

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/海外/債券
信託期間	信託期間は2013年5月7日から2028年4月10日までです。
運用方針	安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	AllianceBernstein (Luxembourg) S.a r.l.が運用する円建外国投資信託証券「アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)」を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	毎月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第118期(決算日 2023年5月10日)	第121期(決算日 2023年 8月10日)
第119期(決算日 2023年6月12日)	第122期(決算日 2023年 9月11日)
第120期(決算日 2023年7月10日)	第123期(決算日 2023年10月10日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			債組入比率	券率	投資信託証券組入比率	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率				
第17		円	円	%	%	%	百万円	
	第94期(2021年5月10日)	8,150	40	△0.3	—	97.5	1,808	
	第95期(2021年6月10日)	8,255	40	1.8	—	97.3	1,925	
	第96期(2021年7月12日)	8,272	40	0.7	—	98.0	1,906	
	第97期(2021年8月10日)	8,238	40	0.1	—	97.4	1,912	
	第98期(2021年9月10日)	8,194	40	△0.0	—	98.1	1,907	
第18	第99期(2021年10月11日)	8,218	40	0.8	—	98.0	1,918	
	第100期(2021年11月10日)	8,288	30	1.2	—	97.9	1,885	
	第101期(2021年12月10日)	8,230	30	△0.3	—	98.0	1,820	
	第102期(2022年1月11日)	8,219	30	0.2	—	97.4	1,802	
	第103期(2022年2月10日)	8,110	30	△1.0	—	97.6	1,766	
	第104期(2022年3月10日)	7,886	30	△2.4	—	97.7	1,720	
第19	第105期(2022年4月11日)	8,262	30	5.1	—	98.0	1,788	
	第106期(2022年5月10日)	8,341	30	1.3	—	98.1	1,759	
	第107期(2022年6月10日)	8,544	30	2.8	—	98.1	1,798	
	第108期(2022年7月11日)	8,354	30	△1.9	—	98.0	1,737	
	第109期(2022年8月10日)	8,542	30	2.6	—	98.2	1,760	
	第110期(2022年9月12日)	8,776	30	3.1	—	98.0	1,811	
第20	第111期(2022年10月11日)	8,499	30	△2.8	—	98.0	1,745	
	第112期(2022年11月10日)	8,484	30	0.2	—	98.2	1,733	
	第113期(2022年12月12日)	8,293	30	△1.9	—	98.1	1,696	
	第114期(2023年1月10日)	8,072	30	△2.3	—	97.7	1,650	
	第115期(2023年2月10日)	8,085	30	0.5	—	97.8	1,661	
	第116期(2023年3月10日)	8,132	30	1.0	—	97.9	1,678	
第21	第117期(2023年4月10日)	8,024	30	△1.0	—	97.9	1,688	
	第118期(2023年5月10日)	8,173	30	2.2	—	97.7	1,730	
	第119期(2023年6月12日)	8,362	30	2.7	—	98.0	1,782	
	第120期(2023年7月10日)	8,394	30	0.7	—	97.7	1,789	
	第121期(2023年8月10日)	8,597	30	2.8	—	98.1	1,834	
	第122期(2023年9月11日)	8,735	30	2.0	—	98.2	1,868	
	第123期(2023年10月10日)	8,555	30	△1.7	—	97.6	1,840	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当作成期中の基準価額の推移

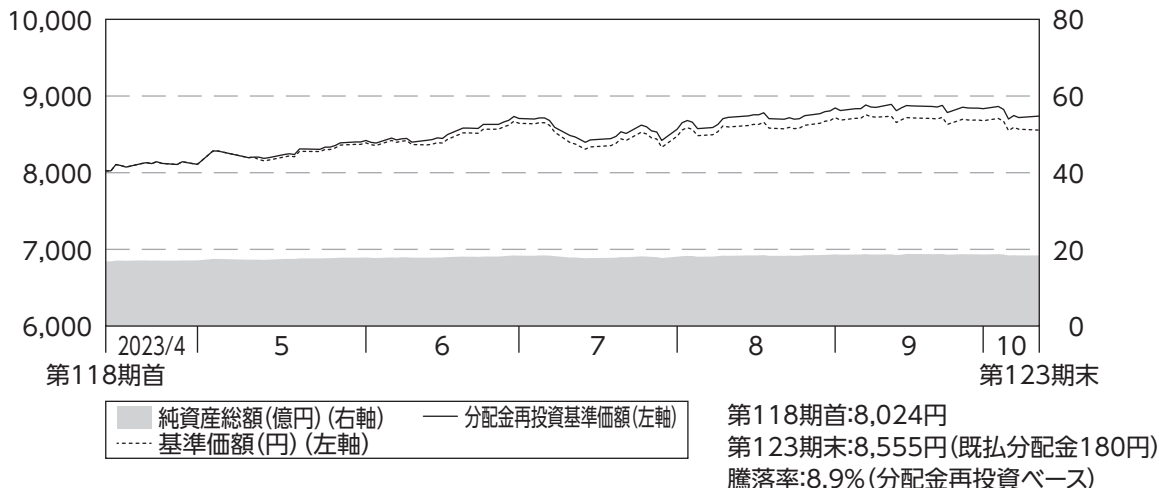
決算期	年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率		
第118期	(期 首)2023年 4月10日	円	%	%	%
	(期 末)2023年 5月10日	8,024	—	—	97.9
第119期	(期 首)2023年 5月10日	8,203	2.2	—	97.7
	(期 末)2023年 6月12日	8,173	—	—	97.7
第120期	(期 首)2023年 6月12日	8,392	2.7	—	98.0
	(期 末)2023年 7月10日	8,362	—	—	98.0
第121期	(期 首)2023年 7月10日	8,424	0.7	—	97.7
	(期 末)2023年 8月10日	8,394	—	—	97.7
第122期	(期 首)2023年 8月10日	8,627	2.8	—	98.1
	(期 末)2023年 9月11日	8,597	—	—	98.1
第123期	(期 首)2023年 9月11日	8,765	2.0	—	98.2
	(期 末)2023年10月10日	8,735	—	—	98.2
		8,585	△1.7	—	97.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2023年4月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

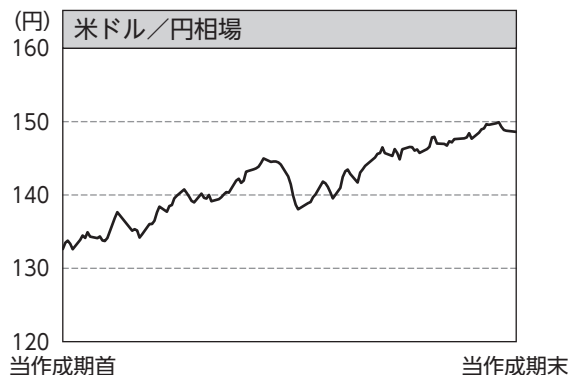
基準価額の主な変動要因

主な投資対象である「アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)」の基準価額(分配金再投資ベース)が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)	米ドル建ての公社債等	97.6%	9.7%
マネープールマザーファンド	わが国の公社債等	0.0%	△0.0%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境



米国国債市場は、根強いインフレ懸念を背景にFRB(米連邦準備理事会)が金融引き締め姿勢をより長く維持するとの観測が強まったことから、金利は前作成期末比で上昇(債券価格は下落)しました。米ドル建ハイイールド社債市場は、前作成期末比で上昇しました。堅調な企業業績を受けて概ね上昇基調で推移したものの、9月中旬以降は、銀行の格下げから与信市場への警戒感が高まったことなどから下落しました。新興国債券市場は、前作成期末比で下落しました。インフレ鈍化の兆しや商品価格の反発から上昇したものの、米国長期金利の上昇や中国の不動産大手企業の信用悪化を受け、リスク回避の姿勢が強まると下落に転じました。

為替市場は、日米の金利差が意識され、円安・米ドル高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

主な投資対象である「アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。

・アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)

主として米ドル建の国債、政府機関債、投資適格社債、ハイイールド社債、新興国債券などの様々な公社債等に分散投資する戦略を維持しました。米ドル建の投資適格債券に投資することで安定した収益の確保を図るとともに、ハイイールド社債や新興国債券に投資することで収益の向上を目指しました。マクロ経済の環境や債券種別ごとの相対的な魅力度などの分析を行い、債券種別ごとの配分比率を機動的に変更するなどして、魅力ある投資機会を積極的に追求しました。投資適格債券の組入比率は50%以上を維持しました。

<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

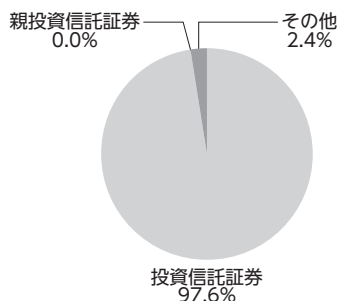
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

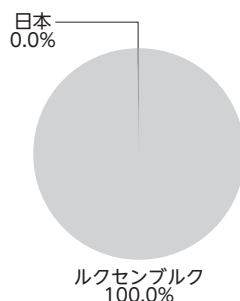
	当作成期末
	2023年10月10日
アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)	97.6%
マネープールマザーファンド	0.0%
その他	2.4%
組入ファンド数	2

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

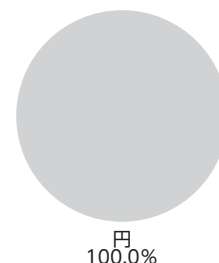
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2023年4月11日～ 2023年5月10日	2023年5月11日～ 2023年6月12日	2023年6月13日～ 2023年7月10日	2023年7月11日～ 2023年8月10日	2023年8月11日～ 2023年9月11日	2023年9月12日～ 2023年10月10日
当期分配金 (円)	30	30	30	30	30	30
(対基準価額比率) (%)	(0.366)	(0.357)	(0.356)	(0.348)	(0.342)	(0.349)
当期の収益 (円)	30	30	30	30	30	27
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	2
翌期繰越分配対象額 (円)	449	452	453	457	471	468

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) —印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

AllianceBernstein(Luxembourg)S.a r.l.が運用する円建外国投資信託証券「アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)」への投資を通じて、主として米ドル建ての公社債等に投資します。

・アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT(為替ヘッジなし)

主として米ドル建の国債、政府機関債、投資適格社債、ハイイールド社債、新興国債券、資産担保証券等の公社債等に分散投資します。

・マネープールマザーファンド

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2023年4月11日～2023年10月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	46円	0.539%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は8,502円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(14)	(0.165)	
(販売会社)	(30)	(0.357)	
(受託会社)	(1)	(0.016)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(商品)	(—)	(—)	
(先物・オプション)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(公社債)	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(d) その他費用	0	0.003	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	46	0.542	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

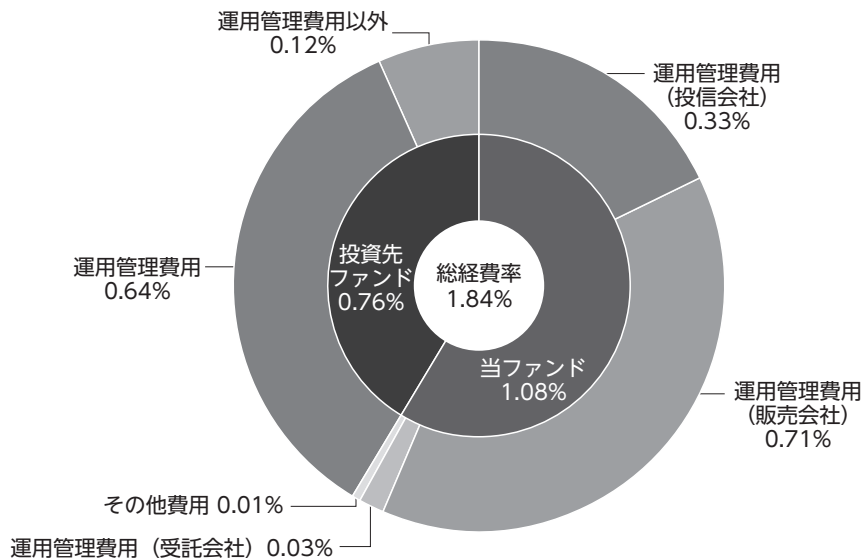
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

<参考情報>

総経費率

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



総経費率(①+②+③)	1.84%
①当ファンドの費用の比率	1.08%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.64%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.12%

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

(注2)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3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当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。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券>

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
国内	アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスII (為替ヘッジなし)	5	53,300	2	26,000

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 作 成 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 4,942	百万円 667	% 13.5	百万円 4,932	百万円 674	% 13.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<マネープールマザーファンド>

区 分	当 作 成 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 29,828,170	百万円 4,256,519	% 14.3	百万円 29,882,944	百万円 4,299,543	% 14.4

<平均保有割合 0.0%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

ファンド名	当 作 成 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
債券ファンド	千口	千円	%
アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT (為替ヘッジなし)	171	1,796,052	97.6

(注)比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	前作成期末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
マネープールマザーファンド	210	210	210

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、232,534,561千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,796,052	97.1
マネープールマザーファンド	210	0.0
コール・ローン等、その他	53,071	2.9
投資信託財産総額	1,849,333	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	第118期末 2023年5月10日現在	第119期末 2023年6月12日現在	第120期末 2023年7月10日現在	第121期末 2023年8月10日現在	第122期末 2023年9月11日現在	第123期末 2023年10月10日現在
(A) 資 産	1,742,262,122円	1,791,640,799円	1,807,546,347円	1,842,384,359円	1,886,233,767円	1,849,333,668円
コール・ローン等	44,105,506	44,723,948	58,048,672	42,943,691	51,877,546	53,070,979
投資信託受益証券(評価額)	1,690,613,631	1,746,706,562	1,749,287,407	1,799,230,400	1,834,145,974	1,796,052,463
マネープールマザーファンド(評価額)	210,289	210,289	210,268	210,268	210,247	210,226
未 収 配 当 金	7,332,696	—	—	—	—	—
(B) 負 債	11,706,836	8,852,378	17,621,240	8,050,883	17,672,304	8,776,062
未 払 金	—	—	5,000,000	—	7,000,000	—
未払収益分配金	6,352,334	6,395,840	6,397,236	6,401,055	6,417,293	6,454,135
未払解約金	3,828,704	729,187	4,718,402	232	2,503,072	721,123
未払信託報酬	1,517,973	1,718,506	1,497,923	1,641,120	1,742,937	1,592,619
未 払 利 息	88	90	48	114	121	71
その他未払費用	7,737	8,755	7,631	8,362	8,881	8,114
(C) 純資産総額(A-B)	1,730,555,286	1,782,788,421	1,789,925,107	1,834,333,476	1,868,561,463	1,840,557,606
元 本	2,117,444,912	2,131,946,923	2,132,412,121	2,133,685,047	2,139,097,810	2,151,378,580
次期繰越損益金	△386,889,626	△349,158,502	△342,487,014	△299,351,571	△270,536,347	△310,820,974
(D) 受益権総口数	2,117,444,912口	2,131,946,923口	2,132,412,121口	2,133,685,047口	2,139,097,810口	2,151,378,580口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,173円	8,362円	8,394円	8,597円	8,735円	8,555円

■損益の状況

項 目	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	自 2023年4月11日 至 2023年5月10日	自 2023年5月11日 至 2023年6月12日	自 2023年6月13日 至 2023年7月10日	自 2023年7月11日 至 2023年8月10日	自 2023年8月11日 至 2023年9月11日	自 2023年 9月12日 至 2023年10月10日
(A) 配 当 等 収 益	7,318,297円	7,384,802円	7,340,097円	7,400,321円	7,390,430円	7,466,881円
受取配当金	7,319,716	7,386,845	7,342,339	7,402,581	7,393,459	7,468,631
受取利息	—	—	—	—	32	58
支払利息	△1,419	△2,043	△2,242	△2,260	△3,061	△1,808
(B) 有価証券売買損益	31,793,936	40,874,417	6,568,065	43,938,147	30,343,659	△38,058,274
売 買 益	31,927,315	41,092,921	7,080,648	43,950,088	30,415,748	33,703
売 買 損	△133,379	△218,504	△512,583	△11,941	△72,089	△38,091,977
(C) 信託報酬等	△1,525,710	△1,727,261	△1,505,554	△1,649,482	△1,751,818	△1,600,733
(D) 当期損益金(A+B+C)	37,586,523	46,531,958	12,402,608	49,688,986	35,982,271	△32,192,126
(E) 前期繰越損益金	△130,208,900	△98,432,554	△57,434,233	△51,326,994	△8,005,026	21,491,436
(F) 追加信託差損益金	△287,914,915	△290,862,066	△291,058,153	△291,312,508	△292,096,299	△293,666,149
(配当等相当額)	(77,722,097)	(78,495,053)	(78,827,174)	(78,928,947)	(79,257,764)	(79,906,779)
(売買損益相当額)	(△365,637,012)	(△369,357,119)	(△369,885,327)	(△370,241,455)	(△371,354,063)	(△373,572,928)
(G) 計 (D+E+F)	△380,537,292	△342,762,662	△336,089,778	△292,950,516	△264,119,054	△304,366,839
(H) 収益分配金	△6,352,334	△6,395,840	△6,397,236	△6,401,055	△6,417,293	△6,454,135
次期繰越損益金(G+H)	△386,889,626	△349,158,502	△342,487,014	△299,351,571	△270,536,347	△310,820,974
追加信託差損益金	△287,914,915	△290,862,066	△291,058,153	△291,312,508	△292,096,299	△293,666,149
(配当等相当額)	(77,722,097)	(78,495,053)	(78,827,174)	(78,928,947)	(79,257,764)	(79,906,779)
(売買損益相当額)	(△365,637,012)	(△369,357,119)	(△369,885,327)	(△370,241,455)	(△371,354,063)	(△373,572,928)
分配準備積立金	17,405,080	18,034,427	17,915,921	18,642,008	21,559,952	20,903,444
繰越損益金	△116,379,791	△76,330,863	△69,344,782	△26,681,071	—	△38,058,269

(注1) (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2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

〈注記事項〉

※当ファンドの第118期首元本額は2,103,867,285円、第118～123期中追加設定元本額は123,112,257円、第118～123期中一部解約元本額は75,600,962円です。

※分配金の計算過程

項 目	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	7,032,832円	7,120,524円	6,545,457円	7,162,622円	7,047,240円	5,866,143円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	—円	—円	—円	—円	2,366,921円	—円
(C) 収益調整金額	77,722,097円	78,495,053円	78,827,174円	78,928,947円	79,257,764円	79,906,779円
(D) 分配準備積立金額	16,724,582円	17,309,743円	17,767,700円	17,880,441円	18,563,084円	21,491,436円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	101,479,511円	102,925,320円	103,140,331円	103,972,010円	107,235,009円	107,264,358円
(F) 期末残存口数	2,117,444,912口	2,131,946,923口	2,132,412,121口	2,133,685,047口	2,139,097,810口	2,151,378,580口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	479円	482円	483円	487円	501円	498円
(H) 分配金額(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	30円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	6,352,334円	6,395,840円	6,397,236円	6,401,055円	6,417,293円	6,454,135円

分配金のお知らせ

	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
1万口当たり分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円

(注)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。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

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

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

該当事項はありません。

組入投資信託証券の内容

■アメリカン・インカム・ポートフォリオークラスIT（為替ヘッジなし）

●ファンドの概要

管 理 会 社	アライアンス・バーンスタイン・ルクセンブルク・エス・エイ・アール・エル
運 用 方 針	主として米ドル建の国債、政府機関債、投資適格社債、ハイイールド社債、新興国債券、資産担保証券等の公社債等に分散投資します。
主要運用対象	主として米ドル建の公社債等に投資します。
組 入 制 限	債券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の80%以上とします。 米国の発行体が発行する証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の65%以上とします。 (i) 米国債及び(ii) 投資時点において投資適格を有するとみなされる、又は格付を得ていない場合には投資顧問会社が同等の水準であるとみなすその他の証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 S&P社又はMoody's社からCCC格相当以下の格付が付与された証券、又は格付を得ていない場合には投資顧問会社が同等の水準であるとみなす証券への投資は原則として行いません。

以下の「損益の状況」、「投資明細表」は「AllianceBernstein ANNUAL REPORT AB FCP I」の情報を基に掲載しています。

American Income Portfolio

● 損益の状況 (2022年8月31日に終了した年度)

	American Income Portfolio (USD)
INVESTMENT INCOME	
Interest	\$ 1,093,601,849
Swap income	129,203,251
Dividends, net	33,881,711
Securities lending income, net	-0-
	<u>1,256,686,811</u>
EXPENSES	
Management fee	194,482,224
Expense on swaps	30,263,372
Management Company fee	17,587,689
Transfer agency	9,297,316
Taxes	8,341,684
Distribution fee	6,531,694
Professional fees	1,462,460
Depository and custodian fees	906,177
Accounting and administration fee	212,377
Printing	326,453
Miscellaneous	1,207,757
	<u>270,619,203</u>
Expense reimbursed or waived	(159)
Net expenses	270,619,044
Net investment income	<u>986,067,767</u>
REALIZED GAINS AND (LOSSES)	
On investments, forward foreign currency contracts, swaps, financial futures contracts, options and currency	(1,225,239,270)
Capital withholding tax	-0-
CHANGES IN UNREALIZED GAINS AND (LOSSES)	
On investments	(2,873,187,184)
On financial futures contracts	(19,061,167)
On forward foreign currency contracts	(14,957,715)
On swaps	196,738,540
On options written	2,347,748
Result of operations	<u>(2,947,291,281)</u>
CAPITAL STOCK TRANSACTIONS	
(Decrease)	(4,488,398,526)
Distributions	(835,033,647)
NET ASSETS	
Beginning of year	24,837,439,539
Currency translation adjustment	-0-
End of year	<u>\$ 16,566,716,085</u>

●投資明細表(2022年8月31日現在)

	利率	満期日	元本 (単位:千)	時価 (USD)	純資産 比率
TRANSFERABLE SECURITIES QUOTED ON A STOCK EXCHANGE OR DEALT IN ON ANOTHER REGULATED MARKET					
GOVERNMENTS - TREASURIES					
UNITED STATES					
U.S. Treasury Bonds	3.38%	08/15/2042	USD 200,555	\$ 196,387,227	1.2%
U.S. Treasury Bonds	6.13%	11/15/2027	344,064	388,685,252	2.4
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	537,115	632,116,627	3.8
U.S. Treasury Bonds(a)	6.25%	05/15/2030	747,077	900,228,026	5.4
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	13,643	15,322,682	0.1
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	217,311	237,887,307	1.4
U.S. Treasury Notes	2.63%	05/31/2027	72,073	69,899,358	0.4
U.S. Treasury Notes	2.88%	08/31/2027	1,257,127	1,247,894,712	7.5
U.S. Treasury Notes	3.25%	08/31/2024	90,480	90,126,069	0.6
				<u>3,778,547,260</u>	<u>22.8</u>
CORPORATES - NON-INVESTMENT GRADE					
INDUSTRIAL					
BASIC					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	8,819	7,190,627	0.1
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	3,318	3,271,322	0.0
Avient Corp.	7.13%	08/01/2030	8,812	8,714,500	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	1,879	1,900,350	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	5,000	4,149,245	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	7,573	6,899,249	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	45,235	41,943,394	0.3
Glatfelter Corp.	4.75%	11/15/2029	8,295	5,164,748	0.0
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,101,618	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	23,855,916	0.2
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	25,574,091	0.2
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	22,466	18,641,691	0.1
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	6,793	6,312,605	0.0
				<u>157,719,356</u>	<u>1.0</u>
CAPITAL GOODS					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	3,559	3,484,973	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	5,709	5,437,823	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,221,784	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	18,012,708	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	41,527	38,419,236	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	7,955	6,849,408	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	4,000	3,663,940	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	4,915,802	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	21,995	20,018,994	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	8,943	9,015,124	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	10,456	10,498,584	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	9,299,733	0.1
				<u>133,838,109</u>	<u>0.8</u>
COMMUNICATIONS - MEDIA					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	37,082	31,891,853	0.2
Alice Financing SA	5.00%	01/15/2028	42,199	34,251,604	0.2
Alice Financing SA	5.75%	08/15/2029	24,913	20,102,887	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	3,926	3,710,363	0.0
Belo Corp.	7.75%	06/01/2027	2,604	2,546,244	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	8,714,196	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	61,959	49,007,769	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	8,598,431	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	8,724	7,829,526	0.1
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	5,991	4,493,894	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	23,052	16,548,913	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	37,402	28,952,740	0.2
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	25,055	20,716,044	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	21,888,557	0.1
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	4,062,245	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	42,997	36,352,836	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	22,917	21,656,308	0.1
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	40,341	35,422,199	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	8,693	4,347,731	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	10,438,322	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	17,585	13,784,826	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	10,359	8,377,306	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	20,137	18,840,419	0.1
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	700	609,168	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	8,302	7,258,698	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	27,053,775	0.2

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	USD 16,494	\$ 16,364,602	0.1%
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	946	786,878	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	794	635,567	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	24,189	20,670,416	0.1
				<u>485,914,317</u>	<u>2.9</u>
COMMUNICATIONS - TELECOMMUNICATIONS					
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	40,042	36,638,430	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	5,895	4,560,539	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	32,651	26,604,467	0.2
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	21,303	16,484,666	0.1
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	14,216	13,025,233	0.1
Iliad Holding SASU	7.00%	10/15/2028	9,698	8,931,902	0.1
Lumen Technologies, Inc., Series Y.	7.50%	04/01/2024	17,638	17,998,540	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	9,850	8,405,669	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	7,678	6,630,639	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	6,675	5,479,718	0.0
				<u>144,759,803</u>	<u>0.9</u>
CONSUMER CYCLICAL - AUTOMOTIVE					
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	4,888	4,568,528	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	10,159	9,653,822	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	20,680	20,455,611	0.1
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	5,591	4,539,170	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	12,089	10,786,865	0.1
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	65,028	63,413,819	0.3
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	2,698	2,419,776	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	2,860	2,466,306	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.00%	05/15/2027	23,494	20,909,707	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	12,577	11,102,594	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	22,261	16,324,318	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	31,879	24,234,782	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	34,461	32,322,693	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	10,388	10,712,625	0.1
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	8,241	8,286,125	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	14,495	13,666,353	0.1
				<u>255,863,094</u>	<u>1.5</u>
CONSUMER CYCLICAL - ENTERTAINMENT					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	13,272	11,015,760	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	58,296	45,325,140	0.3
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	10,000	10,019,500	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025	52,796	51,937,759	0.3
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	18,007	14,000,442	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	23,060	18,377,436	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	11,994,685	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	31,966	32,466,588	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	34,310	36,413,546	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	5,175	5,232,423	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	8,044	8,059,668	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	8,267	6,758,961	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	21,681	18,322,083	0.1
				<u>269,923,991</u>	<u>1.6</u>
CONSUMER CYCLICAL - OTHER					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	14,225	12,414,628	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	500	477,888	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	28,915	22,345,986	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	43,589,334	0.3
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	5,000	4,638,945	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	29,496	28,798,431	0.2
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	8,518	7,326,209	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	4,804,033	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	3,337	3,107,857	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	35,757	35,063,413	0.2
KB Home	4.80%	11/15/2029	2,965	2,529,822	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	4,102	4,064,629	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	3,034	3,030,881	0.0
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	7,000	5,648,623	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	15,986,731	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	8,959	8,265,330	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	15,629	15,110,006	0.1
Travel + Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	27,347	22,232,814	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	3,108	2,536,581	0.0
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	13,210	12,809,671	0.1

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	USD 11,291	\$ 10,181,311	0.1%
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	11,303,820	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	14,262	14,221,684	0.1
				<u>290,488,627</u>	<u>1.8</u>
CONSUMER CYCLICAL - RETAILERS					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	11,996	10,035,434	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	10,155	8,483,888	0.1
Bath & Body Works, Inc.	5.25%	02/01/2028	5,737	5,149,629	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	11,017	10,012,678	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	25,820	22,284,598	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	21,725	18,985,481	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	270,938	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	7,154	6,881,588	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	591,610	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	7,381	6,486,601	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	21,733	19,445,839	0.1
Michaels Cos, Inc. (The)	5.25%	05/01/2028	23,129	17,744,121	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	11,452	10,519,290	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	33,180	29,863,112	0.2
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	10,386	9,240,053	0.1
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	24,937	21,080,958	0.1
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	5,890	4,815,753	0.0
				<u>201,891,571</u>	<u>1.2</u>
CONSUMER NON-CYCLICAL					
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	6,613	6,217,189	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	15,673	13,741,404	0.1
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	4,505	2,161,273	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	17,487	6,599,884	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	271	174,131	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	1,977	1,847,432	0.0
Darling Ingredients, Inc.	6.00%	06/15/2030	9,928	9,937,666	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	1,026,139	0.0
Garden Spinco Corp.	8.63%	07/20/2030	10,941	11,646,079	0.1
Grifols Escrow Issuer SA.	4.75%	10/15/2028	7,443	6,308,878	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	33,210	30,106,824	0.2
Legacy LifePoint Health LLC.	6.75%	04/15/2025	64,710	63,528,683	0.4
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	2,163	1,920,325	0.0
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	8,368	7,114,954	0.1
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	5,000	4,343,642	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	6,001,552	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	6,778,347	0.1
RP Escrow Issuer LLC.	5.25%	12/15/2025	24,848	22,414,211	0.1
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	9,491	8,553,677	0.1
				<u>210,422,290</u>	<u>1.3</u>
ENERGY					
Berry Petroleum Co. LLC.	7.00%	02/15/2026	3,175	2,984,335	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	11,064	11,059,457	0.1
Cheniere Energy Partners LP.	4.50%	10/01/2029	4,266	3,930,232	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	12,725,501	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	45,862	44,747,226	0.3
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	4,730	4,464,975	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	13,971	13,144,132	0.1
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	2,995	2,758,542	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC.	5.50%	06/15/2031	16,660	14,742,713	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	15,590	14,905,256	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC.	8.50%	05/01/2028	12,292	11,728,673	0.1
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	17,787	17,106,746	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	4.40%	04/01/2024	804	806,474	0.0
EnLink Midstream Partners LP.	5.05%	04/01/2045	12,996	9,385,296	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.45%	06/01/2047	10,303	7,869,128	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.60%	04/01/2044	1,916	1,519,996	0.0
EQM Midstream Partners LP.	4.50%	01/15/2029	16,753	14,583,493	0.1
EQM Midstream Partners LP.	4.75%	01/15/2031	15,247	13,178,216	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	5,083	4,641,832	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	3,830	3,565,096	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	40,175	37,461,927	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	28,318	26,831,432	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	11,607	10,657,115	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	7,835	7,458,480	0.1
Harbour Energy PLC.	5.50%	10/15/2026	7,343	6,712,598	0.0
Hess Midstream Operations LP.	4.25%	02/15/2030	206	177,631	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	5,408	4,969,157	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	7,941	7,194,669	0.0

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	USD 6,979	\$ 6,813,957	0.0%
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	36,137	30,649,472	0.2
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	17,675	17,056,675	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	22,561	21,824,380	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	54,939	49,734,106	0.3
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	5,779	5,928,293	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	4,679	4,872,800	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	10,610	11,497,030	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	5,994	6,715,378	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	6,994	8,183,265	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	8,594	8,232,383	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	3,417	3,406,731	0.0
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	3,267	3,091,984	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	8.50%	10/15/2026	14,264	13,861,700	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	4,184	4,107,699	0.0
				<u>507,286,181</u>	<u>3.1</u>
OTHER INDUSTRIAL					
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	5,810	5,139,489	0.0
SERVICES					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	46,602	43,626,685	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARRL	4.63%	06/01/2028	21,890	18,472,564	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	14,450	14,177,151	0.1
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	13,856	13,697,802	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	13,634	12,266,300	0.1
ION Trading Technologies SARRL	5.75%	05/15/2028	11,107	9,464,593	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	20,092,176	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	26,526	22,608,239	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	34,084	27,043,151	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,002	10,041,619	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	3,599	3,610,748	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	9,896	9,809,423	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	11,581,544	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	575	570,976	0.0
Sabre GLBL, Inc.	7.38%	09/01/2025	2,660	2,521,243	0.0
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	17,308	17,056,068	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	9,576	9,414,421	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,706	5,503,403	0.0
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	19,625	16,418,017	0.1
				<u>267,976,123</u>	<u>1.6</u>
TECHNOLOGY					
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	6,123	6,096,770	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	210	198,596	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	6,238	6,458,762	0.0
Entegris Escrow Corp.	5.95%	06/15/2030	12,650	12,006,381	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	09/01/2027	3,670	2,695,888	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	10,151	9,827,721	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	7,437	7,119,587	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	5,300	4,556,551	0.0
Sensata Technologies BV	5.88%	09/01/2030	10,263	10,029,284	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	76,800	59,177,348	0.4
				<u>118,166,888</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTATION - AIRLINES					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	10,577	10,512,711	0.1
American Airlines, Inc.	11.75%	07/15/2025	5,000	5,523,446	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	8,593	8,180,787	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	13,211	11,933,666	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	10,686	9,757,184	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	30,569	31,068,725	0.2
				<u>76,976,519</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTATION - SERVICES					
Albion Financing 1 SARRL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	19,507	17,432,612	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	4.75%	04/01/2028	15,737	13,744,323	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	3,641	3,175,680	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	16,432	13,785,453	0.1
				<u>48,138,068</u>	<u>0.3</u>
				<u>3,174,504,426</u>	<u>19.2</u>
FINANCIAL INSTITUTIONS					
BANKING					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(c)	6.50%	03/05/2025	48,200	45,140,890	0.3
Banco Santander SA(c)	7.50%	02/08/2024	18,600	18,341,587	0.1

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Bread Financial Holdings, Inc.	4.75%	12/15/2024	USD 33,539	\$ 29,647,517	0.2%
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	15,902	14,311,800	0.1
Credit Suisse Group AG	6.25%	12/18/2024	33,000	29,700,000	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	6.25%	12/18/2024	12,694	11,424,600	0.1
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	07/17/2023	5,000	4,422,694	0.0
Credit Suisse Group AG	7.50%	07/17/2023	27,754	24,549,488	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	12/11/2023	2,004	1,903,800	0.0
Credit Suisse Group AG	7.50%	12/11/2023	25,000	23,733,289	0.1
Credit Suisse Group AG	9.75%	06/23/2027	1,083	1,095,184	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	29,505	28,352,717	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	2,854,526	0.0
Societe Generale SA(c)	7.88%	12/18/2023	9,332	9,238,680	0.0
Societe Generale SA(c)	8.00%	09/29/2025	16,232	16,311,211	0.1
				<u>261,027,983</u>	<u>1.6</u>
BROKERAGE					
AG Tmt Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	23,499	23,506,925	0.1
Jane Street Group/JSG Finance, Inc.	4.50%	11/15/2029	17,383	15,779,360	0.1
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	8,605	7,634,472	0.1
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,419	<u>17,165,053</u>	<u>0.1</u>
				<u>64,085,810</u>	<u>0.4</u>
FINANCE					
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	15,194	12,024,050	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,524	9,051,747	0.0
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	21,183	20,005,143	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	15,619	<u>13,330,200</u>	<u>0.1</u>
				<u>54,411,140</u>	<u>0.3</u>
REITS					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Selco LL	4.50%	04/01/2027	29,109	24,983,130	0.0
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Selco LL	5.75%	05/15/2026	9,735	9,124,844	0.1
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	13,966	13,725,391	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	10,460	9,077,301	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	9,146,860	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	11,339	10,470,617	0.1
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	13,793	<u>12,154,203</u>	<u>0.1</u>
				<u>88,682,346</u>	<u>0.5</u>
				<u>468,207,279</u>	<u>2.8</u>
UTILITY					
ELECTRIC					
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	21,905	19,566,438	0.1
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	7,871	7,545,699	0.1
Vistra Corp.(c)	7.00%	12/15/2026	16,102	14,974,860	0.1
Vistra Corp.(c)	8.00%	10/15/2026	19,514	18,684,655	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	18,523	<u>17,905,921</u>	<u>0.1</u>
				<u>78,677,573</u>	<u>0.5</u>
				<u>3,721,389,278</u>	<u>22.5</u>
CORPORATES - INVESTMENT GRADE					
FINANCIAL INSTITUTIONS					
BANKING					
ABN AMRO Bank NV	4.80%	04/18/2026	7,000	6,865,756	0.0
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	60,316	58,795,832	0.4
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	11,107	12,284,523	0.1
AmSouth Bancorp	6.75%	11/01/2025	11,929	12,677,277	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	8,780	8,596,631	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd/United Kingdom	6.75%	06/15/2026	43,923	43,838,628	0.3
Banco Santander SA	4.18%	03/24/2028	13,200	12,439,752	0.1
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	74,800	74,183,492	0.4
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	37,420,334	0.2
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	15,203	15,071,529	0.1
Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	14,620	14,742,903	0.1
Barclays Bank PLC, Series Z(c)	7.63%	11/21/2022	8,608	8,651,512	0.1
Barclays PLC(c)	8.00%	03/15/2029	26,640	25,970,793	0.2
BBVA USA	5.90%	04/01/2026	7,500	7,846,024	0.0
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027	13,920	13,567,607	0.1
BNP Paribas SA	7.75%	08/16/2029	18,753	18,700,178	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	17,050	16,853,689	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	23,260,543	0.1
Capital One Financial Corp.	4.93%	05/10/2028	19,600	19,368,125	0.1
Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	24,915	21,637,944	0.1

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	USD 14,902	\$ 14,761,034	0.1%
Citigroup, Inc., Series P(c)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,063,770	0.1
Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	26,500	24,612,569	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	9,977	8,448,116	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	16,145	14,165,713	0.1
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	12,544,715	0.1
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	21,494	22,004,482	0.1
Credit Agricole SA	8.13%	03/23/2171	19,693	20,165,286	0.1
Danske Bank A/S	4.30%	04/01/2028	34,018	31,923,552	0.2
Deutsche Bank AG/New York NY	6.12%	07/14/2026	24,309	24,343,835	0.1
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	40,909,027	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	12,758,609	0.1
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	4.55%	08/23/2027	33,130	32,511,954	0.2
First Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,612,204	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series D(c)	5.30%	11/10/2026	1,910	1,845,267	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	15,687	14,762,913	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	17,054	15,281,796	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	9,850	9,505,250	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.50%	03/23/2028	17,335	16,132,626	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	31,733	31,035,227	0.2
JPMorgan Chase & Co.	4.32%	04/26/2028	43,463	42,469,832	0.2
JPMorgan Chase & Co.	4.57%	06/14/2030	17,051	16,588,791	0.1
JPMorgan Chase & Co., Series S(c)	6.75%	02/01/2024	13,340	13,475,388	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	22,146,830	0.1
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	25,585	25,226,073	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.02%	07/20/2028	19,113	19,247,521	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	17,908	17,833,641	0.1
Morgan Stanley	4.21%	04/20/2028	17,502	17,038,927	0.1
Nordea Bank Abp(c)	6.63%	03/26/2026	59,046	57,964,454	0.3
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	51,158	49,261,540	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB	6.88%	06/30/2027	600	588,887	0.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	10,887,234	0.1
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	16,497,805	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	21,637,468	0.2
Standard Chartered PLC(c) (d)	4.32%	01/30/2027	34,013	27,210,321	0.2
Standard Chartered PLC(c)	7.75%	04/02/2023	988	992,822	0.0
Standard Chartered PLC	7.75%	04/02/2023	1,505	1,512,345	0.0
Standard Chartered PLC	7.75%	02/15/2171	881	856,583	0.0
Svenska Handelsbanken AB	4.38%	03/01/2027	1,800	1,551,236	0.0
Svenska Handelsbanken AB	4.75%	03/01/2031	13,600	11,070,809	0.1
Swedbank AB, Series NC5	5.63%	09/17/2024	13,600	13,233,570	0.1
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	7,756,902	0.0
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	4,473	4,432,608	0.0
UBS Group AG(c)	7.00%	01/31/2024	12,992	12,717,634	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	28,847	29,006,447	0.2
UniCredit SpA	4.63%	04/12/2027	1,425	1,337,465	0.0
UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	24,650	25,212,663	0.1
				<u>1,280,916,813</u>	<u>7.7</u>
BROKERAGE					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	39,660	39,535,068	0.2
FINANCE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	3,072	2,942,780	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.00%	10/29/2028	35,999	30,875,583	0.2
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	162	161,194	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	7,258	6,617,275	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025	12,253	11,882,336	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,140	3,217,940	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	8,142	6,649,981	0.1
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	4,820	4,708,390	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	1,132	1,042,749	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	12,230	12,176,378	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	46,031	44,344,028	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	4,621,254	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	11,054,636	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	7,086,076	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	109,397	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	4,752,448	0.0
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	18	13,885	0.0
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	6,078	5,528,295	0.0
Synchrony Financial	4.88%	06/13/2025	32,687	32,210,480	0.2
Synchrony Financial	5.15%	03/19/2029	1,500	1,427,600	0.0
				<u>191,422,705</u>	<u>1.2</u>
INSURANCE					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	40,836,925	0.3

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	USD 8,665	\$ 8,819,696	0.1%
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	35,856	32,877,585	0.2
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	20,363,673	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	18,183,035	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	5.63%	06/24/2046	3,300	3,315,983	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	5.03%	02/12/2047	61,341	51,027,935	0.3
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	6,501	7,513,478	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	13,306,662	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7,456	7,681,225	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	11,712,423	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(d)	4.12%	12/15/2024	1,000	999,386	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	41,373,897	0.3
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	52,407	52,202,473	0.3
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	15,690	14,930,107	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	68,904	67,528,542	0.4
				<u>392,673,025</u>	<u>2.4</u>
OTHER FINANCE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	6,125	5,920,662	0.0
REITS					
Brixmor Operating Partnership LP	4.05%	07/01/2030	62	55,164	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	14,756,373	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,110,950	0.0
Kite Realty Group LP	4.00%	10/01/2026	2,785	2,648,552	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	9,147	7,687,154	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	13,581	12,998,444	0.1
Office Properties Income Trust	3.45%	10/15/2031	14,840	9,843,914	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.50%	01/15/2025	3,865	3,828,044	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	5.25%	01/15/2026	5,503	5,459,290	0.0
Realty Income Corp.	3.40%	01/15/2028	7,691	7,214,937	0.1
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	17,949,516	0.1
Spirit Realty LP	4.00%	07/15/2029	14,882	13,502,695	0.1
STORE Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	4,427,870	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	1,235	1,236,778	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.75%	02/01/2027	19,477	19,171,572	0.1
				<u>125,891,253</u>	<u>0.8</u>
TRANSPORTATION - SERVICES					
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	35,753	34,828,910	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	30,072,642	0.2
				<u>64,901,552</u>	<u>0.4</u>
				<u>2,101,261,078</u>	<u>12.7</u>
INDUSTRIAL					
BASIC					
Arcenic Corp.	6.00%	05/15/2025	29,005	28,533,385	0.1
Celanese US Holdings LLC.	5.90%	07/05/2024	8,615	8,684,348	0.1
Celanese US Holdings LLC.	6.05%	03/15/2025	8,615	8,638,686	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	5,293,379	0.0
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	354,089	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	13,883,872	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	9,094,271	0.1
Huntsman International LLC.	4.50%	05/01/2029	13,936	12,833,387	0.1
MEGlobal Canada ULC.	5.00%	05/18/2025	5,875	5,904,375	0.0
MEGlobal Canada ULC.	5.88%	05/18/2030	3,112	3,246,789	0.0
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	19,000	22,183,605	0.1
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	4,108	3,247,887	0.0
				<u>121,898,073</u>	<u>0.7</u>
CAPITAL GOODS					
General Electric Co., Series D(c) (d)	5.16%	12/15/2022	41,196	39,000,250	0.2
Parker-Hannifin Corp.	4.50%	09/15/2029	31,682	31,175,454	0.2
				<u>70,175,704</u>	<u>0.4</u>
COMMUNICATIONS - MEDIA					
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	13,188	12,068,349	0.1
Magallanes, Inc.	4.05%	03/15/2029	3,850	3,497,046	0.0
Magallanes, Inc.	4.28%	03/15/2032	19,532	16,966,574	0.1
Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030	42	39,933	0.0
Time Warner Entertainment Co. LP	8.38%	07/15/2033	15,020	17,238,652	0.1
				<u>49,810,554</u>	<u>0.3</u>
COMMUNICATIONS - TELECOMMUNICATIONS					
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,411,610	0.0
British Telecommunications PLC	5.13%	12/04/2028	10,440	10,268,351	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	39,776	49,155,100	0.2
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC.	4.74%	03/20/2025	9,793	9,826,588	0.1

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	USD 9,140	\$ 9,241,999	0.1%
				<u>81,903,648</u>	<u>0.5</u>
CONSUMER CYCLICAL - AUTOMOTIVE					
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	14	14,418	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	7,120,014	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	15	15,918	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	62	59,649	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	13,435	11,991,731	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	12,998	12,462,603	0.1
Learn Corp.	3.50%	05/30/2030	57	49,583	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	19,242,193	0.1
				<u>50,956,109</u>	<u>0.3</u>
CONSUMER CYCLICAL - OTHER					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	15,999,353	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	3,052,953	0.1
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	1,449	1,565,780	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	1,352	1,371,500	0.0
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	1,500	1,672,925	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLVP Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	16,048,397	0.1
				<u>39,710,908</u>	<u>0.3</u>
CONSUMER CYCLICAL - RETAILERS					
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	4,040	3,453,287	0.0
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	14,349,406	0.1
				<u>17,802,693</u>	<u>0.1</u>
CONSUMER NON-CYCLICAL					
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	38,826	37,591,032	0.2
BAT International Finance PLC.	4.45%	03/16/2028	36,222	34,494,743	0.2
				<u>72,085,775</u>	<u>0.4</u>
ENERGY					
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	6,893	6,618,736	0.0
Boardwalk Pipelines LP	4.80%	05/03/2029	19,313	18,561,393	0.1
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	8,488	8,204,076	0.1
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	10,606	10,886,742	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	428	466,120	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	12,633	12,074,843	0.1
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	6,505	7,747,677	0.1
Energy Transfer LP	4.40%	03/15/2027	71,587	69,343,678	0.4
Energy Transfer LP	4.95%	05/15/2028	6,435	6,282,499	0.0
Energy Transfer LP	5.50%	06/01/2027	23,075	23,352,669	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	13,000,702	0.1
Eni SpA	4.25%	05/09/2029	12,712	12,115,206	0.1
Eni SpA, Series X-R	4.75%	09/12/2028	1,500	1,486,230	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	45,274	50,554,422	0.3
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	18,550,069	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP	7.30%	08/15/2033	9,000	9,982,637	0.1
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	201	195,488	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	10,843,996	0.1
ONEOK, Inc.	4.35%	03/15/2029	21,411	20,217,861	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	9,649	9,404,216	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	3,461	3,007,609	0.0
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	13,533,201	0.1
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	15,917	16,371,329	0.1
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC	7.00%	10/15/2028	19,360	20,849,957	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	22,413	21,446,337	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	4,159	3,865,142	0.0
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	12,047	11,524,430	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	7,998	7,538,362	0.0
				<u>408,025,627</u>	<u>2.5</u>
SERVICES					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	36	36,938	0.0
Global Payments, Inc.	5.30%	08/15/2029	8,683	8,591,988	0.1
RELX Capital, Inc.	4.75%	05/20/2032	5,389	5,412,641	0.0
				<u>14,041,567</u>	<u>0.1</u>
TECHNOLOGY					
Broadcom, Inc.	3.14%	11/15/2035	2,915	2,209,935	0.0
Broadcom, Inc.	3.19%	11/15/2036	61,106	45,333,245	0.3
Broadcom, Inc.	4.00%	04/15/2029	3,991	3,699,716	0.0
Broadcom, Inc.	4.15%	04/15/2032	19,296	17,278,805	0.1
Broadcom, Inc.	4.93%	05/15/2037	10,043	8,960,615	0.1
Entegris Escrow Corp.	4.75%	04/15/2029	35,879	33,017,829	0.2
HP, Inc.	4.75%	01/15/2028	33,320	32,812,938	0.2

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Leidos, Inc.	7.13%	07/01/2032	USD 2,000	\$ 2,131,671	0.0%
NXP BV/NXP Funding LLC	5.35%	03/01/2026	21,052	21,459,883	0.1
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	3,634	2,739,374	0.0
				<u>169,644,011</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTATION - AIRLINES					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	29,751,205	0.2
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	59,148	59,325,585	0.4
				<u>89,076,790</u>	<u>0.6</u>
TRANSPORTATION - RAILROADS					
BNSF Funding Trust I	6.61%	12/15/2055	5,597	5,509,859	0.0
TRANSPORTATION - SERVICES					
Ashtead Capital, Inc.	5.50%	08/11/2032	4,450	4,373,136	0.0
				<u>1,195,014,454</u>	<u>7.2</u>
UTILITY					
ELECTRIC					
NRG Energy, Inc.	3.75%	06/15/2024	10,265	9,963,444	0.1
				<u>3,306,238,976</u>	<u>20.0</u>
EMERGING MARKETS - HARD CURRENCY					
FINANCIAL INSTITUTIONS					
BANKING					
Absa Group Ltd.	6.38%	05/27/2026	4,093	3,752,258	0.0
Banco de Credito del Peru S.A.	3.13%	07/01/2030	20,748	19,088,160	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	23,905	24,014,067	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	26,946	24,685,904	0.2
				<u>71,540,389</u>	<u>0.4</u>
FINANCE					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	400	331,450	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	39,399	36,562,272	0.2
				<u>36,893,722</u>	<u>0.2</u>
OTHER FINANCE					
OEC Finance Ltd.(b)	4.38%	10/25/2029	5,023	154,890	0.0
OEC Finance Ltd.(b)	7.13%	12/26/2046	12,883	334,387	0.0
				<u>489,277</u>	<u>0.0</u>
REITs					
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.38%	09/13/2022	531	33,188	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.88%	03/01/2027	5,486	342,875	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.98%	08/18/2025	433	26,467	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	7.95%	02/19/2023	913	57,234	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.	6.00%	02/04/2026	2,671	510,495	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.	7.00%	05/02/2025	1,440	299,520	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	9.38%	06/30/2024	1,573	174,800	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	9.95%	07/23/2025	5,483	609,298	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	10.50%	01/15/2025	764	84,518	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	11.65%	06/01/2026	1,137	124,928	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	11.70%	11/11/2025	623	68,063	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	5.95%	08/10/2025	1,601	203,927	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	6.00%	08/14/2026	400	49,575	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	7.40%	01/13/2027	347	43,375	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	642	80,250	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	5.95%	04/30/2025	940	109,451	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	6.25%	08/10/2024	364	48,867	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e)	5.20%	01/16/2027	1,491	197,557	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e)	5.60%	07/15/2026	270	36,450	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	5.95%	04/26/2024	1,297	181,580	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.50%	01/10/2025	2,260	316,400	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.50%	01/26/2026	1,087	152,180	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.65%	08/03/2024	282	39,480	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.80%	10/20/2024	724	101,360	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	7.00%	07/09/2025	316	44,240	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.55%	06/04/2024	2,235	391,125	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.75%	01/14/2027	1,726	241,640	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.60%	03/02/2023	490	120,050	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.75%	07/08/2025	703	105,450	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	29,764	25,559,835	0.2
Yango Justice International Ltd.(e)	7.50%	04/15/2024	727	39,985	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	7.50%	02/17/2025	7,372	405,460	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	7.88%	09/04/2024	2,391	131,505	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	8.25%	11/25/2023	1,343	73,865	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	9.25%	04/15/2023	630	34,650	0.0

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Yango Justice International Ltd.(e)	10.25%	09/15/2022	USD 335	\$ 19,011	0.0%
Zhenro Properties Group Ltd.(e)	7.10%	09/10/2024	587	23,480	0.0
				<u>31,082,134</u>	<u>0.2</u>
				<u>140,005,522</u>	<u>0.8</u>
INDUSTRIAL					
BASIC					
Anglo American Capital PLC	5.63%	04/01/2030	40,450	40,204,772	0.3
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	23,386	18,124,150	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	4,456	3,840,515	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	20,153	17,709,449	0.1
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	2,050	1,797,338	0.0
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	11,082	10,465,287	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	24,154	18,591,334	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	12,403	9,918,524	0.1
Freeport Indonesia PT	4.76%	04/14/2027	5,354	5,200,072	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	8,730,053	0.1
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	9,269	8,623,182	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	22,607	21,691,416	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	3,637,743	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	16,701	16,015,215	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	6,361	5,183,420	0.0
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	8,684	8,653,606	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	5,644	4,973,070	0.0
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	5,188	4,230,814	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	6,570	6,131,124	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	8.95%	03/11/2025	20,226	15,574,020	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	1,974	1,709,731	0.0
				<u>231,004,835</u>	<u>1.4</u>
CAPITAL GOODS					
Cemex SAB de CV	5.13%	06/08/2026	16,029	13,284,034	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	6,522	6,587,220	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	25,149,134	0.2
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	14,202	14,133,653	0.1
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	6,475	5,575,784	0.0
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	2,727	2,297,498	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	11,027,885	0.1
				<u>78,055,208</u>	<u>0.5</u>
COMMUNICATIONS - MEDIA					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	10,669	8,697,235	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	4,627,476	0.0
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	3,891	1,710,338	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	27,742,866	0.2
				<u>42,777,915</u>	<u>0.3</u>
COMMUNICATIONS - TELECOMMUNICATIONS					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	21,849	19,307,958	0.1
CT Trust	5.13%	02/03/2032	2,965	2,567,352	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	20,951	19,619,302	0.1
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	30,147	27,870,558	0.2
				<u>69,365,170</u>	<u>0.4</u>
CONSUMER CYCLICAL - RETAILERS					
Falabella SA	3.75%	10/30/2027	4,335	4,077,067	0.0
CONSUMER NON-CYCLICAL					
BRF SA	4.88%	01/24/2030	27,471	23,184,151	0.2
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdeco SL/					
Beliv Holdeco SL	5.25%	04/27/2029	2,894	2,666,097	0.0
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	10,259	8,566,265	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	8,466	6,673,854	0.0
Natura & Co., Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	15,717	13,819,172	0.1
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	9,714,375	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	3,907	2,769,819	0.0
				<u>67,393,733</u>	<u>0.4</u>
ENERGY					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,939	9,224,995	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	5,838	4,531,748	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	7,071	4,684,537	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	22,951,403	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	4,306	3,557,573	0.0
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	10,110	9,099,000	0.1
HPLC-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,476,400	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,854	1,756,650	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	18,656	17,779,168	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	10,837	9,969,654	0.1

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	USD 8,487	\$ 7,256,385	0.0%
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	11,304	9,551,880	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	16,108,217	0.1
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	11,120	9,785,600	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	5,998	4,381,179	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	21,853,877	0.1
				<u>154,968,266</u>	<u>0.9</u>
SERVICES					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,606,083	0.1
TECHNOLOGY					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	312,389	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	26,695	23,892,025	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	1,531,406	0.0
				<u>25,735,820</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTATION - RAILROADS					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	4,347	3,901,819	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	9,104	8,967,803	0.1
				<u>12,869,622</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTATION - SERVICES					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	21,821,095	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	3,094	2,558,932	0.0
				<u>24,380,027</u>	<u>0.1</u>
				<u>719,233,746</u>	<u>4.3</u>
SOVEREIGN BONDS					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	14,850,315	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	12,250,102	0.1
				<u>27,100,417</u>	<u>0.2</u>
BRAZIL					
Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	15,326	17,354,779	0.1
COLOMBIA					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	3,358,038	0.0
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	34,898,316	0.2
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,769	8,520,020	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	29,991	23,914,073	0.1
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	9,114	8,631,528	0.1
				<u>79,321,975</u>	<u>0.5</u>
DOMINICAN REPUBLIC					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	75,271	63,077,098	0.4
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	15,468,016	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,306	5,737,672	0.0
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	7,634,000	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,196,608	0.0
				<u>94,113,394</u>	<u>0.6</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	3,678	1,242,140	0.0
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	9,839	3,362,346	0.0
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	26,864	10,288,943	0.1
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	12,724	6,670,764	0.0
				<u>21,564,193</u>	<u>0.1</u>
EGYPT					
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	7,543,300	0.0
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	4,869,589	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	41,608	34,950,720	0.2
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	43,373,586	0.3
				<u>90,737,195</u>	<u>0.5</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	23,539	12,475,670	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	5,641,875	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	3,171,177	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	13,501	4,959,930	0.0
				<u>26,248,652</u>	<u>0.2</u>
GHANA					
Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027	21,220	9,177,650	0.1
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	14,024	6,135,500	0.0
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	10,289	3,704,040	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	503	360,903	0.0
				<u>19,378,093</u>	<u>0.1</u>

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
IVORY COAST					
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 18,113	\$ 15,229,637	0.1%
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	<u>36,918,060</u>	<u>0.2</u>
				<u>52,147,697</u>	<u>0.3</u>
KENYA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	15,341,115	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	11,890	<u>9,214,750</u>	<u>0.0</u>
				<u>24,555,865</u>	<u>0.1</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	5,632,156	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	8,592,165	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	7,783,875	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	5,591	<u>4,011,543</u>	<u>0.0</u>
				<u>26,019,739</u>	<u>0.2</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	12,053	7,474,186	0.0
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	589	362,300	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	19,018	<u>10,557,082</u>	<u>0.1</u>
				<u>18,393,568</u>	<u>0.1</u>
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	32,190	<u>31,612,592</u>	<u>0.2</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	34,626,283	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	22,447	<u>15,604,874</u>	<u>0.1</u>
				<u>50,231,157</u>	<u>0.3</u>
SOUTH AFRICA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	45,168	32,012,820	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	<u>11,142,232</u>	<u>0.1</u>
				<u>43,155,052</u>	<u>0.3</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	32,227	5,639,725	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	68,051	12,079,052	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	10,000	<u>2,100,000</u>	<u>0.0</u>
				<u>19,818,777</u>	<u>0.1</u>
				<u>641,753,145</u>	<u>3.9</u>
UTILITY ELECTRIC					
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	3.75%	01/14/2028	7,817	7,151,578	0.0
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	19,852	15,792,266	0.1
Empresa Electrica Cochranе SpA	5.50%	05/14/2027	5,785	5,409,380	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	11,919	10,326,324	0.1
Light Servicios de Eletricidade SA/Light Energia SA	4.38%	06/18/2026	9,592	8,319,861	0.0
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	10,259	9,540,870	0.1
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.00%	08/03/2026	15,853	14,870,114	0.1
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	12,300	11,385,187	0.1
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	9,482	9,096,054	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,725	11,344,054	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	24,989	20,456,620	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	13,448	10,220,480	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	3,102	2,501,763	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	<u>9,996,773</u>	<u>0.1</u>
				<u>146,411,324</u>	<u>0.9</u>
				<u>1,647,403,737</u>	<u>9.9</u>
AGENCIES					
AGENCY DEBENTURES					
Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	33,587,306	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	146,494,350	0.9
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	80,716,249	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	10,542,114	0.1
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	140,317,980	0.8
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	438,956,770	2.7
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	176,903,193	1.1
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	18,818,944	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	<u>23,919,503</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,070,256,409</u>	<u>6.5</u>
COLLATERALIZED MORTGAGE OBLIGATIONS					
RISK SHARE FLOATING RATE					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(d)	6.69%	04/25/2028	2,270	2,256,838	0.0

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Series 2018-3A, Class M1B(d)	4.29%	10/25/2028	USD 1,955	\$ 1,953,011	0.0%
Series 2019-1A, Class M2(d)	5.14%	03/25/2029	13,043	13,067,554	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(d)	4.44%	04/25/2029	51,941	51,819,828	0.3
Series 2019-2A, Class M2(d)	5.54%	04/25/2029	5,000	4,915,264	0.0
Series 2019-3A, Class M1C(d)	4.39%	07/25/2029	49,916	49,511,855	0.3
Series 2019-4A, Class M1B(d)	4.44%	10/25/2029	370	369,957	0.0
Series 2019-4A, Class M1C(d)	4.94%	10/25/2029	25,958	26,026,144	0.2
Series 2019-4A, Class M2(d)	5.29%	10/25/2029	40,849	39,258,683	0.2
Series 2020-3A, Class M2(d)	7.29%	10/25/2030	4,250	4,273,418	0.0
Eagle RE Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(d)	4.14%	11/25/2028	2,145	2,132,916	0.0
Series 2019-1, Class M1B(d)	4.24%	04/25/2029	1,278	1,273,750	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	5.74%	04/25/2029	5,236	5,181,756	0.0
Series 2020-1, Class M2(d)	4.44%	01/25/2030	15,704	14,738,719	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN4, Class M3(d)	6.99%	10/25/2024	6,022	6,190,450	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(d)	6.19%	09/25/2024	1,440	1,473,089	0.0
Series 2015-HQA1, Class M3(d)	7.14%	03/25/2028	11,289	11,631,327	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(d)	7.24%	05/25/2028	11,909	12,252,535	0.1
Series 2016-HQA3, Class M3(d)	6.29%	03/25/2029	1,960	1,996,949	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(d)	7.69%	10/25/2023	1,515	1,558,509	0.0
Series 2014-C01, Class M2(d)	6.84%	01/25/2024	1,198	1,221,681	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(d)	5.34%	07/25/2024	409	408,806	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(d)	7.34%	11/25/2024	7,749	8,105,002	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(d)	7.44%	11/25/2024	413	416,902	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(d)	7.99%	04/25/2028	21,170	21,858,106	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(d)	9.19%	08/25/2028	9,834	10,475,122	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(d)	9.39%	08/25/2028	6,535	6,780,363	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(d)	8.44%	09/25/2028	19,643	20,580,284	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(d)	7.74%	10/25/2028	11,684	11,861,083	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(d)	7.29%	10/25/2029	10,420	10,999,536	0.1
Home Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(d)	4.04%	10/25/2028	16	15,789	0.0
Series 2018-1, Class M2(d)	5.44%	10/25/2028	1,062	1,054,346	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	5.69%	05/25/2029	5,400	5,357,257	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(d)	3.99%	07/25/2028	380	380,181	0.0
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(d)	4.99%	07/25/2029	23,910	23,757,260	0.2
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(d)	7.69%	10/25/2030	4,014	4,081,858	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(d)	5.24%	05/27/2023	14,690	14,399,560	0.1
Series 2019-3R, Class A(d)	5.19%	10/27/2022	4,723	4,706,981	0.0
Radnor RE Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(d)	4.39%	02/25/2029	12,742	12,636,042	0.1
Series 2019-1, Class M2(d)	5.64%	02/25/2029	12,181	11,800,784	0.1
Series 2019-2, Class M1B(d)	4.19%	06/25/2029	8,572	8,559,226	0.1
Series 2020-1, Class M1B(d)	3.89%	01/25/2030	22,546	22,413,220	0.1
Series 2020-1, Class M1C(d)	4.19%	01/25/2030	8,262	7,892,564	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(d)	6.94%	10/25/2030	2,656	2,659,255	0.0
				<u>464,303,760</u>	<u>2.8</u>

AGENCY FLOATING RATE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3119, Class PI(d) (f)	4.81%	02/15/2036	3,655	605,073	0.0
Series 3898, Class NS(d) (f)	3.54%	07/15/2041	5,615	531,226	0.0
Series 3921, Class SB(d) (f)	4.17%	09/15/2041	11,997	1,677,333	0.0
Series 3928, Class SE(d) (f)	4.19%	09/15/2041	10,741	1,463,756	0.0
Series 4125, Class SA(d) (f)	3.76%	11/15/2042	7,043	870,888	0.0
Series 4248, Class SL(d) (f)	3.66%	05/15/2041	2,040	190,203	0.0
Series 4494, Class SL(d) (f)	3.83%	07/15/2045	31,713	4,061,604	0.1
Series 4495, Class SA(d) (f)	3.76%	07/15/2045	7,257	990,079	0.0
Series 4585, Class DS(d) (f)	3.61%	05/15/2046	15,893	2,015,696	0.0
Series 4656, Class SK(d) (f)	3.66%	02/15/2047	8,237	1,028,395	0.0
Series 4707, Class LS(d) (f)	3.76%	08/15/2047	9,649	1,216,492	0.0
Series 4719, Class SB(d) (f)	3.76%	09/15/2047	16,240	2,130,746	0.0
Series 4727, Class AS(d) (f)	3.81%	11/15/2047	13,562	1,827,762	0.0
Series 4754, Class QS(d) (f)	3.76%	02/15/2048	13,306	1,854,937	0.0
Series 4767, Class SB(d) (f)	3.81%	03/15/2048	5,461	691,869	0.0
Series 4824, Class KS(d) (f)	3.81%	09/15/2048	5,095	677,029	0.0
Series 4932, Class SM(d) (f)	3.61%	06/25/2049	24,912	2,843,631	0.0
Series 4954, Class SL(d) (f)	3.61%	02/25/2050	274	31,678	0.0
Series 4981, Class HS(d) (f)	3.66%	06/25/2050	73,041	8,520,815	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-58, Class IK(d) (f)	3.56%	07/25/2035	7,318	926,319	0.0
Series 2011-146, Class SA(d) (f)	3.56%	01/25/2042	8,544	1,048,526	0.0

	利率	滿期日	元本 (單位：千)	時價 (USD)	純資產 比率
Series 2012-122, Class LS(d) (f)	3.66%	11/25/2042	USD 7,635	\$ 986,178	0.0%
Series 2012-122, Class MS(d) (f)	3.66%	11/25/2042	8,197	1,131,204	0.0
Series 2012-17, Class SE(d) (f)	3.51%	03/25/2042	7,849	1,173,747	0.0
Series 2012-7, Class QS(d) (f)	3.56%	02/25/2042	10,932	1,341,858	0.0
Series 2012-70, Class HS(d) (f)	3.56%	07/25/2042	12,783	1,570,360	0.0
Series 2013-15, Class SA(d) (f)	3.71%	03/25/2043	6,746	871,637	0.0
Series 2013-4, Class ST(d) (f)	3.71%	02/25/2043	7,532	982,644	0.0
Series 2014-17, Class SB(d) (f)	3.61%	04/25/2044	8,455	1,104,944	0.0
Series 2014-28, Class SB(d) (f)	3.61%	05/25/2044	7,620	1,118,092	0.0
Series 2014-40, Class HS(d) (f)	4.26%	07/25/2044	5,194	914,730	0.0
Series 2014-78, Class SA(d) (f)	3.66%	12/25/2044	4,402	626,973	0.0
Series 2014-88, Class BS(d) (f)	3.71%	01/25/2045	7,258	917,082	0.0
Series 2015-26, Class SH(d) (f)	4.01%	05/25/2045	11,055	1,655,592	0.0
Series 2015-90, Class SL(d) (f)	3.71%	12/25/2045	9,355	1,176,629	0.0
Series 2016-29, Class SA(d) (f)	3.56%	05/25/2046	10,639	1,314,907	0.0
Series 2016-89, Class SH(d) (f)	3.56%	12/25/2046	5,749	712,824	0.0
Series 2017-105, Class SE(d) (f)	3.71%	01/25/2048	37,713	4,889,219	0.1
Series 2017-112, Class SA(d) (f)	3.71%	01/25/2048	10,350	1,343,109	0.0
Series 2017-20, Class SJ(d) (f)	3.66%	04/25/2047	22,594	2,938,896	0.0
Series 2017-26, Class TS(d) (f)	3.51%	04/25/2047	7,925	1,036,458	0.0
Series 2017-35, Class LS(d) (f)	3.71%	05/25/2047	24,730	3,231,051	0.1
Series 2017-38, Class DS(d) (f)	3.76%	05/25/2047	8,313	542,507	0.0
Series 2017-38, Class SE(d) (f)	3.66%	05/25/2047	17,156	2,201,204	0.0
Series 2018-28, Class PS(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,116	1,696,954	0.0
Series 2018-28, Class SB(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,625	1,807,948	0.0
Series 2018-30, Class SA(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,194	1,638,728	0.0
Series 2018-32, Class SB(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,706	1,816,422	0.0
Series 2018-45, Class SL(d) (f)	3.76%	06/25/2048	10,110	1,378,824	0.0
Series 2018-96, Class SA(d) (f)	3.61%	10/25/2035	5,361	482,771	0.0
Series 2019-13, Class SA(d) (f)	3.56%	04/25/2049	12,379	1,406,069	0.0
Series 2019-25, Class SA(d) (f)	3.61%	06/25/2049	30,083	3,774,363	0.1
Series 2019-31, Class SJ(d) (f)	3.66%	07/25/2049	6,377	777,182	0.0
Series 2019-37, Class US(d) (f)	3.61%	07/25/2049	10,122	1,135,354	0.0
Series 2019-48, Class SA(d) (f)	3.76%	12/25/2039	23,435	3,273,650	0.1
Series 2019-48, Class SM(d) (f)	3.61%	07/25/2039	8,365	1,178,097	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(d) (f)	3.23%	10/20/2044	12,811	1,696,893	0.0
Series 2017-103, Class SL(d) (f)	3.83%	07/20/2047	15,609	1,700,713	0.0
Series 2017-134, Class SE(d) (f)	3.83%	09/20/2047	6,856	780,522	0.0
Series 2017-52, Class SN(d) (f)	3.78%	04/20/2047	4,345	474,388	0.0
				<u>94,004,780</u>	<u>0.6</u>
AGENCY FIXED RATE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(g)	6.00%	10/15/2037	12,609	2,415,187	0.0
Series 4913, Class IO(g)	6.00%	04/15/2041	5,880	1,245,527	0.0
Series 4976, Class MI(g)	4.50%	05/25/2050	32,840	6,795,973	0.1
Series 4981, Class MI(g)	5.00%	06/25/2050	46,957	9,755,300	0.1
Series 5011, Class MI(g)	3.00%	09/25/2050	14,816	2,400,132	0.0
Series 5015, Class BI(g)	4.00%	09/25/2050	20,682	3,935,492	0.0
Series 5018, Class AI(g)	4.00%	10/25/2050	10,861	2,041,321	0.0
Series 5024, Class DI(g)	4.00%	10/25/2050	5,466	964,920	0.0
Series 5030, Class EI(g)	3.50%	10/25/2050	5,255	877,307	0.0
Series 5040, Class AI(g)	3.50%	11/25/2050	2,179	367,611	0.0
Series 5043, Class IO(g)	5.00%	11/25/2050	15,128	3,292,291	0.0
Series 5052, Class IK(g)	4.00%	12/25/2050	21,981	4,002,990	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2014-37, Class AI(g)	5.50%	07/25/2044	4,320	830,468	0.0
Series 2016-26, Class IO(g)	5.00%	05/25/2046	13,644	2,294,778	0.0
Series 2016-64, Class BI(g)	5.00%	09/25/2046	23,041	3,544,319	0.0
Series 2018-54, Class IO(g)	5.50%	08/25/2048	8,014	1,703,264	0.0
Series 2020-89, Class KI(g)	4.00%	12/25/2050	75,745	14,183,983	0.1
Series 2020-96, Class KI(g)	2.50%	01/25/2051	7,322	958,165	0.0
Series 2021-18, Class IT(g)	3.00%	04/25/2051	13,503	2,173,560	0.0
				<u>63,782,588</u>	<u>0.4</u>
				<u>622,091,128</u>	<u>3.8</u>
INVESTMENT COMPANIES					
FUNDS AND INVESTMENT TRUSTS					
AB FCP I - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			670,675	43,406,102	0.3
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			3,298,026	270,636,030	1.6
AB SICAV I - Global Income Portfolio			1,073,799	86,462,297	0.5
AB SICAV I - Short Duration Income Portfolio			897,588	83,906,504	0.5
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio			856,251	75,255,868	0.5
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,048,698	51,904,314	0.3
				<u>611,571,115</u>	<u>3.7</u>

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
MORTGAGE PASS-THROUGHS					
AGENCY FIXED RATE 30-YEAR					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	USD 4,131	\$ 3,987,943	0.0%
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	1,046	1,033,887	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	4,049	4,177,750	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	4,294	4,152,914	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	3,167	3,132,546	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	6,198	6,138,308	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2022	3.00%	09/01/2052	225,053	211,221,714	1.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022	4.50%	09/01/2052	102,045	101,414,832	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022	5.00%	09/01/2052	100,693	101,605,403	0.6
				<u>436,865,297</u>	<u>2.6</u>
COMMERCIAL MORTGAGE-BACKED SECURITIES					
NON-AGENCY FIXED RATE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	12,568	11,137,355	0.1
Bank of America Commercial Mortgage Trust, Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	2,340	2,243,008	0.0
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust, Series 2016-UB10, Class C	5.00%	07/15/2049	2,354	2,237,947	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(g)	1.18%	05/15/2052	218,523	10,675,288	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g)	1.17%	11/15/2050	6,992	238,601	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g)	1.12%	02/10/2050	97,993	3,274,270	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	390	370,562	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-B1, Class C	4.26%	08/15/2050	9,500	8,513,148	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.33%	04/10/2046	1,201	1,169,953	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(g)	1.26%	04/10/2046	7,517	30,690	0.0
Series 2013-GC17, Class C	5.25%	11/10/2046	3,895	3,790,474	0.0
Series 2013-GC17, Class D	5.25%	11/10/2046	5,540	5,078,908	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(g)	1.16%	04/10/2048	30,294	641,691	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g)	1.16%	11/15/2049	161,772	5,326,440	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g)	1.27%	04/14/2050	78,375	3,132,363	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,697,100	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.93%	10/15/2045	2,959	1,479,419	0.0
Series 2012-CR5, Class C	4.44%	12/10/2045	620	604,724	0.0
Series 2013-CR6, Class D	4.22%	03/10/2046	2,600	2,543,791	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	12,900	11,820,013	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,514,666	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	378,486	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g)	1.06%	10/10/2048	24,470	554,718	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g)	0.81%	07/10/2048	71,542	1,056,668	0.0
Series 2015-PC1, Class C	4.43%	07/10/2050	11,346	10,608,756	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(g)	1.10%	02/10/2049	1,469	36,794	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(g)	1.31%	09/10/2050	21,514	970,806	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	3,699	1,575,704	0.0
Series 2012-GC9, Class AS	3.12%	11/10/2045	10,000	9,976,744	0.1
Series 2013-GC13, Class D	4.21%	07/10/2046	17,538	7,637,799	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.84%	06/10/2047	993	950,684	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(g)	1.32%	10/10/2049	113,423	4,258,621	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g)	0.99%	03/10/2050	135,203	4,220,003	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g)	1.24%	08/10/2050	80,916	3,144,754	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	11,005,989	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	8,841,215	0.1
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.96%	09/15/2047	54,401	641,401	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,283,956	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.53%	11/15/2047	455	396,948	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.52%	01/15/2048	4,926	4,636,005	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(g)	1.04%	03/15/2050	130,372	3,871,403	0.0
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	5.11%	05/15/2045	5,000	3,875,000	0.0
Series 2012-LC9, Class B	3.81%	12/15/2047	2,000	1,986,246	0.0
Series 2012-LC9, Class E	4.49%	12/15/2047	10,881	9,796,743	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,513	2,474,576	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	11,127,228	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(g)	1.93%	08/15/2049	60,608	3,219,731	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g)	1.69%	07/12/2050	33,229	1,817,730	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	6,185,500	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	3,758,517	0.0

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C	5.25%	07/15/2049	USD 920	\$ 911,079	0.0%
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	6.66%	05/10/2045	1,525	1,387,875	0.0
Series 2017-C1, Class XA(g)	1.69%	06/15/2050	46,996	2,599,523	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g)	1.13%	08/15/2050	38,041	1,542,019	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g)	1.16%	10/15/2050	56,412	2,321,631	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g)	1.23%	12/15/2050	37,298	1,559,510	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g)	1.04%	05/15/2051	124,438	4,988,751	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g)	1.15%	12/15/2051	86,436	4,084,590	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class XA(g)	1.65%	12/10/2045	986	10	0.0
Series 2013-C5, Class C	4.20%	03/10/2046	1,798	1,636,522	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.44%	04/10/2046	8,381	7,159,669	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C28, Class B	4.22%	05/15/2048	2,802	2,674,263	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	6,937,833	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	4,966,309	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g)	1.37%	01/15/2059	109,982	3,641,561	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g)	1.75%	10/15/2049	80,505	4,050,174	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g)	0.98%	12/15/2059	123,136	3,406,293	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g)	1.12%	07/15/2050	33,894	1,239,581	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g)	1.12%	01/15/2052	11,918	541,473	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.99%	06/15/2044	8,030	6,279,174	0.1
Series 2012-C9, Class E	4.99%	11/15/2045	5,000	4,809,183	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,743,085	0.0
Series 2013-C14, Class B	3.84%	06/15/2046	360	349,069	0.0
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.94%	09/15/2057	39,341	467,402	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	6,624,373	0.1
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	7,899,495	0.1
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	853	823,192	0.0
				<u>287,452,775</u>	<u>1.7</u>
AGENCY CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	12,923	12,712,521	0.1
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	10,770,776	0.0
				<u>23,483,297</u>	<u>0.1</u>
NON-AGENCY FLOATING RATE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d)	6.64%	05/15/2036	9,789	9,083,571	0.1
				<u>9,083,571</u>	<u>0.1</u>
				<u>320,019,643</u>	<u>1.9</u>
QUASI-SOVEREIGNS					
QUASI-SOVEREIGN BONDS					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	25,539	25,985,933	0.2
INDONESIA					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	4,242,568	0.0
KAZAKHSTAN					
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/24/2025	1,395	1,355,591	0.0
MEXICO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	13,131	10,269,263	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	10,400	8,013,200	0.0
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	20,918	18,784,364	0.1
Comision Federal de Electricidad	6.13%	06/16/2045	5,200	4,373,850	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	71,699	53,648,777	0.3
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	9,171,872	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	48,445	30,418,615	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	18,641	11,604,023	0.1
				<u>146,283,964</u>	<u>0.9</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	9,964	8,100,732	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	8,472	6,797,721	0.0
				<u>14,898,453</u>	<u>0.1</u>
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	7,557	7,324,622	0.0
				<u>200,091,131</u>	<u>1.2</u>

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
EMERGING MARKETS - CORPORATE BONDS					
INDUSTRIAL					
CONSUMER CYCLICAL - OTHER					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	USD 12,622	\$ 8,141,190	0.1%
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	9,002	6,387,482	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	8,970	7,530,875	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	4,527	3,983,760	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	4,869	4,041,270	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	30,884	16,059,680	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	953	762,400	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	30,257	23,449,175	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	4,203	3,026,160	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	16,758	11,730,600	0.1
				<u>85,112,592</u>	<u>0.5</u>
CONSUMER NON-CYCLICAL					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4.75%	05/09/2027	25,018	21,918,895	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	05/09/2029	19,409	16,859,143	0.1
				<u>38,778,038</u>	<u>0.2</u>
ENERGY					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	16,779	16,677,277	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	5,318	5,218,952	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	12,964	12,614,067	0.1
				<u>34,510,296</u>	<u>0.2</u>
				<u>158,400,926</u>	<u>0.9</u>
FINANCIAL INSTITUTIONS					
INSURANCE					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b)	7.63%	10/15/2025	12,319	11,579,538	0.1
				<u>169,980,464</u>	<u>1.0</u>
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS					
CLO - FLOATING RATE					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(d)	6.41%	01/20/2034	4,250	4,002,875	0.0
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(d)	5.41%	04/15/2034	6,750	6,038,219	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(d)	5.66%	04/15/2034	4,750	4,312,368	0.0
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(d)	5.88%	01/25/2035	10,400	9,357,088	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(d)	5.36%	04/20/2034	6,000	5,464,872	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(d)	5.81%	10/20/2034	4,000	3,572,696	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(d)	6.31%	01/20/2034	8,330	7,777,571	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d)	4.52%	04/26/2031	11,000	10,452,420	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(d)	5.83%	07/23/2032	8,000	7,549,160	0.1
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d)	9.04%	07/18/2030	4,717	4,261,402	0.0
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-IRA, Class D(d)	5.56%	07/15/2030	1,500	1,375,452	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(d)	4.31%	04/22/2035	3,550	3,247,235	0.0
Goldentree Loan Opportunities Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(d)	3.81%	01/18/2031	600	592,435	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(d)	5.46%	10/20/2030	6,000	5,571,534	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class DR(d)	5.64%	10/16/2033	1,875	1,743,051	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(d)	6.31%	01/20/2032	1,000	961,844	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(d)	5.84%	07/17/2035	11,050	10,340,280	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(d)	6.06%	10/20/2034	11,950	10,722,078	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)	7.91%	01/20/2031	2,750	2,418,562	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(d)	4.73%	04/22/2034	8,650	7,971,079	0.1
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(d)	5.81%	07/20/2034	4,000	3,612,396	0.0
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(d)	6.71%	07/20/2030	17,169	15,569,726	0.1
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(d)	4.09%	04/21/2035	7,000	6,387,535	0.0
				<u>133,301,878</u>	<u>0.8</u>
ASSET-BACKED SECURITIES					
AUTOS - FIXED RATE					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	4,000	3,848,500	0.0
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A, Class E	5.38%	07/15/2025	13,125	13,158,300	0.1
First Investors Auto Owner Trust, Series 2018-1A, Class E	5.35%	07/15/2024	3,100	3,102,018	0.0
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-1, Class E	5.06%	06/15/2026	5,339	5,197,443	0.0
Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	5,677	5,516,793	0.1
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	5,230	5,009,874	0.0
				<u>35,832,928</u>	<u>0.2</u>

	利率	満期日	元本 (単位：千)	時価 (USD)	純資産 比率
OTHER ABS - FIXED RATE					
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-P2,					
Class C	5.21%	10/15/2025	USD 557	\$ 554,463	0.0%
Marlette Funding Trust					
Series 2018-3A, Class C(d)	4.63%	09/15/2028	1,835	1,829,245	0.0
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	2,569	2,564,881	0.0
				4,948,589	0.0
				40,781,517	0.2
EMERGING MARKETS - SOVEREIGNS					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	14,026,732	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	7,827,271	0.0
				21,854,003	0.1
				16,080,391,836	97.0
OTHER TRANSFERABLE SECURITIES					
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS					
CLO - FLOATING RATE					
AGL CLO 12 Ltd. Series 2021-12A, Class D (d)	5.56%	07/20/2034	6,000	5,330,244	0.0
AGL CLO 13 Ltd. Series 2021-13A, Class D (d)	5.86%	10/20/2034	27,834	25,111,025	0.2
AGL CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class D (d)	5.81%	01/20/2035	5,550	4,979,016	0.0
Apidos CLO XXIII Series 2015-23A, Class ER (d)	8.71%	04/15/2033	2,248	2,014,820	0.0
Ballyrock CLO Ltd. Series 2021-17A, Class C (d)	5.61%	07/20/2034	13,950	12,479,809	0.1
Ballyrock CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class C (d)	5.76%	10/20/2034	3,000	2,660,370	0.0
CBAM Ltd. Series 2018-7A, Class B1 (d)	4.31%	07/20/2031	7,726	7,408,315	0.0
ClFC Funding Ltd. Series 2017-3A, Class A1 (d)	3.93%	07/20/2030	560	553,325	0.0
Dryden CLO Ltd. Series 2018-57A, Class A (d)	3.92%	05/15/2031	25,195	24,736,753	0.2
Greywolf CLO VI Ltd. Series 2018-1A, Class A1 (d)	1.30%	04/26/2031	22,100	21,689,780	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. Series 2018-1A, Class A2 (d)	4.51%	07/21/2031	7,424	7,051,123	0.0
ICG US CLO Ltd. Series 2015-1A, Class CR (d)	5.84%	10/19/2028	2,500	2,353,972	0.0
Invesco CLO Ltd. Series 2021-1A, Class D (d)	5.56%	04/15/2034	8,000	7,208,848	0.0
Neub 2022-51a D Series 2022-51A, Class D (d)	8.27%	10/23/2035	9,161	9,046,240	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. Series 2019-33A, Class CR (d)	4.64%	10/16/2033	12,000	11,266,728	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd. Series 2021-42A, Class D (d)	5.54%	07/16/2035	4,000	3,657,708	0.0
Northwoods Capital XII-B Ltd. Series 2018-12BA, Class B (d)	3.68%	06/15/2031	5,400	5,137,884	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd. Series 2018-1A, Class B (d)	4.66%	07/20/2030	3,900	3,674,993	0.0
OZLM Ltd. Series 2014-7RA, Class BR (d)	4.94%	07/17/2029	9,000	8,606,898	0.1
OZLM VII Ltd. Series 2014-7RA, Class CR (d)	5.74%	07/17/2029	10,500	9,835,434	0.1
OZLM XVIII Ltd. Series 2018-18A, Class A (d)	3.53%	04/15/2031	9,625	9,439,488	0.1
OZLM XVIII Ltd. Series 2018-18A, Class B (d)	4.06%	04/15/2031	3,000	2,843,826	0.0
Peace Park CLO Ltd. Series 2017-3A, Class D (d)	5.66%	10/20/2034	27,675	25,699,974	0.2
PPM CLO 5 Ltd. Series 2021-5A, Class D (d)	5.79%	10/18/2034	16,000	14,050,928	0.1
Sound Point CLO XIX Ltd. Series 2018-1A, Class A (d)	3.51%	04/15/2031	34,104	33,414,826	0.2
Speak Series 2022-12A, Class D (d)	6.94%	07/18/2034	4,550	4,318,296	0.0
THL Credit Wind River CLO Ltd. Series 2017-4A, Class A (d)	4.13%	11/20/2030	6,898	6,805,625	0.0
TICP CLO IX Ltd. Series 2017-9A, Class B (d)	4.31%	01/20/2031	1,550	1,504,549	0.0
Venture XXIX CLO Ltd. Series 2017-29A, Class C (d)	5.41%	09/07/2030	2,300	2,160,655	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class A1R (d)	3.93%	10/18/2031	3,000	2,953,584	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class BR (d)	4.94%	10/18/2031	10,000	9,303,700	0.1
				287,298,736	1.7
COLLATERALIZED MORTGAGE OBLIGATIONS					
AGENCY FIXED RATE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4933, Class IO(g)	5.00%	03/15/2049	7,352	1,198,634	0.0
Series 4987, Class IC(g)	4.50%	06/25/2050	112,432	19,316,886	0.1
Series 4993, Class LI(g)	5.00%	07/25/2050	13,613	2,192,606	0.0
Series 5008, Class AI(g)	3.50%	09/25/2050	15,090	2,463,340	0.0
Series 5013, Class II(g)	4.00%	09/25/2050	25,465	3,868,299	0.0
Series 5018, Class GI(g)	4.50%	10/25/2050	17,390	3,186,621	0.0
Series 5036, Class IT(g)	4.00%	03/25/2050	7,015	1,273,666	0.0
Series 5049, Class CI(g)	3.50%	12/25/2050	24,506	4,376,195	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(g)	5.50%	09/25/2040	2,138	353,392	0.0
Series 2015-22, Class EI(g)	6.00%	04/25/2045	18,987	3,491,116	0.0
Series 2016-11, Class GI(g)	5.00%	03/25/2046	3,869	700,740	0.0
Series 2016-33, Class NI(g)	5.00%	07/25/2034	16,109	2,883,191	0.0
Series 2016-34, Class AI(g)	5.00%	06/25/2046	14,114	2,288,872	0.0
Series 2016-37, Class BI(g)	5.00%	06/25/2046	25,300	4,353,055	0.1
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g)	6.50%	05/20/2045	15,523	2,943,674	0.0

	利率	滿期日	元本 (單位：千)	時值 (USD)	純資產 比率
Series 2019-57, Class IO(g)	5.50%	05/20/2049	USD 4,848	\$ 870,150	0.0%
				<u>55,760,437</u>	<u>0.3</u>
AGENCY FLOATING RATE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3725, Class CS(d) (f)	3.61%	05/15/2040	20,946	1,700,089	0.0
Series 4292, Class S(d) (f)	3.66%	01/15/2044	2,563	335,860	0.0
Series 4317, Class SD(d) (f)	4.81%	08/15/2035	6,267	932,226	0.0
Series 4372, Class JS(d) (f)	3.71%	08/15/2044	15,279	1,793,371	0.0
Series 4373, Class SA(d) (f)	3.76%	08/15/2044	9,581	1,201,101	0.0
Series 4570, Class ST(d) (f)	3.61%	04/15/2046	8,428	1,064,013	0.0
Series 4593, Class SA(d) (f)	3.61%	06/15/2046	10,894	1,318,649	0.0
Series 4719, Class SA(d) (f)	3.76%	09/15/2047	8,431	1,165,657	0.0
Series 4735, Class SA(d) (f)	3.81%	12/15/2047	25,000	3,269,637	0.1
Series 4736, Class LS(d) (f)	3.81%	12/15/2047	11,189	1,610,517	0.0
Series 4736, Class SM(d) (f)	3.81%	12/15/2047	22,427	3,016,519	0.1
Series 4927, Class SJ(d) (f)	3.61%	11/25/2049	15,810	2,578,288	0.0
Series 4981, Class JS(d) (f)	3.66%	06/25/2050	112,645	16,398,209	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2006-8, Class JH(d) (f)	4.16%	03/25/2036	8,684	1,151,834	0.0
Series 2012-17, Class ES(d) (f)	4.11%	03/25/2041	1,276	58,696	0.0
Series 2013-62, Class SA(d) (f)	4.26%	06/25/2043	10,823	1,816,932	0.0
Series 2014-35, Class CS(d) (f)	3.71%	06/25/2044	11,848	1,115,792	0.0
Series 2015-57, Class AS(d) (f)	3.81%	08/25/2045	43,877	4,092,690	0.1
Series 2016-60, Class SA(d) (f)	3.66%	09/25/2046	25,392	2,379,335	0.0
Series 2016-65, Class AS(d) (f)	3.66%	09/25/2046	11,364	1,252,127	0.0
Series 2017-49, Class SP(d) (f)	3.71%	07/25/2047	7,240	937,940	0.0
Series 2017-81, Class CS(d) (f)	3.76%	10/25/2047	7,797	1,292,140	0.0
Series 2017-85, Class HS(d) (f)	3.76%	11/25/2047	12,950	1,639,100	0.0
Series 2017-109, Class SJ(d) (f)	3.76%	01/25/2048	3,204	447,952	0.0
Series 2018-13, Class SG(d) (f)	3.71%	03/25/2048	7,143	1,029,854	0.0
Series 2018-39, Class AS(d) (f)	3.76%	06/25/2048	6,469	1,090,114	0.0
Series 2018-47, Class SD(d) (f)	3.76%	07/25/2048	20,922	2,903,001	0.1
Series 2018-63, Class KS(d) (f)	3.76%	09/25/2048	5,655	767,323	0.0
Series 2019-38, Class SM(d) (f)	3.61%	07/25/2049	6,203	1,076,929	0.0
Series 2019-42, Class SQ(d) (f)	3.61%	08/25/2049	18,118	2,546,236	0.0
Series 2019-60, Class SJ(d) (f)	3.61%	10/25/2049	19,225	2,622,606	0.0
Series 2019-65, Class SY(d) (f)	3.61%	11/25/2049	12,987	1,933,340	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2017-115, Class SA(d) (f)	3.83%	07/20/2047	12,237	1,382,536	0.0
Series 2017-122, Class SA(d) (f)	3.83%	08/20/2047	15,250	1,842,514	0.0
Series 2017-149, Class SG(d) (f)	3.83%	10/20/2047	11,485	1,336,959	0.0
Series 2020-47, Class SG(d) (f)	3.63%	02/20/2049	14,600	1,430,648	0.0
				<u>72,530,734</u>	<u>0.5</u>
RISK SHARE FLOATING RATE					
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust, Series 2015-CH1,					
Class M2(d)	7.94%	10/25/2025	450	438,877	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(d)	4.84%	02/27/2023	12,343	12,195,504	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class IM2(d)	7.69%	11/25/2025	534	489,618	0.0
				<u>13,123,999</u>	<u>0.1</u>
				<u>141,415,170</u>	<u>0.9</u>
COMMERCIAL MORTGAGE-BACKED SECURITIES					
NON-AGENCY FIXED RATE CMBS					
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2016-P3,					
Class XA(g)	1.82%	04/15/2049	110,808	4,801,657	0.1
Commercial Mortgage Trust					
Series 2014-CR15, Class XA(g)	0.77%	02/10/2047	6,299	45,297	0.0
Series 2012-CR3, Class D	4.93%	10/15/2045	3,971	3,097,380	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-PIX(h)	4.49%	09/15/2048	105	5,073,287	0.1
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(h)	0.00%	10/03/2047	143	4,675,194	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(h)	4.00%	04/15/2050	207	5,428,207	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(h)	4.00%	11/15/2047	222	2,851,223	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(h)	3.40%	10/15/2057	125	4,318,514	0.0
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2013-GC10, Class XA(g)	1.60%	02/10/2046	27,641	46,960	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2013-GC13, Class E(h)	3.49%	07/10/2046	112	3,090,531	0.0
Series 2013-GC13, Class E(h)(i)	3.49%	07/10/2046	119	4,622,432	0.0
Series 2013-GC13, Class F(h)	3.49%	07/10/2046	50	899,883	0.0
Series 2013-GC13, Class F(h)(i)	3.49%	07/10/2046	30	1,678,736	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-LC20,					
Class XA(g)	1.43%	04/15/2050	31,905	752,450	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, Series 2012-C7, Class E	4.81%	06/15/2045	8,500	765,000	0.0
				<u>42,146,751</u>	<u>0.3</u>

	利率	満期日	株(口)数/元本 (単位: -/千)	時価 (USD)	純資産 比率
NON-AGENCY FLOATING RATE CMBS					
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(d) . . .	3.86%	11/15/2027	USD 36,183	\$ 24,785,449	0.1%
				<u>24,785,449</u>	<u>0.1</u>
				<u>66,932,200</u>	<u>0.4</u>
COMMON STOCKS					
Mt. Logan Re Ltd.(h)			10,878	<u>9,709,449</u>	<u>0.1</u>
CORPORATES - INVESTMENT GRADE					
FINANCIAL INSTITUTIONS					
BANKING					
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023	USD 7,651	<u>7,770,807</u>	<u>0.0</u>
EMERGING MARKETS - CORPORATE BONDS					
INDUSTRIAL					
CAPITAL GOODS					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	<u>124,916</u>	<u>0.0</u>
EMERGING MARKETS - HARD CURRENCY					
INDUSTRIAL					
CONSUMER NON-CYCLICAL					
Virgolino de Oliveira Finance SA (h) (j)	10.50%	01/28/2018	3,700	370	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA (h) (j)	11.75%	02/09/2022	31,238	3,124	0.0
Toton Luxembourg SA (b) (e) (h)	6.50%	10/31/2024	4,600	<u>460</u>	<u>0.0</u>
				<u>3,954</u>	<u>0.0</u>
UTILITY					
ELECTRIC					
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	5,495	3,794,984	0.0
Terraform Global Operating LLC	6.12%	03/01/2026	7,314	<u>7,011,720</u>	<u>0.1</u>
				<u>10,806,704</u>	<u>0.1</u>
				<u>10,810,658</u>	<u>0.1</u>
LOCAL GOVERNMENTS - US MUNICIPAL BONDS					
UNITED STATES					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	1,600	2,160,052	0.0
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	7,675	8,422,652	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	<u>14,174,052</u>	<u>0.1</u>
				<u>24,756,756</u>	<u>0.2</u>
QUASI-SOVEREIGNS					
QUASI-SOVEREIGN BONDS					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(e)	7.63%	11/08/2026	14,994	2,959,441	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	22,184	<u>3,865,562</u>	<u>0.0</u>
				<u>6,825,003</u>	<u>0.0</u>
				<u>555,643,695</u>	<u>3.4</u>
Total Investments				<u>\$ 16,636,035,531</u>	<u>100.4%</u>
Time Deposits					
(cost \$19,445,149,128)					
ANZ, London(k)	0.80 %	—	—	27,004	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(k)	1.37 %	—	—	5,294	0.0
BBH, Grand Cayman(k)	1.65 %	—	—	4,497	0.0
BBH, Grand Cayman(k)	4.15 %	—	—	210,113	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	(0.34)%	—	—	58	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	0.40 %	—	—	1,743,554	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	1.10 %	—	—	949	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(k)	1.68 %	—	—	272,306,421	1.6
HSBC Bank PLC, Paris(k)	(0.13)%	—	—	12,002,310	0.1
Sumitomo, London(k)	0.87 %	—	—	<u>33,960</u>	<u>0.0</u>
Total Time Deposits				<u>286,334,160</u>	<u>1.7</u>
Other assets less liabilities				<u>(355,653,606)</u>	<u>(2.1)</u>
Net Assets				<u>\$ 16,566,716,085</u>	<u>100.0%</u>

FUTURES

Description	Expiration Date	Number of Contracts	Original Value	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/20/2022	2,437	\$ 334,519,648	\$ 331,051,219	\$ (3,468,429)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	7,823	1,629,746,398	1,629,750,930	4,532
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	4,352	483,828,773	482,290,002	(1,538,771)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/20/2022	15,119	1,781,865,414	1,767,505,594	(14,359,820)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/20/2022	2,710	408,564,508	405,145,000	(3,419,508)

Description	Expiration Date	Number of Contracts	Original Value	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Future	12/20/2022	4,709	\$ 592,375,781	\$ 589,507,938	\$ 2,867,843
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	12/20/2022	68	7,998,844	7,949,625	49,219
					<u>\$ (19,864,934)</u>
				Appreciation	\$ 2,921,594
				Depreciation	\$ (22,786,528)

+ Used for share class hedging purposes.

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

Counterparty		Contracts to Deliver (000)	In Exchange For (000)	Settlement Date	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,720,853	USD 1,202,271	09/06/2022	\$ 24,713,524
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	320,765	USD 249,754	09/06/2022	5,522,090
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	11,370	USD 1,663	09/06/2022	13,090
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	239,468	USD 245,103	09/06/2022	4,387,210
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	1,384	USD 1,384	09/06/2022	(7,082)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	355,545	USD 432,003	09/06/2022	18,936,422
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	197,256	USD 42,820	09/06/2022	871,841
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	2,453	USD 515	09/06/2022	(7,001)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	621,561	USD 451,289	09/06/2022	6,504,060
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,590,970	AUD 2,286,051	09/06/2022	(26,655,317)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	332,976	CAD 428,933	09/06/2022	(6,385,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	139	CNH 960	09/06/2022	529
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	48,325	CNH 326,692	09/06/2022	(932,150)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	90,301	EUR 89,858	09/06/2022	25,496
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	240,262	EUR 234,651	09/06/2022	(4,387,913)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	573,981	GBP 475,542	09/06/2022	(21,504,406)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,838	PLN 65,563	09/06/2022	104,092
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	42,820	PLN 197,256	09/06/2022	(871,841)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	235	SGD 329	09/06/2022	22
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	599,491	SGD 827,767	09/06/2022	(7,145,469)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	124,968	ZAR 2,088,938	09/06/2022	(3,051,936)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	1,572,420	USD 94,676	09/06/2022	2,905,434
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	127,165	USD 99,123	09/12/2022	2,302,454
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	45,583	USD 48,337	09/12/2022	1,669,586
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	219,197	USD 225,506	09/12/2022	5,078,657
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	1,665	USD 1,667	09/12/2022	(7,089)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY	5,733,736	USD 43,079	09/12/2022	1,776,363
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	464,098	USD 295,375	09/12/2022	11,435,004
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	508,403	USD 370,230	09/12/2022	6,411,463
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	131,144	CAD 168,793	09/12/2022	(2,629,028)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	63,344	CHF 59,945	09/12/2022	(1,972,034)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	83,856	EUR 83,412	09/12/2022	24,692
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	220,663	EUR 214,380	09/12/2022	(5,079,318)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	56,991	JPY 7,633,842	09/12/2022	(2,000,881)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	395,075	NZD 625,641	09/12/2022	(12,302,337)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	235	SGD 329	09/12/2022	24
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	491,326	SGD 676,891	09/12/2022	(6,936,568)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	242,136	ZAR 4,008,163	09/12/2022	(8,333,599)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	3,010,726	USD 183,681	09/12/2022	8,060,677
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,428,565	USD 991,186	09/19/2022	13,424,780
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	216,793	USD 167,879	09/19/2022	2,830,061
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	9,734	USD 1,421	09/19/2022	8,435
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	234,246	USD 282,683	09/19/2022	10,470,729
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,475,248	AUD 2,132,323	09/19/2022	(15,809,043)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	252,409	CAD 326,676	09/19/2022	(3,702,803)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	139	CNH 960	09/19/2022	536
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	47,502	CNH 322,358	09/19/2022	(732,331)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	421,821	GBP 351,819	09/19/2022	(12,980,096)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	174	USD 175	10/03/2022	(9)
					<u>\$ (15,956,238)</u>
				Appreciation	\$ 127,477,271
				Depreciation	\$ (143,433,509)

+ Used for share class hedging purposes.

CENTRALLY CLEARED CREDIT DEFAULT SWAPS

Clearing Broker/(Exchange)	Referenced Obligation	Termination Date	Notional Amount ('000)	Market Value	Unrealized Appreciation/(Depreciation)
Sale Contracts					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 3,145	\$ (342,828)	\$ (296,894)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 38, 5 Year Index	06/20/2027	1,865,299	(22,860,428)	(80,231,766)
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,611	(284,548)	(246,422)
Total				<u>\$ (23,487,804)</u>	<u>\$ (80,775,082)</u>

CENTRALLY CLEARED INTEREST RATE SWAPS

Clearing Broker/(Exchange)	Notional Amount ('000)	Termination Date	Rate Type		Unrealized Appreciation/(Depreciation)
			Payments Made By the Fund	Payments Received By the Fund	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 453,010	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ 2,451,976
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	4,189,033
Total					<u>\$ 6,641,009</u>

CREDIT DEFAULT SWAPS

Counterparty	Referenced Obligation	Termination Date	Notional Amount ('000)	Market Value	Upfront Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)
Sale Contracts						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	\$ (1,617,400)	\$ (72,867)	\$ (1,544,533)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,329	(3,988,310)	(266,777)	(3,721,533)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	315	(34,283)	177	(34,460)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(107,535)	(578,122)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(116,384)	(569,273)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	12,581	(1,371,314)	(240,187)	(1,131,127)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,255	(525,978)	(227,340)	(298,638)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(446,944)	(605,336)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(456,278)	(596,002)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(458,435)	(593,845)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,601	(1,509,681)	(414,857)	(1,094,824)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(550,051)	(1,067,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(624,840)	(992,560)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(72,910)	(1,544,490)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(80,051)	(1,537,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(80,051)	(1,537,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(74,669)	(1,542,731)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,173	(2,587,840)	(1,139,026)	(1,448,814)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	188	(41,000)	(21,678)	(19,322)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	228	(49,615)	(13,200)	(36,415)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	268	(58,389)	(30,757)	(27,632)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	616	(134,007)	(76,243)	(57,764)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,417	(308,376)	(83,317)	(225,059)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,466	(319,065)	(138,269)	(180,796)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(210,168)	(587,494)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(1,034,940)	237,278
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(1,111,018)	313,356
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(298,528)	(499,134)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,399	(957,194)	(338,952)	(618,242)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,897	(1,065,517)	(1,213,726)	(148,209)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,103	(1,545,709)	(411,222)	(1,134,487)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(2,103,537)	(508,213)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(2,086,840)	(491,516)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(414,620)	(1,180,704)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(431,026)	(1,164,298)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(590,060)	(1,005,264)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(698,142)	(897,182)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(699,912)	(895,412)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(689,732)	(905,592)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(685,081)	(910,243)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,182	(1,997,984)	(2,106,779)	(108,795)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,182	(1,997,984)	(2,085,711)	(87,727)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(951,047)	(1,441,939)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(1,468,681)	(924,305)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(843,001)	(1,549,985)

Counterparty	Referenced Obligation	Termination Date	Notional Amount (000)	Market Value	Upfront Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 12,242	\$ (2,663,872)	\$ (2,780,837)	\$ 116,965
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,974	(2,823,205)	(747,793)	(2,075,412)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	13,246	(2,882,272)	(778,734)	(2,103,538)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,177	(3,084,878)	(1,151,980)	(1,932,898)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,329	(3,988,310)	(325,628)	(3,662,682)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	21,994	(4,785,972)	(1,704,512)	(3,081,460)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	1,558	(169,837)	(58,349)	(111,488)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,290	(249,579)	(88,695)	(160,884)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,809	(306,146)	(103,614)	(202,532)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,053	(332,749)	(116,594)	(216,155)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,117	(339,743)	(118,935)	(220,808)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,353	(692,513)	(62,998)	(629,515)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	7,792	(849,323)	(291,791)	(557,532)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,472	(1,455,660)	(309,215)	(1,146,445)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(697,309)	(1,548,091)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,331	(3,073,060)	(677,236)	(2,395,824)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(149,338)	(3,085,462)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,716	(373,306)	(20,571)	(352,735)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	1,573	(171,414)	884	(172,298)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(60,047)	(282,781)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(115,665)	(227,163)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,523	(1,057,456)	(465,818)	(591,638)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32,796	(13,747,898)	(5,956,008)	(7,791,890)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	233	(50,731)	(23,577)	(28,154)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,993	(651,211)	(289,809)	(361,402)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,049	(663,495)	(199,531)	(463,964)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,145	(684,394)	(208,988)	(475,406)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(482,642)	(315,020)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(465,589)	(332,073)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(952,442)	(642,882)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(529,725)	(1,065,599)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,178	(1,779,424)	(548,428)	(1,230,996)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,285	(1,802,716)	(831,282)	(971,434)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,100	(2,197,718)	(1,127,753)	(1,069,965)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,242	(3,099,076)	(963,866)	(2,135,210)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,663	(3,190,648)	(875,085)	(2,315,563)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(28,424)	(314,404)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(32,180)	(310,648)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(64,459)	(278,369)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,430	(482,840)	(167,580)	(315,260)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,210	(567,930)	(105,973)	(461,957)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(251,023)	(434,634)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,656)	(226,947)	(458,709)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	15,726	(1,714,142)	(538,437)	(1,175,705)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	289	(120,982)	(53,250)	(67,732)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,553	(650,842)	(284,661)	(366,181)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,505	(1,050,016)	(453,481)	(596,535)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,505	(1,050,016)	(455,294)	(594,722)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(553,469)	(1,063,931)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(556,848)	(1,060,552)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,402	(2,264,360)	(680,812)	(1,583,548)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,623	(4,033,795)	(1,727,601)	(2,306,194)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,015	(4,198,446)	(1,786,256)	(2,412,190)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,566	(558,363)	(261,108)	(297,255)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(300,919)	(496,743)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(326,852)	(470,810)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(345,673)	(451,989)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(374,360)	(423,302)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(373,910)	(423,752)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(458,772)	(338,890)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(522,868)	(274,794)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(390,148)	(407,514)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,730	(1,029,303)	(585,619)	(443,684)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,765	(1,036,961)	(487,252)	(549,709)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(709,653)	(885,671)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,037,123)	(558,201)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,061,382)	(533,942)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,043,310)	(552,014)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,045,735)	(549,589)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(844,034)	(751,290)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,436	(2,053,182)	(614,518)	(1,438,664)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(631,725)	(1,761,261)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	21,994	(4,785,972)	(1,790,380)	(2,995,592)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	205	(22,307)	(7,941)	(14,366)

Counterparty	Referenced Obligation	Termination Date	Notional Amount (000)	Market Value	Upfront Premiums Paid/(Received)	Unrealized Appreciation/(Depreciation)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	\$ (685,656)	\$ (116,384)	\$ (569,272)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,800	(754,678)	(208,701)	(545,977)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(67,521)	(1,549,879)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(70,980)	(1,546,420)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(63,681)	(1,553,719)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(142,108)	(3,092,692)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(145,592)	(3,089,208)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(482,642)	(315,020)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,787	(1,041,587)	(307,875)	(733,712)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,645	(1,228,399)	(692,396)	(536,003)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(106,356)	(1,488,968)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(74,047)	(1,521,277)
Total				<u>\$ (195,180,866)</u>	<u>\$ (73,573,972)</u>	<u>\$ (121,606,894)</u>
					Appreciation	\$ 2,012,059
					Depreciation	\$ (123,618,953)

INFLATION (CPI) SWAPS

Counterparty	Notional Amount (000)	Termination Date	Rate Type		Unrealized Appreciation/(Depreciation)
			Payments Made By the Fund	Payments Received By the Fund	
Deutsche Bank AG	USD 65,000	01/15/2026	1.578%	CPI#	<u>\$ 12,111,695</u>
Total for Swaps					<u>\$ (183,629,272)</u>

Variable interest rate based on the rate of inflation as determined by the Consumer Price Index (CPI).

- (a) Position, or a portion thereof, has been segregated to collateralize OTC derivatives outstanding.
- (b) Pay-In-Kind Payments (PIK).
- (c) Securities are perpetual and, thus, do not have a predetermined maturity date. The date shown, if applicable, reflects the next call date.
- (d) Floating Rate Security. Stated interest rate was in effect at August 31, 2022.
- (e) Defaulted.
- (f) Inverse interest only security.
- (g) IO - Interest Only.
- (h) Fair valued as determined in accordance with procedures established by and under the general supervision of the Management Company's Board of Managers.
- (i) Variable rate coupon, rate shown as of August 31, 2022.
- (j) Defaulted matured security.
- (k) Overnight deposit.

Currency Abbreviations:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
JPY – Japanese Yen
NZD – New Zealand Dollar
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossary:

ABS – Asset-Backed Securities
CBT – Chicago Board of Trade

CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
CLO – Collateralized Loan Obligations
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
CME – Chicago Mercantile Exchange
CPI – Consumer Price Index
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
JSC – Joint Stock Company
LIBOR – London Interbank Offered Rate
REIT – Real Estate Investment Trust
REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

マネープールマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2022年11月21日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2010年2月26日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等にも投資します。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	期騰	落中率			
第9期(2018年11月20日)	円 10,032	% △0.1	% —	% —	百万円 577,044
第10期(2019年11月20日)	10,024	△0.1	—	—	544,455
第11期(2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	486,701
第12期(2021年11月22日)	10,015	△0.0	—	—	358,814
第13期(2022年11月21日)	10,011	△0.0	—	—	371,933

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比
	騰	落率		
(当期首) 2021年11月22日	円 10,015	% —	% —	% —
11月末	10,015	0.0	—	—
12月末	10,015	0.0	—	—
2022年 1月末	10,014	△0.0	—	—
2月末	10,014	△0.0	—	—
3月末	10,014	△0.0	—	—
4月末	10,014	△0.0	—	—
5月末	10,014	△0.0	—	—
6月末	10,013	△0.0	—	—
7月末	10,013	△0.0	—	—
8月末	10,013	△0.0	—	—
9月末	10,012	△0.0	—	—
10月末	10,012	△0.0	—	—
(当期末) 2022年11月21日	10,011	△0.0	—	—

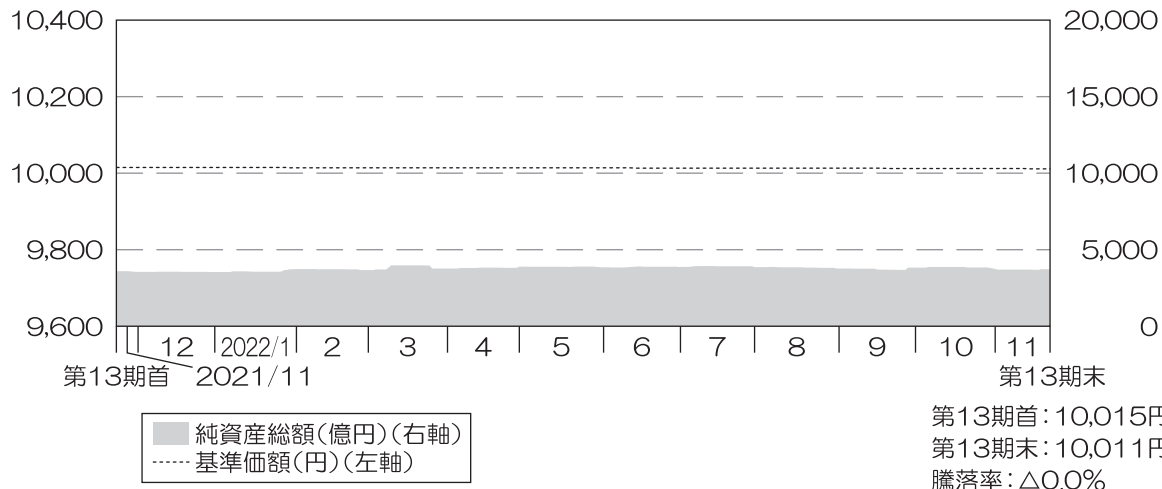
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

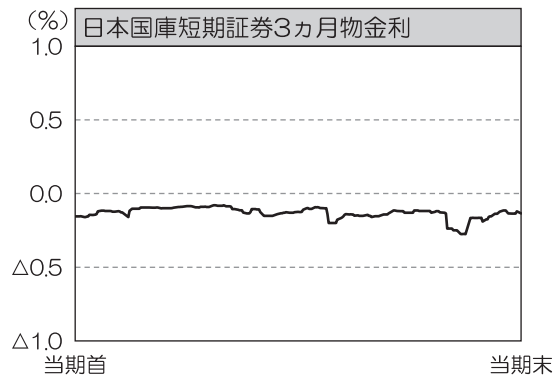
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09\sim 0\%$ 近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

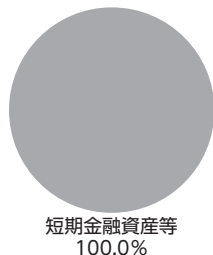
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

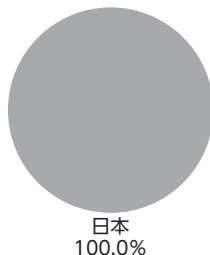
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

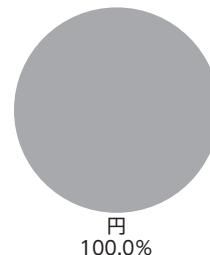
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主としてわが国の公社債を投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。ポートフォリオにつきましては、金利動向やマーケット環境を踏まえながら、債券組入比率の向上を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月23日～2022年11月21日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(－)	(－)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,013円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コール・ローン	91,846,878	6,401,770	7.0	91,833,999	6,401,770	7.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 371,934,952	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	371,934,952	100.0

※ 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。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2022年11月21日現在
(A) 資産	371,934,952,946円
コール・ローン等	371,934,952,946
(B) 負債	1,497,555
未払解約金	544,709
未払利息	952,764
その他未払費用	82
(C) 純資産総額(A-B)	371,933,455,391
元本	371,514,353,891
次期繰越損益金	419,101,500
(D) 受益権総口数	371,514,353,891口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,011円

■損益の状況

項目	当期 自2021年11月23日 至2022年11月21日
(A) 配当等収益	△150,256,731円
受取利息	1,724,564
支払利息	△151,981,295
(B) その他費用	△82
(C) 当期損益金(A+B)	△150,256,813
(D) 前期繰越損益金	549,315,622
(E) 追加信託差損益金	155,678,449
(F) 解約差損益金	△135,635,758
(G) 計(C+D+E+F)	419,101,500
次期繰越損益金(G)	419,101,500

(注1) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は358,265,002,227円、期中追加設定元本額は114,656,558,826円、期中一部解約元本額は101,407,207,162円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	103,275,806,469円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	97,023,993,837円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	40,913,946,872円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	30,921,835,681円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	23,295,546,510円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	21,404,228,793円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	15,577,844,099円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	4,267,283,000円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	4,138,099,571円
北米株配当戦略投信2018-11 (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	3,905,313,624円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
225ベアファンド9 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	3,382,622,913円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,616,273,059円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,331,276,690円
私募マネーボールファンドAL (適格機関投資家専用)	1,057,375,332円
米国株価指数レバレッジ戦略ファンド (米国国債リスクコントロール型) (適格機関投資家専用)	99,396,417円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	299,461円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円

債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9,979円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
GARSファンド	9,961円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (ブラジル・レアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (メキシコ・ペソコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (米ドルコース)	9,960円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
債券コア・セレクション	9,956円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
NWフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985円
バンクローン・オープン (ユーロコース) (SMA専用)	1,993円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (毎月決算型)	1,991円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (豪ドルコース)	988円

お知らせ

該当事項はありません。