098)	0	(17)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.830%	10/12/2053		5,100	(439)	(439)	0	(29)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.880%	10/16/2053		5,100	(396)	(396)	0	(29)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.870%	10/17/2053		5,500	(436)	(436)	0	(31)
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.320%	10/20/2033	GBP	7,300	(39)	(38)	26	0
受取[5]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.500%	03/20/2034		68,850	(1,126)	1,067	0	(182)
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.096%	02/14/2052		5,500	(3,639)	(3,639)	25	0
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.060%	02/21/2052		2,500	(1,671)	(1,671)	11	0
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.101%	02/21/2052		2,500	(1,650)	(1,650)	11	0
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.175%	02/28/2052		5,200	(3,352)	(3,352)	24	0
受取[5]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.250%	03/20/2054		3,800	32	221	0	(23)
受取	UK Retail Price Index	0.000%	09/15/2031		34,900	(5,753)	(5,573)	48	0
受取	UK Retail Price Index	0.000%	10/15/2031		46,300	(6,887)	(6,827)	46	0
受取	UK Retail Price Index	0.000%	11/15/2031		23,300	(3,119)	(2,867)	60	0
						$ 431,204	$ 303,630	$ 23,351	$ (17,160)
スワップ契約合計						**$ 430,142**	**$ 306,486**	**$ 24,867**	**$ (17,211)**

(1) ファンドがプロテクションの売り手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に相当する金額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の引き渡しを受けるか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) インプライド・クレジット・スプレッドは、絶対値で表示され、期末時点の社債、米国地方債またはソブリン債に係るクレジットデフォルトスワップ契約の市場価格を決定する際に利用され、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの債務不履行の可能性またはリスクを表す。特定の参照法人のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買い/売りの原価を反映し、契約締結時に必要な前払金が含まれる可能性がある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

(3) 特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払う必要がある可能性のある、またはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性のある潜在的最大金額。

(4) クレジットデフォルトスワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合、クレジット・デリバティブの期待債務（または利益）の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した絶対値での市場価格の上昇は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

(5) この金融商品は効力発生日が先日付である。

◎店頭金融デリバティブ商品

2023年10月31日現在

●外国為替先渡し契約

単位：千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産		未実現評価損益 負債	
AZD	11/2023	$	8,365	AUD	13,177	$	0	$	(22)
AZD	12/2023	AUD	13,177	$	8,374		22		0
AZD	03/2024	CNH	134,778		18,699		149		0
BOA	11/2023	BRL	56,241		11,120		0		(30)
BOA	11/2023	COP	62,570,000		14,679		0		(345)
BOA	11/2023	EUR	669,706		708,085		206		0
BOA	11/2023	PEN	26,411		6,863		0		(22)
BOA	11/2023	$	4,279	AUD	6,751		0		(5)
BOA	11/2023		11,213	BRL	56,241		0		(62)
BOA	11/2023		5,308	CAD	7,243		0		(90)
BOA	11/2023		12	CLP	10,069		0		0
BOA	11/2023		1,722	JPY	258,400		0		(16)
BOA	11/2023		14,150	PEN	52,571		0		(446)
BOA	12/2023	AUD	6,751	$	4,284		5		0
BOA	12/2023	KRW	9,358,124		7,024		98		0
BOA	12/2023	PEN	4,007		1,048		6		0
BOA	12/2023	TWD	28,641		895		11		0
BOA	12/2023	$	8,570	INR	713,399		0		(17)
BOA	12/2023		6,851	PEN	26,411		22		0
BOA	01/2024	ZAR	10,340	$	538		0		(10)
BOA	02/2024	$	154	CNY	1,089		0		(3)
BOA	03/2024	CNH	189,698	$	26,191		82		0
BOA	03/2024	$	680	IDR	10,617,491		0		(16)
BPS	11/2023	AUD	1,968	$	1,243		0		(3)
BPS	11/2023	BRL	41,146		8,119		0		(38)
BPS	11/2023	CLP	31,237,403		33,473		0		(1,310)
BPS	11/2023	GBP	370,780		451,656		1,734		0
BPS	11/2023	IDR	27,546,121		1,750		22		0
BPS	11/2023		21,859,014		1,400		27		0
BPS	11/2023		7,874,575		500		6		0
BPS	11/2023		109,908,701		6,930		37		0
BPS	11/2023	JPY	14,018,721		93,683		1,117		0
BPS	11/2023	KRW	6,074,750		4,500		9		0
BPS	11/2023		5,039,261		3,750		26		0
BPS	11/2023		3,996,916		2,950		0		(3)
BPS	11/2023		1,345,662		1,000		6		0
BPS	11/2023	MXN	108,084		5,893		0		(94)
BPS	11/2023	$	1,026	AUD	1,604		0		(11)
BPS	11/2023		8,200	BRL	41,146		0		(42)
BPS	11/2023		33,448	CLP	31,237,403		1,319		0
BPS	11/2023		1,542	EUR	1,453		0		(6)
BPS	11/2023		529,829	GBP	436,195		0		(529)
BPS	11/2023		1,267	JPY	189,100		0		(19)
BPS	11/2023		4,497	KRW	6,061,484		0		(16)
BPS	11/2023		38	NZD	63		0		(2)
BPS	11/2023		6,075	ZAR	116,531		131		0
BPS	12/2023	EUR	11,857	$	12,558		8		0
BPS	12/2023	GBP	429,980		522,387		521		0
BPS	12/2023	IDR	56,297,738		3,537		6		0
BPS	12/2023	KRW	18,736,447		14,063		196		0
BPS	12/2023		1,552,254		1,150		2		0
BPS	12/2023	TWD	531		17		0		0
BPS	12/2023	$	6,450	BRL	32,749		17		0
BPS	12/2023		93,683	JPY	13,947,559		0		(1,087)
BPS	12/2023		4	KRW	5,397		0		0
BPS	02/2024		274	CNY	1,942		0		(5)
BPS	03/2024	CNH	131,280	$	18,241		172		0
BPS	03/2024	TWD	450,945		14,313		261		0
BPS	03/2024	$	204	CNH	1,474		0		(1)
BPS	03/2024		12,083	IDR	185,779,982		0		(457)
BRC	11/2023	MXN	252,482	$	13,800		0		(185)
BRC	11/2023	TWD	77,005		2,430		56		0
BRC	11/2023	$	5,319	GBP	4,376		0		(9)
BRC	11/2023		4,965	MXN	86,326		0		(196)
BRC	11/2023	$	2,310	TRY	66,855		4		0

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	負債
BRC	11/2023		2,335		67,710	14	0
BRC	12/2023	IDR	30,326,328	$	1,905	4	0
BRC	12/2023	TWD	231,531		7,324	174	0
BRC	12/2023	$	1,019	JPY	152,700	0	(5)
BRC	12/2023		2,358	TRY	70,205	10	0
BRC	01/2024	JPY	34,990,000	$	239,246	5,200	0
BRC	01/2024	$	3,536	TRY	108,374	13	0
BRC	02/2024		5,894		179,686	0	(16)
BRC	03/2024		1,179		36,926	0	(5)
CBK	11/2023	BRL	904,464	$	179,028	0	(295)
CBK	11/2023	CAD	1,163		853	16	0
CBK	11/2023	CHF	854		986	46	0
CBK	11/2023	CLP	14,313,592		15,574	0	(356)
CBK	11/2023	EUR	4,062		4,301	8	0
CBK	11/2023	MXN	935,451		53,779	1,961	0
CBK	11/2023	PEN	26,160		7,042	223	0
CBK	11/2023		3,699		1,018	54	0
CBK	11/2023		14,568		3,912	114	0
CBK	11/2023		5,009		1,370	64	0
CBK	11/2023		16,050		4,172	0	(11)
CBK	11/2023		16,050		4,300	116	0
CBK	11/2023	$	183,703	BRL	904,464	0	(4,380)
CBK	11/2023		46,916	CLP	38,171,031	0	(4,412)
CBK	11/2023		1,495	EUR	1,420	6	0
CBK	11/2023		1,922	GBP	1,581	0	(4)
CBK	11/2023		3,784	PEN	14,568	13	0
CBK	11/2023		963		3,699	2	0
CBK	11/2023		1,301		5,009	5	0
CBK	11/2023		4,172		16,050	11	0
CBK	11/2023		2,346	TRY	67,915	5	0
CBK	12/2023	KRW	2,653,797	$	2,013	49	0
CBK	12/2023	MXN	10,068		567	14	0
CBK	12/2023	PEN	19,576		5,075	0	(19)
CBK	12/2023	TWD	34		1	0	0
CBK	12/2023	$	18,454	BRL	92,713	0	(145)
CBK	12/2023		195	KRW	264,713	1	0
CBK	12/2023		93,180	MXN	1,690,204	0	(218)
CBK	12/2023		21,795	TWD	684,581	0	(654)
CBK	01/2024	MXN	1,826,794	$	99,447	0	(146)
CBK	01/2024	ZAR	219,315		11,529	0	(92)
DUB	11/2023	IDR	25,687,051		1,620	9	0
DUB	11/2023	$	105,637	JPY	15,631,636	0	(2,420)
DUB	11/2023		2,373	MXN	41,060	0	(99)
DUB	11/2023		21	NZD	35	0	(1)
DUB	11/2023	ZAR	66,048	$	3,472	0	(45)
DUB	12/2023	CLP	17,077,403		19,081	111	0
DUB	12/2023	KRW	7,886,345		5,947	110	0
DUB	03/2024	CNH	113,400		15,737	129	0
DUB	03/2024	IDR	26,592		2	0	0
DUB	03/2024	$	589	IDR	9,194,224	0	(13)
FAR	11/2023	BRL	294,286	$	58,188	0	(158)
FAR	11/2023	$	60,253	BRL	294,286	0	(1,906)
GLM	11/2023	BRL	1,192,496	$	238,166	1,736	0
GLM	11/2023	MXN	591,228		32,215	0	(534)
GLM	11/2023		427,652		23,292	0	(337)
GLM	11/2023	TRY	7,507		259	0	(1)
GLM	11/2023	TWD	651		21	0	0
GLM	11/2023	$	235,788	BRL	1,192,496	642	0
GLM	11/2023		1,009	GBP	832	1	0
GLM	11/2023		542	MXN	9,274	0	(30)
GLM	12/2023	MXN	3,887,275	$	224,075	10,272	0
GLM	12/2023	$	419	PEN	1,561	0	(13)
GLM	01/2024		84	MXN	1,541	0	0
GLM	01/2024		11,426	TRY	350,657	57	0
GLM	01/2024		2,165		64,320	0	(4)
GLM	02/2024		238,166	BRL	1,205,833	0	(1,692)
GLM	03/2024	CNH	58,702	$	8,136	56	0
GLM	03/2024	IDR	228,494		15	1	0
GLM	03/2024	$	19,114	IDR	294,043,935	0	(712)
JPM	11/2023	NOK	1,920	$	189	17	0

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
JPM	11/2023	$	1,249	EUR	1,187	6	0
JPM	11/2023		3,279	GBP	2,699	0	(4)
JPM	11/2023		2,825	MXN	48,858	0	(119)
JPM	11/2023		212,496		3,687,967	0	(8,725)
JPM	12/2023	GBP	1,422	$	1,726	0	0
JPM	12/2023	KRW	6,037,160		4,576	108	0
JPM	12/2023	TWD	1,918,168		60,678	1,443	0
JPM	12/2023	$	35,627	INR	2,950,805	0	(250)
JPM	03/2024		12,430	IDR	191,903,296	0	(420)
MBC	11/2023	CAD	222,304	$	164,446	4,314	0
MBC	11/2023	EUR	137,869		145,893	166	0
MBC	11/2023	JPY	1,270,200		8,480	93	0
MBC	11/2023	$	162,512	CAD	224,510	0	(791)
MBC	11/2023		6,171	EUR	5,831	0	(8)
MBC	11/2023		3,207	GBP	2,651	10	0
MBC	11/2023		1,278	JPY	189,800	0	(25)
MBC	11/2023		2,386	TRY	69,013	2	0
MBC	11/2023		4,948	ZAR	94,754	98	0
MBC	11/2023	ZAR	204,693	$	10,663	0	(238)
MBC	12/2023	CAD	222,771		161,311	770	0
MBC	12/2023	IDR	11,223,968		706	2	0
MBC	01/2024	$	450	ZAR	8,603	6	0
MBC	03/2024	CNH	1,466	$	202	0	0
MBC	03/2024	$	15,163	IDR	233,741,434	0	(534)
MYI	11/2023	AUD	19,220	$	12,341	172	0
MYI	11/2023	CAD	6,558		4,861	137	0
MYI	11/2023	ZAR	90,209		4,742	0	(61)
MYI	12/2023	EUR	800,365		849,354	2,191	0
MYI	12/2023	GBP	4,017		4,900	25	0
MYI	12/2023	KRW	24,362,831		18,348	317	0
MYI	12/2023	TWD	306,302		9,751	292	0
MYI	02/2024	$	161	CNY	1,137	0	(3)
MYI	03/2024	CNH	128,614	$	17,834	132	0
MYI	03/2024	IDR	675,141,442		43,864	1,611	0
MYI	03/2024	$	30,510	IDR	469,287,826	0	(1,141)
SCX	11/2023	PEN	3,699	$	963	0	(2)
SCX	11/2023		3,089		803	0	(2)
SCX	11/2023	TWD	129,639		4,107	111	0
SCX	11/2023	$	1,467	EUR	1,381	0	(7)
SCX	11/2023		1,927	GBP	1,588	0	0
SCX	11/2023		806	PEN	3,089	0	(1)
SCX	11/2023		956		3,699	9	0
SCX	11/2023		803		3,089	2	0
SCX	12/2023	GBP	1,588	$	1,927	0	0
SCX	12/2023	IDR	37,542,548		2,352	0	(2)
SCX	12/2023	PEN	6,788		1,758	0	(8)
SCX	12/2023	TWD	431,770		13,694	361	0
SCX	12/2023	$	12,317	INR	1,026,184	0	(14)
SCX	12/2023		627	MXN	11,588	11	0
SCX	12/2023		2,382	TRY	70,933	10	0
SCX	01/2024	ZAR	252,305	$	13,301	0	(65)
SCX	03/2024	CNH	126,268		17,442	62	0
SCX	03/2024	TWD	244,805		7,756	127	0
SCX	03/2024	$	9,568	IDR	147,921,102	0	(311)
SOG	01/2024		695	MXN	12,752	0	0
SSB	12/2023		2,455	INR	202,623	0	(26)
TOR	11/2023	CLP	5,665,881	$	6,654	345	0
TOR	11/2023	GBP	83,160		101,039	130	0
TOR	11/2023	JPY	7,027,071		46,832	431	0
TOR	11/2023	$	1,376	IDR	21,803,988	0	(6)
TOR	11/2023		66,467	JPY	9,862,919	0	(1,342)
TOR	12/2023		7,389	INR	616,998	9	0
TOR	12/2023		46,832	JPY	6,991,475	0	(416)
TOR	03/2024	CNH	61,066	$	8,458	53	0
TOR	03/2024	IDR	21,854,200		1,376	8	0
UAG	11/2023	AUD	6,771		4,350	63	0
UAG	11/2023	CLP	1,267,746		1,414	2	0
UAG	11/2023	JPY	3,818,673		25,524	309	0
UAG	11/2023	$	4,087	AUD	6,426	0	(18)
UAG	11/2023		163	NZD	269	0	(7)

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産		未実現評価損益 負債	
UAG	11/2023		2,381	TRY	69,022		13		0
UAG	12/2023	AUD	6,426	$	4,092		18		0
UAG	12/2023	KRW	5,054,205		3,815		74		0
UAG	12/2023	$	1,410	CLP	1,267,746		0		(2)
UAG	12/2023		25,524	JPY	3,799,326		0		(301)
UAG	01/2024	JPY	34,000,000	$	230,625		2,990		0
UAG	01/2024	ZAR	597,132		31,282		0		(352)
外国為替先渡し契約合計						**$**	**44,575**	**$**	**(39,021)**

●買建オプション
金利スワップション

単位：千

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	変動金利支払／受取	行使レート	満期日	想定元本[1]	取得原価		市場価格	
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.243%	08/05/2024	52,000	$	702	$	48
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.243%	08/05/2024	52,000		702		2,130
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.110%	07/26/2032	10,500		1,701		321
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.110%	07/26/2032	15,300		2,479		3,669
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.620%	07/22/2024	154,200		1,156		90
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.590%	07/19/2024	109,300		1,503		129
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.400%	07/20/2027	12,100		1,597		244
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.170%	07/19/2032	12,100		1,919		387
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.620%	07/22/2024	154,200		1,156		3,137
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.590%	07/19/2024	109,300		1,503		3,868
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.400%	07/20/2027	13,600		1,794		3,698
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.170%	07/19/2032	13,600		2,157		3,191
買建オプション合計							**$**	**18,369**	**$**	**20,912**

●売建オプション
金利スワップション

単位：千

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	変動金利支払／受取	行使レート	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取額）	市場価格
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.150%	12/01/2023	55,600	$ (172)	$ 0
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	12/01/2023	55,600	(172)	(904)
BPS	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.179%	11/27/2023	10,200	(20)	(36)
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.280%	11/20/2023	6,200	(26)	(36)
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.305%	11/23/2023	12,700	(54)	(97)
BPS	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.572%	11/27/2023	10,200	(20)	(7)
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.700%	11/20/2023	6,200	(26)	(8)
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.743%	11/23/2023	12,700	(54)	(17)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.128%	11/30/2023	7,500	(29)	(27)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.536%	11/30/2023	7,500	(29)	(33)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(2)
CBK	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.270%	11/06/2023	20,700	(48)	(61)
CBK	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.255%	11/20/2023	9,600	(19)	(43)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.250%	11/02/2023	12,700	(59)	(10)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.148%	11/16/2023	12,300	(48)	(25)
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(333)
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.590%	11/06/2023	20,700	(48)	(1)
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.653%	11/20/2023	9,600	(19)	(3)
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.550%	11/02/2023	12,700	(59)	(1)
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.567%	11/16/2023	12,300	(48)	(26)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(4)
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.130%	11/02/2023	8,500	(40)	0
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(499)
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.630%	11/02/2023	8,500	(40)	(13)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(4)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(7)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(672)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(836)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.250%	11/17/2023	54,600	(198)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.150%	11/20/2023	54,500	(190)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.250%	12/07/2023	55,600	(174)	0

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	変動金利支払／受取	行使レート	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取額）	市場価格
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.697%	04/02/2024	59,600	(468)	(9)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(5)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.140%	11/13/2023	20,500	(53)	(31)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.140%	11/06/2023	17,000	(85)	(1)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.050%	11/13/2023	16,800	(81)	(4)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.075%	11/13/2023	8,400	(37)	(3)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.250%	11/20/2023	16,800	(77)	(39)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(609)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(650)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	11/17/2023	54,600	(198)	(848)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	11/20/2023	54,500	(190)	(898)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	12/07/2023	55,600	(174)	(845)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.697%	04/02/2024	59,600	(468)	(1,338)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(649)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.460%	11/13/2023	20,500	(53)	(12)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.640%	11/06/2023	17,000	(85)	(49)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.550%	11/13/2023	16,800	(81)	(137)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.575%	11/13/2023	8,400	(37)	(61)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.850%	11/20/2023	16,800	(77)	(48)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	3.180%	11/10/2023	15,500	(86)	(27)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.130%	11/02/2023	8,500	(41)	0
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.520%	11/10/2023	15,500	(86)	(29)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.630%	11/02/2023	8,500	(41)	(13)
							$ (6,872)	$ (10,010)

金利キャップ付オプション

単位：千

取引相手	銘柄	行使レート	変動金利インデックス	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取額）	市場価格
FAR	Call – OTC 2-Year Interest Rate Cap[2]	2.224	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	$ (897)	$ (2,241)
FAR	Put – OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2.224	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	(897)	(172)
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Cap[2]	2.596	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,350)	(3,209)
MYC	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	3.018	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	308,400	(1,231)	(14)
MYC	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	2.596	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,351)	(191)
MYC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Cap[2]	2.550	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(4,180)
MYC	Put – OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2.550	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(444)
						$ (9,592)	$ (10,451)
売建オプション合計						**$ (16,464)**	**$ (20,461)**

●スワップ契約

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

単位:千

取引相手	参照債務	支払固定金利	満期日	2023/10/31時点の信用スプレッド[5]	想定元本[6]	プレミアム支払額(受取額)	未実現評価損益	スワップ契約時価 資産	スワップ契約時価 負債
BOA	HSBC Holdings PLC	(1.000%)	06/20/2024	0.565%	EUR 200	$ 3	$ (4)	$ 0	$ (1)

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

単位:千

取引相手	参照債務	受取固定金利	満期日	2023/10/31時点の信用スプレッド(5)	想定元本[6]	プレミアム支払額(受取額)	未実現評価損益	スワップ契約時価 資産	スワップ契約時価 負債
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.600%	$ 100	$ (7)	$ 8	$ 1	$ 0
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.938%	200	(18)	19	1	0
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	6,040	(671)	625	0	(46)
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.555%	3,400	(163)	105	0	(58)
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.742%	700	(62)	44	0	(18)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.600%	200	(15)	15	0	0
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	480	(34)	31	0	(3)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2025	2.458%	400	(69)	60	0	(9)
BRC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.309%	4,800	(221)	184	0	(37)
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.600%	1,600	(108)	111	3	0
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.938%	3,370	(300)	305	5	0
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	25,910	(3,201)	3,004	0	(197)
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.412%	21,800	(377)	544	167	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.314%	1,500	(15)	23	8	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.515%	4,300	17	11	28	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.309%	5,900	(275)	229	0	(46)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.555%	1,500	(54)	28	0	(26)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.938%	400	(36)	36	0	0
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	1,400	(146)	135	0	(11)
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.970%	400	(18)	7	0	(11)
DUB	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	1,700	(196)	183	0	(13)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.248%	1,000	(32)	38	6	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.412%	16,700	(260)	388	128	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.191%	4,700	(70)	81	11	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.555%	4,200	(156)	85	0	(71)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.742%	1,900	(169)	120	0	(49)
GST	Equinix, Inc.	5.000%	06/20/2027	1.412%	3,800	531	(63)	468	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2028	0.981%	2,300	0	5	5	0
GST	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.808%	11,600	(495)	523	28	0
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.938%	1,100	(100)	102	2	0
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	12,000	(1,342)	1,251	0	(91)
JPM	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.555%	400	(15)	9	0	(6)
JPM	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.600%	200	(14)	14	0	0
MBC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	1,300	(142)	132	0	(10)
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.555%	4,500	(162)	85	0	(77)
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.742%	5,200	(464)	328	0	(136)
MYC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.970%	13,600	(600)	240	0	(360)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.938%	900	(100)	101	1	0
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.797%	900	(101)	94	0	(7)
						$ (9,660)	$ 9,240	$ 862	$ (1,282)

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

単位：千

取引相手	インデックス／トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本[6]	プレミアム支払額（受取額）	未実現評価損益	スワップ契約時価[7] 資産	負債
BOA	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	$ 6,552	$ (1,273)	$ 1,071	$ 0	$ (202)
BOA	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	5	0	0	0	0
BOA	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	309	(10)	10	0	0
DUB	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	495	(15)	15	0	0
DUB	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,218	(421)	355	0	(66)
DUB	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	66,100	(300)	(341)	0	(641)
FBF	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	6	0	0	0	0
FBF	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,616	(513)	444	0	(69)
FBF	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	58,800	(314)	(542)	0	(856)
FBF	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	17,500	(123)	(218)	0	(341)
GST	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	8	0	0	0	0
GST	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	18,100	(95)	(161)	0	(256)
GST	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	6,600	(56)	(190)	0	(246)
JPS	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	4,172	(171)	149	0	(22)
JPS	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	5,400	(101)	49	0	(52)
JPS	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	28,300	(224)	(188)	0	(412)
MEI	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	2	0	0	0	0
MEI	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	106	(6)	6	0	0
MEI	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	16,200	(870)	847	0	(23)
MEI	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	15,496	(657)	573	0	(84)
MYC	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	6	(1)	1	0	0
MYC	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	3	0	0	0	0
MYC	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	10,430	(515)	458	0	(57)
MYC	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	63,200	(1,929)	1,317	0	(612)
MYC	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	60,700	(516)	(367)	0	(883)
MYC	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	30,300	(12)	(759)	0	(771)
MYC	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	13,200	(112)	(381)	0	(493)
SAL	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	286,300	(1,597)	(2,570)	0	(4,167)
UAG	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	53	(2)	2	0	0
UAG	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	1,600	(95)	93	0	(2)
					$ (9,928)	$ (327)	$ 0	$ (10,255)
スワップ契約合計					**$ (19,585)**	**$ 8,909**	**$ 862**	**$ (11,538)**

(1) 想定元本は契約数を表す。

(2) 原金融商品は効力発生日が先日付である。

(3) ファンドがプロテクションの買い手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの売り手からスワップの想定元本に相当する金額を受け取り参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券を引き渡すか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。

(4) ファンドがプロテクションの売り手で当該特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドは、(i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に相当する金額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の引き渡しを受けるか、または (ii) スワップの想定元本から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収額を控除した金額に相当する純決済金額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(5) インプライド・クレジット・スプレッドは、絶対値で表示され、期末時点の社債、米国地方債またはソブリン債に係るクレジットデフォルトスワップ契約の市場価格を決定する際に利用され、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの債務不履行の可能性またはリスクを表す。特定の参照法人のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買い/売りの原価を反映し、契約締結時に必要な前払金が含まれる可能性がある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

(6) 特定のスワップ契約に定義されている信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払う必要がある可能性のある、またはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性のある潜在的最大金額

(7) クレジットデフォルトスワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合、クレジット・デリバティブの期待債務（または利益）の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した絶対値での市場価格の上昇は、参照法人の信用の健全性の悪化および債務不履行または契約に定義されているその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

運用計算書
2023年10月31日に終了した期間

（金額単位：千米ドル）

収益：		
受取利息（外国税額控除後）	$	584,256
受取配当（外国税額控除後）		896
雑収入		2,092
収益合計		587,244
費用：		
支払利息		2,725
費用合計		2,725
純投資損益		584,519
当期実現損益：		
投資有価証券（外国税額控除後）＊		(557,592)
関連投資		0
上場金融デリバティブ商品		(81,534)
店頭金融デリバティブ商品		102,990
外貨通貨		9,111
当期実現損益		(527,025)
当期未実現評価損益：		
投資有価証券		56,671
関連投資		0
上場金融デリバティブ商品		300,649
店頭金融デリバティブ商品		127,021
外貨建資産および負債		(4,910)
当期未実現評価損益		479,431
当期損益		(47,594)
運用の結果による純資産の増減額	$	536,925
＊外国税	$	1,226

金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

野村マネーポートフォリオ マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2024年７月11日）

作成対象期間（2023年７月12日～2024年７月11日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント株式会社
東京都江東区豊洲二丁目２番１号

https://www.nomura-am.co.jp/

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	%	%	%	百万円
12期(2020年７月13日)	10,055	△0.0	62.0	－	37
13期(2021年７月12日)	10,048	△0.1	55.0	－	1,836
14期(2022年７月11日)	10,045	△0.0	52.2	－	38
15期(2023年７月11日)	10,042	△0.0	58.8	－	40
16期(2024年７月11日)	10,039	△0.0	54.4	－	44

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
＊当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

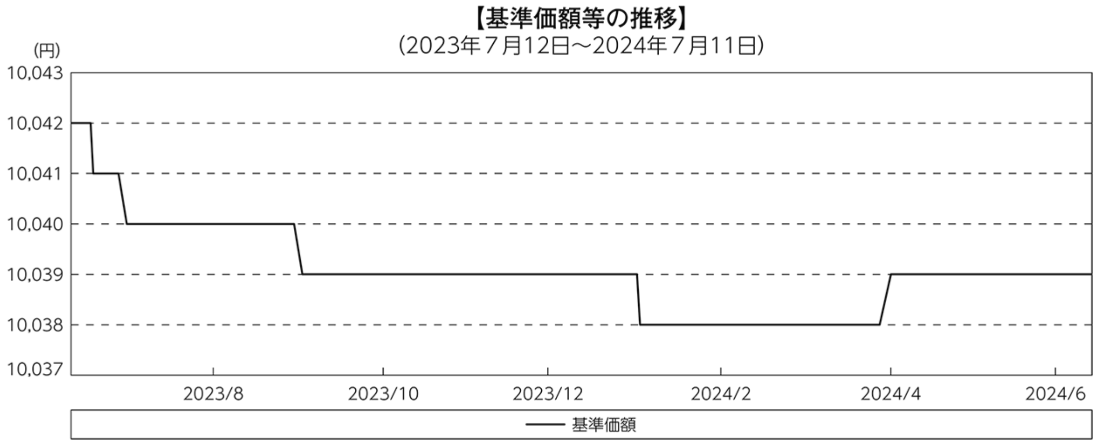
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債券組入比率	債券先物比率
	円	%	%	%
(期首) 2023年７月11日	10,042	－	58.8	－
７月末	10,040	△0.0	58.9	－
８月末	10,040	△0.0	54.2	－
９月末	10,040	△0.0	58.2	－
10月末	10,039	△0.0	54.9	－
11月末	10,039	△0.0	55.5	－
12月末	10,039	△0.0	56.5	－
2024年１月末	10,038	△0.0	57.2	－
２月末	10,038	△0.0	56.9	－
３月末	10,038	△0.0	57.1	－
４月末	10,039	△0.0	54.5	－
５月末	10,039	△0.0	54.5	－
６月末	10,039	△0.0	54.4	－
(期末) 2024年７月11日	10,039	△0.0	54.4	－

＊騰落率は期首比です。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

国内経済は、緩やかな回復が続きました。このような中、日銀は2023年７月にイールドカーブ・コントロールの運用を柔軟化し、実質的な長期金利の上限を＋１％とすることを決定、さらに10月には上限として設定した＋１％を「上限の目途」と変更しました。また2024年３月には、イールドカーブ・コントロールの運用を解除するとともに、無担保コールレートを０％～0.1%程度で推移するよう促すことを決定しました。

TDB（国庫短期証券）３ヵ月物の利回りは、当作成期の前半においては概ねー0.1%～ー0.3%台で推移しましたが、2024年３月中旬以降上昇し、当作成期末にかけては０％～0.04%程度で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は当作成期の前半においてはー0.01%～ー0.08%程度で推移しましたが、３月下旬以降0.08%前後で推移しました。

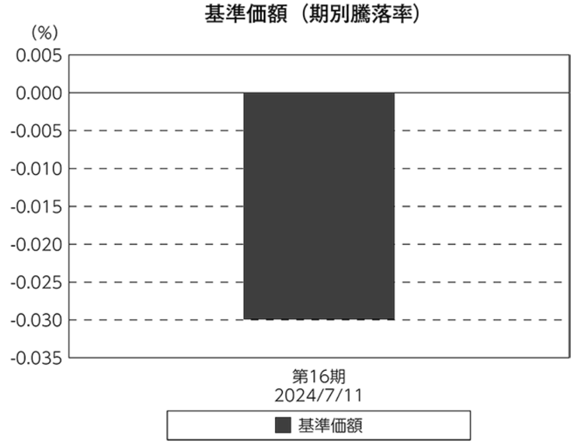
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2023年７月12日～2024年７月11日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2023年７月12日～2024年７月11日）

公社債

		買　付　額	売　付　額
国内	特殊債券	千円 72,171	千円 － (72,000)

＊金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
＊単位未満は切り捨て。
＊（　）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

（2023年７月12日～2024年７月11日）

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

（2024年７月11日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区　分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券（除く金融債）	24,000 (24,000)	24,009 (24,009)	54.4 (54.4)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	54.4 (54.4)
合　計	24,000 (24,000)	24,009 (24,009)	54.4 (54.4)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	54.4 (54.4)

＊（　）内は非上場債で内書きです。
＊組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
＊残存期間が１年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

（Ｂ）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券（除く金融債）	%	千円	千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第222回	0.601	24,000	24,009	2024/７/31
合計		24,000	24,009	

＊額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2024年７月11日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	24,009	54.4
コール・ローン等、その他	20,111	45.6
投資信託財産総額	44,120	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2024年７月11日現在）

項目	当期末
	円
(A)　**資産**	**44,120,699**
コール・ローン等	20,043,175
公社債(評価額)	24,009,141
未収利息	63,641
前払費用	4,742
(B)　**負債**	**0**
(C)　**純資産総額(Ａ－Ｂ)**	**44,120,699**
元本	43,947,918
次期繰越損益金	172,781
(D)　**受益権総口数**	**43,947,918口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**10,039円**

（注）期首元本額は40,660,592円、期中追加設定元本額は6,076,522円、期中一部解約元本額は2,789,196円、１口当たり純資産額は1.0039円です。

○損益の状況

（2023年７月12日～2024年７月11日）

項目	当期
	円
(A)　**配当等収益**	**161,700**
受取利息	165,655
支払利息	△　3,955
(B)　**有価証券売買損益**	**△170,844**
売買損	△170,844
(C)　**当期損益金(Ａ＋Ｂ)**	**△　9,144**
(D)　**前期繰越損益金**	**169,251**
(E)　**追加信託差損益金**	**23,478**
(F)　**解約差損益金**	**△　10,804**
(G)　**計(Ｃ＋Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)**	**172,781**
次期繰越損益金(Ｇ)	**172,781**

＊損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。
＊損益の状況の中で(E)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
＊損益の状況の中で(F)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
財形給付金ファンド	37,538,906
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	1,003,293
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	998,495
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	997,887
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	997,001
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	997,000
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）毎月分配型	996,337
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	100,755
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	99,927
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	99,898
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	9,985
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型	9,978
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,978

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

○お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「http://www.nomura-am.co.jp/」から「https://www.nomura-am.co.jp/」に変更する所要の約款変更を行ないました。 ＜変更適用日：2024年７月４日＞