

運用報告書 (全体版)

第10期<決算日2023年6月12日>

バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)

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/その他資産 (バンクローン) | |
| 信託期間 | 2013年9月30日から2028年6月9日まで。 | |
| 運用方針 | 投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型) | 投資信託証券。 |
| | イートン・パンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオークラス I 3 \$ シェアーズ | 米ドル建ての企業向けバンクローン (貸付債権)。 |
| | DIAMマネーマザーファンド | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産。 |
| 運用方法 | 以下の投資信託証券を通じて、主として米ドル建ての企業向けバンクローン (貸付債権) に実質的な投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 ケイマン諸島籍外国投資法人 イートン・パンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオークラス I 3 \$ シェアーズ (以下、「バンクローン・ポートフォリオ」といいます。) 米ドル建投資証券 内国証券投資信託 (親投資信託) DIAMマネーマザーファンド受益証券 各投資信託証券への投資割合は、資産動向や市況動向などを勘案して決定するものとし、バンクローン・ポートフォリオの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。 外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。 | |
| 組入制限 | バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型) | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 |
| | DIAMマネーマザーファンド | 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。外貨建て資産への投資は行いません。 |
| 分配方針 | 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売差益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。 | |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)」は、2023年6月12日に第10期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

バンクローン・ファンド（ヘッジなし／年1回決算型）

■最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | | Morningstar®LSTA®米国 レバレッジド・ローン指数 SM | | 投資証券 組入比率 | 債券組入 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|------------|--------------|---|-------------------|--------------|-----------|---------|
| | (分配落) | 税 込 分 配 | み 金 期 騰 落 | 中 率 期 騰 落 | (円 換 算) (参考指数) | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 6期 (2019年6月10日) | 12,510 | 0 | 0.7 | 196.86 | 2.9 | 97.0 | 0.2 | 366 |
| 7期 (2020年6月10日) | 12,115 | 0 | △3.2 | 194.15 | △1.4 | 96.8 | 0.3 | 268 |
| 8期 (2021年6月10日) | 13,120 | 0 | 8.3 | 217.46 | 12.0 | 96.5 | — | 218 |
| 9期 (2022年6月10日) | 15,811 | 0 | 20.5 | 267.05 | 22.8 | 96.5 | 0.3 | 324 |
| 10期 (2023年6月12日) | 16,992 | 0 | 7.5 | 295.13 | 10.5 | 97.1 | 0.3 | 215 |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 「投資証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注3) Morningstar®LSTA®米国レバレッジド・ローン指数SM (円換算) は、Morningstar®LSTA®米国レバレッジド・ローン指数SMをアセットマネジメントOneが円換算し、指数化したものです (以下同じ)。

(注4) Morningstar®LSTA®米国レバレッジド・ローン指数SMは、Morningstar, Inc. (以下「Morningstar」と言います。) の製品であり、これを使用する許諾がアセットマネジメントOne株式会社 (以下、「アセットマネジメントOne」) に付与されています。Morningstar®はMorningstarの登録商標であり、アセットマネジメントOneに特定の使用が許諾されています。Loan Syndications and Trading Association®およびLSTA®は、LSTAの商標であり、Morningstarに特定の使用が許諾されており、さらにMorningstarによってアセットマネジメントOneに特定の使用が再許諾されています。当ファンドは、Morningstarおよび／またはそれぞれの関連会社 (以下、「Morningstarグループ」と言います) またはLSTAが組成、推薦、販売または販売促進するものではありません。MorningstarグループまたはLSTAは、当ファンドに投資することの可否についていかなる表明も行わず、また、Morningstar®LSTA®米国レバレッジド・ローン指数SMの誤謬、脱漏、または中断に対して一切の責任を負いません (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | Morningstar®LSTA®米国 レバレッジド・ローン指数 SM | | 投資証券 組入比率 | 債券組入 率 |
|-----------------------|-------------|-------------------|---|--------|--------------|-----------|
| | 騰 落 率 | (円 換 算) (参考指数) | 騰 落 率 | (参考指数) | | |
| (期 首) 2022年 6月 10日 | 円 15,811 | % - | 267.05 | % - | % 96.5 | % 0.3 |
| 6 月 末 | 15,712 | △0.6 | 265.55 | △0.6 | 94.3 | 0.3 |
| 7 月 末 | 15,638 | △1.1 | 265.31 | △0.7 | 96.7 | 0.3 |
| 8 月 末 | 16,317 | 3.2 | 277.83 | 4.0 | 96.7 | 0.3 |
| 9 月 末 | 16,643 | 5.3 | 283.84 | 6.3 | 95.2 | 0.2 |
| 10 月 末 | 17,124 | 8.3 | 293.00 | 9.7 | 96.4 | 0.2 |
| 11 月 末 | 16,256 | 2.8 | 278.13 | 4.1 | 97.7 | 0.3 |
| 12 月 末 | 15,574 | △1.5 | 266.80 | △0.1 | 96.2 | 0.3 |
| 2023年 1 月 末 | 15,668 | △0.9 | 269.55 | 0.9 | 96.5 | 0.4 |
| 2 月 末 | 16,463 | 4.1 | 283.36 | 6.1 | 96.3 | 0.4 |
| 3 月 末 | 16,053 | 1.5 | 277.09 | 3.8 | 96.7 | 0.4 |
| 4 月 末 | 16,262 | 2.9 | 281.51 | 5.4 | 96.3 | 0.4 |
| 5 月 末 | 16,887 | 6.8 | 292.98 | 9.7 | 95.9 | 0.3 |
| (期 末) 2023年 6月 12日 | 16,992 | 7.5 | 295.13 | 10.5 | 97.1 | 0.3 |

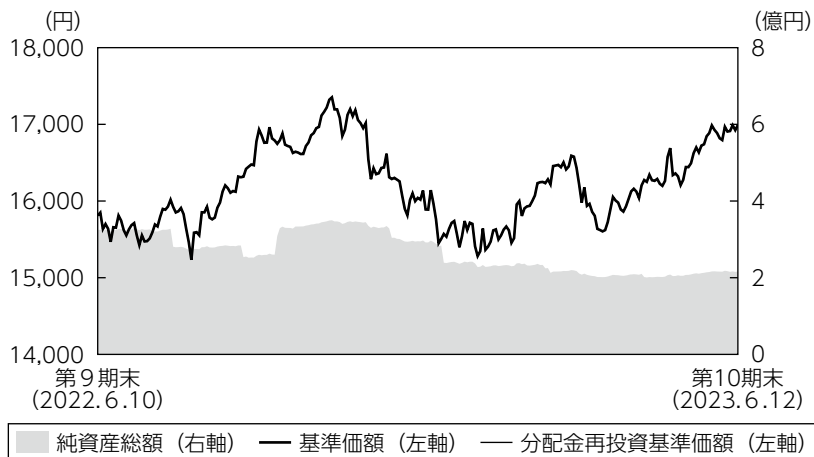
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 「投資証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■当期の運用経過（2022年6月11日から2023年6月12日まで）

基準価額等の推移



第10期首： 15,811円
第10期末： 16,992円
(既払分配金0円)
騰落率： 7.5%
(分配金再投資ベース)

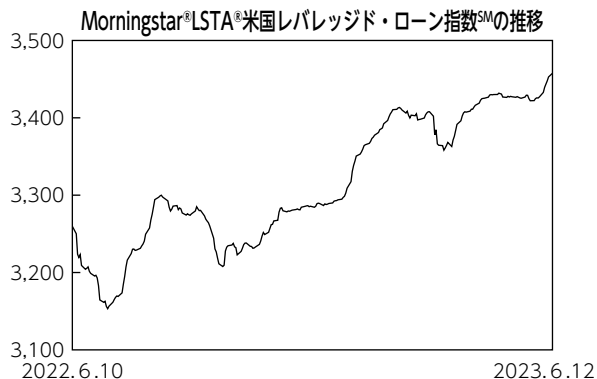
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

イートン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラスI 3 \$ シェアーズ（以下、バンクローン・ポートフォリオ）米ドル建て投資証券を通じて、主として米国企業向けバンクローンに実質的な投資を行い、高水準のインカムゲインの確保を目指して運用を行いました。このような運用を行った結果、バンクローン市場の上昇と円安米ドル高を受けて当作成期間における基準価額は上昇しました。

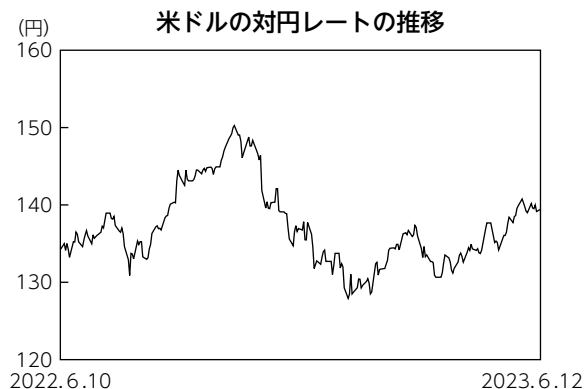
投資環境

バンクローン市場は上昇しました。インフレが高止まりする中、利上げによる景気後退懸念の高まりを受け、6月および9月に下落する局面がありました。いずれも、その後、利上げペースの減速期待、米企業業績への過度な懸念の後退等を背景に上昇に転じました。3月に米銀破綻、5月に債務上限問題の影響から、一時的に軟調な動きとなりましたが、金融システムへの過度な不安の後退、堅調なマクロ経済指標、リスク選好の回復などを背景に上昇しました。



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

米ドルは対円で上昇しました。作成期初から10月にかけて、F R B（米連邦準備理事会）が積極的に利上げを行う一方で、日銀が金融緩和姿勢の継続を示したことから、日米の金利差拡大が意識され、急速に米ドル高円安が進みました。その後、F R Bの利上げペース減速期待や日銀による金融緩和の一部修正等を受け、1月にかけて、米ドル安円高が進みました。2月以降、F R Bが利上げを継続する中、米国の堅調なマクロ指標や企業業績を背景に再び米ドル高円安が進みました。



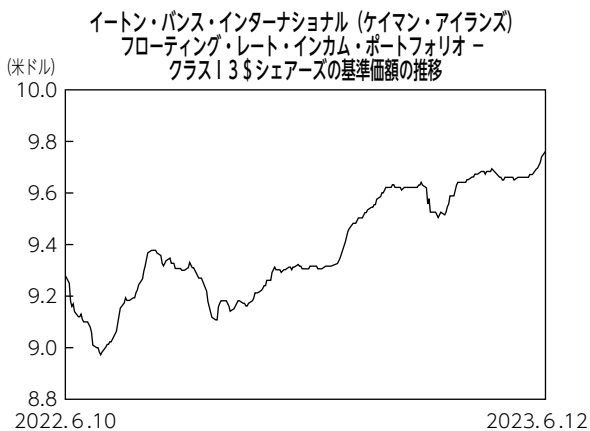
ポートフォリオについて

●当ファンド

バンクローン・ポートフォリオと国内投資信託「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券を投資対象とするファンド・オブ・ファンズの形式で運用を行いました。バンクローン・ポートフォリオの高位組み入れを継続しました。また、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

●バンクローン・ポートフォリオ

ボトムアップリサーチによる銘柄選択を行い、相対的に格付けの高いB B格、B格のローン組入比率を高位として、安定性を重視した運用を行いました。このようなポートフォリオを構築することで、バンクローン市場における流動性の低下や信用リスクが高まる局面においても、運用への影響を軽減できるものと考えました。



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

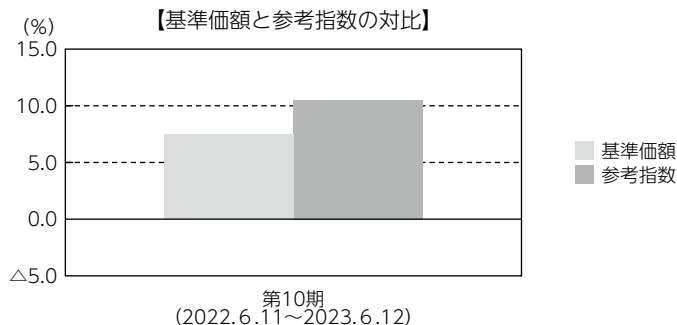
●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは基準価額と参考となるMorningstar[®]LSTA[®]米国レバレッジド・ローン指数SM（円換算）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2022年6月11日 ～2023年6月12日 |
| 当期分配金（税引前） | －円 |
| 対基準価額比率 | －% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,991円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、バンクローン・ポートフォリオおよびD I A Mマネーマザーファンドへの投資を継続し、高水準のインカムゲインの確保を目指して運用を行います。

●バンクローン・ポートフォリオ

米国では、インフレ率の鈍化が見られる一方で、金融システム問題に起因する信用環境の引き締めやリセッション（景気後退）リスクが懸念されています。バンクローン市場においては、利回り水準が上昇し、過去類を見ない信用収縮を織り込んだ価格水準となっていることから、比較的底堅い動きを想定しています。中長期的な視点に立ち、ボトムアップリサーチを前提に、リスクリターンを考慮した銘柄選択によるポートフォリオの最適化を目指す方針です。

●D I A Mマネーマザーファンド

4月に発足した日銀の新体制において、植田新総裁は金融緩和を堅持する姿勢を示しました。当面は、消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、緩和的な金融政策を維持するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第10期 | | 項目の概要 |
|-----------|-----------------------------|---------|--|
| | (2022年6月11日 ～2023年6月12日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 193円 | 1.194% | (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16,189円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (63) | (0.387) | |
| (販売会社) | (125) | (0.774) | |
| (受託会社) | (5) | (0.033) | |
| (b) その他費用 | 1 | 0.005 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (監査費用) | (0) | (0.003) | |
| (その他) | (0) | (0.002) | |
| 合計 | 194 | 1.200 | |

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

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

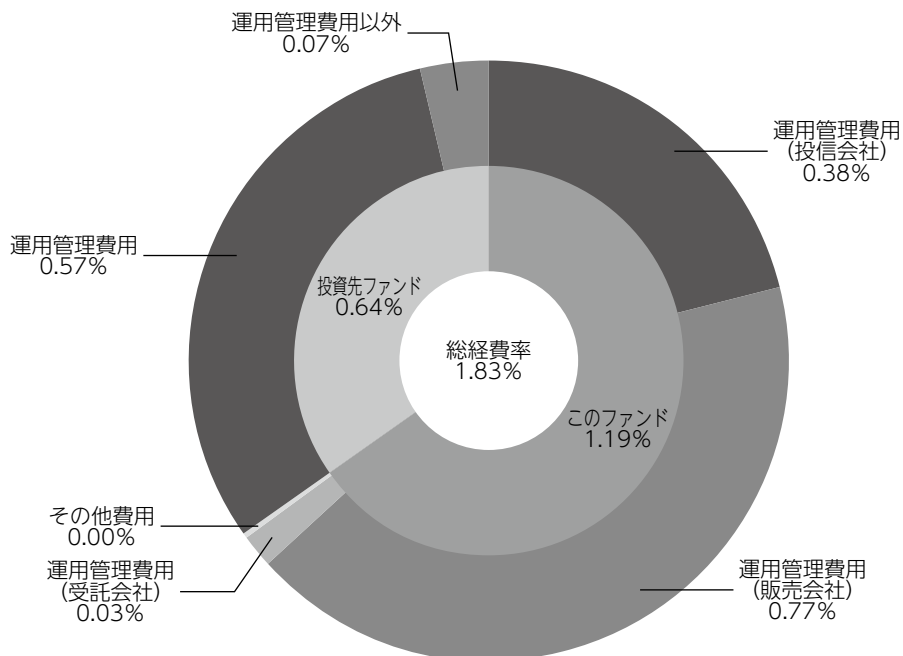
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.83%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.83% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.19% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.57% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.07% |

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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■**売買及び取引の状況**（2022年6月11日から2023年6月12日まで）
投資証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--|----------|----------|------------|----------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外 国 | イートン・パンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・ レート・インカム・ポート フォリオ - クラスI 3\$ シェアーズ | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル |
| | | 76.82573 | 701 | 162.755003 | 1,486 |

(注) 金額は受渡代金です。

■**親投資信託受益証券の設定、解約状況**（2022年6月11日から2023年6月12日まで）
期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■**利害関係人との取引状況等**（2022年6月11日から2023年6月12日まで）
【**バンクローン・ファンド（ヘッジなし／年1回決算型）における利害関係人との取引状況等**】
期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 期 | | | 期 | | |
|---------|----------------|--------------------|------------|----------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.00097 | 百万円 0.00097 | % 100.0 | 百万円 0.00097 | 百万円 0.00097 | % 100.0 |

【**DIAMマネーマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等**】
期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 期 | | | 期 | | |
|---------|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 901 | 百万円 200 | % 22.2 | 百万円 600 | 百万円 - | % - |
| 金 銭 信 託 | 0.028051 | 0.028051 | 100.0 | 0.028051 | 0.028051 | 100.0 |

平均保有割合 0.1%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 比 率 |
|--|------------|-----------|----------|---------|------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| イートン・パンス・インターナショナル (ケイマン・アイランド) フローティング・レート・インカム・ ポートフォリオ - クラス I 3 \$ シェアーズ | 251.211543 | 165.28227 | 1,504 | 209,712 | 97.1 |
| 合 計 | 251.211543 | 165.28227 | 1,504 | 209,712 | 97.1 |

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

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

(2) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------------|-----------|-------|-------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド | 1,088 | 1,088 | 1,095 |

■投資信託財産の構成

2023年6月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 209,712 | % 95.0 |
| D I A M マネーマザーファンド | 1,095 | 0.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 9,961 | 4.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 220,768 | 100.0 |

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、209,712千円、95.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年6月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=139.43円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月12日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 220,768,997円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 9,961,674 |
| 投 資 証 券(評価額) | 209,712,291 |
| D I A M マネーマザーファンド(評価額) | 1,095,032 |
| (B) 負 債 | 4,801,774 |
| 未 払 解 約 金 | 3,458,297 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,340,251 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 3,226 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 215,967,223 |
| 元 本 | 127,100,563 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 88,866,660 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 127,100,563口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 16,992円 |

(注) 期首における元本額は205,121,137円、当期中における追加設定元本額は72,893,587円、同解約元本額は150,914,161円です。

■損益の状況

当期 自2022年6月11日 至2023年6月12日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 13,462,211円 |
| 受 取 配 当 金 | 13,467,198 |
| 受 取 利 息 | 105 |
| 支 払 利 息 | △5,092 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,226,053 |
| 売 買 損 益 | 6,239,985 |
| 売 買 損 益 | △5,013,932 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △3,200,625 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 11,487,639 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 24,041,035 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 53,337,986 |
| (配 当 等 相 当 額) | (49,436,657) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (3,901,329) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 88,866,660 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 88,866,660 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 53,337,986 |
| (配 当 等 相 当 額) | (49,436,657) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (3,901,329) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 35,528,674 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 10,528,903円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 958,736 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 53,337,986 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 24,041,035 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 88,866,660 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 6,991.84 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 たり 分 配 金 | 0 |

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■参考指数の名称が、以下のとおり変更になりました。

変更前：S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックス（円換算）

変更後：Morningstar®LSTA®米国レバレッジド・ローン指数SM（円換算）

（2022年8月29日）

イートン・バンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ - クラス I 3 \$ シェアーズ

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|--|
| 形 態 | ケイマン諸島籍外国投資法人／米ドル建て投資証券 |
| 運 用 方 針 | 主として米ドル建ての企業向けバンクローン（貸付債権）に投資することで、高いインカムゲインの確保を目指して運用を行います。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 主として、優先担保付のバンクローンに投資しますが、劣後担保付や無担保のバンクローンに投資する場合があります。 ・ 総資産の80%以上を変動金利のバンクローンもしくは債券に投資します。 ・ 総資産の25%を上限に米国以外のバンクローンに投資する場合がありますが、原則として、それらは米ドル建てのものとしします。 ・ 流動性の低い有価証券への投資は15%を上限とします。 ・ 解約への対応時やその他の一時的な対応を除き、総資産の5%以上の借り入れは行いません。 |
| 決 算 日 | 10月末 |
| 関 係 法 人 | 投資顧問会社兼管理事務代行会社：イートン・バンス・マネジメント 保管会社（純資産価格の算出業務を含む）：ステート・ストリート・バンク・アンド・トラ スト・カンパニー 登録機関兼名義書換代理人：シティバンク・ヨーロッパ・ピーエルシー |
| 信 託 報 酬 等 | 純資産総額に対し年率0.59%程度 上記料率には、投資顧問会社、保管会社、登録機関兼名義書換代理人などの費用が含まれま ず。ただし、投資対象ファンド全体またはクラスごとに発生する最低支払額、固定費、取引 頻度に応じた費用などは含んでいないため、資産規模、取引頻度などの影響により上記料率 を上回る場合があります。 |

「イトン・バンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオークラス I 3 \$ シェアーズ」は、「イトン・バンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」を構成する個別クラスとなっております。

「イトン・バンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

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

イトン・バンス・インターナショナル (ケイマン・アイランズ) フローティング・レート・インカム・ポートフォリオの内容

(1) 投資有価証券明細表

2022年10月31日現在 (米ドル表示)

普通株式-0.8%

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|---|--------|-------------|
| 航空および軍需-0.0%(1) | | |
| IAP Global Services, LLC(2)(3)(4) | 24 | 100,494 |
| | | 100,494 |
| 容器およびガラス製品-0.2% | | |
| LG Newco Holdco, Inc., Class A(3)(4) | 49,671 | 637,443 |
| | | 637,443 |
| 電子機器/電器-0.0%(1) | | |
| Skillsoft Corp.(3)(4) | 41,237 | 73,814 |
| | | 73,814 |
| ヘルスケア-0.0%(1) | | |
| Akorn Holding Company, LLC, Class A(3)(4) | 27,997 | 167,982 |
| | | 167,982 |
| 投資会社-0.1% | | |
| Aegletes B.V.(3)(4) | 6,697 | 247,789 |
| | | 247,789 |
| 非鉄金属/鉱物-0.1% | | |
| ACNR Holdings, Inc., Class A(3)(4) | 1,930 | 198,790 |
| | | 198,790 |
| 石油およびガス-0.2% | | |
| AFG Holdings, Inc.(2)(3)(4) | 25,000 | 74,250 |
| McDermott International, Ltd.(3)(4) | 58,491 | 31,293 |
| QuarterNorth Energy, Inc.(4) | 3,665 | 448,962 |
| | | 554,505 |

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|--|--------|-------------|
| ラジオおよびテレビ-0.1% | | |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.(3)(4) | 37,554 | 53,702 |
| Cumulus Media, Inc., Class A(3)(4) | 37,138 | 273,707 |
| iHeartMedia, Inc., Class A(3)(4) | 15,942 | 132,000 |
| iHeartMedia, Inc., Class B(3)(4) | 28 | 232 |
| | | 459,641 |
| 小売（食料およびドラッグを除く）-0.0%(1) | | |
| David' s Bridal, LLC(2)(3)(4) | 11,874 | 0 |
| Phillips Pet Holding Corp.(2)(3)(4) | 174 | 53,157 |
| | | 53,157 |
| 電気通信-0.0%(1) | | |
| GEE Acquisition Holdings Corp.(2)(3)(4) | 12,758 | 114,822 |
| | | 114,822 |
| 公益-0.1% | | |
| Longview Intermediate Holdings, LLC, Class A(3)(4) | 36,023 | 495,317 |
| | | 495,317 |
| 普通株式合計（認識された原価：4,081,992米ドル） | | 3,103,754 |

転換優先株式-0.2%

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|---|-------|-------------|
| 容器およびガラス製品-0.2% | | |
| LG Newco Holdco, Inc., Series A, 13.00%(3)(4) | 7,530 | 897,918 |
| 転換優先株式合計（認識された原価：395,310米ドル） | | 897,918 |

社債-0.1%

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|-----------------------------|-----|-------------|
| メディア-0.1% | | |
| iHeartCommunications, Inc.: | | |
| 6.375%, 5/1/26 | 90 | 86,273 |
| 8.375%, 5/1/27 | 164 | 147,332 |
| 社債合計（認識された原価：261,349米ドル） | | 233,605 |

優先株式－0.2%

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|--|-------|-------------|
| 金融サービス－0.0% | | |
| DBI Investors, Inc., Series A-1(2)(3)(4) | 561 | 0 |
| | | 0 |
| 非鉄金属／鉱物－0.2% | | |
| ACNR Holdings, Inc., 15.00% (PIK)(3)(4) | 911 | 562,542 |
| | | 562,542 |
| 小売（食料およびドラッグを除く）－0.0% | | |
| David' s Bridal, LLC: | | |
| Series A, 8.00% (PIK)(2)(3)(4) | 330 | 0 |
| Series B, 10.00% (PIK)(2)(3)(4) | 1,346 | 0 |
| | | 0 |
| 優先株式合計（認識された原価：108,972米ドル） | | 562,542 |

シニア変動利付有価証券－93.3%(5)

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 航空および軍需－1.3% | | |
| Dynasty Acquisition Co., Inc.: | | |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 4/6/26 | 1,148 | 1,081,142 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 4/6/26 | 617 | 581,259 |
| IAP Worldwide Services, Inc., Term Loan - Second Lien, 10.174%, (3 mo. USD LIBOR + 6.50%), 7/18/23(2) | 168 | 130,284 |
| TransDigm, Inc., Term Loan, 5.924%, (3 mo. USD LIBOR + 2.25%), 8/22/24 | 824 | 811,591 |
| WP CPP Holdings, LLC, Term Loan, 8.168%, (USD LIBOR + 3.75%), 4/30/25(6) | 2,297 | 1,975,565 |
| | | 4,579,841 |
| 航空－2.4% | | |
| American Airlines, Inc.: | | |
| Term Loan, 5.346%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 6/27/25 | 990 | 937,800 |
| Term Loan, 8.993%, (3 mo. USD LIBOR + 4.75%), 4/20/28 | 2,470 | 2,448,830 |
| Mileage Plus Holdings, LLC, Term Loan, 8.777%, (3 mo. USD LIBOR + 5.25%), 6/21/27 | 2,660 | 2,721,513 |
| SkyMiles IP, Ltd., Term Loan, 7.993%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/20/27 | 1,775 | 1,793,243 |
| United Airlines, Inc., Term Loan, 8.108%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 4/21/28 | 973 | 951,926 |
| | | 8,853,312 |
| 自動車部品－0.9% | | |
| Adient US, LLC, Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 4/10/28 | | |
| | 346 | 334,824 |
| American Axle and Manufacturing, Inc., Term Loan, 5.84%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 4/6/24 | 989 | 977,631 |
| DexKo Global, Inc., Term Loan, 7.476%, (USD LIBOR + 3.75%), 10/4/28(6) | 423 | 384,156 |
| Garrett LX I S.a.r.l., Term Loan, 7.67%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 4/30/28 | 248 | 241,312 |
| LTI Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 9/6/25 | 312 | 291,876 |
| Term Loan, 8.254%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 7/24/26 | 320 | 300,818 |
| Truck Hero, Inc., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 1/31/28 | 788 | 680,389 |
| Wheel Pros, LLC, Term Loan, 8.825%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 5/11/28 | 96 | 70,240 |
| | | 3,281,246 |
| 自動車－1.1% | | |
| Bombardier Recreational Products, Inc., Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 5/24/27 | | |
| | 3,020 | 2,908,854 |
| MajorDrive Holdings IV, LLC, Term Loan, 7.125%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 6/1/28 | 1,264 | 1,167,643 |
| | | 4,076,497 |
| 飲料－0.3% | | |
| Arterra Wines Canada, Inc., Term Loan, 7.142%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/24/27 | | |
| | 344 | 314,861 |
| City Brewing Company, LLC, Term Loan, 6.814%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 4/5/28 | 247 | 170,912 |
| Triton Water Holdings, Inc., Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 3/31/28 | 691 | 619,102 |
| | | 1,104,875 |
| バイオテクノロジー－0.8% | | |
| Alkermes, Inc., Term Loan, 5.98%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 3/12/26 | | |
| | 1,979 | 1,904,812 |
| Alltech, Inc., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 10/13/28 | 993 | 954,041 |
| | | 2,858,853 |
| 建設関連製品－1.0% | | |
| ACProducts, Inc., Term Loan, 7.325%, (USD LIBOR + 4.25%), 5/17/28(6) | | |
| | 741 | 519,271 |
| Cornerstone Building Brands, Inc., Term Loan, 6.589%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 4/12/28 | 1,310 | 1,104,967 |
| CPG International, Inc., Term Loan, 6.269%, (SOFR + 2.50%), 4/28/29 | 650 | 630,399 |
| LHS Borrower, LLC, Term Loan, 8.579%, (SOFR + 4.75%), 2/16/29 | 920 | 730,931 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 建設関連製品 (続き) | | |
| MI Windows and Doors, LLC, Term Loan, 7.329%, (SOFR + 3.50%), 12/18/27 | 107 | 104,722 |
| Standard Industries, Inc., Term Loan, 6.675%, (6 mo. USD LIBOR + 2.50%), 9/22/28 | 538 | 527,849 |
| | | 3,618,139 |
| 資本市場 - 4.4% | | |
| Advisor Group, Inc., Term Loan, 8.254%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 7/31/26 | 1,475 | 1,420,419 |
| AllSpring Buyer, LLC, Term Loan, 6.688%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 11/1/28 | 498 | 491,903 |
| Aretec Group, Inc., Term Loan, 8.079%, (SOFR + 4.25%), 10/1/25 | 1,139 | 1,108,804 |
| Brookfield Property REIT, Inc., Term Loan, 6.329%, (SOFR + 2.50%), 8/27/25 | 493 | 483,053 |
| Clipper Acquisitions Corp., Term Loan, 4.924%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 3/3/28 | 788 | 773,467 |
| Edelman Financial Center, LLC, Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 4/7/28 | 1,893 | 1,768,652 |
| EIG Management Company, LLC, Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 2/22/25 | 167 | 162,529 |
| FinCo I, LLC, Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 6/27/25 | 373 | 372,338 |
| Focus Financial Partners, LLC: | | |
| Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 7/3/24 | 368 | 363,633 |
| Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 6/30/28 | 445 | 435,553 |
| Franklin Square Holdings, L.P., Term Loan, 6.063%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 8/1/25 | 312 | 307,319 |
| Greenhill & Co., Inc., Term Loan, 6.32%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 4/12/24 | 562 | 550,638 |
| Guggenheim Partners, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 7/21/23 | 2,589 | 2,575,610 |
| HighTower Holdings, LLC, Term Loan, 8.278%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 4/21/28 | 1,658 | 1,546,318 |
| Hudson River Trading, LLC, Term Loan, 6.164%, (SOFR + 3.00%), 3/20/28 | 937 | 863,406 |
| LPL Holdings, Inc., Term Loan, 4.878%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 11/12/26 | 875 | 865,403 |
| Mariner Wealth Advisors, LLC, Term Loan, 7.065%, (SOFR + 3.25%), 8/18/28 | 943 | 908,680 |
| Victory Capital Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 5.962%, (SOFR + 2.25%), 7/1/26 | 497 | 487,433 |
| Term Loan, 5.962%, (SOFR + 2.25%), 12/29/28 | 624 | 610,925 |
| | | 16,096,083 |
| 化学 - 2.5% | | |
| Aruba Investments, Inc., Term Loan, 7.576%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 11/24/27 | 271 | 255,313 |
| Caldic B.V., Term Loan, 7.844%, (SOFR + 3.75%), 2/26/29 | 846 | 775,976 |
| CPC Acquisition Corp., Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/29/27 | 1,034 | 827,400 |
| Flint Group GmbH, Term Loan, 9.32%, (3 mo. USD LIBOR + 5.00%), 8.57% cash, 0.75% PIK, 9/21/23 | 21 | 15,619 |
| Flint Group US LLC, Term Loan, 9.32%, (3 mo. USD LIBOR + 5.00%), 8.57% cash, 0.75% PIK, 9/21/23 | 125 | 94,418 |
| Gemini HDPE, LLC, Term Loan, 7.358%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 12/31/27 | 255 | 245,622 |
| GEON Performance Solutions, LLC, Term Loan, 8.174%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 8/18/28 | 495 | 480,975 |
| Groupe Solmax, Inc., Term Loan, 8.392%, (3 mo. USD LIBOR + 4.75%), 5/29/28 | 494 | 432,302 |
| INEOS Enterprises Holdings US Finco, LLC, Term Loan, 6.57%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 8/28/26 | 100 | 90,679 |
| INEOS Styrolution US Holding, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 1/29/26 | 1,162 | 1,096,912 |
| Kraton Corporation, Term Loan, 6.718%, (SOFR + 3.25%), 3/15/29 | 249 | 240,976 |
| Lonza Group AG, Term Loan, 7.674%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 7/3/28 | 1,434 | 1,267,714 |
| LSF11 Skyscraper Holdco S.a.r.l., Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 9/29/27 | 320 | 308,950 |
| Momentive Performance Materials, Inc., Term Loan, 7.01%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 5/15/24 | 242 | 239,532 |
| Olympus Water US Holding Corporation: | | |
| Term Loan, 7.438%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 11/9/28 | 720 | 657,114 |
| Term Loan, 8.153%, (SOFR + 4.50%), 11/9/28 | 249 | 228,974 |
| Orion Engineered Carbons GmbH, Term Loan, 5.924%, (3 mo. USD LIBOR + 2.25%), 9/24/28 | 198 | 192,019 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 化学 (続き) | | |
| Tronox Finance, LLC: | | |
| Term Loan, 5.938%, (USD LIBOR + 2.25%), 3/10/28(6) | 538 | 508,492 |
| Term Loan, 6.803%, (SOFR + 3.25%), 4/4/29 | 174 | 167,160 |
| W.R. Grace & Co.-Conn., Term Loan, 7.438%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 9/22/28 | 1,042 | 1,004,441 |
| | | 9,130,588 |
| 商業サービス・用品－2.6% | | |
| Asplundh Tree Expert, LLC, Term Loan, 5.504%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 9/7/27 | 441 | 434,695 |
| Belfor Holdings, Inc., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 4/6/26 | 340 | 336,802 |
| Clean Harbors, Inc., Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 10/8/28 | 248 | 247,272 |
| Covanta Holding Corporation: | | |
| Term Loan, 6.229%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 11/30/28 | 231 | 228,812 |
| Term Loan, 6.229%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 11/30/28 | 17 | 17,226 |
| EnergySolutions, LLC, Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 5/9/25 | 730 | 679,160 |
| Garda World Security Corporation, Term Loan, 7.24%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 10/30/26 | 578 | 552,362 |
| GFL Environmental, Inc., Term Loan, 7.415%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 5/30/25 | 1,109 | 1,105,165 |
| LABL, Inc., Term Loan, 8.754%, (1 mo. USD LIBOR + 5.00%), 10/29/28 | 397 | 367,523 |
| Monitronics International, Inc., Term Loan, 11.915%, (3 mo. USD LIBOR + 7.50%), 3/29/24 | 867 | 573,499 |
| PECF USS Intermediate Holding III Corporation, Term Loan, 8.004%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 12/15/28 | 943 | 733,001 |
| Phoenix Services International, LLC: | | |
| DIP Loan, 15.729%, (SOFR + 12.00%), 3/28/23 | 60 | 59,636 |
| Term Loan, 8.25%, (USD Prime + 2.75%), 3/1/25 | 598 | 133,900 |
| Prime Security Services Borrower, LLC, Term Loan, 6.505%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 9/23/26 | 2,476 | 2,443,481 |
| Tempo Acquisition, LLC, Term Loan, 6.729%, (SOFR + 3.00%), 8/31/28 | 347 | 342,716 |
| TruGreen Limited Partnership, Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 11/2/27 | 221 | 205,312 |
| Werner FinCo, L.P., Term Loan, 7.674%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 7/24/24 | 998 | 908,050 |
| | | 9,368,612 |
| 通信機器－0.1% | | |
| Digi International, Inc., Term Loan, 8.754%, (1 mo. USD LIBOR + 5.00%), 11/1/28 | 214 | 210,804 |
| Tiger Acquisition, LLC, Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 6/1/28 | 222 | 208,046 |
| | | 418,850 |
| 建設資材－0.6% | | |
| Oscar AcquisitionCo, LLC, Term Loan, 8.153%, (SOFR + 4.50%), 4/29/29 | 625 | 567,813 |
| Quikrete Holdings, Inc., Term Loan, 6.379%, (1 mo. USD LIBOR + 2.63%), 2/1/27 | 1,613 | 1,571,418 |
| | | 2,139,231 |
| 容器および包装－1.0% | | |
| BWAY Holding Company, Term Loan, 6.378%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 4/3/24 | 907 | 862,813 |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc., Term Loan, 8.004%, (SOFR + 4.18%), 4/13/29 | 1,471 | 1,419,571 |
| Pregis TopCo Corporation, Term Loan, 7.843%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 7/31/26 | 292 | 278,986 |
| Pretium PKG Holdings, Inc., Term Loan, 7.60%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 10/2/28 | 323 | 283,586 |
| Proampac PG Borrower, LLC, Term Loan, 7.728%, (USD LIBOR + 3.75%), 11/3/25(6) | 884 | 843,623 |
| | | 3,688,579 |
| 販売－0.4% | | |
| Autokiniton US Holdings, Inc., Term Loan, 7.80%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 4/6/28 | 716 | 671,370 |
| Phillips Feed Service, Inc., Term Loan, 10.48%, (1 mo. USD LIBOR + 7.00%), 11/13/24(2) | 32 | 25,480 |
| White Cap Buyer, LLC, Term Loan, 7.479%, (SOFR + 3.75%), 10/19/27 | 784 | 744,463 |
| | | 1,441,313 |

| 債務者/細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 各種消費者サービス-1.1% | | |
| Ascend Learning, LLC: | | |
| Term Loan, 7.132%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 12/11/28 | 937 | 862,514 |
| Term Loan - Second Lien, 9.504%, (1 mo. USD LIBOR + 5.75%), 12/10/29 | 625 | 532,812 |
| Corporation Service Company, Term Loan, 11/2/29(7) | 225 | 220,922 |
| KUEHG Corp., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 2/21/25 | 1,928 | 1,851,844 |
| Sotheby's, Term Loan, 8.579%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 1/15/27 | 376 | 369,225 |
| | | 3,837,317 |
| 各種電気通信サービス-3.1% | | |
| CenturyLink, Inc., Term Loan, 6.004%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 3/15/27 | 1,639 | 1,532,182 |
| GEE Holdings 2, LLC: | | |
| Term Loan, 11.604%, (3 mo. USD LIBOR + 8.00%), 3/24/25 | 113 | 113,011 |
| Term Loan - Second Lien, 11.854%, (3 mo. USD LIBOR + 8.25%), 5.104% cash, 6.75% PIK, 3/23/26 | 240 | 184,142 |
| Numericable Group S.A., Term Loan, 7.165%, (3 mo. USD LIBOR + 2.75%), 7/31/25 | 1,229 | 1,119,279 |
| Telenet Financing USD, LLC, Term Loan, 5.412%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 4/30/28 | 1,675 | 1,625,946 |
| UPC Financing Partnership, Term Loan, 6.337%, (1 mo. USD LIBOR + 2.93%), 1/31/29 | 1,000 | 980,179 |
| Virgin Media Bristol, LLC: | | |
| Term Loan, 5.912%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 1/31/28 | 2,800 | 2,750,807 |
| Term Loan, 6.662%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 1/31/29 | 450 | 443,742 |
| Ziggo Financing Partnership, Term Loan, 5.912%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 4/30/28 | 2,625 | 2,560,782 |
| | | 11,310,070 |
| 電気設備-0.0%(1) | | |
| GrafTech Finance, Inc., Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 2/12/25 | 154 | 147,291 |
| | | 147,291 |
| 電子装置、機器および部品-1.0% | | |
| Chamberlain Group, Inc., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/3/28 | 844 | 769,632 |
| Creation Technologies, Inc., Term Loan, 9.248%, (3 mo. USD LIBOR + 5.50%), 10/5/28 | 498 | 412,925 |
| Ingram Micro, Inc., Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 6/30/28 | 415 | 400,704 |
| Mirion Technologies, Inc., Term Loan, 5.627%, (6 mo. USD LIBOR + 2.75%), 10/20/28 | 372 | 363,581 |
| Robertshaw US Holding Corp., Term Loan, 7.313%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/28/25 | 669 | 546,499 |
| Verifone Systems, Inc., Term Loan, 6.997%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 8/20/25 | 1,217 | 1,087,178 |
| | | 3,580,519 |
| エネルギー設備およびサービス-0.2% | | |
| Ameriforge Group, Inc.: | | |
| Term Loan, 15.025%, (1 mo. USD LIBOR + 13.00%), 2/1/26(8) | 109 | 54,054 |
| Term Loan, 16.67%, (3 mo. USD LIBOR + 13.00%), 11.67% cash, 5.00% PIK, 2/1/26 | 856 | 424,655 |
| Lealand Finance Company B.V., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 4.754% cash, 3.00% PIK, 6/30/25 | 141 | 75,163 |
| | | 553,872 |
| 土木および建設-1.1% | | |
| Aegion Corporation, Term Loan, 8.504%, (1 mo. USD LIBOR + 4.75%), 5/17/28 | 1,193 | 1,105,986 |
| American Residential Services, LLC, Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 10/15/27 | 221 | 215,536 |
| APi Group DE, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 10/1/26 | 634 | 626,246 |
| Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 1/3/29 | 419 | 414,020 |
| Centuri Group, Inc., Term Loan, 5.57%, (3 mo. USD LIBOR + 2.50%), 8/27/28 | 374 | 367,287 |
| Northstar Group Services, Inc., Term Loan, 9.254%, (1 mo. USD LIBOR + 5.50%), 11/12/26 | 576 | 568,641 |
| USIC Holdings, Inc., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 5/12/28 | 887 | 845,629 |
| | | 4,143,345 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| エンターテインメント－2.0% | | |
| Alchemy Copyrights, LLC, Term Loan, 6.128%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 3/10/28 | 196 | 195,029 |
| AMC Entertainment Holdings, Inc., Term Loan, 6.314%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 4/22/26 | 941 | 672,725 |
| Crown Finance US, Inc.: | | |
| DIP Loan, 0.00%, 9/7/23(8) | 65 | 65,774 |
| DIP Loan, 13.368%, (SOFR + 10.00%), 9/7/23 | 779 | 782,775 |
| Term Loan, 0.00%, 9/30/26(9) | 658 | 195,686 |
| Delta 2 (LUX) S.a.r.l., Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 2/1/24 | 3,687 | 3,687,999 |
| Playtika Holding Corp., Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 3/13/28 | 1,431 | 1,395,534 |
| Renaissance Holding Corp., Term Loan, 7.608%, (SOFR + 4.50%), 3/30/29 | 125 | 120,947 |
| | | 7,116,469 |
| 不動産投資信託－0.1% | | |
| Iron Mountain, Inc., Term Loan, 5.504%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 1/2/26 | 549 | 540,202 |
| | | 540,202 |
| 食品および生活必需品小売－0.5% | | |
| US Foods, Inc.: | | |
| Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 9/13/26 | 723 | 711,074 |
| Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 11/22/28 | 1,014 | 1,000,103 |
| | | 1,711,177 |
| 食料品－0.1% | | |
| CHG PPC Parent, LLC, Term Loan, 6.813%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 12/8/28 | 249 | 241,287 |
| Monogram Food Solutions, LLC, Term Loan, 7.813%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 8/28/28 | 248 | 241,922 |
| | | 483,209 |
| ガス－0.5% | | |
| CQP Holdco, L.P., Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 6/5/28 | 1,805 | 1,785,043 |
| | | 1,785,043 |
| ヘルスケア機器および用品－1.3% | | |
| Bayou Intermediate II, LLC, Term Loan, 7.302%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 8/2/28 | 323 | 309,660 |
| CryoLife, Inc., Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 6/1/27 | 333 | 312,539 |
| Gloves Buyer, Inc., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 12/29/27 | 443 | 403,582 |
| ICU Medical, Inc., Term Loan, 5.961%, (SOFR + 2.25%), 1/8/29(6) | 348 | 341,339 |
| Journey Personal Care Corp., Term Loan, 7.924%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/1/28 | 1,613 | 1,038,864 |
| Medline Borrower, L.P., Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 10/23/28 | 2,736 | 2,518,871 |
| | | 4,924,855 |
| ヘルスケア・プロバイダーおよびヘルスケア・サービス－3.5% | | |
| AEA International Holdings (Lux) S.a.r.l., Term Loan, 7.438%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 9/7/28 | 496 | 488,806 |
| BW NHHHC Holdco, Inc., Term Loan, 7.961%, (3 mo. USD LIBOR + 5.00%), 5/15/25 | 646 | 408,523 |
| Cano Health, LLC, Term Loan, 7.829%, (SOFR + 4.00%), 11/23/27 | 617 | 529,052 |
| CCRR Parent, Inc., Term Loan, 7.51%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 3/6/28 | 222 | 215,494 |
| Covis Finco S.a.r.l., Term Loan, 10.203%, (SOFR + 6.50%), 2/18/27 | 634 | 427,781 |
| Ensemble RCM, LLC, Term Loan, 7.944%, (SOFR + 3.75%), 8/3/26 | 1,058 | 1,043,358 |
| Envision Healthcare Corporation: | | |
| Term Loan, 11.553%, (SOFR + 7.88%), 3/31/27 | 239 | 222,355 |
| Term Loan - Second Lien, 6.825%, (SOFR + 4.25%), 3/31/27 | 1,698 | 744,091 |
| Global Medical Response, Inc., Term Loan, 8.004%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/14/25 | 569 | 445,070 |
| MDVIP, Inc., Term Loan, 7.072%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 10/16/28 | 149 | 144,493 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| ヘルスケア・プロバイダーおよびヘルスケア・サービス (続き) | | |
| Medical Solutions Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 3.50%, 11/1/28(8) | 107 | 103,340 |
| Term Loan, 6.377%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/1/28 | 665 | 642,321 |
| Midwest Physician Administrative Services, LLC, Term Loan, 6.924%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 3/12/28 | 1,189 | 1,077,437 |
| National Mentor Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.43%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 3/2/28 | 39 | 27,921 |
| Term Loan, 7.466%, (USD LIBOR + 3.75%), 3/2/28(6) | 1,336 | 965,028 |
| Option Care Health, Inc., Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 10/27/28 | 1,464 | 1,439,234 |
| Phoenix Guarantor, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 3/5/26 | 554 | 532,841 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 3/5/26 | 1,256 | 1,208,173 |
| Radiology Partners, Inc., Term Loan, 7.825%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 7/9/25 | 675 | 548,437 |
| Select Medical Corporation, Term Loan, 6.26%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 3/6/25 | 853 | 831,378 |
| TTF Holdings, LLC, Term Loan, 7.813%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 3/31/28 | 216 | 212,158 |
| U.S. Anesthesia Partners, Inc., Term Loan, 7.378%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 10/1/28 | 545 | 516,206 |
| | | 12,773,497 |
| ヘルスケア・テクノロジー—2.7% | | |
| athenahealth, Inc.: | | |
| Term Loan, 3.50%, 2/15/29(8) | 196 | 178,594 |
| Term Loan, 6.967%, (SOFR + 3.50%), 2/15/29 | 1,151 | 1,051,068 |
| Bracket Intermediate Holding Corp., Term Loan, 7.998%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 9/5/25 | 1,520 | 1,459,818 |
| eResearchTechnology, Inc., Term Loan, 8.254%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 2/4/27 | 621 | 579,454 |
| Imprivata, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/1/27 | 1,900 | 1,864,206 |
| Term Loan, 7.979%, (SOFR + 4.25%), 12/1/27 | 150 | 147,817 |
| MedAssets Software Intermediate Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 12/18/28 | 597 | 567,150 |
| Term Loan - Second Lien, 10.504%, (1 mo. USD LIBOR + 6.75%), 12/17/29 | 400 | 344,333 |
| Navicure, Inc., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 10/22/26 | 786 | 766,498 |
| PointClickCare Technologies, Inc., Term Loan, 5.938%, (6 mo. USD LIBOR + 3.00%), 12/29/27 | 222 | 217,285 |
| Project Ruby Ultimate Parent Corp., Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 3/10/28 | 915 | 863,529 |
| Symplr Software, Inc., Term Loan, 8.694%, (SOFR + 4.50%), 12/22/27 | 789 | 739,008 |
| Verscend Holding Corp., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 8/27/25 | 1,184 | 1,169,289 |
| | | 9,948,049 |
| ホテル、レストランおよびレジャー—4.3% | | |
| 1011778 B.C. Unlimited Liability Company, Term Loan, 5.655%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 11/19/26 | | |
| | 692 | 674,052 |
| Bally's Corporation, Term Loan, 6.55%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 10/2/28 | 571 | 532,087 |
| Carnival Corporation: | | |
| Term Loan, 5.877%, (6 mo. USD LIBOR + 3.00%), 6/30/25 | 148 | 139,115 |
| Term Loan, 6.127%, (6 mo. USD LIBOR + 3.25%), 10/18/28 | 2,407 | 2,211,259 |
| ClubCorp Holdings, Inc., Term Loan, 6.424%, (3 mo. USD LIBOR + 2.75%), 9/18/24 | 1,211 | 1,090,882 |
| Dave & Buster's, Inc., Term Loan, 8.875%, (SOFR + 5.00%), 6/29/29 | 499 | 489,295 |
| Fertitta Entertainment, LLC, Term Loan, 7.729%, (SOFR + 4.00%), 1/27/29 | 840 | 790,488 |
| Great Canadian Gaming Corporation, Term Loan, 7.602%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 11/1/26 | 249 | 242,954 |
| Hilton Grand Vacations Borrower, LLC, Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 8/2/28 | 371 | 365,913 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| ホテル、レストランおよびレジャー (続き) | | |
| IRB Holding Corp.: | | |
| Term Loan, 6.208%, (SOFR + 3.00%), 12/15/27 | 739 | 717,838 |
| Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 2/5/25 | 604 | 595,757 |
| Playa Resorts Holding B.V., Term Loan, 6.50%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 4/29/24 | 1,268 | 1,238,137 |
| Scientific Games Holdings, L.P., Term Loan, 7.097%, (SOFR + 3.50%), 4/4/29 | 1,325 | 1,250,929 |
| Scientific Games International, Inc., Term Loan, 6.402%, (SOFR + 3.00%), 4/14/29 | 673 | 666,327 |
| SeaWorld Parks & Entertainment, Inc., Term Loan, 6.813%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 8/25/28 | 446 | 435,309 |
| SMG US Midco 2, Inc., Term Loan, 6.915%, (3 mo. USD LIBOR + 2.50%), 1/23/25 | 167 | 158,953 |
| Stars Group Holdings B.V. (The), Term Loan, 5.892%, (3 mo. USD LIBOR + 2.25%), 7/21/26 | 3,024 | 2,975,629 |
| Travel Leaders Group, LLC, Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 1/25/24 | 1,140 | 1,012,279 |
| | | 15,587,203 |
| 家庭用耐久財－1.4% | | |
| Libbey Glass, Inc., Term Loan, 11.941%, (3 mo. USD LIBOR + 8.00%), 11/13/25 | 1,268 | 1,298,369 |
| Serta Simmons Bedding, LLC: | | |
| Term Loan, 10.793%, (1 mo. USD LIBOR + 7.50%), 8/10/23 | 663 | 644,934 |
| Term Loan - Second Lien, 10.793%, (1 mo. USD LIBOR + 7.50%), 8/10/23 | 2,191 | 1,108,035 |
| Solis IV B.V., Term Loan, 6.34%, (SOFR + 3.50%), 2/26/29 | 2,469 | 2,064,031 |
| | | 5,115,369 |
| 家庭用品－0.7% | | |
| Diamond (BC) B.V., Term Loan, 7.163%, (USD LIBOR + 2.75%), 9/29/28(6) | 1,489 | 1,396,075 |
| Energizer Holdings, Inc., Term Loan, 5.875%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 12/22/27 | 382 | 371,245 |
| Kronos Acquisition Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.82%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/22/26 | 442 | 419,121 |
| Term Loan, 8.94%, (SOFR + 6.00%), 12/22/26 | 223 | 214,380 |
| | | 2,400,821 |
| 独立系発電事業者およびエネルギー販売業者－0.0%(1) | | |
| Longview Power, LLC, Term Loan, 13.674%, (3 mo. USD LIBOR + 10.00%), 7/30/25 | 71 | 69,547 |
| | | 69,547 |
| 複合産業－0.2% | | |
| SPX Flow, Inc., Term Loan, 8.329%, (SOFR + 4.50%), 4/5/29 | 950 | 902,500 |
| | | 902,500 |
| 保険－2.3% | | |
| Alliant Holdings Intermediate, LLC: | | |
| Term Loan, 6.98%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/6/27 | 1,561 | 1,509,458 |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 5/9/25 | 242 | 235,245 |
| AmWINS Group, Inc., Term Loan, 6.004%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 2/19/28 | 1,105 | 1,082,831 |
| AssuredPartners, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.229%, (SOFR + 3.50%), 2/12/27 | 448 | 427,741 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/12/27 | 1,050 | 1,004,208 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/12/27 | 321 | 306,816 |
| Hub International Limited, Term Loan, 7.326%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 4/25/25 | 2,195 | 2,155,480 |
| NFP Corp., Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 2/15/27 | 1,002 | 952,578 |
| USI, Inc., Term Loan, 6.924%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 12/2/26 | 608 | 596,750 |
| | | 8,271,107 |

| 債務者/細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|--|--------------|-------------|
| インタラクティブメディアおよびサービス-0.4% | | |
| Arches Buyer, Inc., Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 12/6/27 | 419 | 371,545 |
| Buzz Finco, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 1/29/27 | 244 | 237,656 |
| Getty Images, Inc., Term Loan, 7.625%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 2/19/26 | 604 | 601,357 |
| Match Group, Inc., Term Loan, 4.692%, (3 mo. USD LIBOR + 1.75%), 2/13/27 | 325 | 319,042 |
| | | 1,529,600 |
| インターネット販売およびカタログ販売-0.6% | | |
| Adevinta ASA, Term Loan, 6.674%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 6/26/28 | 617 | 604,169 |
| CNT Holdings I Corp., Term Loan, 7.239%, (SOFR + 3.50%), 11/8/27 | 1,258 | 1,228,065 |
| Hoya Midco, LLC, Term Loan, 6.979%, (SOFR + 3.25%), 2/3/29 | 370 | 366,078 |
| | | 2,198,312 |
| 情報技術サービス-3.2% | | |
| Asurion, LLC: | | |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 12/23/26 | 403 | 360,150 |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 7/31/27 | 690 | 609,058 |
| Term Loan - Second Lien, 9.004%, (1 mo. USD LIBOR + 5.25%), 1/31/28 | 860 | 610,062 |
| Term Loan - Second Lien, 9.004%, (1 mo. USD LIBOR + 5.25%), 1/20/29 | 800 | 564,000 |
| Cyxtera DC Holdings, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.36%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 5/1/24 | 1,492 | 1,282,829 |
| Term Loan, 8.36%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 5/1/24 | 756 | 674,798 |
| Endure Digital, Inc., Term Loan, 6.698%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/10/28 | 1,457 | 1,248,092 |
| Gainwell Acquisition Corp., Term Loan, 7.674%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 10/1/27 | 3,205 | 3,057,707 |
| Go Daddy Operating Company, LLC, Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 8/10/27 | 440 | 433,709 |
| Indy US Bidco, LLC, Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 3/5/28 | 271 | 241,091 |
| Informatica, LLC, Term Loan, 6.563%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 10/27/28 | 1,418 | 1,383,846 |
| NAB Holdings, LLC, Term Loan, 6.703%, (SOFR + 3.00%), 11/23/28 | 1,092 | 1,049,900 |
| WEX, Inc., Term Loan, 6.004%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 3/31/28 | 172 | 169,266 |
| | | 11,684,508 |
| レジャー用品-0.5% | | |
| Fender Musical Instruments Corporation, Term Loan, 7.368%, (SOFR + 4.00%), 12/1/28 | 173 | 146,055 |
| Hayward Industries, Inc., Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 5/30/28 | 1,806 | 1,700,668 |
| SRAM, LLC, Term Loan, 6.423%, (USD LIBOR + 2.75%), 5/18/28(6) | 96 | 93,402 |
| | | 1,940,125 |
| ライフサイエンス・ツールおよびサービス-3.0% | | |
| Avantor Funding, Inc., Term Loan, 6.004%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 11/8/27 | 1,753 | 1,718,883 |
| Catalent Pharma Solutions, Inc., Term Loan, 5.625%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 2/22/28 | 461 | 456,807 |
| Curia Global, Inc., Term Loan, 8.163%, (USD LIBOR + 3.75%), 8/30/26(6) | 1,681 | 1,545,983 |
| ICON Luxembourg S.a.r.l., Term Loan, 5.938%, (3 mo. USD LIBOR + 2.25%), 7/3/28 | 2,763 | 2,740,084 |
| IQVIA, Inc., Term Loan, 5.504%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 1/17/25 | 760 | 757,706 |
| Loire Finco Luxembourg S.a.r.l., Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 4/21/27 | 147 | 136,759 |
| Packaging Coordinators Midco, Inc., Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/30/27 | 1,557 | 1,508,993 |
| PRA Health Sciences, Inc., Term Loan, 5.938%, (3 mo. USD LIBOR + 2.25%), 7/3/28 | 688 | 682,694 |
| Sotera Health Holdings, LLC, Term Loan, 7.165%, (3 mo. USD LIBOR + 2.75%), 12/11/26 | 1,725 | 1,569,750 |
| | | 11,117,659 |
| 機械-3.9% | | |
| Al Aqua Merger Sub, Inc., Term Loan, 6.858%, (SOFR + 3.75%), 7/31/28 | 1,047 | 976,677 |
| Albion Financing 3 S.a.r.l., Term Loan, 9.575%, (3 mo. USD LIBOR + 5.25%), 8/17/26 | 844 | 799,335 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 機械 (続き) | | |
| Ali Group North America Corporation, Term Loan, 5.843%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 7/30/29 | 746 | 733,575 |
| American Trailer World Corp., Term Loan, 7.579%, (SOFR + 3.75%), 3/3/28 | 354 | 322,158 |
| Apex Tool Group, LLC, Term Loan, 8.624%, (SOFR + 5.25%), 2/8/29 | 1,179 | 1,023,859 |
| Clark Equipment Company, Term Loan, 6.153%, (SOFR + 2.50%), 4/20/29 | 547 | 538,768 |
| Conair Holdings, LLC, Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 5/17/28 | 1,139 | 963,930 |
| CPM Holdings, Inc., Term Loan, 6.628%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/17/25 | 1,673 | 1,629,568 |
| Delachaux Group S.A., Term Loan, 8.915%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 4/16/26 | 234 | 211,544 |
| Engineered Machinery Holdings, Inc., Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 5/19/28 | 1,401 | 1,358,663 |
| Filtration Group Corporation: | | |
| Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 3/29/25 | 987 | 968,133 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 10/21/28 | 396 | 382,918 |
| Gates Global, LLC, Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 3/31/27 | 1,603 | 1,563,890 |
| Icebox Holdco III, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/22/28 | 824 | 764,657 |
| Term Loan, 7.58%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/22/28 | 171 | 159,000 |
| Madison IAQ, LLC, Term Loan, 6.815%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 6/21/28 | 300 | 273,316 |
| Penn Engineering & Manufacturing Corp., Term Loan, 6.424%, (3 mo. USD LIBOR + 2.50%), 6/27/24 | 115 | 112,597 |
| Titan Acquisition Limited, Term Loan, 5.877%, (6 mo. USD LIBOR + 3.00%), 3/28/25 | 1,426 | 1,306,243 |
| | | 14,088,831 |
| メディアー2.3% | | |
| CSC Holdings, LLC, Term Loan, 5.662%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 7/17/25 | 1,645 | 1,597,378 |
| Diamond Sports Group, LLC: | | |
| Term Loan, 11.208%, (SOFR + 8.10%), 5/26/26 | 241 | 232,578 |
| Term Loan - Second Lien, 6.458%, (SOFR + 3.35%), 8/24/26 | 1,431 | 286,349 |
| Entravision Communications Corporation, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 11/29/24 | 525 | 514,500 |
| Gray Television, Inc.: | | |
| Term Loan, 5.625%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 2/7/24 | 121 | 121,488 |
| Term Loan, 5.628%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 1/2/26 | 382 | 376,843 |
| Hubbard Radio, LLC, Term Loan, 8.01%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/28/25 | 688 | 568,517 |
| Magnite, Inc., Term Loan, 8.642%, (USD LIBOR + 5.00%), 4/28/28(6) | 272 | 256,627 |
| Mission Broadcasting, Inc., Term Loan, 5.628%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 6/2/28 | 148 | 146,952 |
| MJH Healthcare Holdings, LLC, Term Loan, 7.329%, (SOFR + 3.50%), 1/28/29 | 174 | 165,419 |
| Nexstar Broadcasting, Inc., Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 9/18/26 | 140 | 139,039 |
| Recorded Books, Inc., Term Loan, 7.578%, (SOFR + 4.00%), 8/29/25 | 750 | 730,625 |
| Sinclair Television Group, Inc., Term Loan, 6.76%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 4/1/28 | 1,975 | 1,839,681 |
| Univision Communications, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 3/15/24 | 200 | 199,127 |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 3/15/26 | 415 | 403,427 |
| Term Loan, 7.79%, (SOFR + 4.25%), 6/24/29 | 788 | 774,891 |
| | | 8,353,441 |
| 金属／鉱物-0.8% | | |
| American Consolidated Natural Resources, Inc., Term Loan, 20.33%, (3 mo. USD LIBOR + 16.00%), 17.33% cash, 3.00% PIK, 9/16/25 | 22 | 22,624 |
| Dynacast International, LLC: | | |
| Term Loan, 7.48%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 7/22/25 | 670 | 571,416 |
| Term Loan, 11.98%, (3 mo. USD LIBOR + 9.00%), 10/22/25 | 259 | 219,910 |
| WireCo WorldGroup, Inc., Term Loan, 7.188%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 11/13/28 | 1,047 | 1,025,183 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| 金属／鉱物（続き） | | |
| Zekelman Industries, Inc., Term Loan, 5.604%, (3 mo. USD LIBOR + 2.00%), 1/24/27 | 937 | 911,852 |
| | | 2,750,985 |
| 石油、ガスおよび消耗燃料－1.4% | | |
| Centurion Pipeline Company, LLC, Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 9/28/25 | 99 | 97,546 |
| CITGO Petroleum Corporation, Term Loan, 10.004%, (1 mo. USD LIBOR + 6.25%), 3/28/24 | 1,166 | 1,168,711 |
| Delek US Holdings, Inc., Term Loan, 9.254%, (1 mo. USD LIBOR + 5.50%), 3/31/25 | 244 | 241,770 |
| Freeport LNG Investments, LLP, Term Loan, 7.743%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 12/21/28 | 862 | 808,889 |
| GIP II Blue Holding, L.P., Term Loan, 8.174%, (3 mo. USD LIBOR + 4.50%), 9/29/28 | 1,314 | 1,304,965 |
| Oryx Midstream Services Permian Basin, LLC, Term Loan, 6.211%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 10/5/28 | 422 | 416,443 |
| Oxbow Carbon, LLC, Term Loan, 7.878%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 10/17/25 | 203 | 201,909 |
| QuarterNorth Energy Holding, Inc., Term Loan - Second Lien, 11.754%, (1 mo. USD LIBOR + 8.00%), 8/27/26 | 319 | 318,574 |
| UGI Energy Services, LLC, Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 8/13/26 | 484 | 482,023 |
| | | 5,040,830 |
| 紙製品および林産物－0.1% | | |
| Spa Holdings 3 Oy, Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 2/4/28 | 493 | 450,680 |
| | | 450,680 |
| 医薬品－1.7% | | |
| Akorn, Inc., Term Loan, 11.243%, (3 mo. USD LIBOR + 7.50%), 10/1/25 | 119 | 112,919 |
| Bausch Health Companies, Inc., Term Loan, 8.624%, (SOFR + 5.25%), 2/1/27 | 962 | 723,098 |
| Horizon Therapeutics USA, Inc.: | | |
| Term Loan, 5.375%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 3/15/28 | 788 | 773,964 |
| Term Loan, 5.625%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 5/22/26 | 346 | 339,866 |
| Jazz Financing Lux S.a.r.l., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 5/5/28 | 601 | 595,275 |
| Mallinckrodt International Finance S.A.: | | |
| Term Loan, 8.733%, (3 mo. USD LIBOR + 5.25%), 9/30/27 | 1,819 | 1,481,465 |
| Term Loan, 8.983%, (3 mo. USD LIBOR + 5.50%), 9/30/27 | 367 | 299,777 |
| Perrigo Investments, LLC, Term Loan, 6.329%, (SOFR + 2.50%), 4/20/29 | 1,870 | 1,851,609 |
| | | 6,177,973 |
| 専門サービス－2.3% | | |
| APFS Staffing Holdings, Inc., Term Loan, 8.044%, (SOFR + 4.00%), 12/29/28(6) | 174 | 168,901 |
| Brown Group Holding, LLC: | | |
| Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 6/7/28 | 563 | 547,737 |
| Term Loan, 7.741%, (SOFR + 3.75%), 7/2/29 | 175 | 173,337 |
| CoreLogic, Inc., Term Loan, 7.313%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 6/2/28 | 1,629 | 1,200,653 |
| Deerfield Dakota Holding, LLC, Term Loan, 7.479%, (SOFR + 3.75%), 4/9/27 | 974 | 923,794 |
| EAB Global, Inc., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 8/16/28 | 1,290 | 1,235,092 |
| Employbridge, LLC, Term Loan, 8.424%, (3 mo. USD LIBOR + 4.75%), 7/19/28 | 693 | 594,495 |
| First Advantage Holdings, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 1/31/27 | 257 | 254,357 |
| Rockwood Service Corporation, Term Loan, 8.004%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 1/23/27 | 1,250 | 1,221,670 |
| Trans Union, LLC, Term Loan, 6.004%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 12/1/28 | 1,920 | 1,893,210 |
| Vaco Holdings, LLC, Term Loan, 8.708%, (SOFR + 5.00%), 1/21/29(6) | 174 | 169,780 |
| | | 8,383,026 |
| 不動産管理および開発－0.6% | | |
| Cushman & Wakefield U.S. Borrower, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 8/21/25 | 1,459 | 1,429,252 |
| RE/MAX International, Inc., Term Loan, 6.313%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 7/21/28 | 716 | 677,456 |
| | | 2,106,708 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|--|--------------|-------------|
| 陸運および鉄道－2.5% | | |
| First Student Bidco, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.642%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 7/21/28 | 182 | 171,567 |
| Term Loan, 6.642%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 7/21/28 | 489 | 461,304 |
| Term Loan, 7.653%, (SOFR + 4.00%), 7/21/28 | 444 | 418,987 |
| Term Loan, 7.653%, (SOFR + 4.00%), 7/21/28 | 31 | 29,096 |
| Grab Holdings, Inc., Term Loan, 8.26%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 1/29/26 | 1,606 | 1,518,117 |
| Hertz Corporation, (The): | | |
| Term Loan, 7.01%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 6/30/28 | 457 | 441,575 |
| Term Loan, 7.01%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 6/30/28 | 87 | 84,273 |
| Kenan Advantage Group, Inc., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 3/24/26 | 884 | 845,472 |
| PODS, LLC, Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 3/31/28 | 788 | 762,035 |
| Uber Technologies, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.57%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 4/4/25 | 2,650 | 2,634,717 |
| Term Loan, 6.57%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/25/27 | 1,490 | 1,477,029 |
| XPO Logistics, Inc., Term Loan, 4.936%, (1 mo. USD LIBOR + 1.75%), 2/24/25 | 425 | 419,455 |
| | | 9,263,627 |
| 半導体および半導体製造装置－1.6% | | |
| Altair Bidco, Inc., Term Loan, 5.368%, (SOFR + 3.10%), 2/1/29(6) | 698 | 655,046 |
| Bright Bidco B.V., Term Loan, 10.903%, (SOFR + 8.00%), 10/31/27 | 195 | 174,601 |
| Entegris, Inc., Term Loan, 5.708%, (SOFR + 3.00%), 7/6/29 | 1,325 | 1,320,238 |
| MaxLinear, Inc., Term Loan, 5.882%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 6/23/28 | 150 | 147,375 |
| MKS Instruments, Inc., Term Loan, 6.317%, (SOFR + 2.75%), 8/17/29 | 3,010 | 2,951,994 |
| Ultra Clean Holdings, Inc., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 8/27/25 | 571 | 565,076 |
| | | 5,814,330 |
| ソフトウェア17.8% | | |
| Applied Systems, Inc., Term Loan, 6.674%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 9/19/24 | 2,604 | 2,575,393 |
| AppLovin Corporation: | | |
| Term Loan, 6.674%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 10/25/28 | 796 | 768,887 |
| Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 8/15/25 | 2,040 | 1,999,288 |
| Aptean, Inc., Term Loan, 7.32%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 4/23/26 | 2,166 | 2,079,170 |
| AQA Acquisition Holding, Inc., Term Loan, 7.32%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/3/28 | 619 | 594,702 |
| Astra Acquisition Corp.: | | |
| Term Loan, 9.004%, (1 mo. USD LIBOR + 5.25%), 10/25/28 | 579 | 504,559 |
| Term Loan - Second Lien, 12.629%, (1 mo. USD LIBOR + 8.88%), 10/25/29 | 900 | 823,302 |
| Banff Merger Sub, Inc., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/2/25 | 1,414 | 1,362,195 |
| Cast and Crew Payroll, LLC, Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/9/26 | 739 | 727,751 |
| CDK Global, Inc., Term Loan, 8.112%, (SOFR + 4.50%), 7/6/29 | 1,575 | 1,545,250 |
| CentralSquare Technologies, LLC, Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 8/29/25 | 992 | 864,265 |
| Ceridian HCM Holding, Inc., Term Loan, 6.254%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 4/30/25 | 936 | 908,017 |
| Cloudera, Inc., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/8/28 | 1,340 | 1,252,783 |
| ConnectWise, LLC, Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 9/29/28 | 1,290 | 1,223,157 |
| Constant Contact, Inc., Term Loan, 7.909%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 2/10/28 | 693 | 603,346 |
| Cornerstone OnDemand, Inc., Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/16/28 | 697 | 585,060 |
| Delta TopCo, Inc., Term Loan, 5.836%, (6 mo. USD LIBOR + 3.75%), 12/1/27 | 1,282 | 1,174,153 |
| E2open, LLC, Term Loan, 6.644%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 2/4/28 | 644 | 628,676 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|--|--------------|-------------|
| ソフトウェア (続き) | | |
| ECI Macola Max Holding, LLC, Term Loan, 7.424%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 11/9/27 | 2,005 | 1,943,958 |
| Epicor Software Corporation, Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 7/30/27 | 4,612 | 4,388,958 |
| Finastra USA, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.871%, (6 mo. USD LIBOR + 3.50%), 6/13/24 | 3,686 | 3,347,994 |
| Term Loan - Second Lien, 7.326%, (1 week USD LIBOR + 7.25%), 6/13/25 | 750 | 560,625 |
| Fiserv Investment Solutions, Inc., Term Loan, 6.961%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 2/18/27 | 244 | 231,393 |
| GoTo Group, Inc., Term Loan, 8.322%, (1 mo. USD LIBOR + 4.75%), 8/31/27 | 1,455 | 938,318 |
| Hyland Software, Inc., Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 7/1/24 | 3,444 | 3,364,698 |
| Instructure Holdings, Inc., Term Loan, 6.121%, (3 mo. USD LIBOR + 2.75%), 10/30/28 | 995 | 983,806 |
| Ivanti Software, Inc., Term Loan, 7.332%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 12/1/27 | 999 | 753,885 |
| MA FinanceCo., LLC, Term Loan, 7.418%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 6/5/25 | 677 | 673,761 |
| Magenta Buyer, LLC: | | |
| Term Loan, 9.17%, (3 mo. USD LIBOR + 4.75%), 7/27/28 | 1,807 | 1,584,859 |
| Term Loan - Second Lien, 12.67%, (3 mo. USD LIBOR + 8.25%), 7/27/29 | 425 | 366,917 |
| Maverick Bidco, Inc., Term Loan, 8.165%, (3 mo. USD LIBOR + 3.75%), 5/18/28 | 371 | 353,638 |
| McAfee, LLC, Term Loan, 6.87%, (SOFR + 3.75%), 3/1/29 | 1,820 | 1,664,184 |
| Mediaocean, LLC, Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 12/15/28 | 348 | 328,226 |
| MH Sub I, LLC, Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 9/13/24 | 223 | 214,839 |
| Mitnick Corporate Purchaser, Inc., Term Loan, 8.944%, (SOFR + 4.75%), 5/2/29 | 325 | 310,456 |
| Panther Commercial Holdings, L.P., Term Loan, 8.665%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 1/7/28 | 420 | 380,472 |
| Proofpoint, Inc., Term Loan, 6.32%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 8/31/28 | 1,832 | 1,746,774 |
| Quest Software US Holdings, Inc., Term Loan, 8.494%, (SOFR + 4.25%), 2/1/29 | 1,771 | 1,316,364 |
| Red Planet Borrower, LLC, Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/2/28 | 1,460 | 901,183 |
| Redstone Holdco 2 L.P., Term Loan, 9.108%, (3 mo. USD LIBOR + 4.75%), 4/27/28 | 1,411 | 1,024,753 |
| Sabre GBLB, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 12/17/27 | 517 | 464,298 |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 12/17/27 | 325 | 291,268 |
| Seattle Spinco, Inc., Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 6/21/24 | 1,246 | 1,235,874 |
| SkillSoft Corporation, Term Loan, 8.473%, (SOFR + 5.25%), 7/14/28 | 400 | 332,727 |
| SolarWinds Holdings, Inc., Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 2/5/24 | 1,011 | 1,003,193 |
| Sophia, L.P.: | | |
| Term Loan, 7.174%, (3 mo. USD LIBOR + 3.50%), 10/7/27 | 486 | 469,875 |
| Term Loan, 7.979%, (SOFR + 4.25%), 10/7/27 | 1,546 | 1,501,029 |
| Sovos Compliance, LLC, Term Loan, 8.254%, (1 mo. USD LIBOR + 4.50%), 8/11/28 | 348 | 337,493 |
| SS&C Technologies, Inc.: | | |
| Term Loan, 6.079%, (SOFR + 2.25%), 3/22/29 | 162 | 158,932 |
| Term Loan, 6.079%, (SOFR + 2.25%), 3/22/29 | 244 | 239,474 |
| SurveyMonkey, Inc., Term Loan, 7.51%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 10/10/25 | 714 | 692,354 |
| Tibco Software, Inc., Term Loan, 8.153%, (SOFR + 4.50%), 3/30/29 | 1,300 | 1,189,500 |
| Turing Midco, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.50%), 3/23/28 | 85 | 83,541 |
| Ultimate Software Group, Inc. (The): | | |
| Term Loan, 6.998%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 5/4/26 | 3,332 | 3,223,328 |
| Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 5/4/26 | 1,364 | 1,328,804 |
| Term Loan - Second Lien, 8.998%, (1 mo. USD LIBOR + 5.25%), 5/3/27 | 1,725 | 1,597,062 |
| Veritas US, Inc., Term Loan, 8.674%, (3 mo. USD LIBOR + 5.00%), 9/1/25 | 1,270 | 1,017,286 |

| 債務者／細目 | 額面 (千米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---|--------------|-------------|
| ソフトウェア (続き) | | |
| Virgin Pulse, Inc., Term Loan, 7.754%, (1 mo. USD LIBOR + 4.00%), 4/6/28 | 494 | 431,757 |
| Vision Solutions, Inc., Term Loan, 8.358%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 4/24/28 | 1,535 | 1,308,743 |
| VS Buyer, LLC, Term Loan, 6.754%, (1 mo. USD LIBOR + 3.00%), 2/28/27 | 512 | 499,078 |
| | | 65,005,631 |
| 専門小売－2.3% | | |
| Belron Finance US, LLC, Term Loan, 5.375%, (3 mo. USD LIBOR + 2.50%), 4/13/28 | 345 | 339,848 |
| BW Gas & Convenience Holdings, LLC, Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 3/31/28 | 667 | 649,898 |
| David' s Bridal, Inc.: | | |
| Term Loan, 9.754%, (3 mo. USD LIBOR + 6.00%), 6/30/23 | 199 | 185,999 |
| Term Loan, 14.28%, (3 mo. USD LIBOR + 10.00%), 9.28% cash, 5.00% PIK, 6/23/23 | 166 | 159,786 |
| Great Outdoors Group, LLC, Term Loan, 7.504%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 3/6/28 | 2,714 | 2,563,442 |
| Harbor Freight Tools USA, Inc., Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 10/19/27 | 1,516 | 1,425,199 |
| Les Schwab Tire Centers, Term Loan, 6.58%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 11/2/27 | 1,206 | 1,174,627 |
| Mattress Firm, Inc., Term Loan, 8.433%, (3 mo. USD LIBOR + 4.25%), 9/25/28 | 743 | 637,854 |
| PetSmart, Inc., Term Loan, 7.50%, (1 mo. USD LIBOR + 3.75%), 2/11/28 | 1,336 | 1,288,582 |
| | | 8,425,235 |
| 貯蓄および抵当金融－0.2% | | |
| Ditech Holding Corporation, Term Loan, 0.00%, 6/30/23(9) | 1,342 | 167,791 |
| Walker & Dunlop, Inc., Term Loan, 6.079%, (SOFR + 2.25%), 12/16/28 | 571 | 562,127 |
| | | 729,918 |
| 商社および流通業－2.2% | | |
| American Builders & Contractors Supply Co., Inc., Term Loan, 5.754%, (1 mo. USD LIBOR + 2.00%), 1/15/27 | 1,043 | 1,023,606 |
| Avolon TLB Borrower 1 (US), LLC, Term Loan, 5.739%, (1 mo. USD LIBOR + 2.25%), 12/1/27 | 1,159 | 1,139,835 |
| Core & Main L.P., Term Loan, 6.525%, (USD LIBOR + 2.50%), 7/27/28(6) | 593 | 579,354 |
| DXP Enterprises, Inc., Term Loan, 8.504%, (1 mo. USD LIBOR + 4.75%), 12/16/27 | 221 | 211,322 |
| Electro Rent Corporation, Term Loan, 9.278%, (3 mo. USD LIBOR + 5.00%), 1/31/24 | 948 | 894,694 |
| Park River Holdings, Inc., Term Loan, 6.993%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 12/28/27 | 1,239 | 1,055,538 |
| Spin Holdco, Inc., Term Loan, 7.144%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 3/4/28 | 2,809 | 2,487,377 |
| SRS Distribution, Inc.: | | |
| Term Loan, 7.254%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 6/2/28 | 420 | 390,921 |
| Term Loan, 7.329%, (SOFR + 3.50%), 6/2/28 | 223 | 207,960 |
| | | 7,990,607 |
| 運送インフラ－0.3% | | |
| KKR Apple Bidco, LLC, Term Loan, 6.504%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 9/23/28 | 1,117 | 1,085,275 |
| | | 1,085,275 |
| 無線通信サービス－0.1% | | |
| Digicel International Finance Limited, Term Loan, 7.004%, (1 mo. USD LIBOR + 3.25%), 5/28/24 | 523 | 449,791 |
| | | 449,791 |
| シニア変動利付有価証券合計 (認識された原価: 367,290,998米ドル) | | 340,444,573 |

ワラントー0.0%

| 銘柄名 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|--|--------|-------------|
| レジャー用品／活動／映画ー0.0% | | |
| Cineworld Group PLC, Exp. 11/23/25(3)(4) | 77,219 | 0 |
| | | 0 |
| 小売（食料およびドラッグを除く）ー0.0% | | |
| David' s Bridal, LLC, Exp. 11/26/22(2)(3)(4) | 2,292 | 0 |
| | | 0 |
| ワラント合計（認識された原価：0米ドル） | | 0 |

短期投資証券ー3.7%

| 細目 | 数量 | 時価 (米ドル) |
|---|------------|-------------|
| Morgan Stanley Institutional Liquidity Funds - Government Portfolio, Institutional Class, 2.88%(10) | 13,382,353 | 13,382,353 |
| 短期投資証券合計（認識された原価：13,382,353米ドル） | | 13,382,353 |

投資合計ー98.3%

| | | |
|--------------------------|--|-------------|
| （認識された原価：385,520,974米ドル） | | 358,624,745 |
| 未実行ローン契約控除ー（0.1）% | | (422,287) |
| 純投資ー98.2% | | |
| （認識された原価：385,098,687米ドル） | | 358,202,458 |
| 負債控除後その他の資産ー1.8% | | 6,804,027 |
| 純資産ー100.0% | | 365,006,485 |

投資有価証券明細表のそれぞれの投資カテゴリーに表示されているパーセンテージは純資産を基にしています。

- (1) 合計0.05%未満です。
- (2) 開示を目的とした公正価値測定では、当該証券はレベル3に分類されます。レベル3とは米国会計基準における3段階の公正価値評価法による価格で、市場での価格は観察不可能だが、市場関係者による最善の情報を仮定とした価格に相当します。
- (3) 無利息証券です。
- (4) 当該証券は、シニアローンの再構築に関連して取得されており、転売時に制限を受けることがあります。
- (5) シニア変動利付有価証券（シニアローン）は、余剰のキャッシュフローから繰上返済が要求されることや、債務者に自身の選択で返済を認めることがあります。債務者が返済する程度は、契約上の要求もしくは債務者の選択によるものであれ、正確に予測することはできません。結果として、実際の残存期間は記載された記載の満期より大幅に短くなる場合があります。ただし、シニアローンの一般的な予想平均残存期間は概ね2年から4年程度となっています。一般的にシニアローンの利率は、定期的に、基準貸出金利にスプレッドを加算することにより再算定されます。これらの基準貸出金利は、第一にロンドン・インターバンク・オファード・レート（「LIBOR」）、または担保付翌日物調達金利（「SOFR」）であり、第二に、単一もしくは複数の主要な米国銀行によって提示されるプライム・レート（「Prime Rate」）です。基準貸出金利は、フロア金利、すなわち最低金利が設定されることがあります。SOFRは通常、1か月物もしくは3か月物であり、信用スプレッド調整の対象になることがあります。シニアローンは通常、売買する前に満たす必要のある契約上の制限の対象となります。
- (6) 記載の利率は、2022年10月31日時点のシニアローンファシリティの契約の加重平均利率を表します。各契約の利率は、主として、週次、月次あるいは四半期毎に、基礎となる貸出利率、スプレッドおよび更改期間により再算定されます。
- (7) 当該シニアローンは、2022年10月31日以降に、受渡しされ利率が決定される予定です。
- (8) 未実行の、または一部未実行のローン契約です。記載の利率は、ローン実行部分がある場合にはその参照金利およびスプレッド、ならびに、ローン未実行部分に係るコミットメントフィーの加重平均利率を表します。2022年10月31日時点の未実行のローン契約額は396,750米ドルです。
- (9) 発行体は利息および／または元本の支払に関してデフォルト状態にあるか破産宣告しています。変動金利証券については、利息計上停止の状況を反映するために利率が調整されています。
- (10) 関連投資会社とみなされることがあります。表示の利回りは、2022年10月31日時点の7日間の年率換算利回りです。

略語：

DIP－占有債務者（Debtor In Possession）

LIBOR－ロンドン・インターバンク・オファード・レート（London Interbank Offered Rate）

PIK－約定繰延利息（Payment In Kind）

SOFR－担保付翌日物調達金利（Secured Overnight Financing Rate）

通貨略称

USD－米ドル

(2) 資産・負債計算書

(米ドル表示)

| 資産 | 2022年10月31日現在 |
|--|---------------|
| 関連当事者以外に係る投資－評価額（認識された原価：371,716,334米ドル） | 344,820,105 |
| 関連当事者に係る投資－評価額（認識された原価：13,382,353米ドル） | 13,382,353 |
| 現金 | 3,672,961 |
| 未収利息 | 1,381,696 |
| 関連当事者に係る未収配当 | 28,194 |
| 売却済投資に係る未収金 | 3,983,972 |
| 売却済参加型投資証券に係る未収金 | 1,214,409 |
| 前払費用 | 24,896 |
| 資産合計 | 368,508,586 |

| 負債 | |
|------------------|-------------|
| 購入済投資に係る未払金 | 219,924 |
| 償還済参加型投資証券に係る未払金 | 1,349,355 |
| 未払分配金 | 1,437,897 |
| 関連当事者に係る未払金： | |
| 投資顧問会社報酬 | 158,986 |
| 未払費用 | 335,939 |
| 負債合計 | 3,502,101 |
| 純資産 | 365,006,485 |

| 純資産の源泉 | |
|--------|--------------|
| 払込資本 | 427,995,357 |
| 累積損失 | (62,988,872) |
| 純資産 | 365,006,485 |

| クラス I 3 \$ シェアーズ | |
|--|------------|
| 純資産 | 37,049,027 |
| 参加型投資証券発行済口数 | 4,103,998 |
| 1口当たり純資産価額、発行価格および償還価格 (純資産 ÷ 参加型投資証券発行済口数) | 9.03 |

(3) 損益計算書

(米ドル表示)

| | 2022年10月31日終了年度 |
|--------------------------------|-----------------|
| 投資収益 | |
| 配当収益 (外国税18,786米ドル控除後) | 41,615 |
| 関連当事者からの配当収益 (外国税15,482米ドル控除後) | 139,269 |
| 利息収益 | 21,448,723 |
| 投資収益合計 | 21,629,607 |
| 費用 | |
| 投資顧問会社報酬 | 2,260,688 |
| 保管銀行報酬 | 201,201 |
| 名義書換および分配支払代理人報酬 | 160,285 |
| 法のおよび会計サービス | 106,299 |
| 印刷費用および送料 | 13,096 |
| 金利費用および報酬 | 169,877 |
| 雑費 | 20,906 |
| 費用合計 | 2,932,352 |
| 控除： | |
| 関連当事者による費用の放棄および／または償還 | 12,789 |
| 費用控除合計 | 12,789 |
| 純費用 | 2,919,563 |
| 純投資収益 | 18,710,044 |
| 実現および未実現利益 (損失) | |
| 実現純利益 (損失)： | |
| 投資取引 | (7,003,012) |
| 投資取引－関連当事者 | (3,927) |
| 実現純損失 | (7,006,939) |
| 未実現利益 (損失) 変動額： | |
| 投資 | (24,234,606) |
| 未実現利益 (損失) 純変動額 | (24,234,606) |
| 実現および未実現損失純額 | (31,241,545) |
| 営業による純資産の純減少額 | (12,531,501) |

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2023年4月5日）

（計算期間 2022年4月6日～2023年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2009年10月29日から無期限です。 |
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざします。 |
| 主要投資対象 | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 債券 組入比率 | 新株予約権 付社債 (転換社債) | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|--------|------|------------|------------------------|------------|-----------|
| | 期騰 | 落率 | | | | |
| 10期(2019年4月5日) | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2020年4月6日) | 10,098 | △0.0 | 79.4 | — | — | 16,167 |
| 12期(2021年4月5日) | 10,089 | △0.1 | 69.3 | — | — | 1,139 |
| 13期(2022年4月5日) | 10,080 | △0.1 | 62.4 | — | — | 1,064 |
| 14期(2023年4月5日) | 10,071 | △0.1 | 76.3 | — | — | 1,192 |
| 14期(2023年4月5日) | 10,063 | △0.1 | 71.8 | — | — | 1,253 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

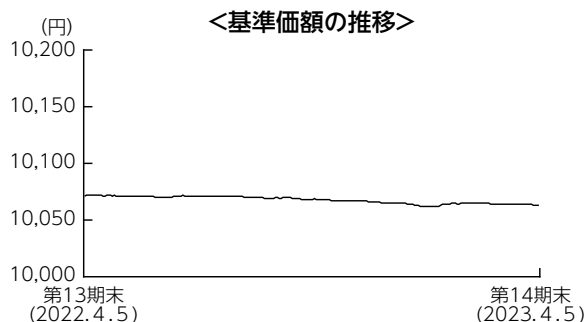
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|------------------------|---------|-------|-----------|---|-----------|
| | | | | | |
| (期 首) 2022年 4 月 5 日 | 10,071 | — | 76.3 | — | — |
| 4 月 末 | 10,071 | 0.0 | 76.3 | — | — |
| 5 月 末 | 10,071 | 0.0 | 76.3 | — | — |
| 6 月 末 | 10,071 | 0.0 | 75.5 | — | — |
| 7 月 末 | 10,071 | 0.0 | 75.5 | — | — |
| 8 月 末 | 10,069 | △0.0 | 75.5 | — | — |
| 9 月 末 | 10,068 | △0.0 | 75.5 | — | — |
| 10 月 末 | 10,067 | △0.0 | 75.6 | — | — |
| 11 月 末 | 10,065 | △0.1 | 75.9 | — | — |
| 12 月 末 | 10,062 | △0.1 | 75.9 | — | — |
| 2023年 1 月 末 | 10,064 | △0.1 | 75.3 | — | — |
| 2 月 末 | 10,064 | △0.1 | 75.3 | — | — |
| 3 月 末 | 10,063 | △0.1 | 71.8 | — | — |
| (期 末) 2023年 4 月 5 日 | 10,063 | △0.1 | 71.8 | — | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年4月6日から2023年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,063円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いましたが、日銀のマイナス金利政策の影響が大きく基準価額は前期末比で下落して期末を迎えました。

投資環境

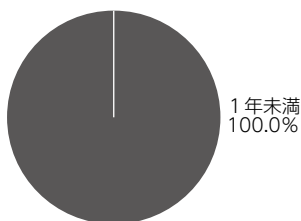
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

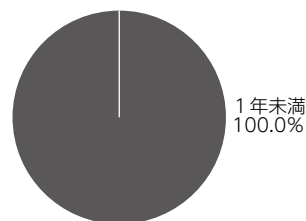
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

2023年4月9日に黒田日銀総裁の後任として植田和男氏が日銀総裁に就任しますが、新体制発足後も急速な金融引き締めは見込みにくく、金融政策は緩和的な状態を維持するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2022年4月6日から2023年4月5日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|---------|-----------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 901,029 | (910,000) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年4月6日から2023年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 区分 | 当 | | | 期 | | |
|-----------|--------------|--------------------|-------|--------------|--------------------|-------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金銭信託 | 百万円 0.028 | 百万円 0.028 | % | 百万円 0.028 | 百万円 0.028 | % |
| | | | 100.0 | | | 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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|---------|---------|---------|---------|-----------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 900,000 | 900,426 | 71.8 | — | — | — | 71.8 |
| 合 計 | 900,000 | 900,426 | 71.8 | — | — | — | 71.8 |

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 | | 末 | |
|--------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 4 2 4 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 200,000 | 200,020 | 2023/05/01 |
| 4 2 6 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 200,000 | 200,090 | 2023/07/01 |
| 4 2 7 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 200,000 | 200,102 | 2023/08/01 |
| 4 2 9 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 200,000 | 200,140 | 2023/10/01 |
| 4 3 0 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 100,000 | 100,074 | 2023/11/01 |
| 合 計 | — | 900,000 | 900,426 | — |

■投資信託財産の構成

2023年4月5日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 | % | 千円 | % |
| | 900,426 | 71.8 | 900,426 | 71.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 353,089 | 28.2 | 353,089 | 28.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,253,515 | 100.0 | 1,253,515 | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年4月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,253,515,428円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 353,078,860 |
| 公 社 | 900,426,000 |
| 未 収 利 息 | 10,144 |
| 前 払 費 用 | 424 |
| (B) 負 債 | - |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,253,515,428 |
| 元 本 | 1,245,658,613 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 7,856,815 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,245,658,613口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 10,063円 |

| | | | |
|--|----------------|--|----------------|
| (注1) 期首元本額 | 1,184,299,773円 | みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルレアルコース | 9,925円 |
| 追加設定元本額 | 67,418,522円 | マシュエズ・アジア株式ファンド | 29,641,137円 |
| 一部解約元本額 | 6,059,682円 | One世界分散セレクト (Aコース) | 99,040円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | One世界分散セレクト (Bコース) | 99,040円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし) | 15,843,407円 | One世界分散セレクト (Cコース) | 99,040円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり) | 13,867,169円 | 世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型) | 99,109円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型) | 1,088,285円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) | 188,380円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型) | 98,095円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし) | 109,063円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号 | 3,959,763円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり) | 297,442円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号 | 989,197円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし) | 118,977円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号 | 494,102円 | ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド | 99,255,584円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号 | 494,102円 | リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (F OF S 用) (適格機関投資家専用) | 27,831,876円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号 | 48,517円 | 期末元本合計 | 1,245,658,613円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号 | 395,083円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号 | 11,377円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号 | 98,027円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号 | 989,197円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号 | 395,083円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号 | 494,102円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号 | 494,102円 | | |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり> | 791,316円 | | |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし> | 2,474,972円 | | |
| クルーズコントロール | 990,000,991円 | | |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 39,586,646円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース> | 870,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース> | 530,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース> | 70,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース> | 10,530,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース> | 149,716円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース> | 5,972円 | | |
| USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり) | 993,740円 | | |
| USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし) | 1,987,479円 | | |
| DIAM・ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金> | 9,935円 | | |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース | 9,925円 | | |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース | 9,925円 | | |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース | 9,925円 | | |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース | 9,925円 | | |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース | 9,925円 | | |

■損益の状況

当期 自2022年4月6日 至2023年4月5日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|-------------|---|------------|
| (A) | 配当等収益 | | 276,679円 |
| | 受取利息 | | 389,729 |
| | 支払利息 | | △113,050 |
| (B) | 有価証券売買損益 | | △1,274,900 |
| | 売却 | | △1,274,900 |
| | 買入 | | |
| (C) | 当期損益金(A+B) | | △998,221 |
| (D) | 前期繰越損益金 | | 8,464,251 |
| (E) | 解約差損益金 | | △40,693 |
| (F) | 追加信託差損益金 | | 431,478 |
| (G) | 合計(C+D+E+F) | | 7,856,815 |
| | 次期繰越損益金(G) | | 7,856,815 |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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