

運用報告書 (全体版)

バンクローン・ファンド (ヘッジあり)

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	2012年12月17日から2027年12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。外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
主要投資対象	バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	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・ポートフォリオクラス13\$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)。
	D I A M 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・ポートフォリオクラス13\$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) D I A M マネーマザーファンド受益証券 各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向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、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
組入制限	バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	D I A M 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・配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、投資信託証券からの分配金水準等を参考に委託者が決定します。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。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

第137期	<決算日	2024年7月10日>
第138期	<決算日	2024年8月13日>
第139期	<決算日	2024年9月10日>
第140期	<決算日	2024年10月10日>
第141期	<決算日	2024年11月11日>
第142期	<決算日	2024年12月10日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「バンクローン・ファンド (ヘッジあり)」は、2024年12月10日に第142期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

アセットマネジメントOne 株式会社

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

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

バンクローン・ファンド（ヘッジあり）

■最近5作成期の運用実績

作成期	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 比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
第20作成期	113期(2022年7月11日)	円 8,185	円 20	% △3.2	3,161.59	% △3.0	% 97.5	% 0.5	百万円 2,151
	114期(2022年8月10日)	8,407	20	3.0	3,275.24	3.6	94.4	0.5	2,201
	115期(2022年9月12日)	8,352	20	△0.4	3,279.56	0.1	102.5	0.5	2,192
	116期(2022年10月11日)	8,191	20	△1.7	3,237.67	△1.3	98.2	0.5	2,149
	117期(2022年11月10日)	8,187	20	0.2	3,262.30	0.8	95.4	0.5	2,138
	118期(2022年12月12日)	8,181	20	0.2	3,284.37	0.7	105.1	0.6	1,910
第21作成期	119期(2023年1月10日)	8,204	20	0.5	3,330.89	1.4	94.1	0.6	1,912
	120期(2023年2月10日)	8,318	20	1.6	3,410.54	2.4	98.8	0.5	1,926
	121期(2023年3月10日)	8,271	20	△0.3	3,407.86	△0.1	99.7	0.5	1,906
	122期(2023年4月10日)	8,211	20	△0.5	3,408.60	0.0	96.0	0.5	1,868
	123期(2023年5月10日)	8,157	20	△0.4	3,426.92	0.5	97.9	0.6	1,854
第22作成期	124期(2023年6月12日)	8,183	20	0.6	3,457.58	0.9	99.0	0.5	1,853
	125期(2023年7月10日)	8,243	20	1.0	3,517.00	1.7	98.2	0.5	1,858
	126期(2023年8月10日)	8,251	20	0.3	3,553.84	1.0	99.1	0.5	1,861
	127期(2023年9月11日)	8,281	20	0.6	3,604.03	1.4	96.9	0.5	1,857
	128期(2023年10月10日)	8,229	20	△0.4	3,616.50	0.3	98.2	0.5	1,844
	129期(2023年11月10日)	8,213	20	0.0	3,646.26	0.8	97.6	0.5	1,837
第23作成期	130期(2023年12月11日)	8,215	20	0.3	3,681.00	1.0	93.1	0.5	1,815
	131期(2024年1月10日)	8,245	20	0.6	3,739.01	1.6	97.5	0.6	1,403
	132期(2024年2月13日)	8,228	20	0.0	3,764.70	0.7	98.5	0.6	1,396
	133期(2024年3月11日)	8,207	20	△0.0	3,800.90	1.0	94.2	0.6	1,393
	134期(2024年4月10日)	8,210	20	0.3	3,826.47	0.7	98.0	0.6	1,385
	135期(2024年5月10日)	8,219	20	0.4	3,859.33	0.9	98.9	0.8	1,350
第24作成期	136期(2024年6月10日)	8,193	20	△0.1	3,886.57	0.7	97.5	0.8	1,319
	137期(2024年7月10日)	8,153	20	△0.2	3,900.75	0.4	98.8	0.9	1,301
	138期(2024年8月13日)	8,115	20	△0.2	3,916.85	0.4	90.4	0.9	1,294
	139期(2024年9月10日)	8,122	20	0.3	3,952.64	0.9	93.4	0.9	1,288
	140期(2024年10月10日)	8,117	20	0.2	3,987.48	0.9	101.9	1.0	1,278
	141期(2024年11月11日)	8,121	20	0.3	4,016.00	0.7	98.7	0.9	1,272
	142期(2024年12月10日)	8,115	20	0.2	4,048.31	0.8	93.0	1.1	1,017

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」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。

(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当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)。

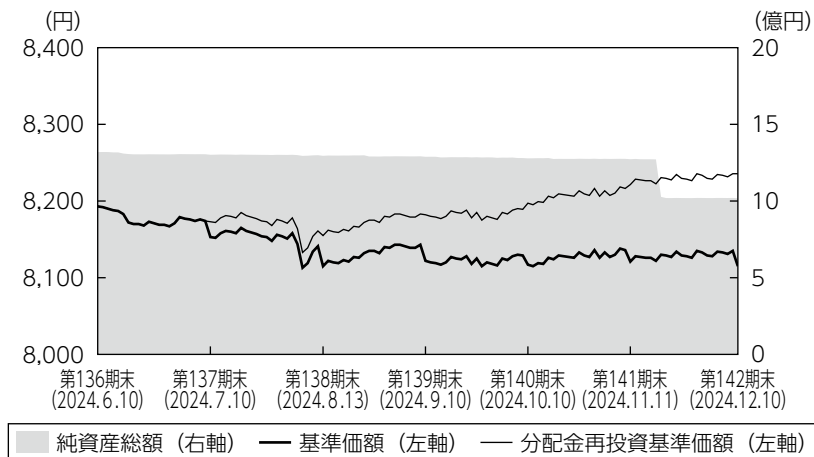
■過去 6 ヶ月間の基準価額と市況の推移

決 算 期	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	債 券 組 入
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	組 入 比 率	比 率
第137期	(期 首) 2024 年 6 月 10 日	円 8,193	% －	3,886.57	% －	% 97.5	% 0.8
	6 月 末	8,167	△0.3	3,888.70	0.1	98.7	0.9
	(期 末) 2024 年 7 月 10 日	8,173	△0.2	3,900.75	0.4	98.8	0.9
第138期	(期 首) 2024 年 7 月 10 日	8,153	－	3,900.75	－	98.8	0.9
	7 月 末	8,154	0.0	3,917.80	0.4	93.6	0.8
	(期 末) 2024 年 8 月 13 日	8,135	△0.2	3,916.85	0.4	90.4	0.9
第139期	(期 首) 2024 年 8 月 13 日	8,115	－	3,916.85	－	90.4	0.9
	8 月 末	8,139	0.3	3,942.20	0.6	94.5	0.9
	(期 末) 2024 年 9 月 10 日	8,142	0.3	3,952.64	0.9	93.4	0.9
第140期	(期 首) 2024 年 9 月 10 日	8,122	－	3,952.64	－	93.4	0.9
	9 月 末	8,120	△0.0	3,968.87	0.4	97.1	0.9
	(期 末) 2024 年 10 月 10 日	8,137	0.2	3,987.48	0.9	101.9	1.0
第141期	(期 首) 2024 年 10 月 10 日	8,117	－	3,987.48	－	101.9	1.0
	10 月 末	8,126	0.1	4,008.18	0.5	99.1	1.0
	(期 末) 2024 年 11 月 11 日	8,141	0.3	4,016.00	0.7	98.7	0.9
第142期	(期 首) 2024 年 11 月 11 日	8,121	－	4,016.00	－	98.7	0.9
	11 月 末	8,133	0.1	4,037.46	0.5	92.7	1.1
	(期 末) 2024 年 12 月 10 日	8,135	0.2	4,048.31	0.8	93.0	1.1

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注 2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」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。

■第137期～第142期の運用経過（2024年6月11日から2024年12月10日まで）

基準価額等の推移



第137期首： 8,193円
 第142期末： 8,115円
 （既払分配金120円）
 騰落率： 0.5%
 （分配金再投資ベース）

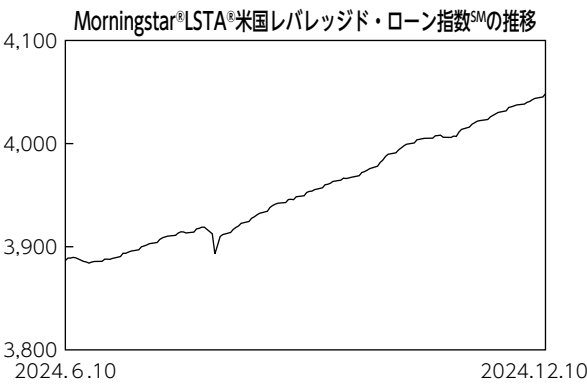
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

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。バンクローン市場の上昇により、当作成期間における基準価額（分配金再投資ベース）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。作成期初から2024年7月にかけて、米雇用統計や米インフレ指標の鈍化を受け、F R B（米連邦準備理事会）の早期利下げ観測が高まったことなどを背景に上昇しました。8月上旬にはリスク回避姿勢が急速に高まり、一時的に下落する場面もありましたが、その後は、F R Bの利下げ、堅調なマクロ経済指標や企業業績、トランプ新政権による財政拡張や規制緩和への期待、底堅いリスク選好などを背景に、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概ねプラス圏内で推移しました。日銀は2024年7月に政策金利を0.25%に引き上げましたが、同利回りの上昇は限定的に留まりました。

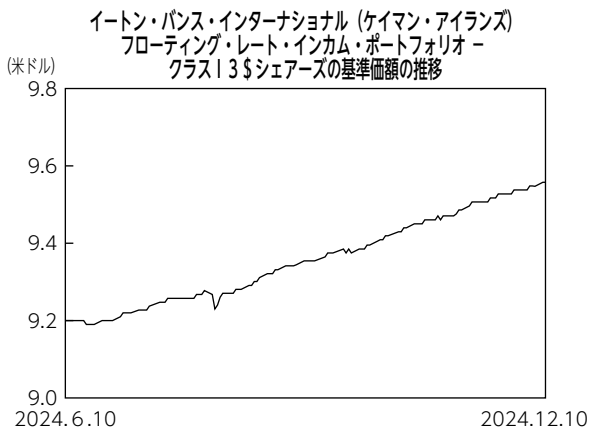
ポートフォリオについて

●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 AM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 AMマネーマザーファンドへの投資も行いました。加えて、外貨建て資産については、対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

●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。



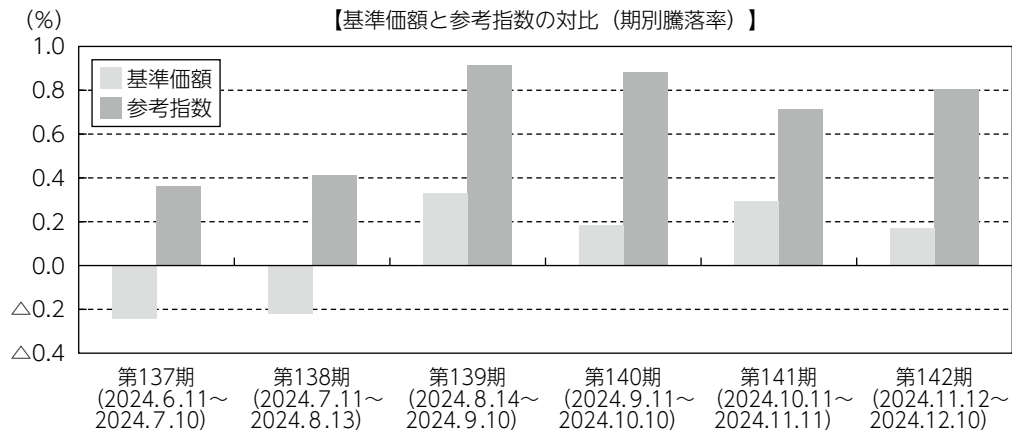
※基準価額は、当作成期間における分配金を再投資したものとみなして計算しています。

●D I AM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運用実績・分配原資等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。
なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期
	2024年6月11日 ～2024年7月10日	2024年7月11日 ～2024年8月13日	2024年8月14日 ～2024年9月10日	2024年9月11日 ～2024年10月10日	2024年10月11日 ～2024年11月11日	2024年11月12日 ～2024年12月10日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.24%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
当期の収益	20円	20円	20円	20円	20円	20円
当期の収益以外	－円	－円	－円	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	976円	996円	1,021円	1,049円	1,068円	1,089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 AM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。加えて、外貨建て資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

●バンクローン・ポートフォリオ

米国では、インフレ圧力が緩和する中、労働市場および個人消費は底堅く推移しており、持続的な経済成長が見られます。企業の資金調達も円滑に行われており、ソフトランディング・シナリオの可能性が高いと考えています。バンクローン市場は、高い利回り水準が下支え要因となり、当面、底堅い動きになると見えています。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 AMマネーマザーファンド

日銀は2024年10月の金融政策決定会合で、政策金利を0.25%とする金融政策を維持しました。日銀は今後政策金利の引き上げを行うと見られますが、そのペースは緩やかなものになると想定され、金利は引き続き安定的に推移することが見込まれます。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137期～第142期		項目の概要
	(2024年6月11日 ～2024年12月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	48円	0.595%	(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8,139円です。
（投信会社）	(16)	(0.193)	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）	(31)	(0.386)	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）	(1)	(0.016)	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
(b) その他費用	2	0.028	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.018)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.001)	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）	(1)	(0.009)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	51	0.623	

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

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

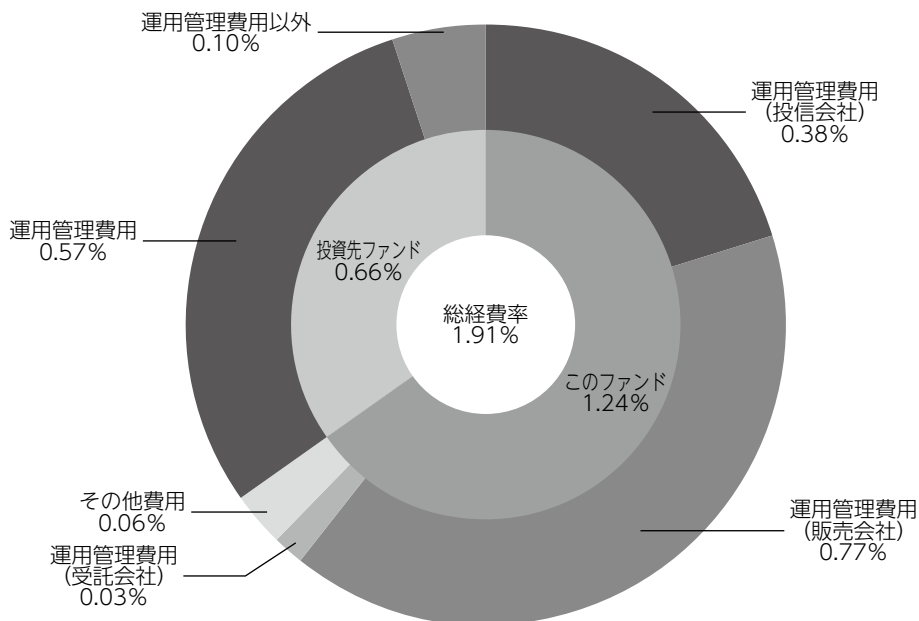
(注3) 比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.91%です。



総経費率 (①+②+③)	1.91%
①このファンドの費用の比率	1.24%
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	0.10%

(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**（2024年6月11日から2024年12月10日まで）
投資証券

		第 137 期 ～ 第 142 期			
		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□ 82.698585	千アメリカ・ドル 760	千□ 292.540469	千アメリカ・ドル 2,690

(注) 金額は受渡金です。

■**親投資信託受益証券の設定、解約状況**（2024年6月11日から2024年12月10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**（2024年6月11日から2024年12月10日まで）
【**バンクローン・ファンド（ヘッジあり）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等はありません。

【**D I AM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	第 137 期 ～ 第 142 期					
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
	百万円 6,697	百万円 1,099	% 16.4	百万円 1,019	百万円 －	% －
公 社 債						

平均保有割合 0.4%

(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、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第23作成期末	第 24 作 成 期 末			
	□ 数	□ 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
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	千□ 890.421126	千□ 680.579242	千アメリカ・ドル 6,247	千円 946,779	% 93.0
合 計	890.421126	680.579242	6,247	946,779	93.0

(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

	第 23 作 成 期 末	第 24 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 13,867	千□ 13,867	千円 13,944	

■投資信託財産の構成

2024年12月10日現在

項 目	第 24 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 946,779	% 92.7
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	13,944	1.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	60,464	5.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,021,188	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、952,875千円、93.3％です。
(注 3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年12月10日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝151.54円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月10日)、(2024年8月13日)、(2024年9月10日)、(2024年10月10日)、(2024年11月11日)、(2024年12月10日)現在

項 目	第 137 期 末	第 138 期 末	第 139 期 末	第 140 期 末	第 141 期 末	第 142 期 末
(A) 資 産	2,597,717,579円	2,468,470,152円	2,501,037,921円	2,593,916,135円	2,535,955,981円	1,969,377,995円
コール・ローン等	49,389,237	31,376,177	47,356,466	45,101,210	45,475,234	28,588,071
投資証券(評価額)	1,285,438,874	1,169,811,413	1,203,571,775	1,302,022,901	1,256,277,338	946,779,101
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド (評価額)	13,944,825	13,943,438	13,944,825	13,947,598	13,947,598	13,944,825
未 収 入 金	1,248,944,643	1,253,339,124	1,236,164,855	1,232,844,426	1,220,255,811	980,065,998
(B) 負 債	1,296,065,731	1,173,719,669	1,212,714,028	1,315,694,702	1,263,376,925	951,734,725
未 払 金	1,291,592,385	1,169,085,660	1,208,359,715	1,307,806,666	1,258,118,602	948,195,505
未 払 収 益 分 配 金	3,193,072	3,190,912	3,172,409	3,149,540	3,134,148	2,508,170
未 払 解 約 金	—	—	—	3,481,258	792,009	—
未 払 信 託 報 酬	1,277,134	1,439,561	1,179,007	1,254,148	1,328,901	1,028,513
そ の 他 未 払 費 用	3,140	3,536	2,897	3,090	3,265	2,537
(C) 純資産総額(A－B)	1,301,651,848	1,294,750,483	1,288,323,893	1,278,221,433	1,272,579,056	1,017,643,270
元 本	1,596,536,345	1,595,456,294	1,586,204,948	1,574,770,089	1,567,074,017	1,254,085,435
次 期 繰 越 損 益 金	△294,884,497	△300,705,811	△297,881,055	△296,548,656	△294,494,961	△236,442,165
(D) 受 益 権 総 口 数	1,596,536,345口	1,595,456,294口	1,586,204,948口	1,574,770,089口	1,567,074,017口	1,254,085,435口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,153円	8,115円	8,122円	8,117円	8,121円	8,115円

(注) 第136期末における元本額は1,610,098,479円、当作成期間（第137期～第142期）中における追加設定元本額は5,316,073円、同解約元本額は361,329,117円です。

■損益の状況

[自 2024年6月11日
至 2024年7月10日]
 [自 2024年7月11日
至 2024年8月13日]
 [自 2024年8月14日
至 2024年9月10日]
 [自 2024年 9月11日
至 2024年10月10日]
 [自 2024年10月11日
至 2024年11月11日]
 [自 2024年11月12日
至 2024年12月10日]

項 目	第 137 期	第 138 期	第 139 期	第 140 期	第 141 期	第 142 期
(A) 配 当 等 収 益	9,438,312円	8,032,947円	8,227,411円	9,033,946円	7,510,202円	6,107,408円
受 取 配 当 金	9,436,609	8,029,735	8,220,421	9,025,322	7,502,106	6,096,515
受 取 利 息	1,703	3,212	6,990	8,624	8,096	10,893
(B) 有価証券売買損益	△11,295,345	△9,356,303	△2,736,890	△5,358,271	△2,382,980	△3,314,492
売 買 益	46,707,160	126,190,509	111,891,564	97,571,842	108,403,968	73,526,615
売 買 損	△58,002,505	△135,546,812	△114,628,454	△102,930,113	△110,786,948	△76,841,107
(C) 信 託 報 酬 等	△1,338,183	△1,506,545	△1,236,881	△1,341,097	△1,388,730	△1,052,660
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△3,195,216	△2,829,901	4,253,640	2,334,578	3,738,492	1,740,256
(E) 前期繰越損益金	△251,999,072	△258,067,328	△262,408,086	△259,294,839	△258,690,962	△206,431,418
(F) 追加信託差損益金	△36,497,137	△36,617,670	△36,554,200	△36,438,855	△36,408,343	△29,242,833
(配当等相当額)	(16,326,588)	(16,393,948)	(16,379,284)	(16,343,742)	(16,348,405)	(13,145,449)
(売買損益相当額)	(△52,823,725)	(△53,011,618)	(△52,933,484)	(△52,782,597)	(△52,756,748)	(△42,388,282)
(G) 合 計(D+E+F)	△291,691,425	△297,514,899	△294,708,646	△293,399,116	△291,360,813	△233,933,995
(H) 収 益 分 配 金	△3,193,072	△3,190,912	△3,172,409	△3,149,540	△3,134,148	△2,508,170
次期繰越損益金(G+H)	△294,884,497	△300,705,811	△297,881,055	△296,548,656	△294,494,961	△236,442,165
追加信託差損益金	△36,497,137	△36,617,670	△36,554,200	△36,438,855	△36,408,343	△29,242,833
(配当等相当額)	(16,326,588)	(16,393,948)	(16,379,284)	(16,343,742)	(16,348,405)	(13,145,449)
(売買損益相当額)	(△52,823,725)	(△53,011,618)	(△52,933,484)	(△52,782,597)	(△52,756,748)	(△42,388,282)
分配準備積立金	139,497,009	142,660,428	145,571,982	148,984,571	151,161,092	123,454,743
繰越損益金	△397,884,369	△406,748,569	△406,898,837	△409,094,372	△409,247,710	△330,654,075

(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	第 137 期	第 138 期	第 139 期	第 140 期	第 141 期	第 142 期
(a) 経費控除後の配当等収益	8,100,715円	6,527,109円	6,991,529円	7,694,064円	6,123,345円	5,056,223円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	16,326,588	16,393,948	16,379,284	16,343,742	16,348,405	13,145,449
(d) 分 配 準 備 積 立 金	134,589,366	139,324,231	141,752,862	144,440,047	148,171,895	120,906,690
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	159,016,669	162,245,288	165,123,675	168,477,853	170,643,645	139,108,362
(f) 1万口当たり当期分配対象額	996.01	1,016.92	1,041.00	1,069.86	1,088.93	1,109.24
(g) 分 配 金	3,193,072	3,190,912	3,172,409	3,149,540	3,134,148	2,508,170
(h) 1万口当たり分配金	20	20	20	20	20	20

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 137 期	第 138 期	第 139 期	第 140 期	第 141 期	第 142 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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	・ 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す。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

2023年10月31日現在（米ドル表示）

普通株式－0.9%

銘柄名	数量	時価 (米ドル)
航空および軍需－0.0%		
IAP Global Services, LLC(1)(2)(3)	24	0
		0
化学－0.0%		
Flint Campfire Topco, Ltd., Class A(1)(2)(3)	42,249	0
		0
商業サービス・用品－0.1%		
Monitronics International, Inc.(2)(3)	11,525	242,025
Phoenix Services International, LLC(2)(3)	11,824	112,328
Phoenix Services International, LLC(2)(3)	1,079	10,250
		364,603
容器およびガラス製品－0.1%		
LG Newco Holdco, Inc.(2)(3)	49,671	285,608
		285,608
電子機器／電器－0.0%(4)		
Skillsoft Corp.(2)(3)	2,061	38,747
		38,747
エンターテインメント－0.1%		
New Cineworld, Ltd.(2)(3)	8,524	182,200
		182,200
ヘルスケア－0.0%		
Akorn Holding Company, LLC(1)(2)(3)	27,997	0
		0

銘柄名	数量	時価 (米ドル)
家庭用耐久財－0.4%		
Serta Simmons Bedding, Inc.(2)(3)	66,960	937,440
Serta SSB Equipment Co.(1)(2)(3)	66,960	0
		937,440
投資会社－0.0%(4)		
Aegletes B.V.(2)(3)	6,697	16,157
		16,157
非鉄金属／鉱物－0.1%		
ACNR Holdings, Inc., Class A(2)(3)	1,930	165,015
		165,015
石油およびガス－0.0%(4)		
AFG Holdings, Inc.(1)(2)(3)	25,000	49,500
McDermott International, Ltd.(2)(3)	58,491	15,793
		65,293
医薬品－0.0%(4)		
Covis Midco 1 S.a.r.l., Class A(2)(3)	383	196
Covis Midco 1 S.a.r.l., Class B(2)(3)	383	196
Covis Midco 1 S.a.r.l., Class C(2)(3)	383	195
Covis Midco 1 S.a.r.l., Class D(2)(3)	383	195
Covis Midco 1 S.a.r.l., Class E(2)(3)	383	195
		977
小売（食料およびドラッグを除く）－0.0%(4)		
Phillips Pet Holding Corp.(1)(2)(3)	173	6,893
		6,893
電気通信－0.0%		
Global Eagle Entertainment(1)(2)(3)	12,758	0
		0
公益－0.1%		
Longview Intermediate Holdings, LLC, Class A(3)	36,023	290,706
		290,706
普通株式合計（認識された原価：4,268,777米ドル）		2,353,639

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	73,708
8.375%, 5/1/27	164	100,504
社債合計（認識された原価：256,483米ドル）		174,212

優先株式－0.2%

銘柄名	数量	時価 (米ドル)
非鉄金属／鉱物－0.2%		
ACNR Holdings, Inc., 15.00% (PIK)(2)(3)	911	468,558
優先株式合計（認識された原価：0米ドル）		468,558

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－1.9%		
Dynasty Acquisition Co., Inc.:		
Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 8/24/28	1,223	1,210,677
Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 8/24/28	524	518,862
IAP Worldwide Services, Inc., Term Loan - Second Lien, 12.152%, (3 mo. USD LIBOR + 6.50%), 7/18/23(1)	166	126,973
TransDigm, Inc., Term Loan, 8.64%, (SOFR + 3.25%), 2/22/27	818	817,889
WP CPP Holdings, LLC, Term Loan, 9.29%, (SOFR + 3.75%), 4/30/25	2,274	2,192,440
		4,866,841
航空－1.8%		
American Airlines, Inc., Term Loan, 10.427%, (SOFR + 4.75%), 4/20/28	2,223	2,257,356
Mileage Plus Holdings, LLC, Term Loan, 10.798%, (SOFR + 5.25%), 6/21/27	2,100	2,166,501
		4,423,857
アパレル・贅沢品－0.2%		
Hanesbrands, Inc., Term Loan, 9.074%, (SOFR + 3.75%), 3/8/30	199	196,761
Samsonite International S.A., Term Loan, 8.074%, (SOFR + 2.75%), 6/21/30	249	250,206
		446,967
自動車部品－1.6%		
Adient US, LLC, Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 4/10/28	222	222,508
Autokiniton US Holdings, Inc., Term Loan, 9.939%, (SOFR + 4.50%), 4/6/28	709	695,990
DexKo Global, Inc.:		
Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 10/4/28	419	401,815
Term Loan, 9.64%, (SOFR + 4.25%), 10/4/28	575	556,852
Garrett LX I S.a.r.l., Term Loan, 8.895%, (SOFR + 3.25%), 4/30/28	245	243,366
Garrett Motion, Inc., Term Loan, 9.883%, (SOFR + 4.50%), 4/30/28	339	340,134
LSF12 Badger Bidco, LLC, Term Loan, 11.324%, (SOFR + 6.00%), 8/30/30	125	124,844
LTI Holdings, Inc.:		
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 9/6/25	309	295,088
Term Loan, 10.189%, (SOFR + 4.75%), 7/24/26	317	303,787
RealTruck Group, Inc.:		
Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 1/31/28	531	507,051
Term Loan, 10.406%, (SOFR + 5.00%), 1/31/28	300	287,718
		3,979,153
自動車－1.3%		
Bombardier Recreational Products, Inc., Term Loan, 7.424%, (SOFR + 2.00%), 5/24/27	1,999	1,984,455
MajorDrive Holdings IV, LLC, Term Loan, 9.652%, (SOFR + 4.00%), 6/1/28	1,251	1,218,902
		3,203,357
飲料－0.5%		
Arterra Wines Canada, Inc., Term Loan, 9.152%, (SOFR + 3.50%), 11/24/27	340	322,198
City Brewing Company, LLC, Term Loan, 9.164%, (SOFR + 3.50%), 4/5/28	245	181,485
Triton Water Holdings, Inc., Term Loan, 8.902%, (SOFR + 3.25%), 3/31/28	684	650,480
		1,154,163
バイオテクノロジー－1.2%		
Alkermes, Inc., Term Loan, 7.949%, (SOFR + 2.50%), 3/12/26	1,959	1,944,242
Alltech, Inc., Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 10/13/28	983	961,622
		2,905,864

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
建設関連製品－0.7%		
CPG International, Inc., Term Loan, 7.924%, (SOFR + 2.50%), 4/28/29	644	643,420
LHS Borrower, LLC, Term Loan, 10.174%, (SOFR + 4.75%), 2/16/29	563	493,898
MI Windows and Doors, LLC, Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 12/18/27	106	106,390
Standard Industries, Inc., Term Loan, 7.953%, (SOFR + 2.50%), 9/22/28	529	530,760
		1,774,468
資本市場－5.9%		
Advisor Group, Inc., Term Loan, 9.824%, (SOFR + 4.50%), 8/17/28	965	962,189
AllSpring Buyer, LLC, Term Loan, 8.949%, (SOFR + 3.25%), 11/1/28	493	480,341
Aretex Group, Inc.:		
Term Loan, 9.674%, (SOFR + 4.25%), 10/1/25	1,128	1,128,205
Term Loan, 9.924%, (SOFR + 4.50%), 8/9/30	374	364,243
Brookfield Property REIT, Inc., Term Loan, 7.924%, (SOFR + 2.50%), 8/27/25	450	446,269
Citadel Securities, L.P., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 7/29/30	324	323,701
Citco Funding, LLC, Term Loan, 8.633%, (SOFR + 3.25%), 4/27/28	350	350,656
Clipper Acquisitions Corp., Term Loan, 7.194%, (SOFR + 1.75%), 3/3/28	780	776,992
Edelman Financial Center, LLC, Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 4/7/28	1,873	1,844,411
EIG Management Company, LLC, Term Loan, 9.177%, (SOFR + 3.75%), 2/22/25	165	165,375
FinCo I, LLC, Term Loan, 8.383%, (SOFR + 3.00%), 6/27/29	549	548,899
Focus Financial Partners, LLC:		
Term Loan, 7.824%, (SOFR + 2.50%), 6/30/28	440	436,598
Term Loan, 8.574%, (SOFR + 3.25%), 6/30/28	563	561,110
Term Loan, 8.824%, (SOFR + 3.50%), 6/30/28	300	299,687
Franklin Square Holdings, L.P., Term Loan, 7.674%, (SOFR + 2.25%), 8/1/25	309	309,134
Guggenheim Partners, LLC, Term Loan, 8.64%, (SOFR + 3.25%), 12/12/29	720	719,863
Harbourvest Partners, LLC, Term Loan, 8.39%, (SOFR + 3.00%), 4/22/30	200	200,125
HighTower Holdings, LLC, Term Loan, 9.38%, (SOFR + 4.00%), 4/21/28	1,143	1,123,488
Hudson River Trading, LLC, Term Loan, 8.439%, (SOFR + 3.00%), 3/20/28	928	915,583
LPL Holdings, Inc., Term Loan, 7.165%, (SOFR + 1.75%), 11/12/26	866	868,236
Mariner Wealth Advisors, LLC, Term Loan, 8.901%, (SOFR + 3.25%), 8/18/28	933	919,334
Victory Capital Holdings, Inc.:		
Term Loan, 7.772%, (SOFR + 2.25%), 7/1/26	493	492,766
Term Loan, 7.772%, (SOFR + 2.25%), 12/29/28	624	621,650
		14,858,855
化学－3.9%		
Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc., Term Loan, 7.89%, (SOFR + 2.50%), 12/20/29	805	807,497
CPC Acquisition Corp., Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 12/29/27	913	722,558
Flint Group Midco Limited, Term Loan, 10.674%, (SOFR + 5.00%), 9.924% cash, 0.75% PIK, 12/31/26	74	68,970
Flint Group Topco Limited:		
Term Loan, 12.674%, (SOFR + 7.00%), 5.774% cash, 6.90% PIK, 12/31/27	36	26,489
Term Loan - Second Lien, 12.674%, (SOFR + 7.00%), 5.774% cash, 6.90% PIK, 12/31/27	48	8,721
Gemini HDPE, LLC, Term Loan, 8.645%, (SOFR + 3.00%), 12/31/27	243	242,768
GEON Performance Solutions, LLC, Term Loan, 10.402%, (SOFR + 4.75%), 8/18/28	490	480,200
Groupe Solmax, Inc., Term Loan, 10.303%, (SOFR + 4.75%), 5/29/28(6)	489	458,123
H.B. Fuller Company, Term Loan, 7.574%, (SOFR + 2.25%), 2/15/30	299	299,930
INEOS Enterprises Holdings US Finco, LLC, Term Loan, 9.272%, (SOFR + 3.75%), 7/8/30	475	465,104

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
化学（続き）		
INEOS Quattro Holdings UK, Ltd., Term Loan, 9.174%, (SOFR + 3.75%), 3/14/30	224	220,650
INEOS Styrolution US Holding, LLC, Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 1/29/26	1,150	1,132,056
INEOS US Finance, LLC, Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 2/18/30	424	416,916
Kraton Corporation, Term Loan, 8.921%, (SOFR + 3.25%), 3/15/29	246	234,861
Lonza Group AG, Term Loan, 9.415%, (SOFR + 3.93%), 7/3/28	1,420	1,206,022
Momentive Performance Materials, Inc., Term Loan, 9.824%, (SOFR + 4.50%), 3/29/28	423	403,846
Olympus Water US Holding Corporation:		
Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 11/9/28	712	695,929
Term Loan, 9.99%, (SOFR + 4.50%), 11/9/28	246	242,351
Orion Engineered Carbons GmbH, Term Loan, 7.64%, (SOFR + 2.15%), 9/24/28	196	193,550
SCUR-Alpha 1503 GmbH, Term Loan, 10.883%, (SOFR + 5.50%), 3/29/30	249	229,473
Starfruit Finco B.V., Term Loan, 9.423%, (SOFR + 4.00%), 4/3/28	324	317,163
Tronox Finance, LLC:		
Term Loan, 8.116%, (SOFR + 2.50%), 3/10/28(6)	538	528,321
Term Loan, 8.64%, (SOFR + 3.25%), 4/4/29	172	170,077
Term Loan, 8.824%, (SOFR + 3.50%), 8/16/28	225	222,188
		9,793,763
商業サービス・用品－2.7%		
Aramark Services, Inc., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 6/22/30	673	674,435
Asplundh Tree Expert, LLC, Term Loan, 7.174%, (SOFR + 1.75%), 9/7/27	437	437,284
Belfor Holdings, Inc.:		
Term Loan, 9.098%, (SOFR + 3.75%), 11/1/30	275	275,000
Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 4/6/26	336	336,404
Term Loan, 9.574%, (SOFR + 4.25%), 4/6/26	149	149,524
EnergySolutions, LLC, Term Loan, 9.382%, (SOFR + 4.00%), 9/20/30	843	839,123
GFL Environmental, Inc., Term Loan, 7.912%, (SOFR + 2.50%), 5/31/27	627	628,027
JFL-Tiger Acquisition Co., Inc., Term Loan, 10.403%, (SOFR + 5.00%), 10/17/30	325	321,344
LABL, Inc., Term Loan, 10.424%, (SOFR + 5.00%), 10/29/28	393	371,311
Monitronics International, Inc., Term Loan, 13.145%, (SOFR + 7.50%), 6/30/28	635	642,363
Phoenix Services International, LLC, Term Loan, 11.427%, (SOFR + 6.10%), 6/30/28	142	132,563
Prime Security Services Borrower, LLC, Term Loan, 7.829%, (SOFR + 2.50%), 10/14/30	1,225	1,223,578
Tempo Acquisition, LLC, Term Loan, 8.074%, (SOFR + 2.75%), 8/31/28	343	343,120
TMF Group Holding B.V., Term Loan, 10.414%, (SOFR + 5.00%), 5/3/28	175	175,109
TruGreen Limited Partnership, Term Loan, 9.424%, (SOFR + 4.00%), 11/2/27	219	205,793
		6,754,978
通信機器－0.1%		
Digi International, Inc., Term Loan, 10.439%, (SOFR + 5.00%), 11/1/28	183	183,184
		183,184
建設資材－0.6%		
Quikrete Holdings, Inc., Term Loan, 8.064%, (SOFR + 2.63%), 2/1/27	1,596	1,595,865
		1,595,865
生活必需品卸売および小売－0.3%		
Cardenas Markets, Inc., Term Loan, 12.24%, (SOFR + 6.75%), 8/1/29	199	199,020
Peer Holding III B.V., Term Loan, 10/19/30(7)	500	498,125
		697,145

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
容器および包装－0.8%		
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc., Term Loan, 9.599%, (SOFR + 4.18%), 4/13/29	1,457	1,411,565
Pretium Packaging, LLC, Term Loan - Second Lien, 9.995%, (SOFR + 4.60%), 10/2/28	299	227,893
Proampac PG Borrower, LLC, Term Loan, 10.585%, (SOFR + 4.50%), 9/15/28	500	494,792
		2,134,250
販売－0.0%(4)		
Phillips Feed Service, Inc., Term Loan, 12.427%, (SOFR + 7.00%), 11/13/24(1)	32	25,220
		25,220
各種消費者サービス－1.5%		
Ascend Learning, LLC:		
Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 12/11/28	927	865,487
Term Loan - Second Lien, 11.174%, (SOFR + 5.75%), 12/10/29	625	533,281
Belron Finance US, LLC, Term Loan, 8.056%, (SOFR + 2.43%), 4/13/28	341	341,634
Fugue Finance B.V., Term Loan, 9.354%, (SOFR + 4.00%), 1/31/28	846	846,436
KUEHG Corp., Term Loan, 10.39%, (SOFR + 5.00%), 6/12/30	625	625,279
Sotheby's, Term Loan, 10.156%, (SOFR + 4.50%), 1/15/27	547	530,990
Spring Education Group, Inc., Term Loan, 9.914%, (SOFR + 4.50%), 10/4/30	150	148,562
		3,891,669
各種電気通信サービス－0.5%		
CenturyLink, Inc., Term Loan, 7.689%, (SOFR + 2.25%), 3/15/27	1,395	1,052,055
GEE Holdings 2, LLC:		
Term Loan, 13.50%, (SOFR + 8.25%), 3/24/25	113	102,455
Term Loan - Second Lien, 13.75%, (SOFR + 8.25%), 7.00% cash, 6.75% PIK, 3/23/26	254	152,254
		1,306,764
電子装置、機器および部品－1.3%		
Creation Technologies, Inc., Term Loan, 11.176%, (SOFR + 5.50%), 10/5/28	493	466,644
Ingram Micro, Inc., Term Loan, 8.653%, (SOFR + 3.00%), 6/30/28	307	306,563
Mirion Technologies, Inc., Term Loan, 8.402%, (SOFR + 2.75%), 10/20/28	314	313,335
Robertshaw US Holding Corp.:		
Term Loan, 13.49%, (SOFR + 8.00%), 8.49% cash, 5.00% PIK, 2/28/27	157	158,229
Term Loan - Second Lien, 12.49%, (SOFR + 7.00%), 2/28/27	662	559,115
TTM Technologies, Inc., Term Loan, 8.065%, (SOFR + 2.75%), 5/30/30	249	249,531
Verifone Systems, Inc., Term Loan, 9.653%, (SOFR + 4.00%), 8/20/25	1,204	1,121,922
		3,175,339
エネルギー設備およびサービス－0.4%		
Ameriforge Group, Inc.:		
Term Loan, 16.735%, (SOFR + 13.00%), 12/29/23(1)(8)	114	90,774
Term Loan, 18.456%, (SOFR + 13.00%), 13.456% cash, 5.00% PIK, 12/29/23(1)(6)	893	712,673
GIP Pilot Acquisition Partners L.P., Term Loan, 8.388%, (SOFR + 3.00%), 10/4/30	200	200,000
Lealand Finance Company B.V., Term Loan, 12.439%, (SOFR + 7.00%), 9.439% cash, 3.00% PIK, 6/30/25	145	80,992
		1,084,439
土木および建設－0.5%		
American Residential Services, LLC, Term Loan, 9.152%, (SOFR + 3.50%), 10/15/27	219	218,539
Centuri Group, Inc., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 8/27/28	370	369,839
Northstar Group Services, Inc., Term Loan, 10.939%, (SOFR + 5.50%), 11/12/26	561	560,585
		1,148,963
エンターテインメント－1.1%		
Crown Finance US, Inc., Term Loan, 7.381%, (SOFR + 1.50%), 7/31/28	183	187,115

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（続き）		
Delta 2 (LUX) S.a.r.l., Term Loan, 7.574%, (SOFR + 2.25%), 1/15/30	2,075	2,069,813
Renaissance Holding Corp., Term Loan, 10.074%, (SOFR + 4.75%), 4/5/30	475	469,161
		2,726,089
金融サービス－1.0%		
Ditech Holding Corporation, Term Loan, 0.00%, 3/28/24(9)	1,083	119,090
GTCR W Merger Sub, LLC, Term Loan, 9/20/30(7)	1,325	1,316,956
NCR Atleos, LLC, Term Loan, 10.176%, (SOFR + 4.75%), 3/27/29	575	552,119
Walker & Dunlop, Inc., Term Loan, 7.674%, (SOFR + 2.25%), 12/16/28	565	563,996
		2,552,161
食品および生活必需品小売－0.6%		
US Foods, Inc.:		
Term Loan, 7.439%, (SOFR + 2.00%), 9/13/26	597	598,000
Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 11/22/28	922	924,606
		1,522,606
食料品－0.1%		
CHG PPC Parent, LLC, Term Loan, 8.439%, (SOFR + 3.00%), 12/8/28	246	243,771
		243,771
ガス－0.7%		
CQP Holdco, L.P., Term Loan, 8.99%, (SOFR + 3.50%), 6/5/28	1,786	1,786,951
		1,786,951
ヘルスケア機器および用品－1.6%		
Artivion, Inc., Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 6/1/27	330	320,116
Bayou Intermediate II, LLC, Term Loan, 10.128%, (SOFR + 4.50%), 8/2/28	319	306,540
Gloves Buyer, Inc., Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 12/29/27	439	423,629
ICU Medical, Inc., Term Loan, 8.04%, (SOFR + 2.50%), 1/8/29	345	344,068
Journey Personal Care Corp., Term Loan, 9.981%, (6 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/1/28	1,597	1,535,428
Medline Borrower, L.P., Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 10/23/28	1,221	1,214,386
		4,144,167
ヘルスケア・プロバイダーおよびヘルスケア・サービス－2.9%		
AEA International Holdings (Lux) S.a.r.l., Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 9/7/28	491	490,022
BW NHHC Holdco, Inc., Term Loan - Second Lien, 13.39%, (SOFR + 8.00%), 1/15/26	653	558,226
Cano Health, LLC, Term Loan, 9.533%, (SOFR + 4.00%), 11/23/27(6)	610	360,082
CCR Parent, Inc., Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 3/6/28	220	209,188
Covis Finco S.a.r.l., Term Loan, 12.04%, (SOFR + 6.50%), 2/18/27	472	339,686
Ensemble RCM, LLC, Term Loan, 9.233%, (SOFR + 3.75%), 8/3/26	174	174,229
Envision Healthcare Corporation:		
Term Loan, 0.00%, 3/31/27(9)	238	283,474
Term Loan - Second Lien, 0.00%, 3/31/27(9)	1,681	294,248
Medical Solutions Holdings, Inc., Term Loan, 8.772%, (SOFR + 3.25%), 11/1/28	764	714,012
National Mentor Holdings, Inc.:		
Term Loan, 9.187%, (SOFR + 3.75%), 3/2/28(6)	742	650,102
Term Loan, 9.24%, (SOFR + 3.75%), 3/2/28	22	19,322
Phoenix Guarantor, Inc.:		
Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 3/5/26	548	543,552
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 3/5/26	747	740,704

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)		
Radiology Partners, Inc., Term Loan, 10.179%, (SOFR + 4.25%), 7/9/25	574	429,824
Select Medical Corporation, Term Loan, 8.324%, (SOFR + 3.00%), 3/6/27	850	849,232
TTF Holdings, LLC, Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 3/31/28	216	216,206
U.S. Anesthesia Partners, Inc., Term Loan, 9.679%, (SOFR + 4.25%), 10/1/28	539	470,128
		7,342,237
ヘルスケア・テクノロジー－2.6%		
athenahealth Group, Inc., Term Loan, 8.577%, (SOFR + 3.25%), 2/15/29	1,188	1,151,694
Imprivata, Inc.:		
Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 12/1/27	1,881	1,875,839
Term Loan, 9.574%, (SOFR + 4.25%), 12/1/27	148	148,187
MedAssets Software Intermediate Holdings, Inc.:		
Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 12/18/28	591	469,106
Term Loan - Second Lien, 12.189%, (SOFR + 6.75%), 12/17/29	400	243,100
Navicure, Inc., Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 10/22/26	778	778,521
Symplr Software, Inc., Term Loan, 9.983%, (SOFR + 4.50%), 12/22/27	781	686,884
Verscend Holding Corp., Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 8/27/25	1,172	1,172,552
		6,525,883
ホテル、レストランおよびレジャー－4.1%		
1011778 B.C. Unlimited Liability Company, Term Loan, 7.574%, (SOFR + 2.25%), 9/20/30	1,836	1,825,739
Bally's Corporation, Term Loan, 8.927%, (SOFR + 3.25%), 10/2/28	440	411,691
Carnival Corporation, Term Loan, 8.336%, (SOFR + 3.00%), 8/8/27	788	774,235
ClubCorp Holdings, Inc., Term Loan, 8.19%, (1 mo. USD LIBOR + 2.75%), 9/18/26	1,144	1,121,129
Fertitta Entertainment, LLC, Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 1/27/29	832	815,031
Four Seasons Hotels Limited, Term Loan, 7.924%, (SOFR + 2.50%), 11/30/29	521	522,076
IRB Holding Corp., Term Loan, 8.424%, (SOFR + 3.00%), 12/15/27	695	688,110
Ontario Gaming GTA L.P., Term Loan, 9.64%, (SOFR + 4.25%), 8/1/30	175	175,078
Playa Resorts Holding B.V., Term Loan, 9.585%, (SOFR + 4.25%), 1/5/29	794	792,511
Scientific Games International, Inc., Term Loan, 8.435%, (SOFR + 3.00%), 4/14/29	667	666,682
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc., Term Loan, 8.439%, (SOFR + 3.00%), 8/25/28	441	440,816
SMG US Midco 2, Inc., Term Loan, 8.145%, (SOFR + 2.50%), 1/23/25	165	165,570
Stars Group Holdings B.V. (The), Term Loan, 7.902%, (SOFR + 2.25%), 7/21/26	1,990	1,990,978
		10,389,646
家庭用耐久財－2.3%		
ACProducts, Inc., Term Loan, 9.902%, (SOFR + 4.25%), 5/17/28	733	584,667
Libbey Glass, Inc., Term Loan, 11.939%, (SOFR + 6.50%), 11/22/27	2,885	2,747,741
Serta Simmons Bedding, LLC, Term Loan, 12.90%, (SOFR + 7.50%), 6/29/28	988	978,050
Solis IV B.V., Term Loan, 8.891%, (SOFR + 3.50%), 2/26/29	1,449	1,371,211
		5,681,669
家庭用品－0.4%		
Energizer Holdings, Inc., Term Loan, 7.703%, (SOFR + 2.25%), 12/22/27	305	304,404
Kronos Acquisition Holdings, Inc.:		
Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 12/22/26	438	429,663
Term Loan, 11.567%, (SOFR + 6.00%), 12/22/26	221	221,063
		955,130
保険－2.1%		
Alliant Holdings Intermediate, LLC:		

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
保険（続き）		
Term Loan, 8.835%, (SOFR + 3.50%), 11/5/27	117	116,477
Term Loan, 8.939%, (1 mo. USD LIBOR + 3.50%), 11/5/27	1,545	1,541,939
AmWINS Group, Inc., Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 2/19/28	372	371,862
AssuredPartners, Inc.:		
Term Loan, 8.824%, (SOFR + 3.50%), 2/12/27	443	439,870
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 2/12/27	1,040	1,032,294
HUB International Limited, Term Loan, 9.662%, (SOFR + 4.25%), 6/20/30	938	938,991
NFP Corp., Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 2/16/27	991	974,174
		5,415,607
インタラクティブメディアおよびサービス-0.6%		
Adevinta ASA, Term Loan, 8.322%, (SOFR + 2.75%), 6/26/28	350	350,542
Buzz Fincio, LLC, Term Loan, 8.174%, (SOFR + 2.75%), 1/29/27	241	241,401
Getty Images, Inc., Term Loan, 9.99%, (SOFR + 4.50%), 2/19/26	560	561,736
Match Group, Inc., Term Loan, 7.298%, (SOFR + 1.75%), 2/13/27	325	324,086
		1,477,765
情報技術サービス-4.1%		
Asurion, LLC:		
Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 7/31/27	683	652,641
Term Loan - Second Lien, 10.689%, (SOFR + 5.25%), 1/31/28	860	750,709
Term Loan - Second Lien, 10.689%, (SOFR + 5.25%), 1/20/29	800	687,313
Cyxtera DC Holdings, Inc.:		
DIP Loan, 13.951%, (SOFR + 8.50%), 12/7/23	621	624,815
Term Loan, 0.00%, 5/1/24(9)	1,484	868,396
Term Loan, 0.00%, 5/1/24(9)	752	441,899
Endure Digital, Inc., Term Loan, 9.422%, (SOFR + 3.50%), 2/10/28	1,442	1,342,012
Gainwell Acquisition Corp., Term Loan, 9.49%, (SOFR + 4.00%), 10/1/27	1,678	1,608,430
Go Daddy Operating Company, LLC, Term Loan, 7.439%, (SOFR + 2.00%), 8/10/27	435	435,557
Informatica, LLC, Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 10/27/28	1,404	1,402,529
NAB Holdings, LLC, Term Loan, 8.54%, (SOFR + 3.00%), 11/23/28	883	878,186
Sedgwick Claims Management Services, Inc., Term Loan, 9.074%, (SOFR + 3.75%), 2/24/28	597	595,711
WEX, Inc., Term Loan, 7.689%, (SOFR + 2.25%), 3/31/28	171	170,743
		10,458,941
レジャー用品-0.8%		
Fender Musical Instruments Corporation, Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 12/1/28	172	165,995
Hayward Industries, Inc., Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 5/30/28	1,788	1,760,816
SRAM, LLC, Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 5/18/28	83	82,747
		2,009,558
ライフサイエンス・ツールおよびサービス-3.2%		
Avantor Funding, Inc., Term Loan, 7.674%, (SOFR + 2.25%), 11/8/27	912	912,832
Catalent Pharma Solutions, Inc., Term Loan, 7.453%, (SOFR + 2.00%), 2/22/28	456	444,477
Curia Global, Inc., Term Loan, 9.233%, (SOFR + 3.75%), 8/30/26(6)	1,165	938,504
ICON Luxembourg S.a.r.l., Term Loan, 7.902%, (SOFR + 2.25%), 7/3/28	2,198	2,201,449
IQVIA, Inc., Term Loan, 7.402%, (SOFR + 1.75%), 1/17/25	760	762,250
Loire Fincio Luxembourg S.a.r.l., Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 4/21/27	145	141,746

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
ライフサイエンス・ツールおよびサービス（続き）		
Packaging Coordinators Midco, Inc., Term Loan, 9.152%, (SOFR + 3.50%), 11/30/27	1,541	1,525,526
PRA Health Sciences, Inc., Term Loan, 7.902%, (SOFR + 2.25%), 7/3/28	548	548,492
Star Parent, Term Loan, 9.386%, (3 mo. USD LIBOR + 4.00%), 9/27/30	625	598,112
		8,073,388
機械－4.8%		
Al Aqua Merger Sub, Inc., Term Loan, 9.082%, (SOFR + 3.75%), 7/31/28	1,037	1,017,866
Albion Financing 3 S.a.r.l.:		
Term Loan, 10.883%, (SOFR + 5.50%), 8/17/26	149	149,157
Term Loan, 10.924%, (SOFR + 5.25%), 8/17/26	835	835,125
Ali Group North America Corporation, Term Loan, 7.439%, (SOFR + 2.00%), 7/30/29	664	663,805
American Trailer World Corp., Term Loan, 9.174%, (SOFR + 3.75%), 3/3/28	354	332,812
Apex Tool Group, LLC, Term Loan, 10.689%, (SOFR + 5.25%), 2/8/29	1,167	995,365
Barnes Group, Inc., Term Loan, 8.424%, (SOFR + 3.00%), 9/3/30	225	223,524
Clark Equipment Company, Term Loan, 7.99%, (SOFR + 2.50%), 4/20/29	477	478,117
Conair Holdings, LLC, Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 5/17/28	1,127	1,047,406
CPM Holdings, Inc., Term Loan, 9.827%, (SOFR + 4.50%), 9/28/28	1,617	1,618,921
Delachaux Group S.A., Term Loan, 9.88%, (SOFR + 4.50%), 4/16/26	175	175,000
EMRLD Borrower, L.P., Term Loan, 8.38%, (SOFR + 3.00%), 5/31/30	525	524,672
Engineered Machinery Holdings, Inc., Term Loan, 9.152%, (SOFR + 3.50%), 5/19/28	1,387	1,375,246
Gates Global, LLC, Term Loan, 7.924%, (SOFR + 2.50%), 3/31/27	1,587	1,586,241
Icebox Holdco III, Inc., Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 12/22/28	488	479,018
Titan Acquisition Limited, Term Loan, 8.731%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 3/28/25	706	695,837
		12,198,112
メディア－1.6%		
Hubbard Radio, LLC, Term Loan, 9.69%, (1 mo. USD LIBOR + 4.25%), 3/28/25	640	541,748
Mission Broadcasting, Inc., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 6/2/28	147	146,877
MJH Healthcare Holdings, LLC, Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 1/28/29	172	170,867
Nexstar Broadcasting, Inc., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 9/18/26	127	127,439
Recorded Books, Inc., Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 8/29/25	431	430,741
Sinclair Television Group, Inc., Term Loan, 8.439%, (SOFR + 3.00%), 4/1/28	1,955	1,411,615
Univision Communications, Inc.:		
Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 3/15/26	411	408,528
Term Loan, 9.64%, (SOFR + 4.25%), 6/24/29	780	780,125
		4,017,940
金属／鉱物－1.4%		
Arsenal AIC Parent, LLC, Term Loan, 9.879%, (SOFR + 4.50%), 8/18/30	350	349,781
Dynacast International, LLC:		
Term Loan, 10.017%, (SOFR + 4.50%), 7/22/25	663	622,010
Term Loan, 14.517%, (SOFR + 9.00%), 10/22/25	256	193,349
PMHC II, Inc., Term Loan, 9.807%, (SOFR + 4.25%), 4/23/29	496	452,704
WireCo WorldGroup, Inc., Term Loan, 9.699%, (SOFR + 4.25%), 11/13/28	966	962,388
Zekelman Industries, Inc., Term Loan, 7.449%, (SOFR + 2.00%), 1/24/27	930	928,822
		3,509,054
石油、ガスおよび消耗燃料－1.3%		
Freeport LNG Investments, LLP, Term Loan, 9.177%, (SOFR + 3.50%), 12/21/28	853	839,682
GIP II Blue Holding, L.P., Term Loan, 9.939%, (SOFR + 4.50%), 9/29/28	1,112	1,114,954

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
石油、ガスおよび消耗燃料（続き）		
ITT Holdings, LLC, Term Loan, 10/5/30(7)	375	369,961
Oxbow Carbon, LLC, Term Loan, 9.457%, (SOFR + 4.00%), 5/10/30(6)	274	274,141
QuarterNorth Energy Holding, Inc., Term Loan - Second Lien, 13.439%, (SOFR + 8.00%), 8/27/26	319	319,172
UGI Energy Services, LLC, Term Loan, 8.674%, (SOFR + 3.25%), 2/22/30	479	479,143
		3,397,053
紙製品および林産物－0.2%		
Spa Holdings 3 Oy, Term Loan, 9.652%, (SOFR + 4.00%), 2/4/28	488	471,385
		471,385
医薬品－1.2%		
Bausch Health Companies, Inc., Term Loan, 10.689%, (SOFR + 5.25%), 2/1/27	663	520,328
Ceva Sante Animale, Term Loan, 11/1/30(7)	175	175,219
Jazz Financing Lux S.a.r.l., Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 5/5/28	594	595,150
Mallinckrodt International Finance S.A.:		
DIP Loan, 13.439%, (SOFR + 8.00%), 8/28/24	76	79,160
DIP Loan, 13.451%, (SOFR + 8.00%), 8/28/24	144	150,030
Term Loan, 12.703%, (SOFR + 7.25%), 9/30/27	1,785	1,359,226
Term Loan, 12.953%, (SOFR + 7.50%), 9/30/27	360	275,283
		3,154,396
専門サービス－3.9%		
APFS Staffing Holdings, Inc., Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 12/29/28	172	169,574
CoreLogic, Inc., Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 6/2/28	1,613	1,471,796
Corporation Service Company, Term Loan, 8.674%, (SOFR + 3.25%), 11/2/29	194	193,879
Deerfield Dakota Holding, LLC, Term Loan, 9.14%, (SOFR + 3.75%), 4/9/27	964	933,116
EAB Global, Inc., Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 8/16/28	1,277	1,257,612
Employbridge Holding Company, Term Loan, 10.407%, (SOFR + 4.75%), 7/19/28	686	598,321
First Advantage Holdings, LLC, Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 1/31/27	257	257,572
Genuine Financial Holdings, LLC, Term Loan, 9.40%, (SOFR + 4.00%), 9/27/30	175	173,414
Neptune Bidco US, Inc., Term Loan, 10.507%, (SOFR + 5.00%), 4/11/29	1,070	941,103
Rockwood Service Corporation, Term Loan, 9.439%, (SOFR + 4.00%), 1/23/27	1,237	1,239,412
Saphilux S.a.r.l., Term Loan, 10.154%, (SOFR + 4.75%), 7/18/28	425	425,000
Thevelia (US), LLC, Term Loan, 10.286%, (SOFR + 4.75%), 6/18/29	550	550,458
Trans Union, LLC, Term Loan, 7.689%, (SOFR + 2.25%), 12/1/28	1,378	1,377,698
Vaco Holdings, LLC, Term Loan, 10.393%, (SOFR + 5.00%), 1/21/29	172	163,126
		9,752,081
不動産管理および開発－1.0%		
Cushman & Wakefield U.S. Borrower, LLC:		
Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 8/21/25	36	36,383
Term Loan, 8.674%, (SOFR + 3.25%), 1/31/30	770	736,822
Term Loan, 9.324%, (SOFR + 4.00%), 1/31/30	316	302,198
Greystar Real Estate Partners, LLC, Term Loan, 9.147%, (SOFR + 3.75%), 8/21/30	275	275,000
Homeserve USA Holding Corp., Term Loan, 8.416%, (SOFR + 3.00%), 10/21/30	425	423,937
RE/MAX International, Inc., Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 7/21/28	709	684,061
		2,458,401
陸運および鉄道－1.3%		
First Student Bidco, Inc.:		
Term Loan, 8.652%, (3 mo. USD LIBOR + 3.00%), 7/21/28	182	176,715

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
陸運および鉄道 (続き)		
Term Loan, 8.655%, (SOFR + 3.00%), 7/21/28	484	470,170
Term Loan, 9.49%, (SOFR + 4.00%), 7/21/28	441	432,332
Term Loan, 9.49%, (SOFR + 4.00%), 7/21/28	31	30,253
Grab Holdings, Inc., Term Loan, 9.939%, (SOFR + 4.50%), 1/29/26	718	721,193
Hertz Corporation (The):		
Term Loan, 8.691%, (SOFR + 3.25%), 6/30/28	452	449,337
Term Loan, 8.691%, (SOFR + 3.25%), 6/30/28	87	86,632
Uber Technologies, Inc., Term Loan, 8.159%, (SOFR + 2.75%), 3/3/30	1,041	1,041,637
		3,408,269
半導体および半導体製造装置－0.6%		
Altair Bidco, Inc., Term Loan, 8.142%, (SOFR + 3.10%), 2/1/29(6)	691	686,004
Bright Bidco B.V., Term Loan, 14.378%, (SOFR + 9.00%), 6.378% cash, 8.00% PIK, 10/31/27	211	82,691
Entegris, Inc., Term Loan, 7.89%, (SOFR + 2.50%), 7/6/29	668	669,583
MaxLinear, Inc., Term Loan, 7.689%, (SOFR + 2.25%), 6/23/28	125	123,125
		1,561,403
ソフトウェア－15.4%		
Applied Systems, Inc., Term Loan, 9.89%, (SOFR + 4.50%), 9/18/26	2,915	2,924,446
AppLovin Corporation, Term Loan, 8.424%, (SOFR + 3.10%), 8/16/30	1,250	1,248,520
Astra Acquisition Corp.:		
Term Loan, 10.902%, (SOFR + 5.25%), 10/25/28	579	397,051
Term Loan - Second Lien, 14.527%, (SOFR + 8.88%), 10/25/29	900	472,386
Banff Merger Sub, Inc., Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 10/2/25	902	902,010
Cast and Crew Payroll, LLC, Term Loan, 8.825%, (SOFR + 3.50%), 2/9/26	731	718,686
Central Parent, Inc., Term Loan, 9.406%, (SOFR + 4.00%), 7/6/29	1,563	1,556,703
CentralSquare Technologies, LLC, Term Loan, 9.29%, (SOFR + 3.75%), 8/29/25	982	929,042
Cloud Software Group, Inc., Term Loan, 9.99%, (SOFR + 4.50%), 3/30/29(6)	1,294	1,231,574
Cloudera, Inc., Term Loan, 9.174%, (SOFR + 3.75%), 10/8/28	582	561,442
Constant Contact, Inc., Term Loan, 9.687%, (SOFR + 4.00%), 2/10/28	688	639,311
Cornerstone OnDemand, Inc., Term Loan, 9.189%, (SOFR + 3.75%), 10/16/28	690	652,654
Delta TopCo, Inc., Term Loan, 9.069%, (SOFR + 3.75%), 12/1/27	1,269	1,251,548
E2open, LLC, Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 2/4/28	637	629,483
ECI Macola Max Holding, LLC, Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 11/9/27	1,985	1,977,404
Epicor Software Corporation, Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 7/30/27	2,580	2,570,808
Fiserv Investment Solutions, Inc., Term Loan, 9.383%, (SOFR + 4.00%), 2/18/27	242	227,287
GoTo Group, Inc., Term Loan, 10.283%, (SOFR + 4.75%), 8/31/27	1,440	911,668
Instructure Holdings, Inc., Term Loan, 8.679%, (SOFR + 2.75%), 10/30/28	985	983,769
iSolved, Inc., Term Loan, 9.484%, (SOFR + 4.00%), 10/14/30	225	225,422
Ivanti Software, Inc., Term Loan, 9.907%, (SOFR + 4.25%), 12/1/27	801	714,504
Magenta Buyer, LLC:		
Term Loan, 10.645%, (SOFR + 5.00%), 7/27/28	817	571,850
Term Loan - Second Lien, 13.895%, (SOFR + 8.25%), 7/27/29	225	97,425
Maverick Bidco, Inc., Term Loan, 9.283%, (SOFR + 3.75%), 5/18/28	368	359,790
McAfee, LLC, Term Loan, 9.165%, (SOFR + 3.75%), 3/1/29	1,060	1,014,889
Open Text Corporation, Term Loan, 8.174%, (SOFR + 2.75%), 1/31/30	802	802,412
Proofpoint, Inc., Term Loan, 8.689%, (SOFR + 3.25%), 8/31/28	1,814	1,786,206
Quartz Acquireco, LLC, Term Loan, 8.824%, (SOFR + 3.50%), 6/28/30	375	375,000

債務者／細目	額面 (千米ドル)	時価 (米ドル)
ソフトウェア（続き）		
Quest Software US Holdings, Inc., Term Loan, 9.783%, (SOFR + 4.25%), 2/1/29	1,753	1,395,363
Red Planet Borrower, LLC, Term Loan, 9.174%, (SOFR + 3.75%), 10/2/28	1,046	979,067
Redstone Holdco 2, L.P., Term Loan, 10.189%, (SOFR + 4.75%), 4/27/28	871	700,415
Sabre GBLB, Inc.:		
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 12/17/27	502	429,816
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 12/17/27	321	275,060
Skillsoft Corporation, Term Loan, 10.699%, (SOFR + 5.25%), 7/14/28	396	363,362
Sophia, L.P.:		
Term Loan, 8.924%, (SOFR + 3.50%), 10/7/27	481	475,719
Term Loan, 9.574%, (SOFR + 4.25%), 10/7/27	1,531	1,516,754
SS&C Technologies, Inc.:		
Term Loan, 7.674%, (SOFR + 2.25%), 3/22/29	153	152,626
Term Loan, 7.674%, (SOFR + 2.25%), 3/22/29	242	241,773
Turing Midco, LLC, Term Loan, 7.939%, (SOFR + 2.50%), 3/24/28	62	62,195
Ultimate Software Group, Inc. (The):		
Term Loan, 8.764%, (SOFR + 3.25%), 5/4/26	2,202	2,192,957
Term Loan, 9.233%, (SOFR + 3.75%), 5/4/26	1,350	1,348,494
Veritas US, Inc., Term Loan, 10.439%, (SOFR + 5.11%), 9/1/25	762	647,117
Vision Solutions, Inc., Term Loan, 9.64%, (SOFR + 4.00%), 4/24/28	1,520	1,452,240
		38,966,248
専門小売－1.7%		
Great Outdoors Group, LLC, Term Loan, 9.402%, (SOFR + 3.75%), 3/6/28	2,189	2,175,962
Harbor Freight Tools USA, Inc., Term Loan, 8.189%, (SOFR + 2.75%), 10/19/27	1,003	992,257
Hoya Midco, LLC, Term Loan, 8.633%, (SOFR + 3.25%), 2/3/29	366	366,213
Mattress Firm, Inc., Term Loan, 9.95%, (6 mo. USD LIBOR + 4.25%), 9/25/28	708	701,041
		4,235,473
商社および流通業－2.8%		
Avolon TLB Borrower 1 (US), LLC, Term Loan, 7.689%, (SOFR + 2.25%), 12/1/27	1,148	1,149,136
Core & Main, L.P., Term Loan, 7.967%, (SOFR + 2.50%), 7/27/28(6)	587	586,720
Delos Aircraft Designated Activity Co., Term Loan, 7.402%, (SOFR + 2.00%), 10/31/27	175	175,175
DXP Enterprises, Inc., Term Loan, 10.291%, (SOFR + 4.75%), 10/11/30	325	323,375
Electro Rent Corporation, Term Loan, 11.002%, (SOFR + 5.50%), 11/1/24	938	881,294
PEARLS (Netherlands) Bidco B.V., Term Loan, 9.133%, (SOFR + 3.75%), 2/26/29	837	829,575
Spin Holdco, Inc., Term Loan, 9.664%, (SOFR + 4.00%), 3/4/28	2,291	1,968,944
SRS Distribution, Inc.:		
Term Loan, 8.825%, (SOFR + 3.50%), 6/2/28	221	216,586
Term Loan, 8.939%, (SOFR + 3.50%), 6/2/28	415	406,765
Windsor Holdings III, LLC, Term Loan, 9.815%, (SOFR + 4.50%), 8/1/30	475	474,131
		7,011,701
無線通信サービス－0.2%		
Digicel International Finance Limited, Term Loan, 8.902%, (3 mo. USD LIBOR + 3.25%), 5/28/24	517	476,078
		476,078
シニア変動利付有価証券合計（認識された原価：247,056,696米ドル）		235,328,267

短期投資証券－4.7%

細目	数量	時価 (米ドル)
Morgan Stanley Institutional Liquidity Funds - Government Portfolio, Institutional Class, 5.25%(10)	12,021,089	12,021,089
短期投資証券合計（認識された原価：12,021,089米ドル）		12,021,089
投資合計－99.2% （認識された原価：263,603,045米ドル）		250,345,765
未実行ローン契約控除－(0.0)%(4)		(10,632)
純投資－99.2% （認識された原価：263,592,413米ドル）		250,335,133
負債控除後その他の資産－0.8%		1,914,217
純資産－100.0%		252,249,350

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) 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。
- (2) 無利息証券です。
- (3) 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。
- (4) 合計0.05%または(0.05)%未満です。
- (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ことがあります。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、第一に担保付翌日物調達金利(「SOFR」)(または2023年6月30日のロンドン・インターバンク・オファード・レート(「LIBOR」)廃止前に金利が再設定されたローンについてはLIBOR)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、2023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、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、2023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。2023年10月31日時点の未実行のローン契約額は8,482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、2023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	2023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：251,571,324米ドル）	238,314,044
関連当事者に係る投資－評価額（認識された原価：12,021,089米ドル）	12,021,089
現金	2,718,573
未収利息	1,187,987
関連当事者に係る未収配当	67,323
売却済投資に係る未収金	1,505,373
売却済参加型投資証券に係る未収金	849,141
借入枠に関する前払アップフロントフィー	17,429
前払費用	3,864
資産合計	256,684,823

負債	
購入済投資に係る未払金	2,747,982
償還済参加型投資証券に係る未払金	277,401
未払分配金	1,037,571
関連当事者に係る未払金：	
投資顧問会社報酬	108,751
未払費用	263,768
負債合計	4,435,473
純資産	252,249,350

純資産の源泉	
払込資本	310,327,724
累積損失	(58,078,374)
純資産	252,249,350

クラス I 3 \$ シェアーズ	
純資産	31,590,836
参加型投資証券発行済口数	3,442,007
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)	9.18

(3) 損益計算書

(米ドル表示)

投資収益	2023年10月31日終了年度
配当収益（外国税10,156米ドル控除後）	237,458
関連当事者からの配当収益（外国税110,158米ドル控除後）	281,260
利息収益	26,436,284
投資収益合計	26,955,002
費用	
投資顧問会社報酬	1,493,251
保管銀行報酬	126,917
名義書換および分配支払代理人報酬	146,835
法的および会計サービス	121,931
印刷費用および送料	5,988
金利費用および報酬	138,274
雑費	19,538
費用合計	2,052,734
控除：	
関連当事者による費用の放棄および／または償還	13,631
費用控除合計	13,631
純費用	2,039,103
純投資収益	24,915,899
実現および未実現利益（損失）	
実現純利益（損失）：	
投資取引	(8,745,768)
実現純損失	(8,745,768)
未実現利益（損失）変動額：	
投資	13,638,949
未実現利益（損失）純変動額	13,638,949
実現および未実現利益純額	4,893,181
営業による純資産の純増加額	29,809,080

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2024年4月5日）

（計算期間 2023年4月6日～2024年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第15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	期 中 率		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 額
		騰	落				
11期(2020年4月6日)	円	%		%	%	%	百万円 1,139
12期(2021年4月5日)	10,089	△0.1		69.3	—	—	1,064
13期(2022年4月5日)	10,080	△0.1		62.4	—	—	1,192
14期(2023年4月5日)	10,071	△0.1		76.3	—	—	1,253
15期(2024年4月5日)	10,063	△0.1		71.8	—	—	1,253
	10,055	△0.1		62.0	—	—	483

(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。

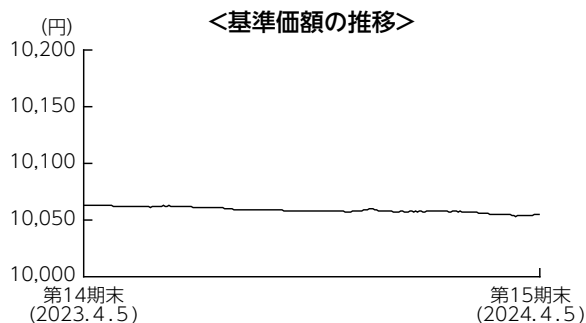
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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) 2023年 4 月 5 日	円 10,063	% －	% 71.8	% －	% －
4 月 末	10,062	△0.0	71.8	－	－
5 月 末	10,062	△0.0	61.6	－	－
6 月 末	10,061	△0.0	61.6	－	－
7 月 末	10,060	△0.0	61.6	－	－
8 月 末	10,059	△0.0	61.6	－	－
9 月 末	10,058	△0.0	61.6	－	－
10 月 末	10,057	△0.1	61.6	－	－
11 月 末	10,058	△0.0	61.6	－	－
12 月 末	10,057	△0.1	60.2	－	－
2024年 1 月 末	10,057	△0.1	60.2	－	－
2 月 末	10,055	△0.1	60.1	－	－
3 月 末	10,054	△0.1	62.0	－	－
(期 末) 2024年 4 月 5 日	10,055	△0.1	62.0	－	－

(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。

■当期の運用経過（2023年4月6日から2024年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,055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

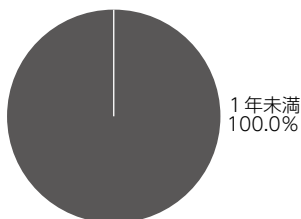
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは、日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響によりマイナス圏で推移しましたが、当期末にかけては、マイナス金利政策の解除を受けて上昇の動きとなり、利回りはプラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

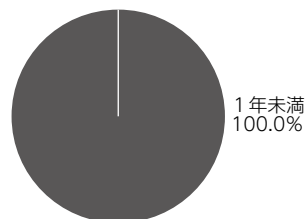
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【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

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

■ 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（2023年 4 月 6 日から2024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	500,341	600,273 (500,000)

（注 1）金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。
（注 2）（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2023年 4 月 6 日から2024年 4 月 5 日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
公 社 債	百万円 500	百万円 200	% 40.0	百万円 600	百万円 －	% －

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 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
国 債 証 券	千円 300,000	千円 299,992	% 62.0	% －	% －	% －	% 62.0
合 計	300,000	299,992	62.0	－	－	－	62.0

(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 4 0 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,006	2024/09/01	
4 4 1 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,004	2024/10/01	
4 4 6 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	99,982	2025/03/01	
合 計	－	300,000	299,992	－	

■投資信託財産の構成

2024年 4月 5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 299,992	% 62.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	183,876	38.0
投 資 信 託 財 産 総 額	483,868	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月5日)現在

項 目				当 期 末
(A) 資	産			483,868,290円
コ	ー	ル	・	等
公	社			183,875,306
未	収	利		債(評価額)
前	払	費		299,992,000
(B) 負	債			—
(C) 純	資	産	総	額(A－B)
元				483,868,290
次	期	繰	越	損
				益
(D) 受	益	権	総	口
1	万	口	当	た
			り	基
			準	価
			額	(C／D)
				10,055円

(注1) 期首元本額	1,245,658,613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
追加設定元本額	13,726,863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
一部解約元本額	778,151,914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
(注2) 期末における元本の内訳		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
バンクローン・ファンド (ヘッジなし)	15,843,407円	PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり)	301,134円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	13,867,169円	PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし)	1,493,740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	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)	9,943,324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	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	1,988,665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	期末元本合計	481,233,562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		
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		
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		
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		
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	294,245,101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<ブラジルリアルコース>	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		
マッシュューズ・アジア株式ファンド	14,723,185円		
One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円		
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円		
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040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		
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		

■損益の状況

当期 自2023年4月6日 至2024年4月5日

項 目					当 期
(A) 配 当 等 収 益					△54,712円
受 取 利 息					26,392
支 払 利 息					△81,104
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益					△502,000
売 買 益					14,000
売 買 損					△516,000
(C) 当 期 損 益 金(A + B)					△556,712
(D) 前 期 繰 越 損 益 金					7,856,815
(E) 解 約 差 損 益 金					△4,744,512
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金					79,137
(G) 合 計(C + D + E + F)					2,634,728
次 期 繰 越 損 益 金(G)					2,634,728

(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。