

## 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	2029年4月20日まで（2014年5月21日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるピムコバミューダ インカム ファンド A - クラスY（USD）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債等を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および長期的な値上がり益の獲得をめざします。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	PIMCO インカム戦略ファンド ＜米ドルインカム＞ （毎月分配型）	ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY （USD）およびマネー・マ ーケット・マザーファンドの投資信 託証券を主要投資対象とします。
	ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY （USD）	ピムコ バミューダ インカム ファンド（M）への投資を通じて、 世界の幅広い種類の公社債等お よびそれらの派生商品等を主要 投資対象とします。
	マネー・ マーケット・ マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対 象とします。 外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、配当等収益の水準を考慮して分配します。さらに、基準価額水準に応じて、売買益等を付加して分配する場合があります。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

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

## 運用報告書（全体版）

# PIMCO インカム戦略ファンド ＜米ドルインカム＞ （毎月分配型）

第108期（決算日：2023年5月22日）  
 第109期（決算日：2023年6月20日）  
 第110期（決算日：2023年7月20日）  
 第111期（決算日：2023年8月21日）  
 第112期（決算日：2023年9月20日）  
 第113期（決算日：2023年10月20日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「PIMCO インカム戦略ファンド＜米ドルインカム＞（毎月分配型）」は、去る10月20日に第113期の決算を行いましたので、法令に基づいて第108期～第113期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	基準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落						
	円		円			%		%		百万円
84期(2021年5月20日)	10,169		20			0.7	—	—	99.3	11,456
85期(2021年6月21日)	10,336		20			1.8	—	—	99.4	11,534
86期(2021年7月20日)	10,265		20			△0.5	—	—	99.0	11,333
87期(2021年8月20日)	10,295		20			0.5	—	—	99.1	11,222
88期(2021年9月21日)	10,313		20			0.4	—	—	99.6	11,167
89期(2021年10月20日)	10,726		15			4.2	—	—	99.0	11,583
90期(2021年11月22日)	10,643		15			△0.6	—	—	99.2	11,313
91期(2021年12月20日)	10,553		15			△0.7	—	—	99.0	11,060
92期(2022年1月20日)	10,560		15			0.2	—	—	99.0	11,039
93期(2022年2月21日)	10,510		15			△0.3	—	—	99.0	10,882
94期(2022年3月22日)	10,441		25			△0.4	—	—	98.2	10,233
95期(2022年4月20日)	11,092		25			6.5	—	—	98.3	10,554
96期(2022年5月20日)	10,721		25			△3.1	—	—	99.4	9,804
97期(2022年6月20日)	11,033		55			3.4	—	—	96.2	9,917
98期(2022年7月20日)	11,182		155			2.8	—	—	100.1	10,072
99期(2022年8月22日)	11,337		55			1.9	—	—	99.3	10,519
100期(2022年9月20日)	11,547		55			2.3	—	—	99.5	11,306
101期(2022年10月20日)	11,276		355			0.7	—	—	99.8	11,589
102期(2022年11月21日)	10,784		55			△3.9	—	—	100.0	12,450
103期(2022年12月20日)	10,664		55			△0.6	—	—	100.2	13,453
104期(2023年1月20日)	10,154		55			△4.3	—	—	100.6	13,706
105期(2023年2月20日)	10,428		55			3.2	—	—	99.1	14,946
106期(2023年3月20日)	10,189		55			△1.8	—	—	99.5	15,447
107期(2023年4月20日)	10,357		55			2.2	—	—	99.0	16,457
108期(2023年5月22日)	10,605		55			2.9	—	—	99.1	17,336
109期(2023年6月20日)	10,873		55			3.0	—	—	99.3	18,179
110期(2023年7月20日)	10,817		55			△0.0	—	—	99.7	18,580
111期(2023年8月21日)	11,062		55			2.8	—	—	98.1	19,540
112期(2023年9月20日)	11,052		255			2.2	—	—	98.0	19,942
113期(2023年10月20日)	10,845		55			△1.4	—	—	99.5	20,493

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

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
			騰 落 率	率						
第108期	(期 首) 2023年 4月20日	円		%	%	%	%	%	%	99.0
	4月末	10,357		—	—	—	—	—	—	99.4
	(期 末) 2023年 5月22日	10,350		△0.1	—	—	—	—	—	99.4
第109期	(期 首) 2023年 5月22日	10,660		2.9	—	—	—	—	—	99.1
	5月末	10,605		—	—	—	—	—	—	99.1
	(期 末) 2023年 6月20日	10,670		0.6	—	—	—	—	—	99.0
第110期	(期 首) 2023年 6月20日	10,928		3.0	—	—	—	—	—	99.3
	6月末	10,873		—	—	—	—	—	—	99.3
	(期 末) 2023年 7月20日	11,119		2.3	—	—	—	—	—	98.8
第111期	(期 首) 2023年 7月20日	10,872		△0.0	—	—	—	—	—	99.7
	7月末	10,817		—	—	—	—	—	—	99.7
	(期 末) 2023年 8月21日	10,892		0.7	—	—	—	—	—	98.9
第112期	(期 首) 2023年 8月21日	11,117		2.8	—	—	—	—	—	98.1
	8月末	11,062		—	—	—	—	—	—	98.1
	(期 末) 2023年 9月20日	11,204		1.3	—	—	—	—	—	99.0
第113期	(期 首) 2023年 9月20日	11,307		2.2	—	—	—	—	—	98.0
	9月末	11,052		—	—	—	—	—	—	98.0
	(期 末) 2023年10月20日	11,058		0.1	—	—	—	—	—	99.6
		10,900		△1.4	—	—	—	—	—	99.5

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

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

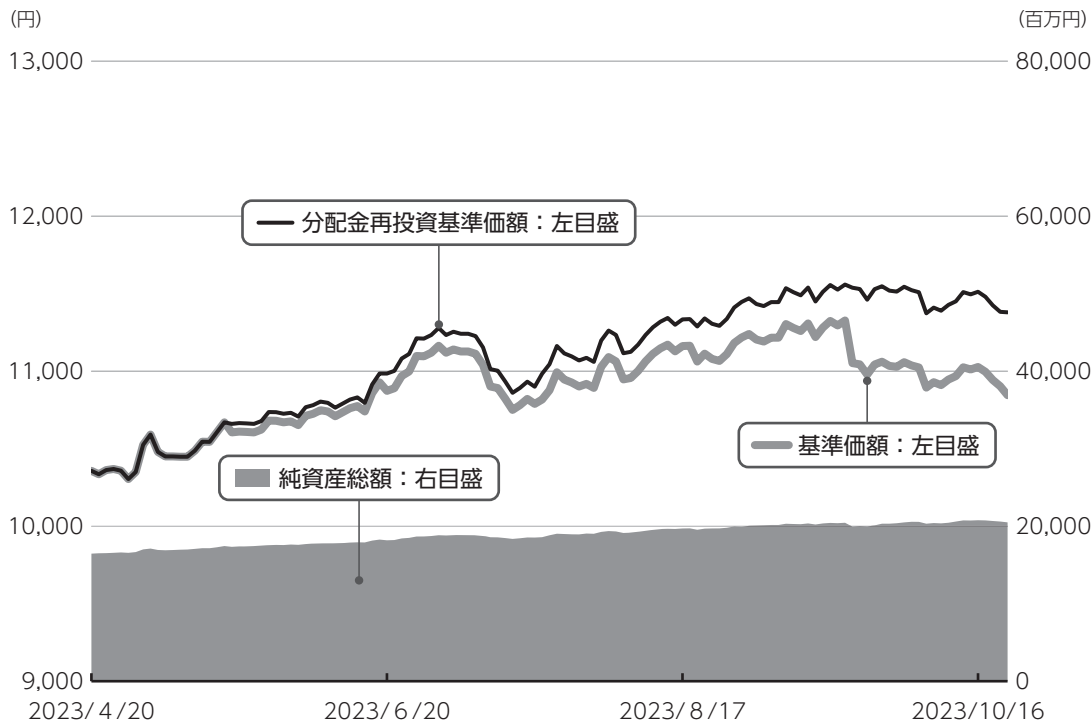
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第108期～第113期：2023年4月21日～2023年10月20日

## ▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第108期首	10,357円
第113期末	10,845円
既払分配金	530円
騰落率	9.9%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

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

### 基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ9.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

### > 基準価額の変動要因

#### 上昇要因

債券利子収入を享受したこと。  
米ドルが対円で上昇したこと。

#### 下落要因

信託報酬等の運用上の費用がかかったこと。  
米国金利が上昇したこと。

第108期～第113期：2023年4月21日～2023年10月20日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**米国債券市況は下落しました。**

米連邦準備制度理事会（F R B）による金融引き締め長期化観測が強まったことなどを背景に、期間を通じてみると米国の長期金利は上昇し、米国債券市況は下落しました。

スプレッド（国債に対する上乗せ金利）セクターにおいては、スプレッドが縮小したことはプラスなどに寄与したものの、米国金利が上昇したことなどがマイナスに影響し、米国ハイイールド社債、新興国債券は共に下落しました。

### ▶ 為替市況

**期間を通じてみると円安・米ドル高となりました。**

F R B が利上げを継続すると共に早期の利下げ観測をけん制したことなどを受けて米国金利が大きく上昇したことから、円安・米ドル高が進行しました。また、米国の消費や労働市場の底堅さを示す経済指標の発表が相次いだことも要因となり、期間を通じてみると円安・米ドル高となりました。

### ▶ 国内短期金融市場

**無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。**

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足元のコール・レートは-0.010%となりました。

## ▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ PIMCO インカム戦略ファンド <米ドルインカム> (毎月分配型)

主として円建て外国投資信託であるピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD) への投資を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

### ▶ ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD)

世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債およびそれらの派生商品を高位に組み入れる運用を行いました。

#### 金利戦略

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ました。当期間においては、金融引き締め長期化観測が強まっている米国について、中期年限の金利リスクを中心に積み増しを行いました。一方で、相対的に投資妙味に欠けると判断した日本の金利リスクは売り持ちとしています。そのほか、米非政府系住

宅ローン担保証券などの変動利付債券を組み入れることで、金利上昇に対する耐性を確保しています。

#### セクター配分戦略

米政府関連債や米政府系住宅ローン担保証券といったリスクオフ時に底堅い値動きが期待出来る債券を組み入れポートフォリオの高い安定性を維持しています。社債についてはファンダメンタルズの健全な発行体を選好して投資を行い、また、長年にわたる住宅価格の上昇から恩恵を受ける米非政府系住宅ローン担保証券への投資を継続しております。また、利回りが相対的に高い新興国債券については、南アフリカやメキシコ等へ投資を継続しています。

### ▶ マネー・マーケット・マザーファンド コール・ローン等短期金融商品を活用し、 利子等収益の確保を図りました。

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

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

## 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第108期 2023年4月21日~ 2023年5月22日	第109期 2023年5月23日~ 2023年6月20日	第110期 2023年6月21日~ 2023年7月20日	第111期 2023年7月21日~ 2023年8月21日	第112期 2023年8月22日~ 2023年9月20日	第113期 2023年9月21日~ 2023年10月20日
当期分配金 (対基準価額比率)	<b>55</b> (0.516%)	<b>55</b> (0.503%)	<b>55</b> (0.506%)	<b>55</b> (0.495%)	<b>255</b> (2.255%)	<b>55</b> (0.505%)
当期の収益	55	55	53	55	65	51
当期の収益以外	-	-	1	-	189	3
翌期繰越分配対象額	2,988	2,988	2,987	3,053	3,038	3,034

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

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

## 今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

### ▶ PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)

円建て外国投資信託への投資を通じて世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債およびそれらの派生商品を高位に組み入れた運用を行います。また、一部、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券の組み入れを維持し、毎月の分配をめざしていく方針です。

### ▶ ピムコ バミューダ インカムファンド A - クラスY (USD)

先進国では足元の景気に底堅さがみられるものの、これまでの金融引き締めによる影響が徐々に波及することで、2024年の景気は減速する可能性が高いとみております。なお、欧米の中央銀行による金融引き締めは最終局面に近いとみていますが、インフレ率が中央銀行の目標水準



まで低下するには時間を要すると想定されることから、利下げは慎重に進められるものと考えられます。米国については、コロナショックにより停滞がみられたサプライチェーンの改善が引き続きインフレ圧力の緩和に繋がる一方、生産性が大幅に改善しない限り、労働市場のひっ迫などによる賃金への上昇圧力を背景にインフレ率は米連邦準備制度理事会（F R B）の目標水準を上回って推移する可能性が高いとみています。ユーロ圏については、クレディ・スイス救済時にスイス当局が普通株より先にA T 1 債を無価値化するという対応を行ったことを背景に、今後の金融機関の資本調達コストが上昇し、域内における融資が縮小することなどが想定され、景気の重しになるとみています。

かかる環境下、投資においては引き続き慎重なリスク管理が求められると考えており、投資の元本保全を意識しつつ、魅力的な水準のインカム収入を獲得していくことは、中長期的にも引き続き重要なテーマであると考えています。

運用戦略としては、リスク取得に過度に傾斜しない投資指針を通じ、市場が軟調となる局面において下値を抑制すると共に、確信度の高いボトムアップの投資アイデアに基づく魅力的な投資機会の発掘に取り組んでいます。当戦略は、質の良い高利回り資産を中心とする「攻め」の

資産と、リスクオフ時にポートフォリオを安定化させる「守り」の資産のバランスを重視し、「良質なインカム」を着実に積み上げることで、引き続き元本の保全と安定的なインカムの提供を目指していきます。

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

2023年4月21日～2023年10月20日

## ▶ 1万口当たりの費用明細

項目	第108期～第113期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	101	0.923	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
( 投 信 会 社 )	(57)	(0.522)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(42)	(0.385)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(2)	(0.017)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	101	0.925	

作成期中の平均基準価額は、10,906円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

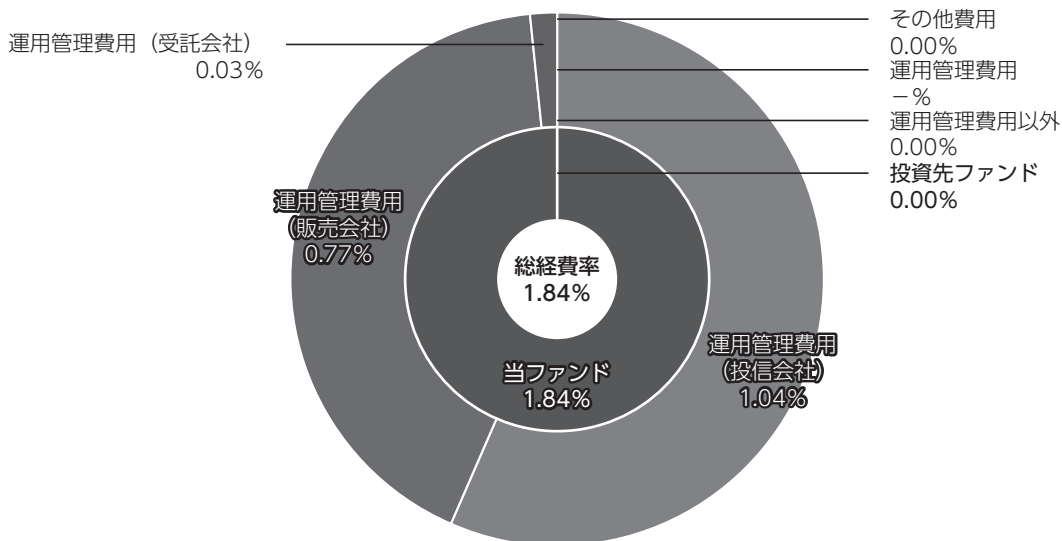
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

## (参考情報)

## ■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.84%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.84
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.84
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.00

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

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

## ○売買及び取引の状況

(2023年4月21日～2023年10月20日)

## 投資信託証券

銘柄		第108期～第113期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ビムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY(USD)	千口 375	千円 4,041,848	千口 103	千円 1,130,100

(注) 金額は受渡代金。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第108期～第113期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 10,401	千円 10,590	千口 -	千円 -

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年4月21日～2023年10月20日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2023年10月20日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第107期末		第113期末		
		口数	金額	口数	評価額	比率
	ビムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY(USD)	千口 1,605	千円 1,878	千口 1,878	千円 20,388,066	% 99.5
	合計	1,605	1,878	1,878	20,388,066	99.5

(注) 比率はPIMCO インカム戦略ファンド&lt;米ドルインカム&gt; (毎月分配型) の純資産総額に対する比率。

## 親投資信託残高

銘柄	第107期末	第113期末	
	口数	口数	評価額
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 8,067	千口 18,468	千円 18,803

## ○投資信託財産の構成

(2023年10月20日現在)

項目	第113期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 20,388,066	% 98.8
マネー・マーケット・マザーファンド	18,803	0.1
コール・ローン等、その他	224,832	1.1
投資信託財産総額	20,631,701	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第108期末	第109期末	第110期末	第111期末	第112期末	第113期末
	2023年5月22日現在	2023年6月20日現在	2023年7月20日現在	2023年8月21日現在	2023年9月20日現在	2023年10月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	17,454,016,398	18,297,722,321	18,834,103,393	19,673,738,512	20,522,762,684	20,631,701,351
コール・ローン等	259,027,433	243,982,653	187,782,644	216,336,886	291,197,752	224,832,154
投資信託受益証券(評価額)	17,186,775,847	18,045,526,550	18,532,617,631	19,171,298,508	19,549,461,814	20,388,066,079
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	8,213,118	8,213,118	18,803,118	18,803,118	18,803,118	18,803,118
未収入金	—	—	94,900,000	267,300,000	663,300,000	—
(B) 負債	117,506,587	117,947,044	253,206,979	133,514,485	580,679,793	137,878,838
未払金	—	—	130,500,000	—	—	—
未払収益分配金	89,912,404	91,961,810	94,480,200	97,150,606	460,131,186	103,936,930
未払解約金	200,000	—	—	5,197,913	90,025,898	2,959,949
未払信託報酬	27,345,022	25,938,338	28,176,110	31,109,932	30,467,778	30,926,664
未払利息	341	589	365	491	536	79
その他未払費用	48,820	46,307	50,304	55,543	54,395	55,216
(C) 純資産総額(A-B)	17,336,509,811	18,179,775,277	18,580,896,414	19,540,224,027	19,942,082,891	20,493,822,513
元本	16,347,709,887	16,720,329,095	17,178,218,271	17,663,746,639	18,044,360,272	18,897,623,712
次期繰越損益金	988,799,924	1,459,446,182	1,402,678,143	1,876,477,388	1,897,722,619	1,596,198,801
(D) 受益権総口数	16,347,709,887口	16,720,329,095口	17,178,218,271口	17,663,746,639口	18,044,360,272口	18,897,623,712口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,605円	10,873円	10,817円	11,062円	11,052円	10,845円

## ○損益の状況

項 目	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日	2023年9月21日～ 2023年10月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	96,620,159	96,792,662	119,666,132	123,590,511	126,469,259	128,056,002
受取配当金	96,630,579	96,806,584	119,676,897	123,607,413	126,484,773	128,064,979
受取利息	—	—	395	35	402	617
支払利息	△ 10,420	△ 13,922	△ 11,160	△ 16,937	△ 15,916	△ 9,594
(B) 有価証券売買損益	422,127,794	465,446,889	△ 98,484,781	431,087,105	335,481,902	△ 381,592,466
売買益	422,535,752	465,930,413	63,081	431,995,729	339,965,746	216,838
売買損	△ 407,958	△ 483,524	△ 98,547,862	△ 908,624	△ 4,483,844	△ 381,809,304
(C) 信託報酬等	△ 27,393,842	△ 25,984,645	△ 28,226,414	△ 31,165,475	△ 30,522,173	△ 30,981,880
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	491,354,111	536,254,906	△ 7,045,063	523,512,141	431,428,988	△ 284,518,344
(E) 前期繰越損益金	△ 115,500,662	284,676,995	728,134,251	624,625,349	1,034,159,843	1,003,116,029
(F) 追加信託差損益金	702,858,879	730,476,091	776,069,155	825,490,504	892,264,974	981,538,046
(配当等相当額)	( 3,940,342,397)	( 4,056,274,980)	( 4,194,860,723)	( 4,343,463,418)	( 4,477,127,212)	( 4,739,197,075)
(売買損益相当額)	(△3,237,483,518)	(△3,325,798,889)	(△3,418,791,568)	(△3,517,972,914)	(△3,584,862,238)	(△3,757,659,029)
(G) 計 (D + E + F)	1,078,712,328	1,551,407,992	1,497,158,343	1,973,627,994	2,357,853,805	1,700,135,731
(H) 収益分配金	△ 89,912,404	△ 91,961,810	△ 94,480,200	△ 97,150,606	△ 460,131,186	△ 103,936,930
次期繰越損益金 (G + H)	988,799,924	1,459,446,182	1,402,678,143	1,876,477,388	1,897,722,619	1,596,198,801
追加信託差損益金	702,858,879	730,476,091	776,069,155	825,490,504	892,264,974	981,538,046
(配当等相当額)	( 3,940,342,397)	( 4,056,274,980)	( 4,194,860,723)	( 4,343,463,418)	( 4,477,127,212)	( 4,739,197,075)
(売買損益相当額)	(△3,237,483,518)	(△3,325,798,889)	(△3,418,791,568)	(△3,517,972,914)	(△3,584,862,238)	(△3,757,659,029)
分配準備積立金	944,522,168	940,702,968	936,583,778	1,050,986,884	1,005,457,645	996,253,132
繰越損益金	△ 658,581,123	△ 211,732,877	△ 309,974,790	—	—	△ 381,592,377

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首 (前作成期末) 元本額 15,889,933,913円  
 作成期中追加設定元本額 3,590,042,633円  
 作成期中一部解約元本額 582,352,834円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0845円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日	2023年9月21日～ 2023年10月20日
費用控除後の配当等収益額	91,516,606円	92,318,022円	91,439,625円	116,646,584円	118,112,085円	97,074,033円
費用控除後・繰越欠損金繰戻後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	97,872,044円	313,316,903円	—円
収益調整金額	3,940,342,397円	4,056,274,980円	4,194,860,723円	4,343,463,418円	4,477,127,212円	4,739,197,075円
分配準備積立金額	942,917,966円	940,346,756円	939,624,353円	933,618,862円	1,034,159,843円	1,003,116,029円
当ファンドの分配対象収益額	4,974,776,969円	5,088,939,758円	5,225,924,701円	5,491,600,908円	5,942,716,043円	5,839,387,137円
1万円当たり収益分配対象額	3,043円	3,043円	3,042円	3,108円	3,293円	3,089円
1万円当たり分配金額	55円	55円	55円	55円	255円	55円
収益分配金金額	89,912,404円	91,961,810円	94,480,200円	97,150,606円	460,131,186円	103,936,930円

③信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の60以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○分配金のお知らせ

	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
1万口当たり分配金 (税込み)	55円	55円	55円	55円	255円	55円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

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

◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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

## 【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

<参考> 投資する投資信託証券およびその概要

<b>ファンド名</b>	ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD)
<b>運用方針</b>	ピムコ バミューダ インカム ファンド (M) への投資を通じて、世界（新興国を含みます。以下同じ。）の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等に実質的な投資を行い、利子収益の獲得をめざします。
<b>主要運用対象</b>	世界の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等
<b>主な組入制限</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 通常、総資産の 65%以上を世界の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等に投資します。</li> <li>・ 投資適格未満の公社債等への投資比率は総資産の 50%以内とします。ただし、資産担保証券およびモーゲージ証券についてはこの限りではありません。</li> <li>・ ポートフォリオの平均デュレーション<sup>※</sup>は、原則として 0～8 年の範囲で調整します。  <small>※デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいくほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。</small></li> <li>・ 米ドル以外の通貨エクスポージャーを総資産の 10%以内で持つことができます。</li> <li>・ 新興国の発行体が発行する銘柄への投資は総資産の 20%以内とします。</li> <li>・ 保有外貨建て資産に対し、原則として、為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
<b>決算日</b>	毎年 10 月 31 日
<b>分配方針</b>	原則として毎月分配を行う方針です。



運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Bermuda Trust II Annual Report October 31, 2022版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは「ピムコ バミューダ インカム ファンド A」で掲載しています。また、「ピムコ バミューダ インカム ファンド (M)」を「マスターファンド」と表示する場合があります。

### (1) 運用計算書

#### ピムコ バミューダ インカム ファンド A (2022年10月31日に終了する期間)

	ピムコ インカム	バミューダ ファンド A
	千米ドル	
<b>投資収入：</b>		
受取利息（外国税額控除後*）		3,963
受取配当金（外国税額控除後*）		0
雑収入		0
収入合計		3,963
<b>費用：</b>		
顧問料		0
顧問料W(USD)		188
管理報酬M(JPY アドバイザー)		547
管理報酬M(USD アドバイザー)		332
管理報酬P(JPY)		241
管理報酬R(USD)		93 <sup>(1)</sup>
管理報酬T(JPY)		5,769
管理報酬U(USD)		83 <sup>(2)</sup>
管理報酬U2(JPY)		214 <sup>(3)</sup>
管理報酬X(JPY)		30
管理事務費		0
管理事務費R(USD)		29 <sup>(1)</sup>
管理事務費W(USD)		58
販売報酬M(JPY アドバイザー)		474
販売報酬M(USD アドバイザー)		288
販売報酬P(JPY)		241
代行費用M(JPY アドバイザー)		37
代行費用M(USD アドバイザー)		22
支払利息		133
雑費		12
費用合計		8,791
<b>投資純収入</b>		<b>(4,828)</b>
<b>実現純利益（損失）：</b>		
投資有価証券		0
マスターファンド		440,185
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		(2,074,947)
外貨		(2,481)
実現純利益（損失）		(1,637,243)
<b>未実現評価益（評価損）の純変動：</b>		
投資有価証券		(1)
マスターファンド		(1,752,599)
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		(4,806)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨		(100)
未実現評価益（評価損）の純変動		(1,757,506)
純利益（損失）		(3,394,749)
<b>運用による純資産の純増（減）額</b>		<b>(3,399,577)</b>
*外国税源泉徴収		0

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

<sup>(1)</sup> 2022年1月21日（設定）から2022年10月31日までの期間。

<sup>(2)</sup> 2021年11月1日から2022年2月10日までの期間（終了）。

<sup>(3)</sup> 2022年2月3日（設定）から2022年10月31日までの期間。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ バミューダ インカム ファンド A  
(2022年10月31日に終了する期間)

ピムコ バミューダ  
インカム ファンド A  
千米ドル

純資産の増加（減少）：

運用：

投資純収入	(4, 828)
実現純利益（損失）	(1, 637, 243)
未実現評価益（評価損）の純変動	(1, 757, 506)
運用による純資産の純増（減）額	(3, 399, 577)

分配：

F (JPY)	(38, 633)
F (USD)	(86, 845)
J (JPY)	(10, 837)
J (USD)	(3, 870)
N (JPY)	(290, 646)
N (USD)	(141, 816)
NN (USD)	(5, 403)
P (JPY)	(349)
Q (JPY)	0
R (JPY)	0
R (USD)	0 <sup>(1)</sup>
S (JPY)	(5, 933)
U (USD)	(811) <sup>(2)</sup>
U2 (JPY)	0 <sup>(3)</sup>
X (JPY)	0
X (USD)	(5, 656)
Y (JPY)	(8, 330)
Y (USD)	(12, 662)
分配金額合計	(611, 791)

ファンドユニット取引：

ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額	1, 051, 973
-------------------------	-------------

純資産の増（減）額合計

(2, 959, 395)

純資産：

期首	12, 875, 599
期末	9, 916, 204

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

<sup>(1)</sup> 2022年1月21日（設定）から2022年10月31日までの期間。

<sup>(2)</sup> 2021年11月1日から2022年2月10日までの期間（終了）。

<sup>(3)</sup> 2022年2月3日（設定）から2022年10月31日までの期間。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)

(A) ピムコ バミューダ インカム ファンド A

(2022年10月31日現在)

元本 時価  
(単位：千) (単位：千)

INVESTMENTS IN SECURITIES 4.7%		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 4.7%		
TIME DEPOSITS 4.7%		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
2.580% due 11/01/2022	\$ 72,714	\$ 72,714
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
2.580% due 11/01/2022	5,987	5,987
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
2.580% due 11/01/2022	39	39
<b>Citibank N.A.</b>		
2.580% due 11/01/2022	60,870	60,870
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
2.580% due 11/01/2022	37,928	37,928
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
2.580% due 11/01/2022	81,160	81,160
<b>Royal Bank of Canada</b>		
2.580% due 11/01/2022	80,362	80,362
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
2.580% due 11/01/2022	61,645	61,645
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
2.580% due 11/01/2022	62,794	62,794
		<u>463,499</u>
U.S. TREASURY BILLS 0.0%		
2.552% due 11/10/2022 (a)	2,825	2,823
U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS 0.0%		
3.278% due 01/10/2023 (a)	1,720	1,707
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<u>468,029</u>
<b>(Cost \$468,031)</b>		
<b>Total Investments in Securities</b>		<u>468,029</u>
<b>(Cost \$468,031)</b>		
	口数	(単位：千)
INVESTMENTS IN AFFILIATES 95.8%		
OTHER INVESTMENT COMPANIES 95.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
(Cost \$9,636,026)	682,263	9,497,093
<b>Total Investments in Affiliates</b>		<u>9,497,093</u>
<b>(Cost \$9,636,026)</b>		
<b>Total Investments 100.5%</b>		<u>\$ 9,965,122</u>
<b>(Cost \$10,104,057)</b>		
Financial Derivative		
Instruments (b) (2.0%)		(197,302)
<b>(Cost or Premiums, net \$0)</b>		
<b>Other Assets and Liabilities, net 1.5%</b>		<u>148,384</u>
<b>Net Assets 100.0%</b>		<u>\$ 9,916,204</u>

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.  
(a) Coupon represents a yield to maturity.

(b) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益		
				資産	負債	
BPS	11/2022	JPY 106,684	\$ 728	\$ 10	\$	0
BPS	11/2022	899,743	6,163	109		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BPS	11/2022	\$ 1,379	JPY 201,334	\$ 0	\$ (25)
BPS	11/2022	0	0	0	0
BPS	11/2022	933	136,228	0	(16)
MBC	11/2022	JPY 844,346	\$ 5,725	44	0
MBC	11/2022	38,092	258	2	0
MYI	11/2022	1,072,662	7,218	0	0
MYI	11/2022	\$ 253	JPY 37,641	0	0
				\$ 165	\$ (41)

F (JPY), J (JPY), M (JPY Advisory), N (JPY), P (JPY), Q (JPY), R (JPY), S (JPY), T (JPY), U2 (JPY), X (JPY), Y (JPY) AND Z (JPY) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BDA	11/2022	JPY 874,671	\$ 5,984	\$ 99	\$ 0
BDA	11/2022	\$ 2,687	JPY 399,465	1	0
CBK	11/2022	JPY 10,974,574	\$ 75,552	1,716	0
CBK	11/2022	\$ 11,727	JPY 1,750,671	52	0
JPM	11/2022	JPY 210,644,904	\$ 1,435,595	18,400	0
JPM	12/2022	\$ 1,435,595	JPY 209,941,463	0	(18,442)
MBC	11/2022	JPY 253,278,894	\$ 1,723,284	19,251	0
MBC	11/2022	\$ 2,456,288	JPY 354,314,651	0	(72,498)
MBC	12/2022	1,439,739	\$ 211,607,321	0	(11,341)
MYI	11/2022	JPY 93,706	\$ 630	0	0
MYI	11/2022	\$ 1,013,884	JPY 146,309,231	0	(29,532)
RBC	11/2022	398,620	\$ 57,546,962	0	(11,450)
RBC	12/2022	JPY 334,137	\$ 2,275	20	0
SCX	11/2022	65,277,116	438,841	0	0
SCX	12/2022	\$ 438,481	JPY 65,010,705	0	0
SDG	11/2022	JPY 221,942,790	\$ 1,496,893	3,686	0
SDG	12/2022	\$ 1,496,893	JPY 221,204,896	0	(3,709)
SSB	11/2022	JPY 57,631,197	\$ 387,413	0	(323)
SSB	12/2022	\$ 387,413	JPY 57,440,745	325	0
TOR	11/2022	JPY 134,818,267	\$ 912,952	5,909	0
TOR	12/2022	\$ 912,952	JPY 134,368,643	0	(5,926)
UAG	11/2022	2,901,337	417,318,500	0	(93,664)
				\$ 49,459	\$ (246,885)
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>				<b>\$ 49,624</b>	<b>\$ (246,926)</b>





	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	
<b>Melco Resorts Finance Ltd.</b>									
4.875% due 06/06/2025	\$ 400	\$ 286		5.500% due 01/15/2026	\$ 6,500	\$ 4,517	3.250% due 06/15/2023	\$ 8,640	\$ 8,506
5.375% due 12/04/2029	5,200	2,915		5.500% due 10/01/2027	1,000	647	3.250% due 06/01/2031	3,800	2,982
				5.625% due 08/26/2028	1,198	734	3.300% due 03/15/2027	3,838	3,311
						<b>537,719</b>	3.300% due 12/01/2027	14,666	12,450
<b>MGM China Holdings Ltd.</b>	4,500	3,586					3.300% due 08/01/2040	1,542	1,004
5.250% due 06/18/2025				<b>UTILITIES 8.1%</b>			3.400% due 08/15/2024	6,570	6,251
<b>Micron Technology, Inc.</b>				<b>Altice Financing S.A.</b>			3.450% due 07/01/2025	12,102	11,254
4.663% due 02/15/2030	3,365	3,007		3.000% due 01/15/2028	EUR 1,200	910	3.500% due 06/15/2025	8,068	7,510
5.327% due 02/06/2029	1,333	1,237		4.250% due 08/15/2029	3,510	2,666	3.500% due 08/01/2050	4,660	2,851
<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>				5.750% due 08/15/2029	\$ 12,389	9,755	3.750% due 02/15/2024	10,188	9,882
3.743% due 12/15/2030	435	403		<b>Altice France S.A.</b>			3.750% due 07/01/2028	13,613	11,630
6.013% due 12/15/2028	GBP 874	933		8.125% due 02/01/2027	2,744	2,516	3.750% due 08/15/2042	418	266
<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b>				<b>Charter Communications Operating LLC</b>			3.850% due 11/15/2023	1,830	1,789
3.522% due 09/17/2025	\$ 8,300	7,368		3.900% due 06/01/2052	10,000	6,211	3.950% due 12/01/2047	2,500	1,617
4.345% due 09/17/2027	8,700	7,338		3.950% due 06/30/2062	3,500	2,055	4.000% due 12/01/2046	3,144	2,005
4.810% due 09/17/2030	2,250	1,799		4.400% due 12/01/2061	9,500	6,041	4.200% due 03/01/2029	9,900	8,600
<b>NMG Holding Co., Inc.</b>				4.800% due 03/01/2050	3,818	2,709	4.250% due 08/01/2023	3,735	3,698
7.125% due 04/01/2026	11,900	11,333		<b>Constellation Oil Services Holding S.A.</b>			4.250% due 03/15/2046	5,219	3,483
<b>Oracle Corp.</b>				3.000% due 12/31/2026 (f)	377	282	4.300% due 03/15/2045	3,000	2,026
3.950% due 04/01/2060	1,835	1,112		<b>Directv Financing LLC</b>			4.400% due 03/01/2032	7,300	6,119
<b>PeaceHealth Obligated Group</b>				5.875% due 08/15/2027	7,200	6,498	4.450% due 04/15/2042	4,333	3,062
3.218% due 11/15/2050	3,100	1,918		<b>DISH DBS Corp.</b>			4.500% due 07/01/2040	39,210	29,308
<b>QVC, Inc.</b>				5.250% due 12/01/2026	11,110	9,673	4.500% due 12/15/2041	743	507
5.950% due 03/15/2043	5,293	3,240		5.750% due 12/01/2028	11,110	8,978	4.550% due 07/01/2030	50,195	44,022
<b>Roadster Finance DAC</b>				<b>Enel Finance America LLC</b>			4.600% due 06/15/2043	1,794	1,289
2.375% due 12/08/2027	EUR 1,000	843		7.100% due 10/14/2027	6,000	5,986	4.650% due 08/01/2028	100	88
<b>Rolls-Royce PLC</b>				<b>Enel Finance International NV</b>			4.750% due 02/15/2044	2,707	1,958
4.625% due 02/16/2026	13,860	13,124		7.500% due 10/14/2032	4,700	4,714	4.950% due 07/01/2050	25,950	19,397
5.750% due 10/15/2027	GBP 8,199	8,159		7.750% due 10/14/2052	3,000	2,881	5.250% due 03/01/2052	7,300	5,630
<b>Royal Caribbean Cruises Ltd.</b>				<b>Garzprom PJSC Via Gaz Capital S.A.</b>			<b>Petrobras Global Finance BV</b>		
11.500% due 06/01/2025	\$ 7,300	7,871		2.250% due 11/22/2024	EUR 100	62	6.250% due 12/14/2026	GBP 6,234	6,833
<b>Russian Railways Via RZD Capital PLC</b>				2.949% due 01/24/2024	450	278	6.625% due 01/16/2034	2,900	2,800
7.487% due 03/25/2031	GBP 6,300	2,539		4.950% due 03/23/2027	\$ 1,800	963	<b>Petroleos de Venezuela S.A. (c)</b>		
<b>Sands China Ltd.</b>				4.950% due 02/06/2028	1,000	545	5.375% due 04/12/2027	\$ 11,932	283
3.350% due 03/08/2029	\$ 2,500	1,679		5.150% due 02/11/2026	5,700	3,550	5.500% due 04/12/2037	10,372	236
3.750% due 08/08/2031	2,200	1,445		7.288% due 08/16/2037	500	282	6.000% due 05/16/2024	8,283	217
4.300% due 01/08/2026	3,000	2,462		8.625% due 04/28/2034	2,372	1,340	6.000% due 11/15/2026	13,183	300
4.875% due 06/18/2030	2,700	1,930		<b>Garzprom PJSC via Gaz Finance PLC</b>			9.000% due 11/17/2022	400	9
5.625% due 08/08/2025	4,500	3,984		1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	18,868	9.750% due 05/17/2035	4,730	112
5.900% due 08/08/2028	5,500	4,381		2.950% due 04/15/2025	5,000	2,842	<b>Petroleos Mexicanos</b>		
<b>Studio City Co. Ltd.</b>				2.950% due 01/27/2029	\$ 23,200	13,579	2.750% due 04/21/2027	EUR 1,200	883
7.000% due 02/15/2027	2,700	2,148		<b>iHeartCommunications, Inc.</b>			5.950% due 01/28/2031	\$ 22,485	16,245
<b>Syngenta Finance NV</b>				4.750% due 01/15/2028	36,300	31,726	6.700% due 02/16/2032	79,356	60,145
3.375% due 04/16/2026	EUR 11,100	10,051		6.375% due 05/01/2026	6,808	6,503	6.950% due 01/28/2060	6,116	3,681
4.441% due 04/24/2023	\$ 5,300	5,257		8.375% due 05/01/2027	6,911	6,220	7.690% due 01/23/2050	1,570	1,026
4.892% due 04/24/2025	800	766		<b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>			<b>PG&amp;E Wildfire Recovery Funding LLC</b>		
<b>Times Square Hotel Trust</b>				6.500% due 03/15/2030	70,143	64,550	4.263% due 06/01/2036	3,600	3,245
8.528% due 08/01/2026	1,070	1,054		<b>Netflix, Inc.</b>			4.377% due 06/01/2039	3,990	3,479
<b>Triumph Group, Inc.</b>				3.625% due 05/15/2027	EUR 3,900	3,761	4.451% due 12/01/2047	20,700	17,233
6.250% due 09/15/2024	1,541	1,427		3.625% due 06/15/2030	18,776	16,893	4.674% due 12/01/2051	3,600	3,086
<b>U.S. Renal Care, Inc.</b>				3.875% due 11/15/2029	8,217	7,566	<b>Prosus NV</b>		
10.625% due 07/15/2027	1,282	519		4.625% due 05/15/2029	7,600	7,343	1.985% due 07/13/2033 (n)	EUR 5,600	3,340
<b>Uber Technologies, Inc.</b>				4.875% due 04/15/2028	\$ 200	190	2.085% due 01/19/2030	4,200	2,934
4.500% due 08/15/2029	2,865	2,461		4.875% due 06/15/2030	2,900	2,689	3.061% due 07/13/2031	\$ 11,900	8,004
7.500% due 05/15/2025	571	572		5.375% due 11/15/2029	1,219	1,219	4.193% due 01/19/2032	5,600	3,989
<b>United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust</b>				5.875% due 11/15/2028	300	298	4.987% due 01/19/2052	4,700	2,925
2.700% due 05/01/2032	1,365	1,086		6.375% due 05/15/2029	1,500	1,532	<b>Rio Oil Finance Trust Series 2014-1</b>		
<b>United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust</b>				<b>Noble Finance Co.</b>			9.250% due 07/06/2024	1,184	1,199
5.875% due 10/15/2027	24,502	23,679		11.000% due 02/15/2028 (f)	2,086	2,263	<b>Rio Oil Finance Trust Series 2014-3</b>		
<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>				<b>NPC Ukrenegro</b>			9.750% due 01/06/2027	554	573
3.875% due 08/15/2029	3,600	3,097		6.875% due 11/09/2028 (h)	1,200	215	<b>Rio Oil Finance Trust Series 2018-1</b>		
3.875% due 11/01/2033	15,900	12,790		<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>			8.200% due 04/06/2028	2,383	2,388
4.125% due 08/15/2031	3,500	2,983		6.720% due 12/01/2022	20	20	<b>Southern California Edison Co.</b>		
<b>VOC Escrow Ltd.</b>				<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>			4.875% due 03/01/2049	346	279
5.000% due 02/15/2028	1,100	908		2.100% due 08/01/2027	1,910	1,572	<b>Sprint Capital Corp.</b>		
<b>Western Midstream Operating LP</b>				2.500% due 02/01/2031	2,600	1,946	8.750% due 03/15/2032	2,200	2,585
5.041% due 01/13/2023	1,048	1,043		2.950% due 03/01/2026	8,630	7,643	<b>Sprint Communications LLC</b>		
<b>Wynn Las Vegas LLC</b>				3.000% due 06/15/2028	11,288	9,298	6.000% due 11/15/2022	3,934	3,940
5.250% due 05/15/2027	1,800	1,569		3.150% due 01/01/2026	15,753	14,202			
<b>Wynn Macau Ltd.</b>									
5.125% due 12/15/2029	2,800	1,701							

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Sprint Corp.</b>		
7.125% due 06/15/2024	\$ 8,766	\$ 8,874
7.625% due 02/15/2025	1,100	1,132
7.625% due 03/01/2026	839	877
7.875% due 09/15/2023	46,749	47,578
<b>Sprint Spectrum Co. LLC</b>		
4.738% due 03/20/2025	2,425	2,392
5.152% due 03/20/2028	2,758	2,685
<b>System Energy Resources, Inc.</b>		
2.140% due 12/09/2025	6,100	5,475
<b>T-Mobile USA, Inc.</b>		
3.375% due 04/15/2029	5,983	5,188
3.500% due 04/15/2031	3,000	2,527
<b>Topaz Solar Farms LLC</b>		
4.875% due 09/30/2039	5,450	4,610
5.750% due 09/30/2039	7,731	7,363
<b>Transocean Phoenix 2 Ltd.</b>		
7.750% due 10/15/2024	840	836
<b>Transocean, Inc.</b>		
7.500% due 01/15/2026	1,228	1,040
8.000% due 02/01/2027	2,983	2,423
<b>United Group BV</b>		
4.875% due 07/01/2024	EUR 565	535
<b>Valaris Ltd.</b>		
8.250% due 04/30/2028 (f)	\$ 2,483	2,446
<b>Viasat, Inc.</b>		
5.625% due 09/15/2025	3,363	3,109
6.500% due 07/15/2028	2,700	2,261
<b>Windstream Escrow LLC</b>		
7.750% due 08/15/2028	11,607	10,076
		<u>777,725</u>
<b>Total Corporate Bonds &amp; Notes</b>		<b>2,020,932</b>
<b>(Cost \$2,522,028)</b>		
<b>CONVERTIBLE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>Multiplan Corp.</b>		
6.000% due 10/15/2027 (d)	5,700	3,933
<b>Nationwide Building Society</b>		
10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	9,571
<b>Stichting AK Rabobank Certificaten</b>		
6.500% due 03/29/2170 (e)	EUR 30,963	28,971
<b>Total Convertible Bonds &amp; Notes</b>		<b>42,475</b>
<b>(Cost \$67,887)</b>		
<b>MUNICIPAL BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010</b>		
6.630% due 02/01/2035	\$ 655	654
6.725% due 04/01/2035	310	310
7.350% due 07/01/2035	506	519
<b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015</b>		
7.750% due 01/01/2042	130	131
<b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017</b>		
7.045% due 01/01/2029	275	274
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2021</b>		
4.000% due 07/01/2037	2,082	1,861
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022</b>		
0.000% due 11/01/2043	13,426	6,142
<b>Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021</b>		
2.246% due 05/01/2029	1,600	1,305
3.000% due 06/01/2046	710	644
<b>Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (c)</b>		
6.050% due 07/01/2032	800	604

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
6.125% due 07/01/2040	\$ 3,000	\$ 2,265
<b>Total Municipal Bonds &amp; Notes</b>		<b>14,509</b>
<b>(Cost \$14,672)</b>		
<b>U.S. GOVERNMENT AGENCIES 28.5%</b>		
<b>Fannie Mae</b>		
2.614% due 05/25/2048 (g)	\$ 2,241	281
3.000% due 04/01/2037	667	615
3.000% due 09/01/2049	194	167
3.000% due 03/01/2050	18,419	15,817
3.000% due 10/01/2051	1,378	1,174
3.000% due 12/01/2051	210	179
3.000% due 02/01/2052	10,966	9,361
3.000% due 03/01/2052	25,128	21,428
3.000% due 04/01/2052	27,202	23,152
3.000% due 05/01/2052	3,554	3,030
3.000% due 06/01/2052	9,382	8,001
3.000% due 07/01/2052	7,483	6,393
3.000% due 08/01/2052	3,667	3,126
3.500% due 08/01/2042	20	18
3.500% due 09/01/2047	182	165
3.500% due 03/01/2048	56	50
3.500% due 04/01/2051	729	653
4.000% due 07/01/2040	7	6
4.000% due 12/01/2041	55	50
4.000% due 07/01/2042	75	67
4.000% due 08/01/2042	8	7
4.000% due 09/01/2042	98	89
4.000% due 11/01/2045	98	92
4.000% due 03/01/2047	31	29
4.000% due 04/01/2047	242	227
4.000% due 08/01/2047	4,110	3,834
4.000% due 10/01/2047	257	239
4.000% due 12/01/2047	82	76
4.000% due 01/01/2048	52	48
4.000% due 02/01/2048	586	546
4.000% due 07/01/2048	6,869	6,338
4.000% due 08/01/2048	4,053	3,744
4.000% due 09/01/2048	1,153	1,075
4.500% due 05/01/2033	15	14
4.500% due 05/01/2035	6	6
4.500% due 02/01/2038	1	1
4.500% due 01/01/2041	177	164
4.750% due 06/01/2033	172	163
5.000% due 10/01/2035	64	63
5.000% due 12/01/2035	148	142
5.000% due 10/01/2036	6	6
5.000% due 05/01/2038	2	2
5.000% due 11/01/2039	7	7
5.500% due 07/01/2033	23	23
5.500% due 06/01/2035	699	682
5.500% due 04/01/2036	1	1
5.500% due 11/01/2036	2	2
5.500% due 03/01/2037	11	11
5.500% due 09/01/2037	5	4
5.500% due 02/01/2038	3	3
5.500% due 04/01/2038	13	13
6.000% due 08/01/2031	22	21
6.000% due 06/01/2032	1	1
6.000% due 09/01/2039	373	368
6.000% due 10/01/2047	8	8
6.500% due 01/01/2037	2	2
6.500% due 10/01/2037	3	3
7.000% due 09/01/2031	30	30
7.000% due 05/01/2037	1	1

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Fannie Mae, TBA (h)</b>		
2.500% due 11/01/2052	\$ 47,000	\$ 38,482
2.500% due 12/01/2052	99,000	81,061
3.000% due 12/01/2052	243,350	206,886
3.500% due 12/01/2052	862,411	757,936
4.000% due 11/01/2052	55,000	50,006
4.000% due 12/01/2052	107,150	97,375
4.500% due 12/01/2052	36,200	33,940
<b>Freddie Mac</b>		
3.000% due 05/01/2037	1,902	1,753
3.000% due 11/01/2046	63	54
3.000% due 12/01/2047	1,956	1,692
3.000% due 03/01/2048	111	96
3.000% due 04/01/2052	154	132
3.000% due 07/01/2052	164	140
3.138% due 06/15/2042 (g)	33	4
3.500% due 10/01/2039	122	110
3.500% due 10/01/2047	2,126	1,914
3.500% due 12/01/2047	724	651
3.500% due 03/01/2048	2,588	2,325
3.500% due 04/01/2048	933	840
3.500% due 10/01/2048	1,039	931
3.500% due 12/01/2048	2,503	2,251
3.500% due 03/01/2049	1,595	1,427
3.500% due 05/01/2051	82	73
4.000% due 09/01/2033	1	1
4.000% due 04/01/2047	328	307
4.000% due 05/01/2047	319	298
4.000% due 08/01/2047	570	532
4.000% due 08/01/2048	673	624
4.000% due 09/01/2048	276	255
4.000% due 12/01/2048	10,622	9,840
4.000% due 02/01/2049	4,039	3,742
4.000% due 03/01/2049	315	292
5.000% due 06/01/2034	75	75
5.000% due 08/01/2035	42	41
5.000% due 01/01/2037	3	3
5.000% due 01/01/2038	1	1
5.000% due 01/01/2035	273	271
5.500% due 05/01/2037	2	2
5.500% due 06/01/2037	205	203
5.750% due 05/01/2037	186	186
6.000% due 07/01/2037	44	44
<b>Ginnie Mae</b>		
4.000% due 06/20/2041	2	1
4.000% due 04/20/2047	1,622	1,520
4.000% due 05/20/2047	30,018	28,145
4.000% due 06/20/2047	14,337	13,442
4.000% due 07/20/2047	12,474	11,696
4.000% due 02/20/2048	8,496	7,981
4.000% due 05/20/2049	29,604	27,562
4.000% due 02/20/2050	360	337
4.000% due 07/20/2050	179	166
4.000% due 08/20/2050	27	25
4.000% due 09/20/2050	2,159	2,009
4.000% due 10/20/2050	67,643	62,916
4.500% due 01/20/2040	79	76
4.500% due 03/20/2040	8	7
5.000% due 08/20/2030	191	188
5.000% due 05/20/2040	276	270
5.000% due 04/20/2041	7	7
5.000% due 05/20/2038	7	7
5.000% due 06/20/2038	40	40
5.000% due 07/20/2038	35	34
5.000% due 08/20/2038	279	280
5.000% due 09/20/2038	75	75
5.000% due 10/20/2038	15	15







	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
2.985% due 01/28/2042	GBP 54,421	\$ 59,356	6.000% due 12/25/2035 (c)	\$ 481	\$ 199	5.161% due 04/25/2034	\$ 1,204	\$ 1,078
3.585% due 01/28/2042	5,693	6,121	<b>Morgan Stanley Reremic Trust</b>			<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>		
3.935% due 01/28/2042	4,066	4,360	3.404% due 11/26/2036	6,042	5,270	3.936% due 10/25/2036	16,691	15,347
4.385% due 01/28/2042	2,439	2,609	<b>Mortgage Loan Trust</b>			4.186% due 02/25/2036	1,793	1,767
5.185% due 01/28/2042	1,626	1,741	5.370% due 03/25/2034	3,310	2,983	4.261% due 11/25/2035	10,786	10,472
7.185% due 01/28/2042	3,252	3,345	<b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>			4.266% due 12/25/2035	10,537	9,485
<b>Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC</b>			3.790% due 11/15/2032	1,400	1,262	4.336% due 09/25/2035	8,801	8,560
1.300% due 06/15/2045	EUR 3,120	2,944	8.821% due 02/15/2039	2,900	2,542	<b>RESIMAC Bastille Trust</b>		
<b>Legacy Mortgage Asset Trust</b>			5.471% due 02/15/2033	3,204	3,189	4.073% due 09/05/2057	1,612	1,612
0.000% due 09/25/2059 (g)	\$ 621,026	3,092	<b>New York Mortgage Trust</b>			<b>Saxon Asset Securities Trust</b>		
0.000% due 09/25/2059	18,314	5,964	4.126% due 04/25/2035	623	590	2.472% due 03/25/2035 (c)	506	490
3.000% due 09/25/2059	107,358	100,159	<b>Newgate Funding PLC</b>			5.336% due 12/25/2037	3,000	2,779
4.040% due 09/25/2059	129,610	94,743	2.903% due 12/15/2050	GBP 18,103	19,844	<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>		
5.382% due 01/28/2070	33,490	33,407	<b>Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</b>			5.034% due 05/25/2035 (c)	\$ 2,890	1,462
<b>Lehman XS Trust</b>			5.034% due 05/25/2035 (c)	\$ 2,890	1,462	<b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>		
3.786% due 02/25/2037 (c)	13,119	11,256	4.351% due 05/25/2035	7,329	7,116	4.351% due 05/25/2035	7,329	7,116
3.966% due 09/25/2036	5,858	4,627	5.745% due 10/25/2036 (c)	21,971	5,648	5.745% due 10/25/2036 (c)	21,971	5,648
3.966% due 12/25/2036	11,465	8,775	<b>Nomura Resecuritization Trust</b>			1.931% due 03/26/2037	5,987	5,348
4.106% due 02/25/2047	22,721	20,159	<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>			3.786% due 09/25/2037	18,680	17,949
5.286% due 10/25/2037	13,965	12,686	3.906% due 05/25/2036	5,904	5,727	3.906% due 05/25/2036	5,904	5,727
6.500% due 06/25/2046	4,809	3,783	3.906% due 10/25/2036	5,502	3,076	3.906% due 10/25/2036	5,502	3,076
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>			4.306% due 10/25/2035	1,341	1,319	<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b>		
3.966% due 02/25/2036	5,414	4,396	<b>NYO Commercial Mortgage Trust</b>			5.408% due 11/15/2038	30,000	27,559
3.966% due 03/25/2046	33,650	12,211	5.958% due 11/15/2038	14,400	12,906	<b>Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>		
<b>Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust</b>			4.336% due 07/25/2035	7,965	7,845	<b>Option One Mortgage Loan Trust</b>		
6.836% due 03/25/2032	861	862	<b>Option One Mortgage Loan Trust</b>			3.686% due 02/25/2037	15,375	7,894
2.691% due 04/25/2034	1	1	3.706% due 03/25/2037	8,563	8,044	3.706% due 03/25/2037	8,563	8,044
<b>Mastr Asset-Backed Securities Trust</b>			3.726% due 03/25/2037	36,689	31,460	<b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>		
3.806% due 11/25/2036	26	15	4.321% due 09/25/2035	3,107	2,974	4.321% due 09/25/2035	3,107	2,974
4.141% due 01/25/2036	7,500	6,672	4.366% due 09/25/2035 (c)	25,075	21,044	<b>People's Financial Realty Mortgage Securities Trust</b>		
4.736% due 08/25/2037	15,101	12,413	3.746% due 09/25/2036	26,527	5,363	3.746% due 09/25/2036	26,527	5,363
<b>Mastr Specialized Loan Trust</b>			<b>Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust (c)</b>			3.622% due 07/25/2035	9,601	6,963
4.306% due 02/25/2036	5,342	4,147	3.896% due 11/25/2036	15,163	12,154	3.896% due 11/25/2036	15,163	12,154
<b>MBRT</b>			<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>			0.000% due 12/12/2055	GBP 0	1,130
5.062% due 11/15/2036	6,435	6,167	<b>PRET LLC</b>			1.843% due 09/25/2051	\$ 42,432	38,399
<b>Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust</b>			<b>Quest Trust</b>			<b>Quest Trust</b>		
6.586% due 10/25/2037	13,033	12,145	5.011% due 03/25/2035	2,667	2,644	5.011% due 03/25/2035	2,667	2,644
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>			<b>RAAC Trust</b>			<b>RAAC Trust</b>		
2.845% due 02/25/2033	8	8	4.291% due 02/25/2036 (c)	9,049	8,328	4.291% due 02/25/2036 (c)	9,049	8,328
3.866% due 05/25/2037	20,107	11,076	4.336% due 06/25/2047	21,346	16,791	4.336% due 06/25/2047	21,346	16,791
4.306% due 07/25/2034	4,854	4,221	<b>RBSGC Mortgage Loan Trust</b>			<b>RBSGC Mortgage Loan Trust</b>		
4.381% due 09/25/2035	1,385	1,346	6.000% due 01/25/2037 (c)	2	2	6.000% due 01/25/2037 (c)	2	2
4.666% due 10/25/2035	830	812	<b>Real Estate Asset Liquidity Trust</b>			2.419% due 06/12/2054	CAD 5,647	4,040
<b>Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust</b>			<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>			4.306% due 11/25/2034	\$ 53	45
3.836% due 07/25/2036	5,076	4,282	4.586% due 09/25/2037	37	31	4.586% due 09/25/2037	37	31
3.846% due 02/25/2037	7,620	3,644	5.612% due 04/25/2037	10,124	3,114	5.612% due 04/25/2037	10,124	3,114
3.886% due 07/25/2036	45,517	18,409	5.675% due 06/25/2037 (c)	3,910	1,207	5.675% due 06/25/2037 (c)	3,910	1,207
4.066% due 06/25/2036	20,749	18,302	<b>Residential Accredit Securities Corporation Trust</b>			<b>Residential Accredit Securities Corporation Trust</b>		
4.086% due 07/25/2036	45,294	18,369	3.806% due 02/25/2037	22,285	21,082	3.806% due 02/25/2037	22,285	21,082
4.126% due 03/25/2036	4,555	4,367	3.886% due 01/25/2037	35,930	26,406	3.886% due 01/25/2037	35,930	26,406
4.321% due 07/25/2035	5,965	5,751	4.081% due 04/25/2036	7,681	7,540	4.081% due 04/25/2036	7,681	7,540
4.586% due 03/25/2033	75	73	4.201% due 03/25/2036	5,500	5,037	4.201% due 03/25/2036	5,500	5,037
4.586% due 07/25/2037	345	334	4.561% due 09/25/2035	6,582	6,382	4.561% due 09/25/2035	6,582	6,382
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>								
0.774% due 11/15/2052 (g)	132,167	3,646						
<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>								
2.428% due 04/05/2042	13,500	10,198						
5.062% due 08/15/2033	2,619	2,556						
5.790% due 12/15/2023	21,942	20,312						
6.489% due 12/15/2023	40,574	37,162						
<b>Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust</b>								
4.126% due 02/25/2036 (c)	18,209	17,982						
<b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>								
4.096% due 02/25/2036	14,415	13,278						
<b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>								
4.046% due 07/25/2036	10,169	4,363						
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>								
2.982% due 11/25/2037	1,247	923						

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
2.193% due 03/24/2059	EUR 22,011	\$ 21,535
2.743% due 03/24/2059	17,746	17,350
3.343% due 03/24/2059	14,202	13,785
4.593% due 03/24/2059	8,521	8,256
5.943% due 03/24/2059	4,256	4,123
6.500% due 03/24/2059	6,568	5,512
6.943% due 03/24/2059	4,256	4,125
7.000% due 03/24/2059	35,506	27,651
<b>Sutherland Commercial Mortgage Loans</b>		
3.192% due 05/25/2037	\$ 50	50
<b>Taurus UK DAC</b>		
2.637% due 06/22/2029	GBP 5,417	6,119
<b>Terwin Mortgage Trust</b>		
4.966% due 03/25/2035	\$ 2,943	2,712
<b>Tharaldson Hotel Portfolio Trust</b>		
5.499% due 11/11/2034	4,718	4,428
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>		
3.750% due 09/25/2062	104,988	97,533
<b>Trinidad Mortgage Securities PLC</b>		
3.110% due 01/24/2059	GBP 5,042	5,746
<b>Truman Capital Mortgage Loan Trust</b>		
3.840% due 03/25/2036	\$ 849	838
<b>Verus Securitization Trust</b>		
4.474% due 04/25/2067	32,656	30,704
<b>Wachovia Mortgage Loan Trust</b>		
4.276% due 10/25/2035	3,180	2,781
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>		
4.306% due 01/25/2045	412	370
<b>Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC</b>		
0.000% due 12/21/2049	GBP 0	272
3.040% due 12/21/2049	27,586	31,734
3.798% due 12/21/2049	4,821	5,658
4.240% due 12/21/2049	2,460	2,827
4.740% due 12/21/2049	1,406	1,615
5.240% due 12/21/2049	1,406	1,614
6.670% due 12/21/2049	0	3,395
<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates</b>		
<b>WMAL Trust (c)</b>		
2.221% due 10/25/2046	\$ 10,743	8,696
5.500% due 11/25/2035	62	54
<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>		
4.006% due 03/25/2037	794	769
<b>Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b>		
4.186% due 04/25/2034	3,873	3,657
<b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>		
4.464% due 10/25/2036 (c)	174	159
<b>WFRBS Commercial Mortgage Trust</b>		
0.423% due 03/15/2047 (lg)	8,800	50
<b>Total Mortgage-Backed Securities</b>		<b>3,574,196</b>
<b>(Cost \$3,974,104)</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 4.1%</b>		
<b>AASET Trust</b>		
3.967% due 05/18/2042	153	118
<b>ALESCO Preferred Funding XI Ltd.</b>		
4.054% due 12/23/2036	5,000	4,306
<b>American Homes 4 Rent Trust</b>		
6.231% due 10/17/2036	1,150	1,131
<b>Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.</b>		
5.226% due 05/15/2037	3,146	3,061
<b>Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion</b>		
2.909% due 02/28/2032	EUR 2,000	1,928
<b>BlueMountain CLO XXII Ltd.</b>		
5.159% due 07/15/2031	\$ 3,900	3,779
<b>BPCRE Ltd.</b>		
5.816% due 01/18/2037	13,800	13,672
6.516% due 01/18/2037	3,468	3,441
7.216% due 01/18/2037	13,516	13,133

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Cairn CLO III DAC</b>		
2.688% due 10/20/2028	EUR 2,270	\$ 2,216
<b>Cairn CLO VI DAC</b>		
0.935% due 07/25/2029	1,584	1,548
<b>Castlelake Aircraft Securitization Trust</b>		
4.125% due 06/15/2043	\$ 1,461	1,281
<b>Cologic Canadian Issuer LP</b>		
4.940% due 01/25/2052	CAD 1,800	1,217
<b>FAB CBO BV</b>		
1.826% due 08/20/2080 (c)	EUR 80	78
<b>Gateway Casinos &amp; Entertainment Ltd.</b>		
5.000% due 03/12/2038	CAD 8,464	5,402
<b>Goodgreen</b>		
3.930% due 10/15/2053	\$ 4,635	4,212
<b>Harley Marine Financing LLC</b>		
6.682% due 05/15/2043	4,913	4,318
<b>Humboldt Americas LLC</b>		
0.000% due 11/30/2022	COP 62,570,000	12,281
<b>Jubilee CLO DAC</b>		
2.128% due 07/12/2028	EUR 87	86
<b>KKR CLO 18 Ltd.</b>		
5.134% due 07/18/2030	\$ 1,792	1,755
<b>LoanCore Issuer Ltd.</b>		
4.712% due 07/15/2036	2,350	2,253
4.712% due 11/15/2038	19,100	18,319
<b>METAL LLC</b>		
4.581% due 10/15/2042	11,855	5,958
<b>MF1 LLC</b>		
5.617% due 06/19/2037	22,100	21,693
6.102% due 09/17/2037	9,600	9,503
6.117% due 06/19/2037	8,236	8,034
<b>MMcapS Funding XVII Ltd.</b>		
3.432% due 12/01/2035	544	535
<b>National Collegiate Student Loan Trust</b>		
2.824% due 10/25/2033	4,462	4,290
<b>Navigent Private Education Loan Trust</b>		
4.312% due 11/15/2068	1,550	1,487
5.562% due 12/15/2045	3,003	3,027
<b>Nelnet Student Loan Trust</b>		
4.386% due 09/25/2065	2,798	2,760
<b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b>		
2.060% due 12/20/2031	EUR 12,800	12,324
<b>Sapphire Aviation Finance I Ltd.</b>		
4.250% due 03/15/2040	\$ 17,848	13,603
<b>Saranac CLO III Ltd.</b>		
5.202% due 06/22/2030	26,301	25,876
<b>SMB Private Education Loan Trust</b>		
0.000% due 02/16/2055	3	6,208
3.940% due 02/16/2055	25,092	23,095
4.241% due 02/16/2055	25,092	24,319
4.550% due 02/16/2055	8,414	7,696
4.950% due 02/16/2055	2,185	1,977
5.950% due 02/16/2055	3,907	3,591
<b>Sound Point CLO XV Ltd.</b>		
5.225% due 01/23/2029	1,568	1,546
<b>Taberna Preferred Funding I Ltd.</b>		
4.218% due 07/05/2035	3,362	3,064
<b>Theorem Funding Trust</b>		
6.060% due 12/15/2028	8,372	8,224
<b>Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.</b>		
4.121% due 05/17/2032	472	399
<b>TICP CLO III-2 Ltd.</b>		
5.083% due 04/20/2028	10,405	10,302
<b>Tropic CDO V Ltd.</b>		
4.399% due 07/15/2036	10,258	9,745
<b>TRTX Issuer Ltd.</b>		
4.441% due 02/15/2039	4,500	4,351
<b>TruPS Financials Note Securitization Ltd.</b>		
4.844% due 03/30/2039	19,698	18,960
5.087% due 09/20/2039	3,631	3,440

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Upstart Pass-Through Trust</b>		
3.800% due 04/20/2030	\$ 27,081	\$ 25,314
<b>Upstart Securitization Trust</b>		
5.500% due 06/20/2032	11,653	11,549
<b>Venture XVII CLO Ltd.</b>		
4.959% due 04/15/2027	25,095	24,656
<b>Venture XXI CLO Ltd.</b>		
4.959% due 07/15/2027	212	212
<b>Total Asset-Backed Securities</b>		<b>397,273</b>
<b>(Cost \$427,456)</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 6.2%</b>		
<b>Abu Dhabi Government International Bond</b>		
3.875% due 04/16/2050	2,600	2,021
<b>Argentina Government International Bond</b>		
5.500% due 07/09/2030	78,827	16,176
1.000% due 07/09/2029	4,943	1,023
1.500% due 07/09/2035	51,459	10,237
1.500% due 07/09/2046	1,035	212
3.500% due 07/09/2041	44,349	10,644
3.875% due 01/09/2038	25,740	6,696
<b>Argentina Treasury Bond BONCER (i)</b>		
1.400% due 03/25/2023	ARS 591,348	6,042
1.450% due 08/13/2023	289,924	2,603
<b>Argentine Bonos del Tesoro</b>		
15.500% due 10/17/2026	49,200	36
<b>Asian Development Bank</b>		
4.700% due 03/12/2024	MXN 18,100	834
<b>Australia Government Bond</b>		
1.750% due 06/21/2051	AUD 38,100	14,846
<b>Autonomous City of Buenos Aires Argentina</b>		
69.966% due 02/22/2028	ARS 76,810	261
72.219% due 03/29/2024	62,559	211
<b>Colombia Government International Bond</b>		
4.000% due 02/28/2024	\$ 1,600	1,535
<b>International Finance Corp.</b>		
8.000% due 10/09/2023	IDR 12,600,000	816
<b>Israel Government International Bond</b>		
3.800% due 05/13/2060	\$ 17,000	12,919
4.500% due 04/03/2120	3,800	2,206
<b>Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER</b>		
0.000% due 05/19/2023	ARS 2,261,600	10,433
<b>Peru Government International Bond</b>		
5.350% due 08/12/2040	PEN 749	134
5.400% due 08/12/2034	862	168
5.940% due 02/12/2029	38,611	8,704
6.150% due 08/12/2032	32,985	7,080
6.350% due 08/12/2028	32,430	7,582
6.950% due 08/12/2031	327	76
8.200% due 08/12/2026	80,750	20,935
<b>Provincia de Buenos Aires</b>		
72.723% due 04/12/2025	ARS 399,853	1,197
<b>Romania Government International Bond</b>		
1.750% due 07/13/2030	EUR 21,200	14,151
2.125% due 03/07/2028	9,200	7,165
2.875% due 04/13/2042	15,000	7,652
<b>Russia Government International Bond</b>		
4.250% due 06/23/2027	\$ 28,400	14,200
4.375% due 03/21/2029	200	90
4.750% due 05/27/2026	23,800	11,900
4.875% due 09/16/2023	2,200	1,606
5.100% due 03/28/2035	3,200	1,408
5.250% due 06/23/2047	82,400	39,552
5.625% due 04/04/2042	37,000	18,500
5.875% due 09/16/2043	13,200	6,864
7.150% due 11/12/2025	RUB 4,002,466	32,435
7.500% due 03/31/2030	\$ 4,748	3,466
7.950% due 10/07/2026	RUB 1,564,954	12,682
12.750% due 06/24/2028	\$ 4,012	2,739

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
14.730% due 04/24/2024	RUB 5,057,901	\$ 40,988
<b>Serbia Government International Bond</b>		
1.650% due 03/03/2033	EUR 4,900	2,877
3.125% due 05/15/2027		4,434
<b>South Africa Government International Bond</b>		
8.000% due 01/31/2030	ZAR 61,300	2,865
8.250% due 03/31/2032		3,285
8.750% due 02/28/2048		34,700
8.875% due 02/28/2035		52,400
10.500% due 12/21/2026		2,153,900
<b>State Agency of Roads of Ukraine</b>		
6.250% due 06/24/2030 (h)	\$ 1,200	181
<b>Turkey Government International Bond</b>		
4.250% due 03/13/2025		30,894
5.250% due 03/13/2030		29,000
6.125% due 10/24/2028		10,100
7.625% due 04/26/2029		30,900
<b>Turkiye Ihtacat Kredi Bankasi AJS</b>		
8.250% due 01/24/2024		3,000
<b>Ukraine Government International Bond</b>		
4.375% due 01/27/2032 (h)	EUR 1,658	262
7.750% due 09/01/2025	\$ 4,390	951
<b>United Kingdom Gilt</b>		
1.250% due 07/31/2051	GBP 180	120
1.500% due 07/22/2047		80
1.750% due 01/22/2049		160
3.250% due 01/22/2044		150
3.500% due 01/22/2045		140
<b>Venezuela Government International Bond (c)</b>		
6.000% due 12/09/2049	\$ 3,367	219
7.000% due 03/31/2038		1,883
7.850% due 04/21/2025		5,349
7.750% due 04/13/2024		1,200
8.250% due 10/13/2024		5,991
9.000% due 05/07/2023		3,161
9.250% due 09/15/2027		4,274
9.250% due 05/07/2028		6,512
11.750% due 10/21/2026		680
11.950% due 08/05/2031		6,000
<b>Total Sovereign Issues (Cost \$860,427)</b>		<b>596,820</b>
<b>株数</b>		
<b>COMMON STOCKS 1.3%</b>		
Cairo Mezz PLC	847,444	96
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	7,568
Constellation Oil Services Holding S.A. (I)	421,249	46
Credit Suisse Group AG	601,156	2,492
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.	10,169,333	10,040
iHeartMedia, Inc. Class A	1,246,745	10,323
iHeartMedia, Inc. Class B	967,427	7,209
Intelsat S.A. (I)	963,915	26,990
National Bank of Greece S.A.	102,570	372
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (I)	151,112	27,423
Noble Corp. PLC	768,399	27,693
Stearns Holdings LLC	110,747	0
Voyager Aviation Holdings LLC	616	0

	株数	時価 (単位：千)
<b>Westmoreland Mining Holdings LLC (I)</b>	8,912	\$ 98
<b>Total Common Stocks (Cost \$176,368)</b>		<b>120,350</b>
<b>COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY 0.3%</b>		
<b>CBL &amp; Associates Properties, Inc.</b>		
Uniti Group, Inc.	6	172
VICI Properties, Inc.	110	850
	760	24,350
<b>Total Commercial Real Estate Equity (Cost \$6,351)</b>		<b>25,372</b>
<b>EQUITY LINKED SECURITIES 0.0%</b>		
<b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>		
12/31/2049	210	1,040
<b>Total Equity-Linked Securities (Cost \$0)</b>		<b>1,040</b>
<b>WARRANTS 0.0%</b>		
<b>Intelsat S.A.</b>		
02/17/2027	26	91
<b>Sequa Corp.</b>		
12/31/2049	10	8
<b>Stearns Holdings LLC</b>		
12/31/2049	1	0
<b>Windstream Services LLC</b>		
09/21/2055	226	3,732
<b>Total Warrants (Cost \$22,629)</b>		<b>3,831</b>
<b>PREFERRED SECURITIES 0.0%</b>		
<b>Cayenne Aviation LLC</b>		
9.500%	3,693	1,057
<b>Sequa Corp.</b>		
15.000%	1,418	1,828
<b>Total Preferred Securities (Cost \$2,292)</b>		<b>2,885</b>
<b>額面金額 (単位：千)</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 11.0%</b>		
<b>COMMERCIAL PAPER 4.0%</b>		
<b>Federal Home Loan Bank</b>		
3.060% due 01/03/2023	\$ 104,700	104,703
3.060% due 01/04/2023		77,700
3.070% due 01/06/2023		98,700
3.070% due 01/10/2023		98,600
		<b>379,713</b>
<b>REPURCHASE AGREEMENTS (m) 6.2%</b>		
		<b>597,100</b>
<b>TIME DEPOSITS 0.6%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
1.410% due 11/01/2022	GBP 276	318
1.620% due 11/01/2022	AUD 1,199	767
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,180	5,180
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
2.580% due 11/01/2022		427
2.810% due 11/01/2022	CAD 164	120
<b>BNP Paribas Bank</b>		
(0.240%) due 11/01/2022	CHF 1	1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1,602	1,583
0.420% due 11/01/2022	DKK 3	0
1.290% due 11/01/2022	NOK 562	54
1.620% due 11/01/2022	AUD 81	52
2.050% due 11/01/2022	NZD 509	296
5.150% due 11/01/2022	ZAR 8,091	440

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 132	\$ 1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1	1
0.850% due 11/01/2022	SEK 1	0
2.580% due 11/01/2022	\$ 3	3
<b>Citibank N.A.</b>		
2.580% due 11/01/2022	4,337	4,337
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
2.580% due 11/01/2022	2,702	2,702
<b>HSBC Bank PLC</b>		
0.310% due 11/01/2022	EUR 558	551
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,782	5,782
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 251,387	1,691
<b>Royal Bank of Canada</b>		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,725	5,725
2.810% due 11/01/2022	CAD 129	94
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 2	0
0.310% due 11/01/2022	EUR 12,088	11,947
1.410% due 11/01/2022	GBP 222	256
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,392	4,392
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 44,520	300
1.410% due 11/01/2022	GBP 1,469	1,691
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,474	4,474
		<b>53,185</b>
<b>U.S. TREASURY BILLS 0.3%</b>		
2.759% due 11/25/2022 (k)	13,900	13,870
2.901% due 12/01/2022 (j)(r)	13,300	13,262
		<b>27,132</b>
<b>Total Short-Term Instruments (Cost \$1,057,127)</b>		
		<b>1,057,130</b>
<b>Total Investments in Securities (a) 126.3% (Cost \$13,587,614)</b>		
	\$ 12,119,648	
<b>Financial Derivative Instruments (o)(q) (1.5%) (Cost or Premiums, net \$(32,050))</b>		
		<b>(148,626)</b>
<b>Other Assets and Liabilities, net (24.8%)</b>		
		<b>(2,376,583)</b>
<b>Net Assets 100.0%</b>		<b>\$ 9,594,439</b>

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS.

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) The allocation of Total Investments by geographic region as of October 31, 2022 is 99.6% of Net Assets in the United States, 5.2% of Net Assets in the United Kingdom and other countries comprising of 21.5% of Net Assets in aggregate.
- (b) All or portion of this amount represent unfunded loan commitments. The interest rate for the unfunded portion will be determined at the time of funding. See Note 4, Securities and Other Investments, in the Notes to Financial Statements for more information regarding unfunded loan commitments.
- (c) Security is in default.
- (d) Contingent convertible security.
- (e) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (f) Payment in-kind security.
- (g) Security is an Interest Only ("IO") or IO Strip.
- (h) When-issued security.
- (i) Principal amount of security is adjusted for inflation.
- (j) Coupon represents a yield to maturity.
- (k) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(l) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Constellation Oil Services Holding S.A.	N/A	N/A	06/10/2022	\$ 46	\$ 46	0.00%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/21/2021	717	493	0.01%
Intelsat S.A.	N/A	N/A	08/02/2018	75,855	26,990	0.28%
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	N/A	N/A	09/25/2020	4,866	27,423	0.28%
Westmoreland Mining Holdings LLC	N/A	N/A	03/28/2019	44	98	0.00%
WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL	6.768%	02/09/2023	05/16/2018	40,918	40,899	0.43%
<b>Total Restricted Securities</b>				<b>\$ 122,446</b>	<b>\$ 95,949</b>	<b>1.00%</b>

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(m) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保債権	担保受取価値	レボ価値	レボ契約の 受取 <sup>(1)</sup>
BPS	2.990%	10/31/2022	11/01/2022	\$ 294,000	U.S. Treasury Notes 1.875% due 08/31/2024			
					U.S. Treasury Notes 2.250% due 11/15/2024	\$ (299,866)	\$ 294,000	\$ 294,024
JPS	3.060%	11/01/2022	11/02/2022	303,100	U.S. Treasury Bonds 2.000% due 02/15/2050	(308,258)	303,100	303,126
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (608,124)</b>	<b>\$ 597,100</b>	<b>\$ 597,150</b>

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入利率 <sup>(2)</sup>	借入日	満期日	借入元本 <sup>(2)</sup>	リバースレボの支払
JML	0.500%	10/14/2022	TBD <sup>(3)</sup>	EUR (123)	\$ (122)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (122)</b>

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

Reverse Repurchase Agreements	残存期間				合計
	オーバーナイト/ 継続	30日迄	31-90日	90日以上	
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (122)</b>	<b>\$ (122)</b>
<b>Total Borrowings</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (122)</b>	<b>\$ (122)</b>
<b>Payable for Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (122)</b>

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/received as of October 31, 2022:

- (n) Securities with an aggregate market value of \$119 has been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of October 31, 2022.

取引相手	レポ契約の 受取	リバースレポ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの支払	合計借入 その他金融取引	担保の (受取) / 差入れ	ネット エクスポージャー <sup>(d)</sup>
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 294,024	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 294,024	\$ (299,866)	\$ (5,842)
JML	0	(122)	0	0	(122)	119	(3)
JPS	303,126	0	0	0	303,126	(308,258)	(5,132)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 597,150</b>	<b>\$ (122)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>			

<sup>(a)</sup> Includes accrued interest.

<sup>(b)</sup> Open maturity reverse repurchase agreement.

<sup>(c)</sup> The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2022 was \$10,260 at a weighted average interest rate of 10.531%. Average borrowings may include sale buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

<sup>(d)</sup> Net exposure represents the net receivable/payable that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

**(a) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED**

**WRITTEN OPTIONS:**

**OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS**

銘柄	ストライクプライス	満期日	契約数	プレミアム	市場価格
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	\$ 98.000	12/15/2023	417	\$ (339)	\$ (120)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.500	12/15/2023	417	(390)	(1,346)
<b>Total Written Options</b>				<b>\$ (729)</b>	<b>\$ (1,466)</b>

**FUTURES CONTRACTS:**

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

**SWAP AGREEMENTS:**

**CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(a)</sup>**

参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インフラード クレジット スプレッド <sup>(b)</sup>		市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金		
			想定元本 <sup>(c)</sup>	EUR			資産	負債	
Airbus SE	1.000%	06/20/2028	1.325%	EUR	600	\$ (9)	\$ (23)	\$ 0	\$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2022	0.772%		9,200	14	3	1	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2023	0.827%		5,800	13	12	0	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2024	1.088%		18,700	(4)	(5)	0	(4)
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2025	1.144%		200	(1)	(3)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	1.184%		400	(2)	(8)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.268%		4,300	(42)	(11)	0	(3)
Bank of America Corp.	1.000%	12/20/2022	0.459%		10,400	19	(56)	0	(2)
Barclays Bank PLC	1.000%	12/20/2022	0.735%	EUR	11,500	17	(59)	0	(1)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(1)</sup> (Cont.)

参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>		市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金	
			想定元本 <sup>(3)</sup>				資産	負債
Boeing Co.	1.000%	12/20/24	1.265%	\$ 4,300	\$ (18)	\$ 21	\$ 1	\$ 0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2025	1.383%	5,200	(42)	31	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2025	1.463%	3,100	(37)	13	1	0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2026	1.522%	8,400	(133)	(27)	1	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	1.567%	1,200	(24)	(18)	0	(6)
Boeing Co.	1.000%	06/20/2027	1.642%	5,400	(134)	56	0	0
Bombardier, Inc.	5.000%	06/20/2024	3.444%	900	26	58	0	(18)
Bombardier, Inc.	5.000%	12/20/2024	3.705%	300	9	5	0	(25)
Ford Motor Co.	5.000%	12/20/2022	1.571%	1,300	14	(47)	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2022	1.531%	100	1	(11)	0	(8)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2024	2.628%	700	30	3	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2024	2.784%	5,500	272	(207)	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2025	2.961%	1,100	60	10	0	(4)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2025	3.082%	8,400	493	166	0	(3)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2026	3.226%	100	6	2	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2027	3.471%	100	6	1	0	(1)
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.512%	17,200	114	30	0	(90)
General Motors Co.	5.000%	12/20/2026	1.906%	1,300	154	(61)	0	(2)
Hess Corp.	1.000%	12/20/2026	1.026%	3,200	1	37	0	(2)
Morgan Stanley	1.000%	12/20/2022	0.516%	2,400	5	(12)	0	(12)
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2022	1.448%	EUR 23,370	13	(408)	5	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2025	2.758%	20,000	(833)	410	1	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2026	3.397%	5,200	(393)	16	13	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2026	3.611%	28,100	(2,583)	(1,242)	75	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2026	1.200%	\$ 2,500	(16)	(72)	0	(15)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.274%	5,400	(54)	(23)	0	(5)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2027	1.334%	5,000	(68)	(9)	0	(2)
					\$ (3,126)	\$ (1,428)	\$ 98	\$ (209)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>(1)</sup>

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



INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 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
Pay <sup>1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1.270%	11/04/2023	\$ 890,800	\$ (33,085)	\$ (16,566)	\$ 51	\$ 0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.000%	01/26/2024	26,500	(1,225)	(1,225)	0	(2)
Pay <sup>2)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1.700%	03/06/2024	59,600	(1,976)	(1,976)	0	(42)
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/18/2024	62,500	2,602	5,305	115	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/16/2025	62,600	4,970	4,970	113	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/18/2025	62,600	4,967	4,967	113	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.000%	06/20/2025	117,800	7,369	9,789	5,696	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.928%	05/06/2026	25,800	3,019	3,019	51	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.940%	06/08/2026	35,000	4,100	4,100	72	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2026	251,400	33,694	29,844	535	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.030%	06/17/2026	43,000	4,918	4,918	96	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.010%	06/24/2026	39,800	4,577	4,577	85	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/15/2026	3,300	386	457	7	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.740%	12/16/2026	15,800	1,535	1,535	42	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.380%	01/04/2027	37,200	(4,162)	(4,162)	0	(96)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/11/2027	21,300	(2,219)	(2,219)	0	(46)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/12/2027	13,400	(1,395)	(1,395)	1,376	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.425%	01/18/2027	25,400	(2,807)	(2,807)	0	(53)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.443%	01/18/2027	27,300	(2,997)	(2,997)	0	(64)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.350%	01/20/2027	19,000	2,159	2,159	38	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.418%	01/20/2027	12,700	(1,407)	(1,407)	0	(25)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/20/2027	84,500	(8,905)	(8,909)	0	(175)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.560%	02/05/2027	28,000	3,140	3,140	59	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.580%	02/16/2027	26,400	(2,946)	(2,946)	0	(57)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.450%	02/17/2027	62,000	7,251	7,251	136	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.700%	02/17/2027	248,100	(26,478)	(25,534)	0	(537)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.420%	02/24/2027	46,300	5,470	5,470	64	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.650%	02/24/2027	154,200	(16,767)	(16,204)	0	(174)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/20/2027	259,700	(19,995)	(36,453)	0	(5,180)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.490%	01/09/2028	190,500	(14,750)	(26,747)	23,869	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.280%	03/24/2028	73,200	(10,642)	(10,642)	0	(191)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.235%	05/12/2028	13,100	1,952	1,952	34	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2028	366,282	(69,256)	(48,720)	0	(1,804)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	12/15/2028	29,662	(4,285)	(4,953)	0	(90)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	01/12/2029	14,850	2,151	2,151	0	(2,103)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.700%	01/12/2029	54,000	(7,201)	(6,991)	6,855	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.518%	01/20/2029	7,600	(1,096)	(1,096)	0	(21)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/20/2029	10,600	(1,461)	(1,461)	0	(29)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/26/2029	12,700	(1,749)	(1,749)	0	(36)
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.000%	06/19/2029	275,100	(17,133)	(48,950)	0	(6,856)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/23/2030	14,000	2,048	2,048	45	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.870%	01/23/2030	14,000	1,940	1,940	44	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.610%	02/28/2030	14,100	2,291	2,291	49	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.430%	03/17/2030	31,300	5,469	5,469	107	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/17/2030	9,500	1,790	1,595	30	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.678%	07/29/2030	12,400	2,911	2,911	38	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.674%	08/05/2030	12,000	2,821	2,821	37	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.000%	12/16/2030	7,588	1,640	1,587	25	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	13,609	(3,341)	(2,089)	0	(97)
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	335,400	82,108	55,541	1,387	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.450%	07/16/2031	23,600	4,534	4,534	77	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.370%	07/19/2031	10,500	2,085	2,085	34	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.360%	07/20/2031	15,700	3,128	3,128	52	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.405%	09/07/2031	25,500	5,180	5,180	0	(4,940)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	10/05/2031	15,500	(3,042)	(3,042)	0	(54)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/15/2031	15,400	(2,982)	(2,982)	0	(51)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/22/2031	10,300	(1,997)	(1,997)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.545%	10/26/2031	10,300	(1,990)	(1,990)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.735%	01/12/2032	10,100	(1,800)	(1,800)	1,763	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.655%	01/24/2032	12,700	(2,350)	(2,350)	0	(42)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.768%	02/02/2032	9,600	(1,749)	(1,749)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.000%	02/18/2032	23,000	(3,795)	(3,795)	0	(84)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2032	12,800	2,634	2,212	144	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.500%	06/20/2048	7,900	1,673	2,768	148	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.910%	10/17/2049	11,400	3,647	3,653	56	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.895%	10/18/2049	11,400	3,679	3,644	62	0

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 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
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.00%	01/15/2050	\$ 8,800	\$ 2,642	\$ 2,936	\$ 53	\$ 0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.625%	01/16/2050	22,500	8,221	6,724	130	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/22/2050	47,500	16,323	14,566	280	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.625%	02/03/2050	42,500	15,813	12,989	247	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.875%	02/07/2050	2,700	888	868	16	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/17/2050	1,200	469	591	16	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.215%	10/13/2050	14,900		(6,610)	0	(81)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.144%	11/04/2050	9,000	(4,111)	(4,111)	0	(50)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/16/2050	128,700	56,255	43,073	720	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.485%	01/13/2051	13,900	(5,478)	(5,478)	0	(78)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.595%	01/13/2051	14,700	(5,506)	(5,506)	0	(84)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.523%	01/19/2051	8,900	(3,450)	(3,450)	0	(50)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/21/2051	10,400	(3,980)	(3,980)	0	(58)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.580%	02/09/2051	98,800	(37,752)	(37,752)	0	(560)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/16/2051	386,100	169,197	103,740	2,428	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.945%	06/23/2051	22,200	6,985	6,985	136	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.785%	08/12/2051	13,100	4,574	4,574	76	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.815%	01/24/2052	2,500	(846)	(846)	0	(14)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.867%	01/26/2052	2,500	(822)	(822)	0	(14)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	ZAR 305,500	(9)	252	0	(1)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2024	7,700	(5)	20	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.850%	01/07/2026	50,200	(249)	(249)	0	(6)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.848%	01/11/2026	148,000	(736)	(698)	0	(19)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.915%	02/01/2026	113,400	(570)	(544)	0	(14)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.065%	02/09/2026	57,500	(276)	(282)	0	(7)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.970%	03/10/2026	7,000	23	23	1	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	1,400	0	(5)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	09/19/2028	626,200	(1,480)	(1,833)	0	(129)
Pay	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	06/18/2024	AUD 28,000	289	(2,997)	17	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2024	39,200	(431)	(3,440)	27	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	12/17/2024	41,400	183	(4,433)	31	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	38,850	(345)	(3,937)	33	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.750%	06/17/2026	3,870	(117)	(397)	3	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.000%	03/21/2027	313,890	(9,622)	(37,946)	577	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.453%)	12/29/2023	EUR 4,300	164	164	14	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.425%)	06/28/2024	4,200	219	219	17	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	21,000	(771)	(771)	0	(86)
Receive	6-Month EURIBOR	(0.395%)	12/30/2024	1,900	132	132	10	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.363%)	06/30/2025	3,500	287	287	21	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.329%)	12/30/2025	2,300	224	224	16	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.294%)	06/30/2026	1,100	120	120	8	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.700%	04/11/2027	42,300	(3,703)	(3,703)	0	(324)
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027	63,000	(5,678)	(5,678)	0	(484)
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027	63,000	(5,684)	(5,684)	0	(493)
Pay	6-Month EURIBOR	1.000%	05/13/2027	85,900	(6,351)	(6,351)	0	(688)
Pay	6-Month EURIBOR	1.000%	05/18/2027	41,200	(3,060)	(3,060)	0	(335)
Receive	6-Month EURIBOR	(0.150%)	03/18/2030	123,000	25,299	21,738	1,365	0
Receive	6-Month EURIBOR	0.150%	06/17/2030	26,800	5,078	5,097	320	0
Pay	6-Month EURIBOR	2.000%	09/21/2032	194,130	(16,717)	(19,530)	0	(2,775)
Receive <sup>(5)</sup>	6-Month EURIBOR	1.750%	03/15/2033	241,200	27,271	2,755	3,476	0
Receive	6-Month EURIBOR	0.250%	03/18/2050	37,600	16,505	13,493	584	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.176%	04/27/2027	¥ 3,890,000	(35)	(35)	5	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	(0.020%)	09/20/2028	67,650,000	10,497	8,911	0	(220)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.000%	03/15/2029	75,360,000	13,062	12,318	0	(145)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.400%	06/15/2032	6,300,000	511	502	0	(20)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042	3,350,000	1,990	968	0	(110)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.711%	04/27/2042	1,020,000	347	347	0	(36)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.830%	01/02/2023	BRL 165,400	(551)	(555)	0	(6)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.836%	01/02/2023	128,800	(425)	(425)	0	(5)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.855%	01/02/2023	42,900	(137)	(137)	0	(2)

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 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
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.670%	01/02/2023	BRL 13,200	\$ 8	\$ 8	\$ 0	\$ 0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.690%	01/02/2023	8,800	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.740%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.750%	01/02/2023	10,900	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.760%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.900%	01/02/2023	46,500	12	12	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.930%	01/02/2023	5,800	1	1	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.939%	01/02/2023	23,200	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.946%	01/02/2023	58,300	12	12	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.960%	01/02/2023	46,500	9	9	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.970%	01/02/2023	76,300	14	14	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.140%	01/02/2025	4,400	(13)	(13)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.160%	01/02/2025	2,900	(9)	(9)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/02/2025	3,600	(8)	(8)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.000%	01/02/2025	9,800	3	3	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.080%	01/02/2025	16,300	9	9	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.140%	01/02/2025	8,200	7	7	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.145%	01/02/2025	8,000	7	7	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.160%	01/02/2025	16,400	14	14	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.220%	01/04/2027	5,300	(10)	(10)	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.245%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.260%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.700%	01/04/2027	1,400	1	1	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.715%	01/04/2027	5,900	4	4	4	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.870%	01/04/2027	14,100	22	22	9	0
Pay	IBMXID	7.880%	12/27/2022	MXN 780,300	(180)	(1,753)	0	(495)
Pay	IBMXID	7.640%	01/03/2023	31,200	(8)	(63)	0	(17)
Pay	IBMXID	7.645%	01/03/2023	49,400	(13)	(100)	0	(27)
Pay	IBMXID	7.745%	01/05/2023	33,200	(9)	(73)	0	(19)
Pay	IBMXID	7.805%	02/06/2023	76,600	(30)	(193)	0	(35)
Pay	IBMXID	7.820%	02/06/2023	37,700	(15)	(96)	0	(17)
Pay	IBMXID	6.350%	09/01/2023	39,100	(7)	(68)	0	(4)
Receive	IBMXID	8.675%	04/03/2024	851,700	1,060	1,060	64	0
Receive	IBMXID	8.660%	04/04/2024	352,700	442	442	0	(2)
Receive	IBMXID	8.750%	04/05/2024	265,800	317	317	0	(1)
Pay	IBMXID	5.980%	08/26/2024	11,300	(41)	(30)	0	(1)
Pay	IBMXID	7.670%	03/05/2025	662,400	(1,588)	(3,527)	0	(361)
Pay	IBMXID	7.710%	03/07/2025	435,800	(1,024)	(2,353)	0	(240)
Pay	IBMXID	7.715%	03/07/2025	433,300	(1,016)	(2,342)	0	(239)
Pay	IBMXID	7.570%	03/18/2025	612,000	(1,563)	(3,107)	0	(357)
Pay	IBMXID	5.160%	06/06/2025	39,200	(209)	(209)	4	0
Pay	IBMXID	5.950%	01/30/2026	104,300	(531)	(365)	0	(12)
Receive	IBMXID	8.410%	03/31/2027	102,000	174	174	7	0
Receive	IBMXID	8.730%	04/06/2027	108,200	121	121	8	0
Receive	IBMXID	7.495%	01/14/2032	52,800	298	82	7	0
Receive	IBMXID	7.498%	01/15/2032	218,400	1,231	335	29	0
Receive	IBMXID	8.732%	03/30/2032	54,100	95	95	6	0
Receive	IBMXID	8.701%	03/31/2032	127,000	236	236	14	0
Receive <sup>(5)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	2.450%	12/20/2024	\$ 428,400	7,067	7,097	310	0
Receive <sup>(5)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	2.350%	01/17/2025	214,000	3,597	3,574	123	0
Receive <sup>(5)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	1.600%	01/16/2026	167,700	7,043	4,909	161	0
Receive <sup>(5)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	2.300%	01/17/2026	120,700	3,552	3,526	118	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.620%	04/18/2027	26,900	(2,682)	(2,682)	0	(53)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.783%	04/22/2027	20,100	(1,860)	(1,860)	0	(40)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.788%	05/03/2027	20,600	(1,921)	(1,921)	0	(41)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	51,050	(6,742)	(5,892)	0	(102)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	68,850	9,089	6,794	134	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.850%	08/30/2027	24,600	(1,258)	(1,258)	0	(52)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/07/2027	12,500	(529)	(529)	0	(27)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.955%	10/04/2027	25,100	(1,186)	(1,186)	0	(54)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.618%	02/09/2029	4,800	(600)	(600)	0	(12)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	6,100	(1,054)	(889)	0	(16)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	97,910	16,882	12,514	257	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2029	59,920	(7,531)	(3,814)	8	(131)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/08/2029	12,400	(619)	(619)	0	(36)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.100%	09/09/2029	12,400	(581)	(581)	0	(36)

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 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	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.650%	02/08/2032	\$ 16,100	\$ (2,658)	\$ (2,658)	\$ 0	\$ (59)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.730%	02/24/2032	15,200	(2,426)	(2,426)	0	(40)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.765%	03/16/2032	5,300	(839)	(839)	0	(19)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	2.385%	06/08/2032	10,400	1,172	1,172	37	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	56,640	(11,615)	(6,902)	0	(187)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	46,970	9,556	7,800	711	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2032	78,300	(13,027)	(8,752)	0	(273)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/06/2032	18,800	(1,153)	(1,153)	0	(71)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052	96,100	29,365	20,305	559	0	
Receive <sup>(i)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2033	GBP 75,300	12,646	756	576	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.096%	02/14/2052	5,500	(2,546)	(2,546)	0	(11)	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.060%	02/21/2052	2,500	(1,178)	(1,178)	0	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.101%	02/21/2052	2,500	(1,155)	(1,155)	0	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.175%	02/28/2052	5,200	(2,322)	(2,322)	0	0	
Receive <sup>(ii)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2053	5,500	1,483	(202)	6	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	09/15/2031	34,900	(4,293)	(4,113)	540	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	10/15/2031	46,300	(4,995)	(4,935)	719	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	11/15/2031	23,300	(2,178)	(1,926)	380	0	
						\$ 227,206	\$ (11,119)	\$ 58,955	\$ (32,925)
<b>Total Swap Agreements</b>						<b>\$ 210,895</b>	<b>\$ 3,284</b>	<b>\$ 60,139</b>	<b>\$ (61,312)</b>

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of October 31, 2022:

(p) Securities with an aggregate market value of \$98,845 and cash of \$171,779 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of October 31, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格 買いオプション	変動証拠金資産		合計	市場価格 売りオプション	変動証拠金負債		合計
		先物	スワップ			先物	スワップ	
\$ 0	\$ 623	\$ 60,139	\$ 60,762	\$ (1,466)	\$ (1,277)	\$ (61,312)	\$ (64,055)	

<sup>(i)</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(ii)</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(iii)</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

<sup>(iv)</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(v)</sup> This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for Further information.

(q) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	11/2022	\$ 2,512	AUD 3,883	\$ 0	\$ (29)
BOA	11/2022	118	CNH 849	0	(2)
BOA	11/2022	3,449	EUR 3,526	36	0
BOA	11/2022	985	PEN 3,842	0	(24)
BOA	11/2022	ZAR 57,968	\$ 3,651	498	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価(損)益	
						資産	負債
BDA	11/2022	ZAR	12,585	\$	730	\$	46
BDA	12/2022	PEN	87,093		22,790		1,054
BDA	12/2022		\$ 1,047	EUR	1,052		0
BDA	12/2022		3,086	GBP	2,684		0
BDA	12/2022		43,942	MXN	886,729		330
BDA	12/2022		73	PEN	278		0
BDA	01/2023	ZAR	38,083	\$	2,143		82
BDA	03/2023	TWD	231,566		7,865		632
BDA	03/2023	ZAR	95,583		5,413		261
BDA	05/2023	PEN	26,923		6,862		207
BPS	11/2022	AUD	2,912		1,835		0
BPS	11/2022	IDR	176,115,710		11,270		1
BPS	11/2022		\$ 18,087	GBP	16,119		472
BPS	11/2022		19,114	IDR	285,197,517		0
BPS	11/2022		37,394	NOK	359,438		0
BPS	11/2022		1,840	PEN	7,138		0
BPS	11/2022		36,525	SEK	370,111		0
BPS	11/2022	ZAR	175,146	\$	10,906		1,381
BPS	12/2022	CNH	1,813		262		14
BPS	12/2022	EUR	10,646		10,612		68
BPS	12/2022	MXN	12,233		595		0
BPS	12/2022		\$ 9,365	CLP	8,700,000		0
BPS	12/2022		262	CNY	1,811		0
BPS	12/2022		11,270	IDR	176,509,731		0
BPS	12/2022		1,532	PEN	6,078		0
BRC	11/2022		74,896	JPY	10,811,717		0
BRC	11/2022	ZAR	78,977	\$	4,921		626
CBK	11/2022	AUD	8,009		5,104		0
CBK	11/2022	BRL	293,224		55,697		0
CBK	11/2022	GBP	2,369		2,668		0
CBK	11/2022	PEN	9,258		2,325		4
CBK	11/2022		\$ 1,156	AUD	1,780		0
CBK	11/2022		56,015	BRL	293,224		0
CBK	11/2022		13,868	COP	62,570,000		0
CBK	11/2022		1,105	EUR	1,135		17
CBK	11/2022		12,594	GBP	11,321		441
CBK	11/2022		23	IDR	345,000		0
CBK	11/2022		240	PEN	928		0
CBK	11/2022		545		2,120		0
CBK	11/2022	ZAR	246,179	\$	15,003		1,620
CBK	12/2022	CNH	708		102		6
CBK	12/2022	MXN	1,362,666		66,837		0
CBK	12/2022	PEN	83,233		19,846		0
CBK	12/2022		\$ 8,906	CLP	8,087,236		0
CBK	12/2022		102	CNY	708		0
CBK	12/2022		2,625	PEN	10,257		0
CBK	12/2022		3,413		13,363		0
CBK	12/2022		7,121		27,834		0
CBK	01/2023		8,749	CLP	8,336,943		0
CBK	01/2023		1,726	PEN	6,931		0
CBK	01/2023		12,421		48,988		0
CBK	01/2023		1,957	ZAR	34,282		0
CBK	02/2023		11,135	BRL	60,092		92
DUB	12/2022	ZAR	107,612	\$	6,849		1,012
DUB	02/2023		33,493		2,006		197
GLM	11/2022	PEN	18,353		4,591		0
GLM	11/2022	ZAR	63,724		3,970		504
GLM	12/2022		\$ 151	CLP	136,490		0
GLM	12/2022		14,377	PEN	57,240		0
GLM	03/2023	MXN	1,037,938	\$	50,490		0
GLM	05/2023		\$ 4,535	PEN	18,353		3
GLM	05/2023	ZAR	58,866	\$	3,522		361
JPM	11/2022	BRL	611,420		117,288		794
JPM	11/2022		\$ 118,205	BRL	611,420		0
JPM	11/2022		336	CNH	2,408		0
JPM	11/2022		12,484	IDR	187,436,692		0
JPM	11/2022		13	INR	1,018		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
JPM	01/2023	\$ 115,808	BRL 611,420	\$ 0	\$ (866)
JPM	02/2023	224,351	MXN 4,599,472	2,596	0
MBC	11/2022	AUD 2,188	\$ 1,412	13	0
MBC	11/2022	CHF 1,482	1,580	97	0
MBC	11/2022	COP 62,570,000	12,597	0	(150)
MBC	11/2022	EUR 4,304	4,214	0	(40)
MBC	11/2022	GBP 50,318	54,817	0	(3,116)
MBC	11/2022	\$ 1,417	AUD 2,188	0	(18)
MBC	11/2022	163	COP 800,585	0	0
MBC	11/2022	11,615	EUR 11,770	18	0
MBC	11/2022	38,798	GBP 35,120	1,637	0
MBC	11/2022	4,550	JPY 682,300	41	0
MBC	12/2022	CNH 915	\$ 131	6	0
MBC	12/2022	COP 800,585	162	0	(1)
MBC	12/2022	\$ 1,413	AUD 2,188	0	(13)
MBC	12/2022	131	CNY 913	0	(5)
MBC	12/2022	1,721	EUR 1,730	0	(8)
MBC	12/2022	2,250	GBP 1,945	0	(9)
MBC	01/2023	ZAR 24,365	\$ 1,354	37	0
MBC	03/2023	TWD 332,849	11,311	914	0
MBC	05/2023	\$ 304	CNH 2,041	0	(22)
MYI	11/2022	BRL 132,971	\$ 25,165	0	(170)
MYI	11/2022	GBP 309,463	335,743	0	(20,558)
MYI	11/2022	IDR 174,972	12	1	0
MYI	11/2022	\$ 22,210	AUD 34,198	0	(342)
MYI	11/2022	25,294	BRL 132,971	41	0
MYI	11/2022	18,343	EUR 18,810	248	0
MYI	11/2022	338,110	GBP 292,205	0	(1,680)
MYI	11/2022	10,082	IDR 149,149,809	0	(546)
MYI	11/2022	53,368	JPY 7,675,094	0	(1,731)
MYI	12/2022	CNH 412	\$ 59	3	0
MYI	12/2022	GBP 292,205	338,373	1,667	0
MYI	12/2022	TWD 293,227	9,712	617	0
MYI	12/2022	\$ 25,008	BRL 132,971	168	0
MYI	12/2022	59	CNY 411	0	(2)
MYI	01/2023	ZAR 9,917	\$ 537	1	0
MYI	02/2023	677,547	37,034	439	0
MYI	03/2023	TWD 302,717	10,279	823	0
MYI	04/2023	ZAR 4,413	238	0	0
RBC	11/2022	\$ 3,477	PEN 13,583	0	(78)
SCX	11/2022	CAD 124,031	\$ 90,928	0	0
SCX	11/2022	CLP 154,813	168	4	0
SCX	11/2022	COP 63,370,585	14,910	1,961	0
SCX	11/2022	IDR 291,285,429	18,742	103	0
SCX	11/2022	\$ 5,494	AUD 8,481	0	(70)
SCX	11/2022	33,178	CAD 45,592	246	0
SCX	11/2022	158	CLP 154,813	6	0
SCX	11/2022	8,340	GBP 7,385	162	0
SCX	11/2022	18,675	IDR 280,138,899	0	(749)
SCX	11/2022	12,127	181,931,834	0	(498)
SCX	11/2022	15,118	NOK 146,545	0	(1,016)
SCX	11/2022	12,521	SEK 128,305	0	(900)
SCX	11/2022	673	ZAR 12,119	0	(14)
SCX	12/2022	CNH 459	\$ 66	3	0
SCX	12/2022	TWD 548,129	18,199	1,197	0
SCX	12/2022	\$ 90,928	CAD 124,009	0	(1)
SCX	12/2022	66	CNY 458	0	(3)
SCX	12/2022	18,742	IDR 291,735,232	0	(122)
SCX	12/2022	199,734	JPY 29,589,031	0	(1)
SCX	12/2022	1,426	PEN 5,570	0	(36)
SCX	01/2023	CLP 154,813	\$ 156	0	(6)
SCX	04/2023	ZAR 56,849	3,090	31	0
SOG	11/2022	CHF 3,477	3,674	195	0
SOG	11/2022	EUR 693,317	666,061	0	(19,180)
SOG	11/2022	\$ 659,513	EUR 656,575	0	(10,588)
SOG	12/2022	EUR 656,575	\$ 660,926	10,621	0
SOG	01/2023	ZAR 18,081	1,019	41	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価(損)益			
		資産	負債	資産	負債	資産	負債		
TDR	11/2022	\$	57,353	CAD	78,280	\$	34	\$	0
UAG	11/2022	AUD	44,269	\$	28,669		361		0
UAG	11/2022	\$	4,438	AUD	6,848		0		(59)
UAG	11/2022		5,637	EUR	5,805		100		0
UAG	11/2022		8,473	IDR	126,098,943		0		(411)
UAG	11/2022		72,172	JPY	10,373,569		0		(2,381)
UAG	11/2022	ZAR	135,711	\$	8,649		1,268		0
UAG	11/2022		64,863		3,970		445		0
UAG	12/2022	\$	28,692	AUD	44,269		0		(360)
UAG	12/2022		12,354	MXN	247,871		21		0
UAG	03/2023	ZAR	71,825	\$	4,019		150		0
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>							<b>\$ 37,075</b>		<b>\$ (82,636)</b>

PURCHASED OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	コスト	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.243%	08/05/2024	52,000	\$ 702	\$ 219
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.243%	08/05/2024	52,000	702	1,566
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.110%	07/26/2032	10,500	1,701	770
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.110%	07/26/2032	15,300	2,479	2,537
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.053%	07/20/2023	154,200	925	104
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	431
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.580%	07/19/2024	109,300	1,503	609
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.400%	07/20/2027	12,100	1,587	815
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.170%	07/19/2032	12,100	1,919	923
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.053%	07/20/2023	154,200	925	2,331
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	2,128
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.580%	07/19/2024	109,300	1,503	2,794
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.400%	07/20/2027	13,600	1,795	2,399
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.170%	07/19/2032	13,600	2,157	2,188
<b>Total Purchased Options</b>							<b>\$ 20,220</b>	<b>\$ 19,814</b>

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.150%	12/01/2023	55,600	\$ (172)	\$ (39)
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	12/01/2023	55,600	(172)	(501)
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.560%	04/11/2023	12,800	(13)	0
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/28/2023	69,500	(121)	(2)
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/11/2023	12,800	(39)	(123)
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/28/2023	69,500	(121)	(591)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(31)
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(211)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(42)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(55)
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.750%	12/14/2022	24,600	(189)	(13)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(512)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(315)
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	12/14/2022	24,600	(189)	(600)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(63)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(91)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(426)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(527)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.560%	04/05/2023	71,800	(134)	(1)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.560%	04/11/2023	95,400	(182)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/24/2023	70,000	(75)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/26/2023	65,600	(116)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.550%	05/15/2023	63,400	(111)	(2)

INTEREST RATE SWAPPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0.870%	11/02/2022	2,294,300	\$ (4,567)	\$ 0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	1.270%	11/02/2022	383,600	(19)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.785%	07/25/2023	67,000	(419)	(32)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(42)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.190%	10/23/2023	27,700	(193)	(47)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(49)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(38)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(33)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.250%	11/17/2023	54,600	(198)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.150%	11/20/2023	54,500	(190)	(35)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.250%	12/07/2023	55,600	(174)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(127)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(66)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.468%	07/25/2023	14,200	(339)	(53)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/05/2023	71,800	(134)	(685)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/11/2023	95,400	(182)	(918)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/24/2023	70,000	(198)	(591)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/26/2023	65,600	(116)	(557)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	05/15/2023	63,400	(111)	(624)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	1.270%	11/02/2022	1,910,700	(3,800)	(70,932)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.785%	07/25/2023	67,000	(419)	(1,180)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(512)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(390)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(359)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.190%	10/23/2023	27,700	(192)	(348)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(341)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(393)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(417)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(362)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(396)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	11/17/2023	54,600	(198)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	11/20/2023	54,500	(190)	(497)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	12/07/2023	55,600	(174)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(847)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(411)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.468%	07/25/2023	14,200	(339)	(900)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(44)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(45)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(41)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(71)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(70)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.800%	12/15/2022	24,600	(200)	(17)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(69)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(68)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(1,017)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(1,010)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(454)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(72)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(801)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.700%	12/15/2022	24,600	(200)	(547)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(582)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(588)
							\$ (25,144)	\$ (93,711)

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
BPS	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	14,800	\$ (18)	\$ (1)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	12,690	(16)	0



CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	2.000%	12/21/2022	14,100	\$ (35)	\$ (4)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	12/21/2022	28,500	(35)	(10)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	12/21/2022	29,200	(43)	(9)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	11/16/2022	58,300	(66)	(3)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.500%	12/21/2022	58,300	(90)	(14)
GST	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	3.000%	03/15/2023	28,000	(50)	(12)
JPM	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	11/16/2022	30,500	(37)	(1)
JPM	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	15,590	(14)	(1)
MYC	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.600%	12/21/2022	15,500	(23)	(3)
						\$ (427)	\$ (58)

OPTIONS ON SECURITIES

取引相手	銘柄	ストライクプライス	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
JPM	Put - Fannie Mae**	\$ 99.406	11/07/2022	20,100	\$ (157)	\$ (1,128)
SAL	Put - Fannie Mae**	98.375	11/07/2022	14,000	(78)	(642)
SAL	Put - Fannie Mae**	98.406	11/07/2022	14,000	(79)	(646)
					\$ (314)	\$ (2,416)

INTEREST RATE-CAPPED OPTIONS

取引相手	銘柄	エクササイズ レート	変動金利インデックス	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	\$ (897)	\$ (1,720)
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	(897)	(383)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(2,469)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(264)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,350)	(2,289)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,351)	(610)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(3,180)
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(965)
						\$ (10,669)	\$ (11,900)
						\$ (36,554)	\$ (108,085)

Total Written Options

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - BUY PROTECTION<sup>(3)</sup>

取引相手	参照エンティティ	固定(支払)		2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(5)</sup>		想定元本 <sup>(6)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値	
		金利	満期日	EUR	USD				資産	負債
BOA	HSBC Holdings PLC	(1.000%)	06/20/2024	1.273%	EUR 200	\$ 3	\$ (3)	\$ 0	\$ 0	

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(3)</sup>

取引相手	参照エンティティ	固定受取金利		2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(5)</sup>		想定元本 <sup>(6)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値	
		金利	満期日	EUR	USD				資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 2,700	\$ (89)	\$ 94	\$ 5	\$ 0	
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	100	(7)	3	0	(4)	
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	200	(18)	4	0	(14)	
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	5,800	(654)	105	0	(549)	
BPS	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	24,100	(1,080)	1,125	45	0	
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	3,400	(163)	(144)	0	(307)	
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	700	(62)	(11)	0	(73)	
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(15)	6	0	(9)	
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2025	6.209%	400	(69)	22	0	(47)	
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	7,100	(280)	294	14	0	
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.672%	8,400	(433)	460	27	0	
BRC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	4,800	(221)	(136)	0	(357)	
BRC	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.469%	10,525	(24)	44	20	0	
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	1,600	(108)	38	0	(70)	
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	3,370	(300)	63	0	(237)	
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	25,410	(3,166)	761	0	(2,405)	

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>SM</sup> (Cont.)

取引相手	参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(%)</sup>	想定元本 <sup>(6)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損)益	スワップの価値 <sup>(7)</sup>	
								資産	負債
BYL	Banca Monte Dei Paschi Di Siena SpA	5.000%	12/20/2022	6.023%	EUR 400	\$ (13)	\$ 14	\$ 1	\$ 0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 6,100	(237)	249	12	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	21,800	(376)	226	0	(150)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.131%	400	1	(1)	0	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2024	2.134%	1,500	(15)	(9)	0	(24)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2024	2.298%	4,300	17	(123)	0	(106)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	5,900	(275)	(164)	0	(439)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	1,500	(54)	(77)	0	(131)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	400	(36)	8	0	(28)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,400	(146)	(13)	0	(133)
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.638%	400	(18)	5	0	(23)
DUB	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,700	(196)	35	0	(161)
FBF	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	800	(31)	32	1	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	10,000	(103)	122	19	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.255%	1,300	(42)	38	0	(4)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	16,700	(260)	144	0	(116)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2023	1.824%	4,700	(70)	33	0	(37)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	4,200	(156)	(223)	0	(379)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	1,900	(169)	(30)	0	(199)
GST	Equinix, Inc.	5.000%	06/20/2027	1.586%	3,800	531	20	551	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.378%	2,800	(54)	10	0	(44)
GST	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.532%	30,310	(230)	355	125	0
GST	Petrobras Global Finance BV	1.000%	12/20/2022	0.823%	2,200	(125)	128	3	0
GST	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.716%	11,600	(495)	379	0	(116)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	1,100	(100)	23	0	(77)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	12,000	(1,342)	206	0	(1,136)
JPM	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	400	(15)	(21)	0	(36)
JPM	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(14)	5	0	(9)
MBC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,300	(142)	19	0	(123)
MYC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	13,800	(479)	505	26	0
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	4,500	(162)	(244)	0	(406)
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	5,200	(464)	(83)	0	(547)
MYC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.638%	13,600	(600)	(189)	0	(788)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	900	(100)	36	0	(64)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	900	(101)	16	0	(85)
						\$ (12,780)	\$ 4,176	\$ 849	\$ (9,433)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>SM</sup>

取引相手	参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(6)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損)益	スワップの価値 <sup>(7)</sup>	
							資産	負債
BDA	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	\$ 7,292	\$ (1,419)	\$ 1,347	\$ 0	\$ (72)
BDA	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	62	(1)	2	1	0
BDA	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	3,400	(106)	107	1	0
DUB	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	5,440	(235)	237	2	0
DUB	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,221	(421)	395	0	(26)
DUB	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	66,100	(300)	(44)	0	(344)
FBF	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	84	(2)	2	0	0
FBF	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	2,900	(180)	181	1	0
FBF	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,618	(513)	486	0	(27)
FBF	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	79,000	(422)	(304)	0	(726)
FBF	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	17,500	(123)	(122)	0	(245)
GST	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	107	1	1	2	0
GST	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	22,600	(628)	625	0	(3)
GST	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	46,895	(1,600)	1,503	0	(97)
GST	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	126,300	(1,397)	740	0	(657)
GST	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	110,100	614	(1,623)	0	(1,009)
GST	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	6,300	(7)	(115)	0	(122)
GST	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	6,600	(56)	(159)	0	(215)
JPS	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	4,173	(171)	163	0	(8)
JPS	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	5,400	(101)	73	0	(28)
JPS	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	28,300	(224)	(36)	0	(260)
MEI	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	21	0	0	0	0
MEI	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	1,166	(64)	64	0	0
MEI	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	16,200	(870)	868	0	(2)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>(6)</sup> (Cont.)

取引相手	参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(6)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値 <sup>(7)</sup>		
							資産	負債	
MEI	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	\$ 15,499	\$ (657)	\$ 625	\$ 0	\$ (32)	
MYC	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	7	(1)	1	0	0	
MYC	CDX.HY-33 Index	5.000%	12/20/2024	78,427	13,071	(5,433)	7,638	0	
MYC	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	38	(1)	1	0	0	
MYC	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	10,432	(515)	493	0	(22)	
MYC	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	63,200	(1,929)	1,600	0	(329)	
MYC	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	60,700	(517)	(28)	0	(545)	
MYC	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	30,300	(12)	(605)	0	(617)	
MYC	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	13,200	(112)	(318)	0	(430)	
SAL	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	88,923	(573)	371	0	(186)	
SAL	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	93,105	(573)	89	0	(484)	
SAL	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	286,300	(1,597)	(1,031)	0	(2,628)	
SAL	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	102,000	(464)	(964)	0	(1,428)	
UAG	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	583	(26)	26	0	0	
UAG	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	1,600	(96)	95	0	(1)	
					\$ (2,211)	\$ (687)	\$ 7,645	\$ (10,543)	

TOTAL RETURN SWAPS

取引相手	トータル リターン <sup>(8)</sup> の 支払/受取	参照エンティティ	数・単位数	変動金利	想定元本	満期日	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値	
									資産	負債
BOA	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	\$ 600	03/20/2023	\$ (1)	\$ 13	\$ 12	\$ 0
JPM	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	2,100	12/20/2022	(9)	(16)	0	(25)
MYC	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	2,100	12/20/2022	(9)	3	0	(6)
							\$ (19)	\$ 0	\$ 12	\$ (31)
							\$ (14,987)	\$ 3,486	\$ 8,506	\$ (20,007)

Total Swap Agreements

<sup>(8)</sup> Option on when-issued security.

<sup>(9)</sup> Notional amount represents the number of contracts.

<sup>(10)</sup> The underlying instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

<sup>(11)</sup> If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(12)</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(13)</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(14)</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

<sup>(15)</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(16)</sup> Net exposure represents the net receivable/payable that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from DTC financial derivative instruments can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

## マネー・マーケット・マザーファンド

### 《第37期》決算日2023年5月22日

[計算期間：2022年11月22日～2023年5月22日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、5月22日に第37期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第37期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		騰 落	率					
33期(2021年5月20日)	10,182		0.0		—		—	百万円 1,245
34期(2021年11月22日)	10,182		0.0		—		—	1,637
35期(2022年5月20日)	10,182		0.0		—		—	2,897
36期(2022年11月21日)	10,181		△0.0		—		—	2,660
37期(2023年5月22日)	10,181		0.0		—		—	2,921

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落	率				
(期首) 2022年11月21日	10,181		—		—		—
11月末	10,181		0.0		—		—
12月末	10,181		0.0		—		—
2023年1月末	10,181		0.0		—		—
2月末	10,181		0.0		—		—
3月末	10,181		0.0		—		—
4月末	10,181		0.0		—		—
(期末) 2023年5月22日	10,181		0.0		—		—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

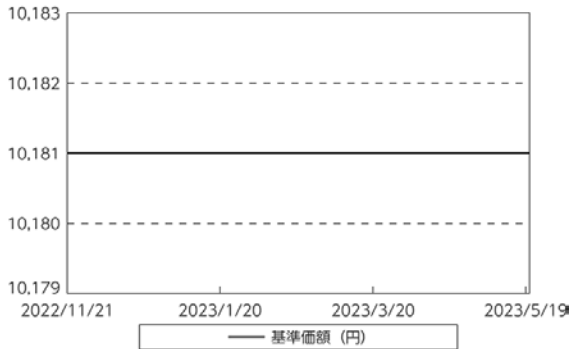
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ横ばいとなりました。

基準価額等の推移



## ●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

利子等収益が積み上がったことが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.034%となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

## ○今後の運用方針

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

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年11月22日～2023年5月22日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2022年11月22日～2023年5月22日)

## その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	269,599,882	269,499,890

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年11月22日～2023年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
その他有価証券	1,999	2,000	—

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アコムです。

## ○組入資産の明細

(2023年5月22日現在)

## 国内その他有価証券

区分	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	2,299,997	78.7

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

## ○投資信託財産の構成

(2023年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 2,299,997	% 78.7
コール・ローン等、その他	621,984	21.3
投資信託財産総額	2,921,981	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	2,921,981,522
コール・ローン等	621,984,405
その他有価証券(評価額)	2,299,997,117
(B) 負債	887
未払解約金	67
未払利息	820
(C) 純資産総額(A-B)	2,921,980,635
元本	2,870,024,150
次期繰越損益金	51,956,485
(D) 受益権総口数	2,870,024,150口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,181円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,613,319,906円  
 期中追加設定元本額 285,598,635円  
 期中一部解約元本額 28,894,391円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0181円です。

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

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,799,691,123円
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	545,437,984円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	71,485,526円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	66,609,195円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	61,994,892円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	41,204,097円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	24,765,135円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	13,122,469円
ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	10,743,284円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	9,893,887円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,872,782円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,828,976円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(年2回決算型)	9,376,245円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,124,755円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	8,067,104円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)	7,489,236円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	7,196,270円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	6,895,341円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	6,887,212円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)	6,675,966円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	6,609,861円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	6,324,266円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,990,990円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	5,812,610円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	5,548,198円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	5,484,593円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,411,821円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(毎月分配型)	4,489,124円

## ○損益の状況 (2022年11月22日~2023年5月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 93,141
受取利息	8,257
支払利息	△ 101,398
(B) 当期損益金(A)	△ 93,141
(C) 前期繰越損益金	47,403,125
(D) 追加信託差損益金	5,169,295
(E) 解約差損益金	△ 522,794
(F) 計(B+C+D+E)	51,956,485
次期繰越損益金(F)	51,956,485

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

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



欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジなし）	4,289,171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	3,857,128円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	3,545,187円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	3,319,056円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型>（3ヵ月決算型）	3,063,931円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>（年1回決算型）	2,990,177円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>（毎月決算型）	2,966,566円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（毎月分配型）	2,895,129円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 米ドル円プレミアム（毎月分配型）	2,724,520円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>（年2回分配型）	2,711,846円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	2,590,474円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）	2,515,903円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	2,299,085円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,210,674円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）	2,178,993円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	2,119,621円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	2,065,331円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,007,890円
バリュエ・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>（毎月決算型）	1,936,118円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（年2回分配型）	1,721,384円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジあり>（毎月分配型）	1,628,892円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>（年2回分配型）	1,616,484円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,491,640円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マネーマーケットファンドB>	1,355,166円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	1,339,040円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 米ドル円プレミアム（年2回分配型）	1,171,788円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,149,232円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,145,161円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,074,934円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（年1回決算型）	1,020,693円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,016,827円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド（毎月分配型）	907,086円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（年2回分配型）	870,254円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（毎月分配型）	845,131円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>（毎月分配型）	669,935円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（毎月分配型）	665,580円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	629,892円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース（為替ヘッジなし）（年1回決算型）	521,457円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	491,449円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>（毎月分配型）	416,840円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（年2回分配型）	382,241円
PIMCO 米国バンクロンファンド<米ドルインカム>（毎月分配型）	334,809円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（年2回分配型）	323,246円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>（毎月分配型）	282,290円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>（年2回分配型）	278,281円
PIMCO 米国バンクロンファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	230,764円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	217,015円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	212,322円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（年2回分配型）	208,430円
PIMCO 米国バンクロンファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	177,761円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	169,198円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジなし>（資産成長型）	138,420円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（年2回分配型）	136,856円

三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	125,118円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	111,354円
三菱UFJ /マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97,104円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース> (毎月分配型)	89,620円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89,287円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (毎月分配型)	74,308円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	60,179円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	50,114円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	44,142円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	30,651円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	30,437円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (年2回分配型)	20,635円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10,795円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10,787円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9,829円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
グローバル・インカム・フルコース (為替リスク軽減型)	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替ヘッジなし)	983円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
合計	2,870,024,150円

## [お知らせ]

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