

償還 運用報告書（全体版）

第10期<償還日2024年10月25日>

新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2014年10月27日から2024年10月25日までです。	
運用方針	投資信託証券を主要投資対象として、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	投資信託証券
	ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドAクラスS（JPY）	ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド（M）
運用方法	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C D、C P、コールローン等の国内短期金融資産
	以下の投資信託証券を通じて、世界の様々な債券（デリバティブを含む）などに市場動向などを踏まえ機動的に投資を行うことで、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 バミューダ籍外国投資信託 ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS（JPY）（以下「インカム・ファンド」といいます。）円建受益証券 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等を勘案して決定するものとし、インカム・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。 インカム・ファンドへの投資に係る指図権限を、ピムコジャパンリミテッドに委託します。	
組入制限	新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。
	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、繰越分を含めた経資控除後の利子・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。 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、「新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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

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

新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号

最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 受 益 証 券 率	債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 金	期 騰 落	中 率			
6 期 (2020年10月26日)	円 10,004	円 50		% 0.5	% 97.7	% 0.0	百万円 7,443
7 期 (2021年10月25日)	10,003	485		4.8	96.7	0.1	4,581
8 期 (2022年10月25日)	8,550	0	△14.5		98.3	0.1	3,699
9 期 (2023年10月25日)	8,458	0	△1.1		97.3	0.1	3,434
(償 還 日) 2024年10月25日	(償還価額) 8,862.28	0		4.8	—	—	2,825

- (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) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。
(注 4) 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、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。
(注 5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

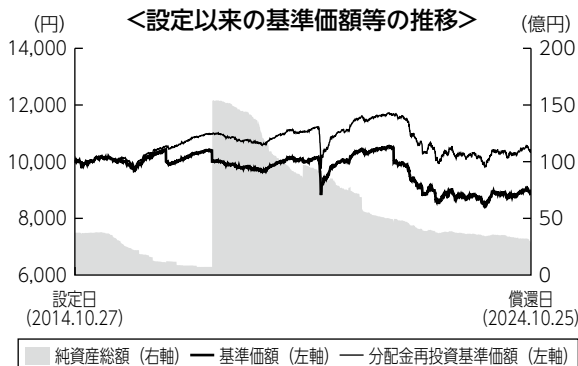
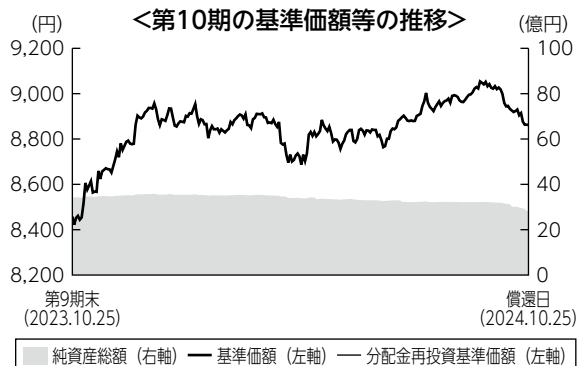
当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 受 益 証 券 率	債 券 組 入 比 率
		騰 落	率		
(期 首) 2023 年 10 月 25 日	円 8,458		% —	% 97.3	% 0.1
10 月 末	8,444	△0.2		97.6	0.1
11 月 末	8,745	3.4		97.1	0.1
12 月 末	8,931	5.6		97.6	0.1
2024 年 1 月 末	8,912	5.4		98.2	0.1
2 月 末	8,838	4.5		98.4	0.1
3 月 末	8,896	5.2		97.3	0.1
4 月 末	8,731	3.2		97.5	0.1
5 月 末	8,779	3.8		97.2	0.1
6 月 末	8,818	4.3		97.2	0.1
7 月 末	8,911	5.4		97.4	0.1
8 月 末	8,970	6.1		97.0	0.1
9 月 末	9,033	6.8		98.2	0.1
(償還日) 2024 年 10 月 25 日	(償還価額) 8,862.28		4.8	—	—

- (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) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■設定以来の運用経過（2014年10月27日から2024年10月25日まで）

基準価額等の推移



- (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) 「第10期の基準価額等の推移」の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) 「設定以来の基準価額等の推移」の基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。
- (注5) 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

当期

バミューダ籍外国投資信託「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)」(以下「インカム・ファンド」) 円建受益証券への投資を通じて、世界で発行されているさまざまな債券などに実質的に投資を行った結果、当期の基準価額(税引前分配金再投資ベース)は上昇しました。保有する債券の利金収入などが上昇要因となり上昇しました。

設定来

バミューダ籍外国投資信託「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)」(以下「インカム・ファンド」) 円建受益証券への投資を通じて、世界で発行されているさまざまな債券などに実質的に投資を行った結果、設定来の基準価額(税引前分配金再投資ベース)は上昇しました。保有する債券の利金収入などが上昇要因となり上昇しました。

設定来の投資環境

米国国債利回りは上昇しました。2018年下旬にかけては一進一退で推移しましたが、その後は米中貿易問題に対する警戒感や利上げ観測の後退などから低下にしました。また、2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大に伴う景気減速懸念から一段と低下しました。2022年以降は、インフレ加速を背景に利上げ観測が高まったことから上昇しましたが、最終期末にかけては経済指標の軟化などを背景に上昇幅を一部縮小しました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。2018年に入り英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感やECB（欧州中央銀行）による金融緩和観測の高まりなどから低下しました。その後は一進一退で推移した後、2022年以降は米国金利の上昇に追随し上昇しました。

国内短期金融市場では、日本銀行の大規模な金融緩和政策の影響で、3ヵ月国庫短期証券利回りは2014年から低下傾向で推移しました。2016年1月にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利は一段と低下しマイナス圏で推移することになりましたが、2024年3月にマイナス金利政策が解除されたことを受けて、その後は概ねプラス圏での推移となりました。

設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

インカム・ファンドを通じて「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド（M）」（以下「インカム・ファンド（M）」）米ドル建受益証券を実質的に高位に組み入れました。また、設定時に組入れた日本短期公社債マザーファンドについては、投資対象マザーファンドの変更に伴い、2021年10月にD I AMマネーマザーファンドへの入れ替えを実施し、組み入れを継続しました。

●インカム・ファンド

当ファンドは世界で発行されているさまざまな債券などに実質的に投資し、あらゆる市場局面において最適な資産配分を追求することで安定的な収益確保を目指しました。金利戦略では市場環境に応じ機動的に金利リスクを調整しました。セクター（債券種別）戦略では、モーゲージ証券（非政府系）など相対的に魅力的な利回りを有する資産へ投資したほか、リスクオフ時にも安定した値動きが期待される債券に投資しました。尚、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行いました。



※基準価額は、分配金を再投資したものとみなして計算しています。

●日本短期公社債マザーファンド

残存期間の短い国債や地方債などで運用を行いました。

●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。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1 万口当たりの費用明細

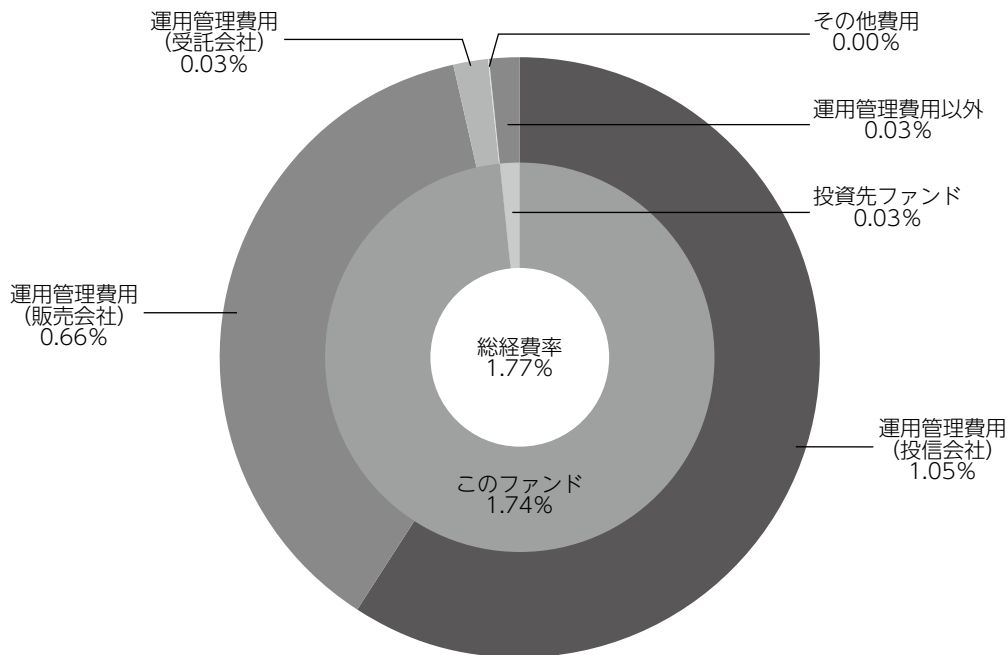
項目	第10期		項目の概要
	(2023年10月26日 ～2024年10月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	154円	1.738%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は8,851円です。
(投信会社)	(92)	(1.045)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(58)	(0.660)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(3)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.001)	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
合計	154	1.739	

- (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1.77%です。



総経費率 (①+②+③)	1.77%
①このファンドの費用の比率	1.74%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.03%

(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および「ビムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS（J P Y）」（以下「インカム・ファンド」という場合があります。）への投資の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社（ビムコジャパンリミテッド）に対する報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.6%（税抜））が含まれます。

(注6) ②の費用には、直接の投資運用会社報酬などはありません。

(注7) 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8) 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（2023年10月26日から2024年10月25日まで）
投資信託受益証券

		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
外国 邦 建		千口	千円	千口	千円
	ピムコ・バミューダ・インカム・ ファンドA クラスS（JPY）	－	－	336.3546644	3,565,296

（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（2023年10月26日から2024年10月25日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
D I AMマネーマザーファンド	－	－	3,959	3,982

■利害関係人との取引状況等（2023年10月26日から2024年10月25日まで）
【新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号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 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
公 社 債	百万円 7,516	百万円 1,099	% 14.6	百万円 1,418	百万円 －	% －

平均保有割合 0.2%

（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、みずほ証券です。

■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	期 首（前期末）
	□ 数
ピ ム コ ン ・ バ ミ ュ ー ダ ・ イ ン カ ム ・ フ ァ ド A ク ラ ス S (J P Y)	千□ 336.3546644
合 計	336.3546644

(2) 親投資信託残高

	期 首 (前期末)
	□ 数
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 3,959

■投資信託財産の構成

2024年10月25日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 2,956,627	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,956,627	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10月25日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	2,956,627,874円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,956,574,840
未 収 利 息	53,034
(B) 負 債	131,092,467
未 払 解 約 金	102,708,677
未 払 信 託 報 酬	28,383,790
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	2,825,535,407
元 本	3,188,270,735
償 還 差 損 益 金	△362,735,328
(D) 受 益 権 総 口 数	3,188,270,735口
1 万口当たり償還価額(C／D)	8,862円28銭

(注) 期首における元本額は4,060,424,957円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は872,154,222円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月26日 至2024年10月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	135,912円
受 取 利 息	140,190
支 払 利 息	△4,278
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	187,566,154
売 買 益	217,936,414
売 買 損	△30,370,260
(C) 信 託 報 酬 等	△58,933,485
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	128,768,581
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△490,979,197
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△524,712
(配 当 等 相 当 額)	(2,753,978)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,278,690)
(G) 合 計(D＋E＋F)	△362,735,328
償 還 差 損 益 金(G)	△362,735,328

(注1) (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2) (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3) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、当期は22,338,770円で、委託者報酬から支弁しております。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014 年 10 月 27 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024 年 10 月 25 日		資産総額	2,956,627,874円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	131,092,467円
				純資産総額	2,825,535,407円
受益権口数	3,730,862,327口	3,188,270,735口	△542,591,592口	受益権口数	3,188,270,735口
元本額	3,730,862,327円	3,188,270,735円	△542,591,592円	1万口当たり償還金	8,862円28銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	2,880,782,040円	2,881,967,686円	10,004円	120円	1.20%
第2期	1,076,110,411	1,076,373,329	10,002	435	4.35
第3期	691,381,005	691,640,220	10,004	385	3.85
第4期	13,696,600,423	13,339,059,903	9,739	0	0.00
第5期	8,555,297,530	8,558,154,399	10,003	85	0.85
第6期	7,440,150,001	7,443,271,749	10,004	50	0.50
第7期	4,580,597,211	4,581,815,821	10,003	485	4.85
第8期	4,326,571,044	3,699,372,515	8,550	0	0.00
第9期	4,060,424,957	3,434,469,009	8,458	0	0.00

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	8,862円28銭
----------------	-----------

償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは販売会社までお問い合わせ下さい。

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	バミューダ籍外国投資信託／円建受益証券
運 用 方 針	「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)」を通じて、世界のさまざまな債券などに投資を行い、市場環境に合わせて機動的に投資比率を変更することで長期的な収益の獲得およびインカム収益の最大化を目指します。また、実質組入外貨建資産については、原則として米ドル対円での為替ヘッジを行います。ただし、総資産の10%程度の範囲で為替ヘッジを行わない場合があります。
主 な 投 資 制 限	①ポートフォリオの実質的なデュレーションは原則0年～8年の間とします。 ②非投資適格債券への実質投資割合は総資産の50%以内とします。ただし、資産担保証券およびモーゲージ証券についてはこの限りではありません。 ③新興国債券への実質投資割合は総資産の20%以内とします。 ④米ドル以外の通貨の実質投資割合は総資産の15%以内とします。 ⑤流動性に欠ける資産への実質投資割合は総資産の15%以内とします。
決 算 日	毎年10月31日
関 係 法 人	受託会社：メイプルズ・トラスティ・サービスズ (バミューダ) リミテッド 投資顧問会社：パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー 管理事務代行会社兼保管受託銀行：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
信 託 報 酬 等	かかりません。
その他の費用・手数料	有価証券の売買手数料などがかかります。
収 益 分 配 方 針	原則として、毎月、分配を行います。

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS（J P Y）」は、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」を構成する個別クラスであり、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド（M）」に投資しております。

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」及び「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド（M）」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。

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドAの内容

(1) 資産・負債計算書

(単位：受益証券数を除き、千米ドル)

	2023年10月31日現在
資産：	
投資－評価額	
有価証券投資	348,778
関連当事者に係る投資	10,181,475
金融デリバティブ商品	
店頭	34,654
現金	52
売却済投資に係る未収金	3
関連当事者に係る売却済投資に係る未収金	14,717
売却済ファンド受益証券に係る未収金	18,758
未収利息および未収配当金	6
	10,598,443
負債：	
金融デリバティブ商品	
店頭	158,549
購入済投資に係る未払金	53
関連当事者に係る購入済投資に係る未払金	14,565
未払利息	11
取引相手方からの預託金	61
償還済ファンド受益証券に係る未払金	18,935
運用手数料未払金	458
助言手数料未払金	11
管理手数料未払金	9
代理店手数料未払金	6
販売手数料未払金	94
	192,752
純資産	10,405,691
有価証券投資の取得原価	348,759
関連当事者に係る投資の取得原価	10,020,480

0となっている金額は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(2) 損益計算書

(単位：千米ドル)

	2023年10月31日終了年度
投資収益：	
利息－外国税引後純額＊	23,195
配当金－外国税引後純額＊	0
雑収入	0
収益合計	23,195
費用：	
助言手数料－クラスW (USD)	142
運用手数料－クラスM (JPY 助言)	777
運用手数料－クラスM (USD 助言)	276
運用手数料－クラスP (JPY)	204
運用手数料－クラスR (USD)	122
運用手数料－クラスS (USD)	82
運用手数料－クラスT (JPY)	4,430
運用手数料－クラスU2 (JPY)	273
運用手数料－クラスX (JPY)	28
管理手数料－クラスR (USD)	37
管理手数料－クラスS (USD)	25
管理手数料－クラスW (USD)	44
販売手数料－クラスM (JPY 助言)	674
販売手数料－クラスM (USD 助言)	239
販売手数料－クラスP (JPY)	204
代理店手数料－クラスM (JPY 助言)	52
代理店手数料－クラスM (USD 助言)	18
支払利息	2,673
費用合計	10,300
純投資利益 (損失)	12,895
実現純利益 (損失)：	
有価証券投資 (外国源泉徴収税控除後)	(128)
関連当事者に係る投資	231,638
店頭金融デリバティブ商品	(570,750)
外国為替	3,475
実現純利益 (損失)	(335,765)
未実現利益 (損失) 純変動額：	
有価証券投資	21
関連当事者に係る投資	299,928
店頭金融デリバティブ商品	73,407
外貨資産および負債	74
未実現利益 (損失) 純変動額	373,430
純利益 (損失)	37,665
営業による純資産の純増加 (減少) 額	50,560
＊外国源泉徴収税	0

0となっている金額は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(3) 投資有価証券明細表

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA

2023年10月31日現在

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資	3.4%		
短期金融商品	3.4%		
定期預金	0.0%		
Bank of Nova Scotia			
4.830% due 11/01/2023	USD	27	27
Brown Brothers Harriman & Co.			
4.830% due 11/01/2023		2	2
Citibank N.A.			
4.830% due 11/01/2023		113	113
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 11/01/2023		97	97
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 11/01/2023		206	206
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	2	0
4.830% due 11/01/2023	USD	11	11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	9	0
4.830% due 11/01/2023	USD	262	262
			<u>718</u>
米国短期国債	3.4%		
5.334% due 11/14/2023 (a)		14,000	13,973
5.355% due 11/21/2023 (a)		21,261	21,199
5.365% due 12/12/2023 (a)		13,000	12,922
5.372% due 01/18/2024 (b)(d)		7,800	7,710
5.374% due 12/07/2023 (a)(d)		5,600	5,570
5.377% due 12/14/2023 (b)		26,200	26,035
5.385% due 01/25/2024 (a)		22,700	22,416
5.396% due 11/24/2023 (a)(d)		9,200	9,169
5.405% due 01/04/2024 (a)(d)		20,600	20,406
5.405% due 01/11/2024 (b)		154,700	153,085
5.414% due 01/23/2024 (a)		18,000	17,780
5.414% due 01/16/2024 (a)(d)		10,700	10,580
5.431% due 01/30/2024 (a)(d)		10,300	10,163
5.441% due 02/06/2024 (a)(d)		17,300	17,052
			<u>348,060</u>
短期金融商品合計			<u>348,778</u>
(取得原価 348,759千米ドル)			
有価証券投資合計			<u>348,778</u>
(取得原価 348,759千米ドル)			
	受益証券口数 (単位：千)		
関連当事者に係る投資	97.8%		
その他の投資会社	97.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M)			
(取得原価 10,020,480千米ドル)		693,561	10,181,475
関連当事者に係る投資合計			<u>10,181,475</u>
(取得原価 10,020,480千米ドル)			
投資合計	101.2%		10,530,253
(取得原価 10,369,239千米ドル)			
金融デリバティブ商品 (c) (1.2%)			(123,895)
(取得原価またはプレミアム (純額) 0千米ドル)			
その他の資産および負債 (純額) (0.0%)			(667)
純資産	100.0%		<u>10,405,691</u>

* 額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(a)利率は満期までの利回りです。

(b)利率は満期までの利回り (加重平均) です。

(c)金融デリバティブ商品：店頭
為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額 (千通貨)		外貨受取額 (千通貨)		未実現利益 (損失)	
						資産 (千米ドル)	負債 (千米ドル)
BPS	11/2023	JPY	1,610,831	USD	10,811	175	0
BPS	11/2023	USD	1,754	JPY	262,091	0	(23)
BPS	11/2023		2,751		409,559	0	(44)
BPS	11/2023		2,470		367,656	0	(40)
JPM	11/2023	JPY	300,970	USD	2,012	25	0
JPM	11/2023	USD	778	JPY	116,391	0	(10)
JPM	11/2023		45		6,799	0	(1)
MYI	11/2023	JPY	141,586	USD	935	0	0
MYI	11/2023	USD	2,979	JPY	450,909	0	0
MYI	11/2023		125		18,978	0	0
						200	(118)

クラスF (JPY)、クラスJ (JPY)、クラスM (JPY助言)、クラスN (JPY)、クラスP (JPY)、
クラスQ (JPY)、クラスR (JPY)、クラスS (JPY)、クラスT (JPY)、クラスU2 (JPY)、
クラスX (JPY)、クラスY (JPY) およびクラスZ (JPY) 為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額 (千通貨)		外貨受取額 (千通貨)		未実現利益 (損失)	
						資産 (千米ドル)	負債 (千米ドル)
AZD	11/2023	USD	51,176	JPY	7,606,046	0	(953)
BOA	11/2023	JPY	1,030,945	USD	6,875	68	0
BOA	11/2023	USD	1,911	JPY	283,637	0	(38)
BPS	11/2023	JPY	1,144,916	USD	7,683	123	0
BPS	11/2023		3,767,140		25,167	292	0
BPS	11/2023	USD	7,597	JPY	1,144,916	0	(37)
CBK	11/2023	JPY	112,987,492	USD	751,417	5,354	0
CBK	12/2023	USD	635,353	JPY	95,219,229	0	(3,205)
DUB	11/2023	JPY	282,100,651	USD	1,869,628	6,901	0
DUB	11/2023	USD	1,291,052	JPY	191,043,295	0	(29,582)
DUB	12/2023		1,869,628		280,681,417	0	(6,221)
GLM	11/2023	JPY	3,566,356	USD	23,994	445	0
GLM	11/2023	USD	52,569	JPY	7,798,910	0	(1,072)
JPM	11/2023	JPY	6,555,452	USD	43,301	15	0
JPM	11/2023	USD	140,639	JPY	20,885,896	0	(2,728)
JPM	12/2023		43,301		6,522,486	1	0
MBC	11/2023	JPY	637,972	USD	4,277	64	0
MBC	11/2023	USD	3,679	JPY	546,680	0	(70)
MYI	11/2023	JPY	34,492,948	USD	228,170	411	0
MYI	11/2023	USD	34,144	JPY	5,073,696	0	(642)
MYI	12/2023		120,636		18,160,488	0	(71)
SCX	11/2023	JPY	1,185,857	USD	7,934	103	0
SSB	11/2023		60,546,400		400,000	209	0
SSB	12/2023	USD	400,000	JPY	60,242,184	0	(60)
TOR	11/2023	JPY	85,314,933	USD	568,577	5,237	0
TOR	11/2023	USD	4,749,153	JPY	704,953,574	0	(94,304)
TOR	12/2023		568,577		84,882,758	0	(5,051)
UAG	11/2023	JPY	357,791,315	USD	2,377,747	15,231	0
UAG	12/2023	USD	2,377,747	JPY	355,986,844	0	(14,397)
						34,454	(158,431)
為替予約契約合計						34,654	(158,549)

(4) 投資有価証券明細表ーピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)

2023年10月31日現在

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資 148.7%				TransDigm, Inc.		
バンクローン債務証券 4.3%				8.640% due 02/22/2027	786	787
AAdvantage Loyalty IP Ltd.				8.640% due 08/24/2028	24,180	24,180
10.427% due 04/20/2028	USD	9,453	9,600	U.S. Renal Care, Inc.		
AmSurg LLC				10.446% due 06/20/2028	3,155	1,956
13.258% due 04/29/2027		78,267	91,831	United AirLines, Inc.		
16.695% due 04/28/2028 (b)		39,584	36,017	9.189% due 04/21/2028	2,439	2,438
Azalea TopCo, Inc.				Westmoreland Coal Co.		
9.184% due 07/24/2026		818	778	8.000% due 03/15/2029	349	260
Carnival Corp.				Windstream Services LLC		
7.618% due 06/30/2025	EUR	11,263	11,919	9.424% due 02/23/2027	4,920	4,846
8.689% due 10/18/2028	USD	2,290	2,252	11.674% due 09/21/2027	8,020	7,450
Cengage Learning, Inc.				バンクローン債務証券合計		435,920
10.405% due 07/14/2026		11,893	11,783	(取得原価 444,839千米ドル)		
Charter Communications Operating LLC				社債 15.6%		
7.074-7.133% due 02/01/2027		3,069	3,065	銀行および金融 7.4%		
DIRECTV Financing LLC				AGFC Capital Trust I		
10.439% due 08/02/2027		7,101	6,923	7.405% due 01/15/2067	2,200	1,157
Envalior Finance GmbH				AIB Group PLC		
9.448% due 03/29/2030	EUR	10,900	10,686	5.250% due 10/23/2031	EUR	4,060
10.883% due 03/29/2030	USD	19,602	18,070	6.608% due 09/13/2029	USD	5,200
Envision Healthcare Corp.				Armor Holdco, Inc.		
13.250% due 07/10/2026		23,591	23,591	8.500% due 11/15/2029	200	175
Finastra USA, Inc.				Army Hawaii Family Housing Trust Certificates		
2.579% due 09/13/2029 (c)		614	603	5.849% due 06/15/2050	7,900	6,006
12.582% due 09/13/2029		6,161	6,053	Aroundtown S.A.		
GTCR W Merger Sub LLC				5.375% due 03/21/2029	11,300	8,843
8.334% due 09/20/2030		9,200	9,146	Avolon Holdings Funding Ltd.		
iHeartCommunications, Inc.				2.528% due 11/18/2027	43,530	36,373
8.439% due 05/01/2026		49,324	42,248	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA		
Iqvia, Inc.				1.875% due 01/09/2026	EUR	7,100
5.868% due 03/07/2024	EUR	3,900	4,123	2.625% due 04/28/2025	1,000	996
Lealand Finance Co. BV				3.625% due 09/24/2024	900	929
3.000-6.439% due 06/30/2025	USD	613	337	6.750% due 03/02/2026	12,961	13,648
8.439% due 06/28/2024		261	190	7.708% due 01/18/2028	1,200	1,111
Poseidon Bidco SAS				8.000% due 01/22/2030	5,237	5,217
9.222% due 09/30/2028	EUR	39,600	42,014	8.500% due 09/10/2030	2,000	1,992
Pug LLC				Banco de Credito del Peru S.A.		
8.939% due 02/12/2027	USD	780	738	4.650% due 09/17/2024	PEN	16,400
Sigma Holdco BV				Banco Santander S.A. (d)		
7.413% due 07/02/2025	EUR	1,820	1,920	6.527% due 11/07/2027	USD	11,000
Sotera Health Holdings LLC				6.607% due 11/07/2028	8,400	8,413
8.395% due 12/11/2026	USD	3,362	3,340	Bank of Nova Scotia		
SS&C Technologies Holdings, Inc.				4.900% due 06/04/2025 (e)(f)	1,124	1,029
7.189% due 04/16/2025		2,824	2,825	Barclays PLC		
SVF II Finco (Cayman) LP				4.972% due 05/16/2029	2,600	2,394
5.000% due 12/21/2025		32,083	30,109	6.490% due 09/13/2029	8,500	8,290
Syniverse Holdings LLC				6.692% due 09/13/2034	9,900	9,368
12.390% due 05/13/2027		24,909	22,192	7.437% due 11/02/2033	400	399
Team Health Holdings, Inc.				BPCE S.A.		
8.189% due 02/06/2024		1,685	1,650	6.714% due 10/19/2029	19,000	18,741

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
7.003% due 10/19/2034		11,600	11,278	Goodman U.S. Finance Three LLC			
Brandywine Operating Partnership LP				3.700% due 03/15/2028		2,324	2,070
3.950% due 11/15/2027		2,000	1,659	Highwoods Realty LP			
4.550% due 10/01/2029		1,500	1,149	3.050% due 02/15/2030		200	150
CA Immobilien Anlagen AG				HSBC Holdings PLC			
1.000% due 10/27/2025	EUR	3,400	3,214	2.848% due 06/04/2031		3,300	2,591
CaixaBank S.A.				3.973% due 05/22/2030		14,100	12,187
6.208% due 01/18/2029	USD	5,400	5,214	5.402% due 08/11/2033		400	360
6.840% due 09/13/2034		7,800	7,376	6.254% due 03/09/2034		29,500	28,014
CIFI Holdings Group Co. Ltd. (b)				Hudson Pacific Properties LP			
4.375% due 04/12/2027		300	17	3.250% due 01/15/2030		100	64
4.450% due 08/17/2026		500	32	3.950% due 11/01/2027		500	384
5.950% due 10/20/2025		200	15	5.950% due 02/15/2028		2,200	1,733
6.000% due 07/16/2025		200	14	InCaps Funding I Ltd.			
6.450% due 11/07/2024		600	39	7.671% due 06/01/2033		6,069	5,705
Corestate Capital Holding S.A. (g)				KBC Group NV			
8.000% due 12/31/2026	EUR	8,491	6,066	6.324% due 09/21/2034		5,500	5,211
10.000% due 12/31/2026		1,300	1,374	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
Corsair International Ltd.				3.250% due 11/12/2025	EUR	1,400	1,322
8.802% due 01/28/2027		10,000	10,411	Kilroy Realty LP			
9.152% due 01/28/2029		4,100	4,247	4.250% due 08/15/2029	USD	300	250
Country Garden Holdings Co. Ltd. (b)				Lloyds Banking Group PLC			
2.700% due 07/12/2026	USD	2,100	92	7.875% due 06/27/2029 (e)(f)	GBP	1,706	1,829
3.125% due 10/22/2025		3,400	147	Nationwide Building Society			
3.875% due 10/22/2030		1,700	78	3.960% due 07/18/2030	USD	5,600	4,867
CPI Property Group S.A.				4.302% due 03/08/2029		12,500	11,366
2.750% due 05/12/2026	EUR	2,100	1,850	4.500% due 11/01/2026 (d)	EUR	12,400	13,186
Credit Suisse AG				NatWest Group PLC			
0.495% due 02/02/2024	USD	5,200	5,116	4.445% due 05/08/2030	USD	17,600	15,610
5.500% due 08/20/2026	EUR	14,000	15,202	5.076% due 01/27/2030		16,500	15,150
7.500% due 02/15/2028	USD	10,500	10,907	6.016% due 03/02/2034		15,900	14,817
Credit Suisse Group AG AT1 Claim (b)				New Metro Global Ltd.			
		9,046	995	4.500% due 05/02/2026		1,000	173
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl				4.625% due 10/15/2025		200	46
2.125% due 11/19/2025	EUR	433	418	4.800% due 12/15/2024		1,400	441
CTP NV				Park Aerospace Holdings Ltd.			
1.250% due 06/21/2029		7,500	5,937	5.500% due 02/15/2024		575	571
1.500% due 09/27/2031	EUR	8,200	6,001	Preferred Term Securities XVIII Ltd.			
Deutsche Bank AG				6.051% due 09/23/2035		68	67
1.375% due 02/17/2032		8,500	6,708	Preferred Term Securities XXIV Ltd.			
1.750% due 11/19/2030		6,200	5,286	5.971% due 03/22/2037		763	686
2.129% due 11/24/2026	USD	1,200	1,084	6.051% due 03/22/2037		4,829	3,622
3.035% due 05/28/2032		700	522	Preferred Term Securities XXV Ltd.			
3.547% due 09/18/2031		7,400	5,815	5.961% due 06/22/2037		18,320	15,939
3.961% due 11/26/2025		3,127	3,016	Preferred Term Securities XXVI Ltd.			
6.720% due 01/18/2029		2,900	2,848	5.971% due 09/22/2037		27,065	22,734
EPR Properties				Santander Holdings USA, Inc.			
4.750% due 12/15/2026		256	234	4.500% due 07/17/2025		1,007	968
4.950% due 04/15/2028		1,132	987	Santander UK Group Holdings PLC			
G City Europe Ltd.				2.469% due 01/11/2028		1,000	864
4.250% due 09/11/2025	EUR	400	376	3.823% due 11/03/2028		3,400	2,993
GLP Capital LP				6.534% due 01/10/2029		9,900	9,690
5.250% due 06/01/2025	USD	650	635	6.750% due 06/24/2024 (e)(f)	GBP	16,610	19,749
5.300% due 01/15/2029		3,142	2,873	7.482% due 08/29/2029	GBP	4,800	5,976

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Seazen Group Ltd.			American Airlines 2016-2 Class AA Pass-Through Trust		
6.000% due 08/12/2024	USD	700	3.200% due 06/15/2028	767	678
Societe Generale S.A.			American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust		
6.446% due 01/10/2029		8,050	3.350% due 10/15/2029	337	297
6.691% due 01/10/2034		15,100	BAT Capital Corp.		
Sunac China Holdings Ltd.			6.343% due 08/02/2030	1,200	1,165
7.000% due 07/09/2025		800	6.421% due 08/02/2033	1,000	943
SVB Financial Group			7.081% due 08/02/2053	1,100	982
3.125% due 06/05/2030 (b)		100	Boeing Co.		
U.S. Capital Funding VI Ltd.			5.705% due 05/01/2040	5,728	5,071
5.948% due 07/10/2043		23,084	5.805% due 05/01/2050	4,500	3,878
UBS Group AG			5.930% due 05/01/2060	9,900	8,338
3.091% due 05/14/2032		2,850	British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust		
3.750% due 03/26/2025		6,200	3.300% due 12/15/2032	85	72
3.869% due 01/12/2029		31,650	Broadcom, Inc.		
4.194% due 04/01/2031		9,150	2.450% due 02/15/2031	USD	7,900
5.959% due 01/12/2034		15,900	3.137% due 11/15/2035	4,435	3,130
6.301% due 09/22/2034		4,900	3.469% due 04/15/2034	4,513	3,440
6.327% due 12/22/2027		10,000	Carvana Co. (g)		
6.442% due 08/11/2028		3,360	12.000% due 12/01/2028	11,453	8,536
6.537% due 08/12/2033		22,110	13.000% due 06/01/2030	17,180	12,729
7.750% due 03/01/2029	EUR	3,540	14.000% due 06/01/2031	20,329	15,161
9.016% due 11/15/2033	USD	4,350	Community Health Systems, Inc.		
UniCredit SpA			5.625% due 03/15/2027	21,336	17,351
7.830% due 12/04/2023		72,590	8.000% due 03/15/2026	8,401	7,691
Unique Pub Finance Co. PLC			CoStar Group, Inc.		
7.395% due 03/28/2024	GBP	344	2.800% due 07/15/2030	2,000	1,554
Uniti Group LP			CVS Pass-Through Trust		
6.500% due 02/15/2029	USD	2,280	5.773% due 01/10/2033	129	125
10.500% due 02/15/2028		6,545	7.507% due 01/10/2032	515	525
VICI Properties LP			8.353% due 07/10/2031	514	532
3.500% due 02/15/2025		4,784	Energy Transfer LP		
3.750% due 02/15/2027		4,300	4.950% due 05/15/2028	424	401
4.125% due 08/15/2030		5,684	Exela Intermediate LLC		
4.250% due 12/01/2026		3,600	11.500% due 04/15/2026 (g)	541	92
4.625% due 12/01/2029		3,600	Ford Foundation		
Voyager Aviation Holdings LLC			2.815% due 06/01/2070	1,940	989
8.500% due 05/09/2026 (b)		4,421	Greene King Finance PLC		
		2,404	3.593% due 03/15/2035	GBP	1,956
		757,304	4.064% due 03/15/2035	532	556
工業 3.2%			5.106% due 03/15/2034	131	147
Air Canada 2020-2 Class A Pass-Through Trust			7.139% due 12/15/2034	4,156	3,915
5.250% due 04/01/2029		1,869	GTCR W-2 Merger Sub LLC		
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			7.500% due 01/15/2031	USD	900
4.800% due 08/15/2027		3,270	Imperial Brands Finance PLC		
Amdocs Ltd.			3.500% due 07/26/2026	1,900	1,771
2.538% due 06/15/2030		4,000	JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
American Airlines 2013-1 Class A Pass-Through Trust			4.000% due 11/15/2032	6,106	5,408
4.000% due 07/15/2025		78	Market Bidco Finco PLC		
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust			4.750% due 11/04/2027	EUR	17,800
3.700% due 10/01/2026		1,849	Massachusetts Institute of Technology		
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust			4.678% due 07/01/2114	USD	65
3.375% due 05/01/2027		1,381	5.600% due 07/01/2111	103	96
American Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			Mitchells & Butlers Finance PLC		
3.575% due 01/15/2028		1,467			

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
6.013% due 12/15/2028	GBP	820	922	Altice France S.A.		
6.022% due 12/15/2030	USD	373	346	8.125% due 02/01/2027	2,744	2,316
Nissan Motor Co. Ltd.				Charter Communications Operating LLC		
3.522% due 09/17/2025		8,300	7,852	3.900% due 06/01/2052	9,800	5,536
4.345% due 09/17/2027		8,700	7,869	3.950% due 06/30/2062	2,600	1,389
4.810% due 09/17/2030		2,250	1,912	4.400% due 12/01/2061	7,100	4,137
NMG Holding Co., Inc.				Constellation Oil Services Holding S.A.		
7.125% due 04/01/2026		11,900	11,142	3.000% due 12/31/2026 (g)	387	273
ONEOK, Inc.				DISH DBS Corp.		
5.800% due 11/01/2030		800	770	5.250% due 12/01/2026	11,110	8,983
6.050% due 09/01/2033		3,500	3,356	5.750% due 12/01/2028	11,110	8,089
6.625% due 09/01/2053		2,900	2,713	Enel Finance America LLC		
Oracle Corp.				7.100% due 10/14/2027	1,000	1,023
3.850% due 04/01/2060		899	540	Enel Finance International NV		
PeaceHealth Obligated Group				7.500% due 10/14/2032	600	621
3.218% due 11/15/2050		3,100	1,735	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
Roadster Finance DAC				2.250% due 11/22/2024	EUR 100	82
2.375% due 12/08/2027	EUR	1,000	889	2.949% due 01/24/2024	450	381
Rolls-Royce PLC				4.950% due 03/23/2027	USD 1,800	1,251
4.625% due 02/16/2026		3,514	3,672	4.950% due 02/06/2028	1,000	695
5.750% due 10/15/2027	GBP	3,199	3,672	5.150% due 02/11/2026	5,700	4,275
Royal Caribbean Cruises Ltd.				7.288% due 08/16/2037	500	390
11.500% due 06/01/2025	USD	2,410	2,549	8.625% due 04/28/2034	2,372	2,163
Russian Railways Via RZD Capital PLC				Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC		
7.487% due 03/25/2049 (b)	GBP	6,300	4,969	1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	20,504
Sands China Ltd.				2.950% due 04/15/2025	5,000	3,964
4.300% due 01/08/2026	USD	1,800	1,671	2.950% due 01/27/2029	USD 23,200	13,340
5.375% due 08/08/2025		2,300	2,228	Intelsat Jackson Holdings S.A.		
5.650% due 08/08/2028		2,400	2,222	6.500% due 03/15/2030	70,143	61,763
Syngenta Finance NV				Netflix, Inc.		
4.892% due 04/24/2025	USD	800	782	3.875% due 11/15/2029	EUR 3,065	3,181
Times Square Hotel Trust				Noble Finance II LLC		
8.528% due 08/01/2026		823	813	8.000% due 04/15/2030	USD 2,072	2,073
U.S. Renal Care, Inc.				NPC Ukrenergo		
10.625% due 06/28/2028		2,342	1,446	6.875% due 11/09/2028	1,200	324
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust				Pacific Gas & Electric Co.		
2.700% due 05/01/2032		1,288	1,049	2.100% due 08/01/2027	1,910	1,618
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust				2.500% due 02/01/2031	2,600	1,929
5.875% due 10/15/2027		20,509	20,217	2.950% due 03/01/2026	8,508	7,813
Venture Global Calcasieu Pass LLC				3.000% due 06/15/2028	11,288	9,559
3.875% due 08/15/2029		7,400	6,165	3.150% due 01/01/2026	15,753	14,585
3.875% due 11/01/2033		16,500	12,486	3.250% due 06/01/2031	3,800	2,952
4.125% due 08/15/2031		5,000	4,025	3.300% due 03/15/2027	3,838	3,443
Venture Global LNG, Inc.				3.300% due 12/01/2027	USD 14,666	12,779
8.125% due 06/01/2028		7,600	7,384	3.400% due 08/15/2024	6,570	6,421
8.375% due 06/01/2031		8,400	8,022	3.450% due 07/01/2025	12,102	11,478
9.500% due 02/01/2029		46,750	47,524	3.500% due 06/15/2025	8,068	7,678
9.875% due 02/01/2032		15,550	15,777	3.500% due 08/01/2050	4,660	2,597
Veritas U.S., Inc.				3.750% due 02/15/2024	10,188	10,121
7.500% due 09/01/2025		1,950	1,598	3.750% due 07/01/2028	13,613	11,944
			<u>331,428</u>	3.750% due 08/15/2042	418	258
公益 5.0%				3.850% due 11/15/2023	1,830	1,828
Altice Financing S.A.				3.950% due 12/01/2047	2,200	1,315
5.750% due 08/15/2029		11,389	8,820	4.000% due 12/01/2046	3,144	1,904

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
4.200% due 03/01/2029	9,900	8,635	8.375% due 04/30/2030	1,666	1,636
4.250% due 03/15/2046	5,219	3,299	Viasat, Inc.		
4.300% due 03/15/2045	3,000	1,944	6.500% due 07/15/2028	2,700	1,917
4.400% due 03/01/2032	7,300	6,003	Windstream Escrow LLC		
4.450% due 04/15/2042	4,333	2,933	7.750% due 08/15/2028	USD 13,507	10,723
4.500% due 07/01/2040	36,242	25,754			517,242
4.500% due 12/15/2041	743	490	社債合計		1,605,974
4.550% due 07/01/2030	50,195	43,469	(取得原価 1,896,675千米ドル)		
4.600% due 06/15/2043	1,794	1,230	転換社債 0.4%		
4.650% due 08/01/2028	100	90	Multiplan Corp.		
4.750% due 02/15/2044	2,707	1,888	6.000% due 10/15/2027	5,700	3,802
4.950% due 07/01/2050	25,950	18,136	Nationwide Building Society		
5.250% due 03/01/2052	7,300	5,292	10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	10,221
Petroleos de Venezuela S.A. (b)			Stichting AK Rabobank Certificaten		
5.375% due 04/12/2027	11,932	1,647	6.500% due 03/29/2170 (f)	EUR 30,963	29,586
5.500% due 04/12/2037	10,372	1,365	転換社債合計		43,609
6.000% due 05/16/2024	8,283	1,093	(取得原価 67,905千米ドル)		
6.000% due 11/15/2026	13,183	1,691	地方債 0.1%		
9.000% due 11/17/2023	400	53	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010		
9.750% due 05/17/2035	4,730	700	6.630% due 02/01/2035	USD 605	599
Petroleos Mexicanos			6.725% due 04/01/2035	286	283
5.950% due 01/28/2031	5,319	3,809	7.350% due 07/01/2035	467	476
6.700% due 02/16/2032	58,087	42,867	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022		
6.950% due 01/28/2060	6,116	3,468	0.000% due 11/01/2043	12,731	6,350
7.690% due 01/23/2050	1,570	971	Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021		
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			2.246% due 06/01/2029	1,600	1,332
4.263% due 06/01/2036	3,600	3,148	3.000% due 06/01/2046	635	560
4.377% due 06/01/2039	3,990	3,407	Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (b)		
4.451% due 12/01/2047	7,700	6,063	6.050% due 07/01/2032	800	202
Prosus NV			6.125% due 07/01/2040	3,000	757
1.985% due 07/13/2033	EUR 5,600	3,873	地方債合計		10,559
2.085% due 01/19/2030	4,200	3,382	(取得原価 12,129千米ドル)		
3.061% due 07/13/2031	USD 9,600	6,919	米国政府関係機関 52.4%		
4.193% due 01/19/2032	4,000	3,074	Fannie Mae		
4.987% due 01/19/2052	1,300	803	0.765% due 05/25/2048 (h)	2,065	207
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			3.000% due 04/01/2037	611	546
9.250% due 07/06/2024	499	504	3.000% due 09/01/2049	188	152
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			3.000% due 03/01/2050	16,878	13,664
9.750% due 01/06/2027	443	459	3.000% due 10/01/2051	1,350	1,084
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			3.000% due 12/01/2051	204	164
8.200% due 04/06/2028	2,101	2,121	3.000% due 01/01/2052	194	156
Sprint Capital Corp.			3.000% due 02/01/2052	10,310	8,273
8.750% due 03/15/2032	2,200	2,479	3.000% due 03/01/2052	23,085	18,518
Sprint LLC			3.000% due 04/01/2052	25,731	20,639
7.125% due 06/15/2024	3,992	4,017	3.000% due 05/01/2052	8,343	6,695
7.625% due 03/01/2026	839	862	3.000% due 06/01/2052	9,332	7,485
Sprint Spectrum Co. LLC			3.000% due 07/01/2052	6,806	5,459
5.152% due 03/20/2028	2,482	2,443	3.000% due 08/01/2052	10,442	8,379
System Energy Resources, Inc.			3.000% due 09/01/2052	164	132
2.140% due 12/09/2025	6,100	5,555	3.000% due 05/01/2053	111	89
Topaz Solar Farms LLC			3.500% due 08/01/2042	18	16
4.875% due 09/30/2039	5,109	4,602	3.500% due 09/01/2047	166	142
5.750% due 09/30/2039	7,292	6,633	3.500% due 03/01/2048	49	42
Valaris Ltd.			3.500% due 04/01/2051	676	578

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.500% due 02/01/2052	977	816	3.000% due 12/01/2053	199,150	159,563
3.500% due 03/01/2052	1,590	1,330	3.500% due 12/01/2053	652,683	544,157
3.500% due 04/01/2052	2,751	2,301	4.000% due 12/01/2053	155,150	134,132
3.500% due 05/01/2052	2,950	2,467	4.500% due 12/01/2053	101,800	90,950
3.500% due 07/01/2052	3,348	2,793	5.000% due 12/01/2053	3,500	3,226
3.500% due 09/01/2052	981	819	5.500% due 12/01/2053	286,200	271,420
4.000% due 07/01/2040	5	5	6.000% due 12/01/2053	30,800	29,962
4.000% due 12/01/2041	46	40	6.500% due 12/01/2053	35,100	34,867
4.000% due 07/01/2042	36	31	Freddie Mac		
4.000% due 08/01/2042	541	476	1.115% due 06/15/2042 (h)	30	3
4.000% due 09/01/2042	125	109	3.000% due 11/01/2046	57	47
4.000% due 10/01/2042	20	18	3.000% due 12/01/2047	1,779	1,469
4.000% due 01/01/2043	5	4	3.000% due 03/01/2048	101	84
4.000% due 11/01/2045	86	76	3.000% due 12/01/2051	187	151
4.000% due 03/01/2047	27	24	3.000% due 03/01/2052	89	71
4.000% due 04/01/2047	230	204	3.000% due 04/01/2052	538	432
4.000% due 08/01/2047	3,707	3,278	3.000% due 05/01/2052	7,575	6,075
4.000% due 10/01/2047	205	181	3.000% due 06/01/2052	203	163
4.000% due 12/01/2047	80	71	3.000% due 07/01/2052	158	127
4.000% due 01/01/2048	46	40	3.000% due 09/01/2052	99	79
4.000% due 02/01/2048	514	454	3.000% due 10/01/2052	396	317
4.000% due 07/01/2048	6,176	5,430	3.000% due 01/01/2053	242	194
4.000% due 08/01/2048	3,627	3,190	3.000% due 03/01/2053	260	209
4.000% due 09/01/2048	1,049	927	3.500% due 10/01/2039	108	94
4.500% due 05/01/2033	13	12	3.500% due 10/01/2047	1,937	1,657
4.500% due 02/01/2038	1	1	3.500% due 12/01/2047	601	513
4.500% due 01/01/2041	156	138	3.500% due 03/01/2048	2,330	1,989
4.750% due 06/01/2033	160	145	3.500% due 04/01/2048	836	714
5.000% due 10/01/2035	60	59	3.500% due 10/01/2048	938	800
5.000% due 12/01/2035	134	125	3.500% due 12/01/2048	2,300	1,966
5.000% due 10/01/2036	5	5	3.500% due 03/01/2049	1,432	1,221
5.000% due 05/01/2038	2	2	3.500% due 05/01/2051	75	63
5.000% due 11/01/2039	6	6	3.500% due 04/01/2052	2,952	2,463
5.500% due 07/01/2033	18	18	3.500% due 06/01/2052	2,323	1,939
5.500% due 06/01/2035	657	624	3.500% due 07/01/2052	993	828
5.500% due 04/01/2036	1	1	3.500% due 09/01/2052	33	27
5.500% due 11/01/2036	1	1	3.500% due 11/01/2052	836	700
5.500% due 03/01/2037	11	11	4.000% due 09/01/2033	1	1
5.500% due 09/01/2037	4	4	4.000% due 08/01/2042	465	410
5.500% due 02/01/2038	3	3	4.000% due 09/01/2042	656	578
5.500% due 04/01/2038	11	11	4.000% due 12/01/2042	7	6
6.000% due 08/01/2031	20	19	4.000% due 04/01/2047	296	262
6.000% due 06/01/2032	1	1	4.000% due 05/01/2047	287	254
6.000% due 09/01/2039	358	345	4.000% due 08/01/2047	522	462
6.000% due 10/01/2047	8	7	4.000% due 08/01/2048	602	530
6.000% due 01/01/2053	26,626	26,056	4.000% due 09/01/2048	245	216
6.500% due 01/01/2037	1	1	4.000% due 12/01/2048	9,227	8,119
6.500% due 10/01/2037	3	3	4.000% due 02/01/2049	3,684	3,241
6.500% due 10/01/2053	6,847	6,815	4.000% due 03/01/2049	287	252
7.000% due 09/01/2031	27	27	5.000% due 06/01/2034	65	64
Fannie Mae, TBA (d)			5.000% due 08/01/2035	39	38
2.500% due 12/01/2053	146,000	112,203	5.000% due 01/01/2037	2	2
3.000% due 11/01/2038	1,800	1,609	5.000% due 01/01/2038	1	1
3.000% due 11/01/2053	0	0	5.500% due 01/01/2035	257	252

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
5.500% due 05/01/2037	2	2	5.500% due 09/20/2039	50	48
5.500% due 06/01/2037	90	88	5.500% due 10/20/2039	8	7
5.750% due 05/01/2037	83	82	5.500% due 11/20/2039	212	204
6.000% due 07/01/2037	40	40	5.500% due 12/20/2039	24	22
6.000% due 01/01/2053	8,304	8,121	5.500% due 01/20/2040	187	176
Ginnie Mae			5.500% due 06/20/2040	208	203
4.000% due 06/20/2041	1	1	5.500% due 07/20/2040	470	443
4.000% due 04/20/2047	1,441	1,290	5.500% due 07/20/2053	21,057	20,155
4.000% due 05/20/2047	26,657	23,925	5.500% due 08/20/2053	18,417	17,627
4.000% due 06/20/2047	12,651	11,325	Ginnie Mae, TBA (d)		
4.000% due 07/20/2047	10,939	9,792	2.000% due 11/01/2053	19,000	14,653
4.000% due 02/20/2048	7,567	6,768	2.500% due 12/01/2053	46,200	36,816
4.000% due 05/20/2049	26,126	23,437	3.000% due 11/01/2053	147,100	121,256
4.000% due 02/20/2050	318	287	3.000% due 12/01/2053	494,900	408,181
4.000% due 07/20/2050	156	140	3.500% due 10/01/2053	182,700	155,733
4.000% due 08/20/2050	24	22	3.500% due 12/01/2053	99,000	84,418
4.000% due 09/20/2050	1,893	1,698	4.000% due 11/01/2053	513,000	450,979
4.000% due 10/20/2050	59,971	53,798	4.000% due 12/01/2053	944,000	830,204
4.000% due 11/20/2052	252	222	4.500% due 11/01/2053	177,660	160,530
4.500% due 10/20/2035	416	380	4.500% due 12/01/2053	496,000	448,368
4.500% due 01/20/2040	76	69	5.000% due 11/01/2041	277,000	257,751
4.500% due 03/20/2040	7	7	5.500% due 11/01/2053	22,000	21,039
4.500% due 07/15/2040	1,105	1,032	5.500% due 12/01/2053	247,000	236,155
4.500% due 07/20/2040	1,207	1,122	米国政府関係機関合計		<u>5,383,620</u>
4.500% due 08/15/2040	1,317	1,239	(取得原価 5,497,999千米ドル)		
4.500% due 08/20/2040	871	810	米国長期国債 15.1%		
4.500% due 09/20/2040	3,628	3,371	Treasury Inflation Protected Securities (i)		
4.500% due 10/20/2040	987	918	0.125% due 07/15/2024	194,667	190,176
4.500% due 01/20/2041	4,678	4,348	0.125% due 10/15/2024	141,986	137,773
4.500% due 02/20/2041	2,268	2,096	0.125% due 04/15/2025	33,341	31,837
4.500% due 03/20/2041	8,736	8,093	0.125% due 07/15/2030	54,737	46,922
4.500% due 04/15/2041	1,054	991	0.125% due 01/15/2031	2,005	1,692
4.500% due 04/20/2041	926	861	0.125% due 07/15/2031	7,606	6,371
4.500% due 06/20/2041	7,991	7,428	0.250% due 01/15/2025	72,526	69,835
4.500% due 07/20/2041	2,066	1,920	0.250% due 07/15/2029	148,070	131,114
4.500% due 09/20/2041	206	191	0.250% due 02/15/2050	21,926	12,189
4.500% due 10/20/2041	1,179	1,083	0.375% due 01/15/2027	5,903	5,486
4.500% due 12/20/2041	1,847	1,718	0.375% due 07/15/2027	1,581	1,463
4.500% due 05/20/2043	438	407	0.500% due 04/15/2024	96,682	95,057
4.500% due 07/20/2043	292	272	0.625% due 01/15/2024	169,533	168,013
4.500% due 07/20/2053	USD 103,767	93,851	0.625% due 07/15/2032	91,088	78,043
4.500% due 08/20/2053	1,022	925	0.625% due 02/15/2043	2,938	2,035
4.500% due 09/20/2053	299,110	270,538	0.750% due 07/15/2028	34,682	32,098
5.000% due 08/20/2030	170	160	0.750% due 02/15/2042	6,930	5,013
5.000% due 05/20/2040	262	246	0.750% due 02/15/2045	18,905	13,052
5.000% due 04/20/2041	7	6	0.875% due 01/15/2029	63,316	58,326
5.500% due 05/20/2038	7	7	0.875% due 02/15/2047	22,131	15,330
5.500% due 06/20/2038	35	34	1.000% due 02/15/2046	11,921	8,609
5.500% due 07/20/2038	34	32	1.000% due 02/15/2048	25,897	18,280
5.500% due 08/20/2038	233	225	1.000% due 02/15/2049	65,655	46,012
5.500% due 09/20/2038	72	69	1.375% due 07/15/2033	117,671	106,538
5.500% due 10/20/2038	15	14	1.375% due 02/15/2044	3,425	2,733
5.500% due 01/20/2039	10	10	1.500% due 02/15/2053	26,958	21,153
5.500% due 02/20/2039	26	25	2.125% due 02/15/2040	USD 3,551	3,322

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
2.125% due 02/15/2041	1,963	1,832	6.039% due 01/25/2036	5,261	4,498
U.S. Treasury Bonds			6.094% due 12/20/2035	5,133	4,495
2.250% due 08/15/2046	100	60	6.150% due 08/25/2035 (b)	367	285
2.750% due 08/15/2047	2,830	1,865	7.000% due 10/25/2037	29,361	10,459
3.000% due 08/15/2048	155	107	7.089% due 10/25/2034	2,026	1,953
3.000% due 02/15/2049	77	53	Ameriquest Mortgage Securities Trust		
3.125% due 05/15/2048	180	127	5.949% due 04/25/2036	656	652
4.375% due 08/15/2043	33,800	30,151	6.054% due 03/25/2036	26,883	24,379
U.S. Treasury Notes			Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
1.625% due 02/15/2026	2,200	2,040	3.610% due 09/25/2032	104	106
2.000% due 02/15/2025	11,021	10,572	6.459% due 01/25/2036	7,000	5,725
2.000% due 08/15/2025	1,400	1,326	7.194% due 10/25/2034	USD 9,913	8,989
2.000% due 11/15/2026	800	735	Angel Oak Mortgage Trust		
2.250% due 11/15/2024	12,300	11,906	6.500% due 12/25/2067	4,058	4,011
2.250% due 02/15/2027	28,000	25,789	Argent Mortgage Loan Trust		
2.375% due 05/15/2029	32,200	28,297	5.919% due 05/25/2035	18,802	16,781
2.625% due 02/15/2029	5,000	4,478	Argent Securities Trust		
2.750% due 08/15/2032	150,100	126,999	5.799% due 04/25/2036	7,677	2,458
2.875% due 05/15/2032	290	249	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
米国長期国債合計		<u>1,555,058</u>	4.131% due 09/25/2033	2,584	2,441
(取得原価 1,734,056千米ドル)			6.204% due 10/25/2035	36,400	31,230
モーゲージバック証券 40.8%			Asset-Backed Funding Certificates Trust		
Accredited Mortgage Loan Trust			5.659% due 10/25/2036	10,129	8,252
6.384% due 07/25/2035	7,714	7,468	6.099% due 03/25/2035	10,915	10,340
7.134% due 07/25/2035 (b)	2,206	1,765	6.174% due 06/25/2035	6,550	6,181
ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust			6.414% due 06/25/2035 (b)	4,194	3,727
5.749% due 08/25/2036	3,308	3,105	Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
6.234% due 01/25/2035	841	763	3.842% due 05/25/2036 (b)	46,467	41,083
6.264% due 02/25/2034	1,389	1,402	Atrium Hotel Portfolio Trust		
6.339% due 08/25/2035	4,516	4,289	7.062% due 06/15/2035	18,395	17,797
6.369% due 11/25/2034	1,120	1,090	Austin Fairmont Hotel Trust		
6.609% due 02/25/2035	6,632	6,153	7.182% due 09/15/2032	3,000	2,927
Adjustable Rate Mortgage Trust			Avon Finance		
6.389% due 08/25/2035	3,175	2,764	0.000% due 12/28/2049	GBP 2,400	2,808
AFC Home Equity Loan Trust			Banc of America Alternative Loan Trust (b)		
6.249% due 06/25/2029	1,587	926	3.986% due 01/24/2024	USD 52	42
Alternative Loan Trust			6.000% due 07/25/2046	1,370	1,102
4.140% due 08/25/2035 (b)	420	385	Banc of America Funding Trust		
4.158% due 08/25/2036	5,426	4,855	4.129% due 02/20/2035	1,283	1,066
5.268% due 09/25/2034	772	686	4.156% due 06/20/2036	4,044	3,205
5.500% due 04/25/2034	8,776	8,291	4.429% due 01/20/2047 (b)	78	70
5.500% due 06/25/2035	4,396	3,424	6.299% due 04/25/2037	7,934	6,646
5.500% due 08/25/2035 (b)	49	40	BCAP LLC Trust		
5.500% due 09/25/2035	2,541	1,568	4.229% due 04/26/2036	4,613	2,335
5.500% due 02/25/2036 (b)	14	8	5.876% due 04/26/2037	2,725	1,250
5.644% due 09/20/2046	542	541	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
5.799% due 07/25/2036	3,895	3,842	4.703% due 11/25/2034	188	177
5.819% due 08/25/2046 (b)	8,382	6,782	Bear Stearns Alternative-A Trust		
5.839% due 05/25/2036	12,205	10,255	5.779% due 04/25/2037	5,937	5,046
5.874% due 03/20/2046	4,994	3,948	5.859% due 11/25/2046	6,882	4,968
5.939% due 12/25/2046	13,414	10,764	6.159% due 08/25/2035 (b)	4,527	4,166
5.979% due 07/25/2036	18,309	15,296	Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
6.000% due 11/25/2036	1,701	960	1.161% due 05/25/2036 (h)	8,516	158
6.000% due 07/25/2037 (b)	24,518	11,622	4.845% due 11/25/2035 (b)	2,773	2,599

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
5.224% due 06/25/2034		3,406	3,272	3.250% due 10/25/2058	17,962	15,283
5.387% due 12/25/2035		9,275	7,956	6.639% due 12/25/2067	4,642	4,598
5.438% due 09/25/2034		4,736	4,517	CIT Mortgage Loan Trust		
5.462% due 04/25/2036		3,944	3,916	6.789% due 10/25/2037	315	314
5.739% due 06/25/2047		6,300	6,037	6.939% due 10/25/2037	28,585	27,688
5.839% due 05/25/2036 (b)		13,454	4,102	Citigroup Commercial Mortgage Trust		
5.844% due 07/25/2036		7,785	7,044	0.280% due 03/11/2047 (h)	25,400	0
5.919% due 02/25/2037		2,089	4,655	Citigroup Mortgage Loan Trust		
6.054% due 02/25/2036 (b)		9,845	9,469	4.313% due 08/25/2036	3,773	3,468
6.489% due 08/25/2037		15,783	13,308	4.507% due 07/25/2037 (b)	2,291	1,957
7.464% due 03/25/2035		3,262	3,074	5.714% due 08/25/2036	15,222	6,195
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5.719% due 12/25/2036	2,337	2,198
5.500% due 11/25/2033		3,513	3,056	5.759% due 12/25/2036	9,652	5,304
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				5.764% due 01/25/2037 (b)	2,205	954
5.839% due 02/25/2037 (b)		4,876	4,369	6.259% due 09/25/2037	12,220	10,065
Benchmark Mortgage Trust				7.250% due 05/25/2036 (b)	8,567	4,259
3.509% due 09/15/2048		47,290	41,029	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
3.899% due 03/15/2062		9,775	6,555	6.474% due 05/25/2035	10,698	9,722
BHP Trust				7.939% due 07/25/2037	3,507	3,193
7.153% due 08/15/2036		10,500	10,283	Commercial Mortgage Trust		
7.950% due 08/15/2036		33,656	32,883	0.177% due 04/10/2047 (h)	33,000	5
Bridgegate Funding PLC				3.633% due 02/10/2037	10,000	9,208
7.442% due 10/16/2062	GBP	12,821	15,532	8.599% due 12/15/2038	8,575	7,709
8.192% due 10/16/2062		18,993	22,788	Conseco Finance Corp.		
9.192% due 10/16/2062		9,971	11,992	6.920% due 12/01/2030	805	800
10.192% due 10/16/2062	GBP	7,217	8,654	7.500% due 03/01/2030	45,434	16,682
BSST Mortgage Trust				7.600% due 04/15/2026	4,902	1,114
8.185% due 02/15/2037	USD	11,000	8,810	Countrywide Asset-Backed Certificates		
8.835% due 02/15/2037		24,700	18,963	5.939% due 08/26/2033	178	167
9.835% due 02/15/2037		7,500	5,591	7.314% due 05/25/2035 (b)	4,282	4,123
BX Commercial Mortgage Trust				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
6.347% due 02/15/2039		6,805	6,614	0.000% due 06/25/2034	1	1
BX Trust				3.765% due 03/25/2037 (b)	3,573	3,079
7.094% due 10/15/2036		16,400	15,715	4.295% due 10/20/2035 (b)	4,097	3,698
7.336% due 10/15/2036		7,150	6,730	4.371% due 11/25/2037	4,383	3,917
7.344% due 10/15/2036		25,610	24,145	4.703% due 11/25/2034	7	6
9.944% due 07/15/2034		6,800	6,692	5.500% due 11/25/2035 (b)	5,427	2,885
Canterbury Finance No.4 PLC				6.000% due 07/25/2036	17,226	8,805
6.042% due 05/16/2058	GBP	82,252	99,544	6.000% due 11/25/2037	3,330	1,277
Carrington Mortgage Loan Trust				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.		
6.609% due 02/25/2035	USD	3,468	2,912	7.889% due 01/25/2033 \$	USD	975
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage				Credit Suisse Mortgage Capital		
6.040% due 01/25/2039 (b)		504	447	3.000% due 01/29/2036	321	305
Centex Home Equity Loan Trust				3.000% due 06/27/2037	1,039	1,010
6.084% due 03/25/2035		1,952	1,925	5.755% due 11/27/2036	10,152	12,301
Chase Home Lending Mortgage Trust				6.199% due 10/26/2036	131	107
3.250% due 03/25/2063		21,203	17,664	Credit Suisse Mortgage Capital Trust		
Chase Mortgage Finance Trust				0.000% due 01/25/2058	20	19
4.017% due 12/25/2035 (b)		3,694	3,154	0.000% due 04/25/2058 (h)	1	1
ChaseFlex Trust				3.431% due 11/10/2032	1,922	1,606
5.739% due 07/25/2037		853	700	3.616% due 01/25/2058	17,606	13,598
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				4.390% due 06/25/2050	41,375	33,819
5.799% due 03/25/2035		298	281	4.454% due 04/25/2058	27,655	24,088
CIM Trust				5.556% due 06/01/2050	36,218	36,129

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)	
6.194% due 07/15/2032	2,303	2,194	6.109% due 09/13/2045	GBP	3,605	4,173
6.444% due 07/15/2032	4,000	3,766	6.289% due 06/13/2045		5,237	6,273
6.644% due 07/15/2032	2,400	2,238	Extended Stay America Trust			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			8.298% due 07/15/2038	USD	15,158	14,849
7.480% due 03/25/2046	4,266	3,505	FBR Securitization Trust			
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			6.114% due 10/25/2035		19,109	15,937
4.341% due 12/25/2034	6,805	6,216	6.204% due 09/25/2035		7,327	7,013
5.579% due 06/25/2035 (b)	1,473	1,240	FFMLT Trust			
5.579% due 06/25/2037	12,462	11,213	6.369% due 11/25/2035		2,069	1,654
5.579% due 07/25/2037 (b)	3,130	3,072	First Franklin Mortgage Loan Trust			
5.619% due 11/25/2047	2,027	2,223	4.330% due 04/25/2035		2,811	2,639
5.633% due 06/25/2035	8,644	6,664	5.749% due 11/25/2036		59,328	45,737
5.659% due 08/25/2037	25,800	22,270	5.759% due 04/25/2036		3,831	3,638
5.669% due 10/25/2047	5,333	5,203	6.114% due 03/25/2034		2,412	2,313
5.689% due 02/25/2036	1,031	952	6.129% due 01/25/2036		24,773	22,083
5.859% due 01/25/2045	765	759	6.144% due 05/25/2036		56	55
5.899% due 05/25/2037 (b)	10,937	10,133	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
5.919% due 05/25/2036	9,196	7,407	0.000% due 05/25/2035 (b)(h)		1,162	21
5.919% due 03/25/2037	27,139	24,503	5.500% due 05/25/2035 (b)		1,162	686
5.919% due 03/25/2047 (b)	26,535	21,424	Fontainebleau Miami Beach Trust			
5.959% due 09/25/2046	5,600	5,070	3.963% due 12/10/2036		33,098	31,391
5.964% due 08/25/2036	2,303	2,197	Fremont Home Loan Trust			
6.039% due 06/25/2036	858	848	5.719% due 02/25/2037		6,602	4,955
6.139% due 03/25/2036 (b)	1,451	1,237	5.729% due 05/25/2036		6,191	5,946
6.519% due 05/25/2036 (b)	2,262	1,537	6.099% due 01/25/2036		6,000	5,597
6.534% due 06/25/2035	8,400	7,947	6.459% due 01/25/2035		6,493	5,200
7.014% due 11/25/2034	7,394	7,166	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
7.389% due 08/25/2035	3,000	2,790	6.129% due 10/25/2035		9,882	8,187
CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust			Glen Securities Finance DAC			
6.789% due 08/25/2047	34,300	30,495	5.814% due 10/28/2038	EUR	4,383	4,565
7.014% due 03/25/2035	16,905	16,185	6.814% due 10/28/2038		3,287	3,383
7.839% due 02/25/2035 (b)	6,963	5,083	7.852% due 10/28/2038		1,607	1,656
DBGS Mortgage Trust			GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			
8.099% due 10/15/2036	15,000	8,342	5.456% due 03/10/2051	USD	11,781	10,098
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust			GreenPoint Mortgage Funding Trust			
5.759% due 03/25/2037	9,093	4,898	5.999% due 11/25/2045		32	21
5.769% due 08/25/2037 (b)	18,540	14,508	Grifonas Finance No.1 PLC			
5.939% due 09/25/2047	11,350	9,410	4.212% due 08/28/2039	EUR	513	518
Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			GS Mortgage Securities Corporation Trust			
4.460% due 10/25/2035 (b)	8,549	7,310	4.591% due 10/10/2032	USD	8,215	7,823
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			GSAA Home Equity Trust (b)			
4.240% due 11/27/2036	812	807	6.182% due 11/25/2036		2,934	662
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates			6.500% due 11/25/2037		20	8
4.051% due 06/27/2037	11,382	9,780	GSAMP Trust			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			5.579% due 03/25/2047		3,675	3,184
5.638% due 10/19/2036 (b)	7,097	5,680	5.599% due 01/25/2037		16,585	9,373
6.108% due 09/19/2045	4,847	2,527	5.959% due 06/25/2036		10,860	10,229
Ellington Loan Acquisition Trust			6.084% due 11/25/2035 (b)		5,636	4,885
6.539% due 05/25/2037	1,020	965	6.414% due 08/25/2034		3,081	2,874
EMC Mortgage Loan Trust			6.414% due 04/25/2035 (b)		5,325	4,827
6.489% due 04/25/2042 (b)	5,437	5,398	7.239% due 06/25/2035		3,500	3,214
Encore Credit Receivables Trust			GSMSC Resecuritization Trust			
6.369% due 11/25/2035	USD	6,510	2.122% due 04/26/2037		44,351	11,193
Eurosail-UK PLC			5.614% due 09/26/2036		3,694	2,285

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
GSR Mortgage Loan Trust			5.730% due 03/25/2036 (b)	56	52
1.261% due 03/25/2037 (h)	7,490	549	5.999% due 04/25/2047	1,536	1,445
5.739% due 03/25/2037	7,490	1,147	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
HarborView Mortgage Loan Trust			4.128% due 07/05/2031	2,500	2,241
4.038% due 06/19/2036 (b)	6,049	3,060	6.548% due 12/15/2036	3,700	2,794
5.928% due 12/19/2036 (b)	772	711	7.235% due 10/05/2040	6,900	6,774
6.008% due 02/19/2036	9,501	5,852	7.799% due 09/15/2029	1,740	1,193
6.088% due 08/19/2045	7,547	5,589	7.964% due 11/15/2038	16,193	15,571
Hawaii Hotel Trust			JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.		
7.032% due 05/15/2038	2,000	1,959	6.369% due 12/25/2035	12,010	11,443
7.541% due 05/15/2038	12,500	12,225	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		
Home Equity Asset Trust			4.573% due 11/25/2036	1,976	1,824
5.919% due 10/25/2036	USD 23,475	13,588	5.589% due 12/25/2036	13,723	7,088
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			5.709% due 08/25/2036	8,600	7,511
5.579% due 11/25/2036	11,236	10,041	5.709% due 06/25/2037	34,606	32,318
5.679% due 04/25/2037	12,380	7,821	5.719% due 06/25/2037 (b)	22,826	18,699
5.799% due 06/25/2036	2,039	1,872	5.844% due 05/25/2036	8,051	7,712
5.979% due 06/25/2036	16,717	11,398	5.874% due 05/25/2036	16,179	14,897
6.429% due 08/25/2035	3,660	3,588	JPMorgan Mortgage Trust		
HPLY Trust			4.686% due 01/25/2037 (b)	375	319
7.451% due 11/15/2036	4,675	4,528	5.250% due 11/25/2063	987	913
7.801% due 11/15/2036	26,212	25,322	5.739% due 10/25/2035 (b)	3,510	2,473
HSI Asset Securitization Corp. Trust			6.000% due 06/25/2037 (b)	3,266	1,298
5.539% due 07/25/2036	2,197	913	JPMorgan Resecuritization Trust		
5.739% due 07/25/2036	8,971	3,744	3.968% due 02/26/2037	1,850	1,657
5.814% due 05/25/2037	7,197	6,772	Kentmere No.2 PLC		
Impac CMB Trust			0.000% due 01/28/2042	GBP 11,939	4,273
6.119% due 01/25/2035	7,756	7,130	5.987% due 01/28/2042	40,807	49,412
Impac Secured Assets Corp.			6.587% due 01/28/2042	5,693	6,702
5.999% due 03/25/2036 (b)	8,132	6,351	6.937% due 01/28/2042	4,066	4,778
Impac Secured Assets Trust			7.387% due 01/28/2042	2,439	2,862
5.629% due 01/25/2037	1,986	1,567	8.187% due 01/28/2042	1,626	1,908
IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust			10.187% due 01/28/2042	3,252	3,729
6.500% due 10/25/2037	8,467	4,234	Kinbane DAC		
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust			4.711% due 09/25/2062	EUR 53,317	55,976
3.894% due 06/25/2037 (b)	8,206	4,916	Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust			4.145% due 06/15/2045	2,557	2,557
3.285% due 07/25/2037	17,978	15,515	Legacy Mortgage Asset Trust		
3.342% due 04/25/2037	13,319	11,321	0.000% due 09/25/2059	USD 18,019	5,150
3.473% due 04/25/2037 (b)	6,519	5,701	0.000% due 09/25/2059 (h)	582,847	2,313
3.546% due 03/25/2036 (b)	3,949	2,796	3.000% due 09/25/2059	93,500	85,921
4.157% due 11/25/2036 (b)	10,927	7,428	4.151% due 09/25/2059	129,610	83,697
5.799% due 02/25/2037 (b)	20,856	19,365	5.750% due 03/25/2060	30,590	30,000
5.819% due 10/25/2036	4,825	1,963	6.250% due 05/25/2060	9,950	9,873
6.039% due 07/25/2035	5,676	4,413	7.191% due 01/28/2070	14,554	14,570
INTOWN Mortgage Trust			7.250% due 11/25/2059	8,626	8,596
9.019% due 08/15/2039	11,495	11,506	Lehman XS Trust		
IXIS Real Estate Capital Trust			5.639% due 02/25/2037 (b)	11,956	10,452
6.204% due 12/25/2035	686	721	5.819% due 09/25/2036	4,609	3,649
Jefferies Resecuritization Trust			5.819% due 12/25/2036	11,465	8,177
8.746% due 06/25/2047 (b)	431	348	5.839% due 06/25/2046	9,022	7,373
JPMorgan Alternative Loan Trust			5.959% due 02/25/2047	20,849	18,287
3.896% due 03/25/2036 (b)	270	192	6.500% due 06/25/2046	4,527	3,527
4.036% due 09/25/2036	8,788	7,263	7.139% due 10/25/2037	12,652	11,250

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Long Beach Mortgage Loan Trust			5.754% due 11/26/2036	5,003	4,135
5.819% due 02/25/2036	23,058	17,770	Mortgage Loan Trust		
5.819% due 03/25/2046	32,775	11,617	5.370% due 03/25/2034	3,310	2,981
LUXE Trust			MortgageIT Trust		
7.204% due 10/15/2038	1,710	1,674	7.014% due 08/25/2035	299	274
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			MTN Commercial Mortgage Trust		
8.689% due 03/25/2032	303	303	6.737% due 03/15/2039	1,120	1,097
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			Natixis Commercial Mortgage Securities Trust		
3.849% due 04/25/2034	1	1	3.790% due 11/15/2032	1,700	1,023
6.000% due 12/25/2046	7,328	6,538	3.821% due 02/15/2039	2,900	2,531
Mastr Asset-Backed Securities Trust			New Century Home Equity Loan Trust		
5.879% due 11/25/2036	24	14	6.564% due 10/25/2033	157	153
5.994% due 01/25/2036	7,500	6,603	New York Mortgage Trust		
6.589% due 08/25/2037	14,253	11,589	5.979% due 04/25/2035	565	522
Mastr Specialized Loan Trust			Newgate Funding PLC		
6.159% due 02/25/2036	5,379	3,995	5.741% due 12/15/2050	GBP 15,345	17,740
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
8.439% due 10/25/2037	13,130	12,180	5.034% due 05/25/2035 (b)	USD 2,780	1,356
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust		
4.926% due 02/25/2033	7	7	6.204% due 05/25/2035	6,036	5,838
5.719% due 05/25/2037	18,801	9,287	6.245% due 10/25/2036 (b)	21,460	4,846
5.719% due 10/25/2037	53,882	7,909	Nomura Resecuritization Trust		
6.159% due 07/25/2034	4,729	4,058	1.952% due 03/26/2037	5,464	4,442
6.234% due 09/25/2035	665	659	NovaStar Mortgage Funding Trust		
6.519% due 10/25/2035	518	508	5.639% due 09/25/2037	15,625	14,955
MFA Trust			5.759% due 05/25/2036	4,708	4,565
6.775% due 10/25/2058	5,073	5,048	5.759% due 10/25/2036	5,312	2,721
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			6.159% due 10/25/2035	848	835
5.689% due 07/25/2036	4,737	4,004	NYO Commercial Mortgage Trust		
5.699% due 02/25/2037	7,251	3,360	7.444% due 11/15/2038	30,130	22,865
5.739% due 07/25/2036	44,061	15,856	7.994% due 11/15/2038	14,400	9,491
5.919% due 06/25/2036	19,511	16,327	OBX Trust		
5.939% due 07/25/2036	43,845	15,776	6.319% due 01/25/2062	10,517	10,413
5.979% due 03/25/2036	4,101	3,866	6.520% due 07/25/2063	7,550	7,499
6.174% due 07/25/2035	4,929	4,727	Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates		
6.439% due 03/25/2033	65	63	6.189% due 07/25/2035	5,051	5,036
6.439% due 07/25/2037	253	245	Option One Mortgage Loan Trust		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			5.539% due 02/25/2037	17,611	8,665
0.771% due 11/15/2052 (h)	129,113	2,858	5.559% due 03/25/2037	7,079	6,625
Morgan Stanley Capital I Trust			5.579% due 03/25/2037	33,857	27,990
2.428% due 04/05/2042	USD 13,500	9,709	5.719% due 07/25/2036	1,970	1,095
7.032% due 08/15/2033	2,619	1,506	6.249% due 02/25/2035	3,416	2,606
7.827% due 12/15/2038	21,942	20,713	Ownit Mortgage Loan Trust		
8.526% due 12/15/2038	40,574	37,466	5.699% due 10/25/2037	3,641	3,411
Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust			5.759% due 10/25/2037	2,501	2,351
5.979% due 02/25/2036 (b)	18,224	15,765	5.819% due 07/25/2037	2,795	2,790
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			5.979% due 03/25/2037	6,225	5,807
5.949% due 02/25/2036	14,415	12,698	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			6.174% due 09/25/2035	3,376	3,218
5.899% due 07/25/2036	9,969	3,961	6.219% due 09/25/2035 (b)	25,075	21,014
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			6.909% due 01/25/2035 (b)	2,000	1,445
3.275% due 11/25/2037	1,208	781	7.464% due 12/25/2034	25,974	22,618
6.000% due 12/25/2035 (b)	480	184	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust		
Morgan Stanley Reremic Trust			5.599% due 09/25/2036	USD 26,232	4,993

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust				1.922% due 03/25/2035 (b)	USD	367	347
3.437% due 11/25/2035		17,970	15,256	7.189% due 12/25/2037		2,648	2,411
3.556% due 07/25/2035 (b)		9,601	6,979	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5.749% due 11/25/2036 (b)		15,325	12,011	5.979% due 03/25/2036		4,673	4,021
Precise Mortgage Funding PLC				6.264% due 10/25/2035		10,136	9,109
0.000% due 12/12/2055	GBP	0	250	6.489% due 03/25/2035		5,127	4,906
PRET LLC				Sequoia Mortgage Trust			
1.843% due 09/25/2051	USD	36,709	33,071	5.854% due 05/20/2035		1,008	859
8.232% due 09/25/2053		17,191	17,153	5.974% due 06/20/2034		19	17
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				Sestante Finance Srl			
8.497% due 10/25/2053 (d)		16,040	16,040	4.222% due 07/23/2046	EUR	7,845	7,837
Prime Mortgage Trust				SFO Commercial Mortgage Trust			
6.000% due 04/25/2037		3,713	2,807	7.848% due 05/15/2038	USD	885	687
PRKCM Trust				8.348% due 05/15/2038		22,000	16,501
6.584% due 09/25/2058		9,307	9,248	SG Mortgage Securities Trust			
PRPM LLC				5.799% due 02/25/2036		4,682	2,334
1.793% due 07/25/2026		8,562	8,006	5.899% due 07/25/2036		8,095	1,698
PRPM Trust				Shamrock Residential DAC			
6.250% due 08/25/2068		8,200	8,072	4.713% due 01/24/2061	EUR	19,491	20,446
Quest Trust				5.113% due 02/24/2071		24,604	25,942
6.864% due 03/25/2035		1,327	1,314	Soundview Home Loan Trust			
RAAC Trust				4.154% due 04/25/2035	USD	2,319	2,127
6.144% due 02/25/2036 (b)		8,360	7,682	5.859% due 06/25/2036 (b)		7,815	6,085
6.189% due 06/25/2047		21,346	14,966	5.904% due 06/25/2036 (b)		49,916	39,853
RBSGC Mortgage Loan Trust				5.919% due 07/25/2036		24,020	20,383
6.000% due 01/25/2037 (b)		2	1	6.414% due 03/25/2036		8,102	7,004
Real Estate Asset Liquidity Trust				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
2.419% due 06/12/2054	CAD	1,194	854	6.414% due 12/25/2035		567	553
Renaissance Home Equity Loan Trust				SREIT Trust			
5.612% due 04/25/2037	USD	10,124	2,724	6.893% due 10/15/2038		24,605	23,869
5.675% due 06/25/2037 (b)		3,910	1,006	7.241% due 10/15/2038		20,425	19,743
6.159% due 11/25/2034		167	142	Stratton Mortgage Funding PLC			
6.439% due 09/25/2037		33	27	7.299% due 09/25/2051	GBP	2,000	2,406
Residential Accredit Securities Corporation Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5.268% due 04/25/2034		1,162	1,012	4.097% due 06/25/2037	USD	1,507	1,352
5.659% due 02/25/2037		20,256	19,003	5.041% due 07/25/2035 (b)		1,993	900
5.739% due 01/25/2037		36,046	25,552	5.759% due 10/25/2035		5,328	4,757
5.934% due 04/25/2036		5,478	5,341	6.200% due 05/25/2035 (b)		53	37
6.054% due 03/25/2036		6,180	5,538	6.414% due 08/25/2035		8,667	7,332
6.414% due 09/25/2035		5,649	5,444	Structured Asset Investment Loan Trust			
6.474% due 08/25/2035		2,060	1,998	5.739% due 06/25/2036		5,118	4,683
Residential Asset Mortgage Products Trust				5.939% due 06/25/2036		25,000	8,293
5.789% due 10/25/2036		14,675	13,617	6.159% due 04/25/2035		3,571	3,451
6.039% due 02/25/2036		1,063	1,048	6.239% due 02/25/2034		12,178	11,773
6.114% due 11/25/2035		8,981	8,664	6.639% due 12/25/2034		2,200	2,164
6.119% due 12/25/2035		9,964	8,431	Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
6.189% due 09/25/2035		7,021	6,784	5.859% due 09/25/2047 (b)		18,876	15,170
Residential Mortgage Acceptance Corporation No.3 PLC				5.879% due 05/25/2036		9,371	7,179
0.000% due 02/15/2047	GBP	26,100	31,720	6.123% due 04/19/2035		1,318	1,209
RESIMAC Bastille Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust			
6.372% due 09/05/2057	USD	598	598	6.108% due 09/19/2032		12	12
RMAC Securities No.1 PLC				Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
4.230% due 06/12/2044	EUR	3,720	3,674	5.569% due 05/25/2036		5,123	4,851
Saxon Asset Securities Trust				5.689% due 05/25/2036		3,418	2,728

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
5.729% due 07/25/2036 (b)		9,526	8,821	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5.749% due 07/25/2036		14,180	13,778	5.859% due 03/25/2037		658	638
5.759% due 10/25/2036		8,263	5,536	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
5.939% due 04/25/2031		5,841	5,780	6.039% due 04/25/2034		3,311	3,150
6.369% due 11/25/2035		3,185	3,175	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
Summerhill Residential				6.389% due 10/25/2036 (b)		145	122
0.000% due 03/24/2059	EUR	5	3	WFRBS Commercial Mortgage Trust			
4.713% due 03/24/2059		121,196	127,947	0.481% due 03/15/2047 (h)		8,800	13
5.113% due 03/24/2059		22,011	23,224	WSTN Trust			
5.663% due 03/24/2059		17,746	18,718	6.297% due 07/05/2037		6,000	5,772
6.263% due 03/24/2059		14,202	14,946	モーゲージバック証券合計			4,187,952
6.500% due 03/24/2059		6,568	5,181	(取得原価 4,663,284千米ドル)			
7.000% due 03/24/2059		35,506	29,385	アセットバック証券 7.5%			
7.513% due 03/24/2059		8,521	8,960	AASET Trust			
8.863% due 03/24/2059		4,256	4,475	3.967% due 05/16/2042		23	20
9.863% due 03/24/2059		4,256	4,475	ACHV ABS TRUST			
Temple Quay No.1 PLC				6.600% due 08/19/2030		525	525
6.689% due 07/24/2085	GBP	58,277	70,553	AGL CLO 6 Ltd.			
7.189% due 07/24/2085		15,904	19,093	6.877% due 07/20/2034		3,000	2,979
8.189% due 07/24/2085		14,681	17,627	ALESCO Preferred Funding XI Ltd.			
Terwin Mortgage Trust				6.112% due 12/23/2036		5,000	3,925
6.819% due 03/25/2035	USD	2,943	2,706	American Homes 4 Rent Trust			
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				6.231% due 10/17/2036		1,150	1,141
7.750% due 11/11/2034		4,718	4,606	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			
Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC				7.185% due 05/15/2037		3,146	3,095
8.261% due 02/20/2054	GBP	16,900	20,505	AREIT LLC			
Towd Point Mortgage Trust				7.447% due 02/17/2028		2,900	2,901
3.750% due 03/25/2058	USD	3,080	2,987	Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion			
3.750% due 09/25/2062		91,538	81,578	5.683% due 02/28/2032	EUR	1,411	1,472
Truman Capital Mortgage Loan Trust				Barings CLO Ltd.			
5.699% due 03/25/2036		491	485	6.747% due 01/20/2032	USD	14,700	14,590
Verus Securitization Trust				BlueMountain CLO XXII Ltd.			
4.474% due 04/25/2067		29,167	27,139	6.735% due 07/15/2031		3,863	3,855
5.811% due 05/25/2068		14,703	14,434	BPCRE Ltd.			
5.999% due 02/25/2068		4,974	4,897	7.735% due 01/16/2037		13,800	13,706
6.443% due 08/25/2068		7,096	7,038	8.435% due 01/16/2037		3,468	3,442
6.665% due 09/25/2068		19,177	19,038	9.135% due 01/16/2037		13,516	13,433
Visio Trust				Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6.598% due 10/25/2058		4,640	4,609	6.699% due 07/27/2031	USD	5,612	5,590
Wachovia Mortgage Loan Trust				6.757% due 01/20/2032		12,400	12,330
6.129% due 10/25/2035		2,862	2,490	Carlyle U.S. CLO Ltd.			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				6.815% due 10/15/2035		19,200	19,095
6.159% due 01/25/2045		360	312	Carvana Auto Receivables Trust			
6.354% due 08/25/2045		3,143	2,557	5.710% due 07/10/2029		2,500	2,455
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC				6.090% due 11/10/2026		2,445	2,442
0.000% due 12/21/2049	GBP	1	3,768	Castlelake Aircraft Securitization Trust			
6.151% due 12/21/2049		21,173	25,727	4.125% due 06/15/2043		1,112	1,012
6.870% due 12/21/2049		4,921	5,914	Cedar Funding VII CLO Ltd.			
7.370% due 12/21/2049		2,460	2,940	6.677% due 01/20/2031		2,357	2,353
7.870% due 12/21/2049		1,406	1,675	CIFC Funding I Ltd.			
8.370% due 12/21/2049		1,406	1,648	6.684% due 04/23/2029		5,130	5,109
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (b)				CIFC Funding III Ltd.			
5.500% due 11/25/2035	USD	58	48	6.795% due 07/15/2036		12,000	11,930
5.650% due 10/25/2046		9,705	7,646	6.874% due 10/22/2031		2,640	2,639

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Cologix Canadian Issuer LP				National Collegiate Student Loan Trust			
4.940% due 01/25/2052	CAD	1,800	1,174	5.792% due 10/25/2033		2,336	2,301
CPS Auto Receivables Trust				Navient Private Education Loan Trust			
5.380% due 01/18/2028	USD	1,000	982	6.349% due 11/15/2068		1,194	1,181
6.040% due 07/16/2029		2,100	2,057	7.599% due 12/15/2045		2,087	2,098
6.130% due 09/15/2026		13,341	13,381	Nelnet Student Loan Trust			
Dewolf Park CLO Ltd.				6.235% due 09/25/2065		2,128	2,113
6.575% due 10/15/2030		3,617	3,608	6.640% due 02/20/2041		6,296	6,230
Diamond Infrastructure Funding LLC				Octagon Investment Partners 33 Ltd.			
1.760% due 04/15/2049		900	768	6.867% due 01/20/2031		9,874	9,864
Elmwood CLO VIII Ltd.				Octagon Loan Funding Ltd.			
6.917% due 01/20/2034		6,600	6,574	6.821% due 11/18/2031		395	395
FAB CBO BV				Pagaya AI Debt Trust			
4.941% due 08/20/2080 (b)	EUR	52	54	7.179% due 04/15/2031		13,040	13,051
Finance of America Structured Securities Trust				7.600% due 12/16/2030		5,506	5,523
2.000% due 04/25/2073	USD	5,198	5,016	7.625% due 04/15/2031		3,300	3,297
3.000% due 09/25/2061		14,495	13,399	Palmer Square CLO Ltd.			
Galaxy Xxviii CLO Ltd.				6.963% due 10/20/2033		23,100	23,096
6.755% due 07/15/2031		9,809	9,770	Palmer Square European Loan Funding DAC			
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.				TBD% due 05/15/2033 (d)	EUR	9,200	9,724
5.000% due 03/12/2038	CAD	8,182	4,981	Rad CLO 1 Ltd.			
Goldentree Loan Management U.S. CLO 6 Ltd.				6.635% due 07/15/2031	USD	11,124	11,100
6.736% due 04/20/2035	USD	1,700	1,685	Rockford Tower Europe CLO DAC			
Goodgreen				4.933% due 12/20/2031	EUR	11,755	12,268
3.930% due 10/15/2053		4,058	3,693	Sapphire Aviation Finance I Ltd.			
Goodleap Sustainable Home Solutions Trust				4.250% due 03/15/2040	USD	9,365	7,822
6.500% due 07/20/2055		877	854	Saranac CLO III Ltd.			
Harley Marine Financing LLC				7.258% due 06/22/2030		16,400	16,425
6.682% due 05/15/2043		4,742	4,446	Saratoga Investment Corp. CLO Ltd.			
Humboldt Americas LLC				7.238% due 04/20/2033		15,000	14,928
0.000% due 10/31/2031	COP	62,570,000	14,021	SMB Private Education Loan Trust			
KKR CLO 18 Ltd.				TBD% due 09/15/2053 (d)		20,504	20,585
6.597% due 07/18/2030	USD	1,335	1,331	0.000% due 02/16/2055		3	4,060
LCM XVII LP				3.940% due 02/16/2055		20,138	18,587
6.785% due 10/15/2031		33,700	33,579	4.550% due 02/16/2055		8,414	7,672
LoanCore Issuer Ltd.				4.950% due 02/16/2055		2,185	1,944
6.749% due 07/15/2036		2,350	2,321	5.950% due 02/16/2055		3,907	3,626
6.749% due 11/15/2038		19,100	18,624	6.150% due 09/15/2053 (d)		12,645	12,695
Lockwood Grove CLO Ltd.				6.770% due 02/16/2055		20,138	19,997
6.810% due 01/25/2030		3,484	3,487	6.930% due 09/15/2053 (d)		5,933	5,956
Magnetite XV Ltd.				7.540% due 09/15/2053 (d)		1,205	1,210
6.650% due 07/25/2031		30,132	30,034	8.870% due 09/15/2053 (d)		2,505	2,513
MAN Euro CLO DAC				Sound Point CLO XV Ltd.			
TBD% due 10/15/2036 (d)	EUR	20,000	21,140	6.574% due 01/23/2029		318	319
METAL LLC				Sound Point CLO XVIII Ltd.			
4.581% due 10/15/2042	USD	10,563	6,510	6.797% due 01/21/2031		5,111	5,082
MF1 LLC				Sound Point Euro CLO IV Funding DAC			
7.484% due 06/19/2037		22,100	22,080	5.065% due 01/15/2035	EUR	20,000	20,829
7.969% due 09/17/2037		9,600	9,660	Symphony CLO 39 Ltd.			
7.984% due 06/19/2037		8,236	8,215	7.002% due 04/25/2034	USD	24,800	24,799
MKS CLO Ltd.				Taberna Preferred Funding I Ltd.			
6.867% due 01/20/2031		13,039	13,047	6.146% due 07/05/2035		3,045	2,771
MMcap5 Funding XVII Ltd.				Theorem Funding Trust			
6.021% due 12/01/2035	USD	518	495	6.060% due 12/15/2028		4,304	4,268
Nassau Ltd.				Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
6.805% due 07/15/2031		3,836	3,821	4.212% due 05/17/2032		326	302

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
TRESTLES CLO V Ltd.				Russia Government International Bond			
6.847% due 10/20/2034		8,025	7,941	4.250% due 06/23/2027	USD	28,400	15,336
Tropic CDO V Ltd.				4.375% due 03/21/2029		200	100
5.975% due 07/15/2036		10,163	9,400	4.750% due 05/27/2026		23,800	16,145
TRTX Issuer Ltd.				5.100% due 03/28/2035		3,200	1,136
6.971% due 02/15/2039		4,500	4,382	5.250% due 06/23/2047		82,400	30,076
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				5.625% due 04/04/2042		37,000	24,884
6.826% due 03/30/2039		17,495	16,926	5.875% due 09/16/2043		13,200	8,307
7.229% due 09/20/2039		2,626	2,540	7.150% due 11/12/2025	RUB	4,002,466	17,537
Upstart Pass-Through Trust				7.500% due 03/31/2030	USD	4,748	3,111
3.800% due 04/20/2030	USD	15,609	15,014	7.950% due 10/07/2026	RUB	1,564,954	6,146
Upstart Securitization Trust				South Africa Government International Bond			
5.500% due 06/20/2032		6,632	6,469	10.500% due 12/21/2026	ZAR	2,032,400	111,719
Venture 39 CLO Ltd.				State Agency of Roads of Ukraine			
6.935% due 04/15/2033		4,600	4,569	6.250% due 06/24/2030	USD	1,200	312
Venture XVII CLO Ltd.				Turkey Government International Bond			
6.535% due 04/15/2027		10,245	10,197	4.250% due 03/13/2025		17,980	17,229
アセットバック証券合計			766,915	5.250% due 03/13/2030		29,000	24,021
(取得原価 785,820千米ドル)				6.125% due 10/24/2028		10,100	9,169
ソブリン発行体 6.6%				7.625% due 04/26/2029		30,900	29,481
Argentina Government International Bond				Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S			
0.750% due 07/09/2030		66,427	17,871	8.250% due 01/24/2024		3,000	3,009
1.000% due 07/09/2029		4,943	1,330	Ukraine Government International Bond			
3.500% due 07/09/2041		58,125	15,285	4.375% due 01/27/2032	EUR	1,658	402
3.625% due 07/09/2035		51,459	12,427	7.750% due 09/01/2025	USD	4,390	1,358
3.625% due 07/09/2046		1,035	258	Venezuela Government International Bond (b)			
4.250% due 01/09/2038		25,740	7,786	6.000% due 12/09/2049		3,367	523
Argentina Bonos del Tesoro				7.000% due 03/31/2038		1,883	324
15.500% due 10/17/2026	ARS	49,200	12	7.650% due 04/21/2025		5,349	947
Asian Development Bank				7.750% due 04/13/2024		1,200	187
4.700% due 03/12/2024	MXN	18,100	976	8.250% due 10/13/2024		5,991	1,053
Australia Government Bond				9.000% due 05/07/2049		3,161	566
1.750% due 06/21/2051	AUD	38,100	11,753	9.250% due 09/15/2027		4,274	813
Autonomous City of Buenos Aires Argentina				9.250% due 05/07/2028		6,512	1,224
119.035% due 02/22/2028	ARS	76,810	103	11.750% due 10/21/2026		680	134
126.571% due 03/29/2024		62,559	79	11.950% due 08/05/2031		6,000	1,176
Israel Government International Bond				ソブリン発行体合計			670,880
3.800% due 05/13/2060	USD	17,000	10,475	(取得原価 866,448千米ドル)			
4.500% due 04/03/2120		3,800	2,513				
5.000% due 10/30/2026	EUR	119,500	126,171	普通株式 0.7%	証券数		
Mexico Government International Bond (i)				Cairo Mezz PLC		847,444	94
2.750% due 11/27/2031	MXN	1,229,193	56,573	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		5,292,182	5,821
3.000% due 12/03/2026		119,106	5,976	Constellation Oil Services Holding S.A.		421,249	46
4.000% due 11/30/2028		685,870	35,408	Corestate Capital Holding S.A.		2,742,788	0
Peru Government International Bond				Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.		5,318,911	8,685
5.400% due 08/12/2034	PEN	862	188	iHeartMedia, Inc. Class A		1,246,745	2,930
6.150% due 08/12/2032		674	161	iHeartMedia, Inc. Class B		967,427	2,046
6.950% due 08/12/2031		150	38	Intelsat S.A.		966,065	26,837
Provincia de Buenos Aires				National Bank of Greece S.A.		102,570	587
128.738% due 04/12/2025	ARS	399,853	424	Neiman Marcus Group Ltd. LLC		151,112	19,868
Romania Government International Bond				Serta Simmons Bedding LLC		56	1
1.750% due 07/13/2030	EUR	12,200	9,855	SSB Manufacturing Co.		56	1
2.125% due 03/07/2028		1,100	1,012	Stearns Holdings LLC		110,747	0
2.875% due 04/13/2042		7,300	4,552	UBS Group AG		26,741	628
5.500% due 09/18/2028		7,400	7,793	Voyager Aviation Holdings LLC		616	0
6.375% due 09/18/2033		14,800	15,436	WestMet Group Holdings LLC		8,915	42

	証券数	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)	
Westmoreland Mining Holdings LLC	8,837	53	4.830% due 11/01/2023		2,137	
Windstream Holdings II LLC	226,019	4,705	DnB Bank ASA		2,137	
普通株式合計		72,344	2.990% due 11/01/2023	SEK	4	0
(取得原価 163,628千米ドル)			HSBC Bank PLC			
商業不動産証券 0.2%			3.100% due 11/01/2023	EUR	1,097	1,159
CBL & Associates Properties, Inc.	6	124	4.420% due 11/01/2023	GBP	66	80
Uniti Group, Inc.	81	374	JPMorgan Chase Bank N.A.			
VICI Properties, Inc.	760	21,217	4.830% due 11/01/2023	USD	4,550	4,550
商業不動産証券合計		21,715	MUFG Bank Ltd.			
(取得原価 6,172千米ドル)			(0.370%) due 11/01/2023	JPY	38,019	251
エクイティリンク証券 0.0%			Royal Bank of Canada			
Intelsat Jackson Holdings S.A.			4.830% due 11/01/2023	USD	1	1
12/31/2049	211	1,963	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
エクイティリンク証券合計		1,963	(0.370%) due 11/01/2023	JPY	234,359	1,548
(取得原価 0千米ドル)			3.100% due 11/01/2023	EUR	10,789	11,404
	額面 (千通貨)		4.830% due 11/01/2023	USD	253	253
ワラント 0.0%			Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
Intelsat S.A.			(0.370%) due 11/01/2023	JPY	927,721	6,126
02/17/2027	26	72	3.100% due 11/01/2023	EUR	4,002	4,230
Stearns Holdings LLC			4.420% due 11/01/2023	GBP	3,526	4,279
12/31/2049	1	0	4.830% due 11/01/2023	USD	5,810	5,810
ワラント合計		72				46,785
(取得原価 20,656千米ドル)			アルゼンチン短期国債 0.1%			
優先証券 0.0%			(32.511%) due 05/20/2024 (k)	ARS	551,156	797
Cayenne Aviation LLC			(17.783%) due 11/23/2023 (j)		4,688,282	8,139
9.500%	3,693	0				8,936
優先証券合計		0	日本短期国債(j) 4.4%			
(取得原価 1,210千米ドル)			(0.234%) due 01/15/2024	JPY	34,990,000	231,136
	額面 (千通貨)		(0.216%) due 01/22/2024		34,000,000	224,605
短期金融商品 5.0%						455,741
定期預金 0.5%			短期金融商品合計			511,462
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			(取得原価 518,529千米ドル)			
3.000% due 11/01/2023	AUD	764	484	有価証券投資合計(a) 148.7%		15,268,043
3.850% due 11/01/2023	NZD	2	1	(取得原価 16,679,350千米ドル)		
4.830% due 11/01/2023	USD	1	1	金融デリバティブ商品 0.0%		1,772
Bank of Nova Scotia				(取得原価またはプレミアム (純額) 19,837千米ドル)		
4.080% due 11/01/2023	CAD	543	391	その他の資産および負債 (純額) (48.7%)		(5,000,688)
4.830% due 11/01/2023	USD	593	593	純資産 100.0%		10,269,127
BNP Paribas Bank						
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	68	1	投資有価証券明細表に対する注記：		
0.550% due 11/01/2023	CHF	16	17	* 額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示して		
3.000% due 11/01/2023	AUD	501	317	いる場合があります。		
3.330% due 11/01/2023	NOK	12	1	(a) 2023年10月31日現在の純資産に対する地域別投資割合は、米国112.9%、英国		
3.850% due 11/01/2023	NZD	1	0	7.1%、その他28.7%です。		
4.420% due 11/01/2023	GBP	1	1	(b) 当該証券は、デフォルト状態にあります。		
6.430% due 11/01/2023	ZAR	10,398	555	(c) この金額の全部または一部は、未実行のローン・コミットメントです。未実行部		
Brown Brothers Harriman & Co.				分の利率は、実行時に決定されます。		
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	3,630	24	(d) 発行時決済証券です。		
2.750% due 11/01/2023	DKK	3	1	(e) 偶発転換社債です。		
3.100% due 11/01/2023	EUR	1	1	(f) 永久債の償還日は、コール日を記載しています。		
4.420% due 11/01/2023	GBP	23	28	(g) ペイメント・イン・カインド債券です。当該債券は、利息支払いに現金ではなく		
4.830% due 11/01/2023	USD	42	42	現物債を充当できる債券です。		
Citibank N.A.				(h) 当該証券は、インタレスト・オンリー(「IO」)またはIOストリップです。		
4.830% due 11/01/2023		2,499	2,499	(i) 当該証券の額面金額は、インフレ調整後のものです。		
DBS Bank Ltd.				(j) 利率は満期までの利回り(加重平均)です。		
				(k) 利率は満期までの利回りです。		

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 総 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。

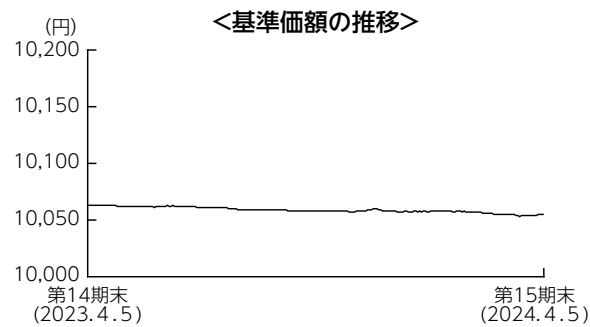
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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	券 率	新株予約権付 社債(転換社債) 組入比率	債 先 物 比	券 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。

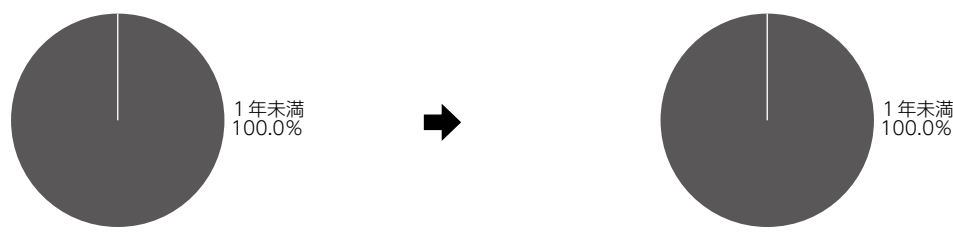
ポートフォリオについて

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	・	
公	司	183,875,306
社	債(評価額)	299,992,000
未	収	利
前	払	息
		用
		438
(B) 負	債	—
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	483,868,290
元		481,233,562
次	期 繰 越 損 益 金	2,634,728
(D) 受	益 権 総 口 数	481,233,562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		
マシュエズ・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。