

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	2017年12月28日から2028年6月5日
運用方針	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	マニユライフ・インベストメント・マネジメント（US）LLCが運用する「ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）」を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	毎年3月、6月、9月、12月の各5日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を目指します。分配金額については、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。※ただし、第1期の決算時においては収益分配を行いません。

# スカイオーシャン・ 世界債券戦略ファンド （為替ヘッジあり）

## 運用報告書（全体版）

第23期（決算日 2023年9月5日）

第24期（決算日 2023年12月5日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。さて、「スカイオーシャン・世界債券戦略ファンド（為替ヘッジあり）」は2023年12月5日に第24期の決算を行いました。

ここに期間中の運用状況について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。

## スカイオーシャン・アセットマネジメント

〒220-8611 神奈川県横浜市西区みなとみらい3-1-1

<照会先> ホームページ：<https://www.soam.co.jp/>  
サポートデスク：045-225-1651

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近10期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		投資信託 組入比率	純資産額
		円	%		
15期(2021年9月6日)	10,190	円	0.0	%	百万円 779
16期(2021年12月6日)	9,953	円	△2.2	97.4	723
17期(2022年3月7日)	9,646	円	△3.0	97.3	658
18期(2022年6月6日)	9,199	円	△4.5	97.4	600
19期(2022年9月5日)	8,881	円	△3.3	97.5	547
20期(2022年12月5日)	8,783	円	△1.0	98.0	577
21期(2023年3月6日)	8,600	円	△2.0	97.8	560
22期(2023年6月5日)	8,620	円	0.3	97.9	557
23期(2023年9月5日)	8,448	円	△1.9	98.0	451
24期(2023年12月5日)	8,411	円	△0.3	98.4	441

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

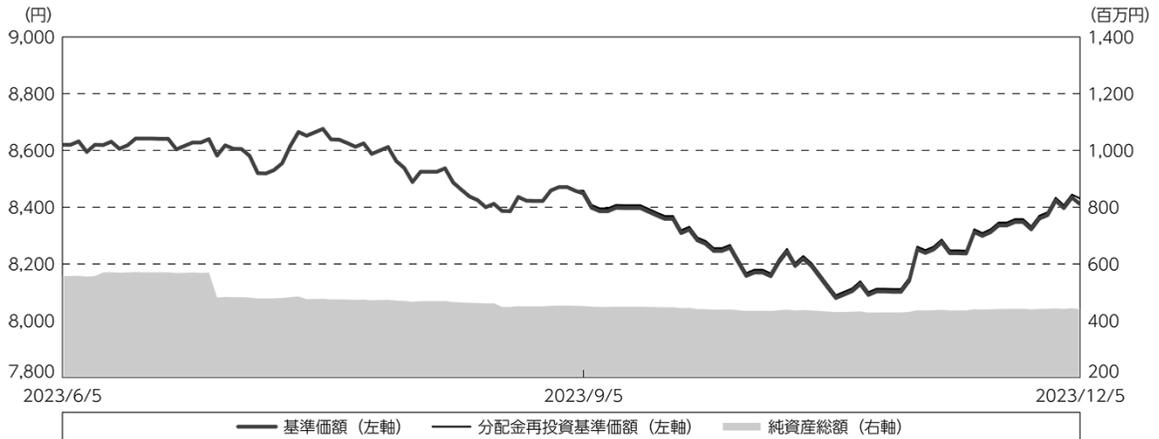
決算期	年 月 日	基準価額	騰落率	
			円	%
第23期	(期首) 2023年6月5日	8,620	円	%
	6月末	8,582	△0.4	97.6
	7月末	8,600	△0.2	97.8
	8月末	8,471	△1.7	97.9
	(期末) 2023年9月5日	8,458	△1.9	98.0
第24期	(期首) 2023年9月5日	8,448	円	%
	9月末	8,246	△2.4	98.4
	10月末	8,102	△4.1	98.6
	11月末	8,423	△0.3	99.1
	(期末) 2023年12月5日	8,421	△0.3	98.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ○運用経過

（2023年6月6日～2023年12月5日）

## 作成期間中の基準価額等の推移



第23期首：8,620円

第24期末：8,411円（既払分配金(税込み)：20円）

騰落率：△ 2.2%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2023年6月5日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

## ○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）」の基準価額（分配金再投資ベース）が下落したことから、当ファンドの基準価額（分配金再投資ベース）も下落しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）	世界の公社債等	98.4%	-1.7%
FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）	わが国の公社債	0.0%	-0.1%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。騰落率は前作成対象期間末（2023年6月5日）からのものです。

(注) 騰落率は分配金再投資ベースです。

## 投資環境

米国国債市場は下落しました。米国10年国債利回りは、作成期初に3.7%近辺で始まった後、堅調な米国景気や根強いインフレ圧力を背景に金融引き締め長期化観測が高まったことや米国の財政運営をめぐる不透明感などを背景に上昇基調が継続し、2023年10月には一時5%台に達しました。その後、米国景気の減速を示す経済指標の発表が相次ぎ、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げ打ち止め観測が広がったことなどを受けて米国10年国債利回りは低下し、4.2%台で作成期末を迎えました。

投資適格社債及びハイ・イールド債券は、米国長期金利の上昇などがマイナスに影響したものの、相対的に高い利息収入がプラスに寄与し、上昇しました。バンクローンは、変動金利資産として金利上昇局面に強い特性を発揮し、上昇しました。

その他の先進国の国債利回りは、オーストラリアやカナダなどで上昇、ドイツや英国などで小幅上昇しました。新興国では、国債利回りは全体的に作成期初とほぼ変わらずの水準で作成期末を迎えました。

外国為替市場では、円安米ドル高となりました。堅調な米国景気や根強いインフレ圧力を背景とした米国長期金利の上昇に伴う日米金利差の拡大などが米ドル買い円売り要因となり、円安米ドル高が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

### ○当ファンド

「ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）」への投資を高位に保つ運用を行いました。

#### ・ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）

ポートフォリオの平均残存年数については、世界的に金利上昇が進んだことを受けて長期化を図ってきました。債券種別では、米国以外の先進国国債等などの比率を引き上げ、ハイ・イールド債券、米国国債などの保有を引き下げました。通貨構成については、ユーロの売り建てを縮小した一方、カナダドル、オーストラリアドル、ニュージーランドドルの売り建てを拡大し、シンガポールドルとノルウェークローネの売り建てを新追加しました。

なお、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図りました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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

## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第23期	第24期
	2023年6月6日～ 2023年9月5日	2023年9月6日～ 2023年12月5日
当期分配金	10	10
（対基準価額比率）	0.118%	0.119%
当期の収益	10	10
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	2,156	2,242

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

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

## ○今後の運用方針

---

### ○当ファンド

「ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）」への投資を通じて、世界の公社債等に投資をすることで、トータル・リターン（金利収入及び値上がり益）の最大化を目指します。

#### ・ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジあり）

インフレの鈍化とともに、主要中央銀行の金融引き締めサイクルは終わりに近づきつつあると見られますが、積極的な利上げの影響が中期的には今後、住宅、雇用、消費などに重くのしかかり、世界経済の減速リスクは高まると考えられます。また、市場では、インフレ率などの経済指標、中央銀行の金融政策、ウクライナ情勢や中東情勢などをめぐり、高いボラティリティ（価格変動性）が続くと思われれます。このような環境下、当ファンドでは利回り、流動性、金利リスク、信用リスクにおいて十分にバランスをとった運用を続けています。

ポートフォリオの平均残存年数は、世界的に金利上昇が進んだことを受けて長期化させていますが、短期的には各国の金融政策や経済状況に応じて機動的に調整する方針です。

投資適格社債やハイ・イールド債券は、引き続き投資機会があると考えていますが、クレジット市場のファンダメンタルズの悪化とともにデフォルト（債務不履行）率の上昇が考えられることから、業種、格付け、発行体によるパフォーマンス差に留意し、選別的に投資を行う方針です。

米国国債、米国以外の先進国国債、資産証券化商品（MBS（不動産担保証券）やABS（資産担保証券））、新興国債券などは、リスク分散のために保有します。また、新興国債券については、ラテンアメリカやアジアの一部地域などに選別的に投資を行う方針です。

通貨に関しては、米国の財政赤字・貿易赤字などを背景に長期的には米ドルの下落圧力が強まると見られますが、短期的には各国の金融政策動向に加え、ウクライナ情勢や中東情勢などの地政学リスクやイベントリスクがボラティリティを高める要因となり得ることから、状況に応じて通貨配分を機動的に調整します。

なお、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図ります。

#### ・F0Fs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した運用を目指します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2023年 6 月 6 日～2023年12月 5 日）

項 目	第23期～第24期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 34	% 0.401	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(14)	(0.165)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(18)	(0.220)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 1 )	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	34	0.404	
作成期間の平均基準価額は、8,404円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

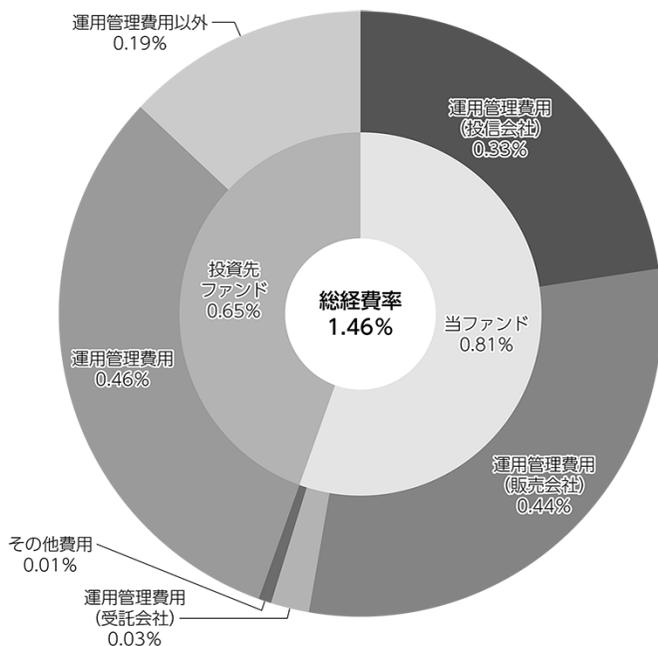
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

## （参考情報）

## ○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.46%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.46
①当ファンドの費用の比率	0.81
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.46
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.19

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2023年6月6日～2023年12月5日)

## 投資信託証券

銘柄		第23期～第24期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)	口	千円	口	千円
		35,850	24,400	168,421	115,000

(注) 金額は受け渡し代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年6月6日～2023年12月5日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年6月6日～2023年12月5日)

該当事項はございません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2023年6月6日～2023年12月5日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2023年12月5日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第22期末		第24期末	
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
	FOFs用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	50,323	50,323	49	0.0
	ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)	788,413	655,842	434,167	98.4
	合計	838,736	706,165	434,217	98.4

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

(2023年12月5日現在)

項 目	第24期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	434,217	97.4
コール・ローン等、その他	11,507	2.6
投資信託財産総額	445,724	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第23期末	第24期末
	2023年9月5日現在	2023年12月5日現在
	円	円
(A) 資産	453,511,127	445,724,846
コール・ローン等	10,626,631	10,507,658
投資信託受益証券(評価額)	442,884,496	434,217,188
未収入金	—	1,000,000
(B) 負債	1,542,185	4,335,713
未払収益分配金	535,008	524,756
未払解約金	—	2,921,202
未払信託報酬	1,000,329	876,933
未払利息	29	28
その他未払費用	6,819	12,794
(C) 純資産総額(A-B)	451,968,942	441,389,133
元本	535,008,003	524,756,625
次期繰越損益金	△ 83,039,061	△ 83,367,492
(D) 受益権総口数	535,008,003口	524,756,625口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,448円	8,411円

(注) 当ファンドの第23期首元本額は646,492,791円、第23～24期中追加設定元本額は15,061,427円、第23～24期中一部解約元本額は136,797,593円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第23期0.8448円、第24期0.8411円です。

(注) 2023年12月5日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は83,367,492円です。

## ○損益の状況

項 目	第23期	第24期
	2023年6月6日～ 2023年9月5日	2023年9月6日～ 2023年12月5日
	円	円
(A) 配当等収益	5,959,931	5,871,940
受取配当金	5,963,157	5,873,795
支払利息	△ 3,226	△ 1,855
(B) 有価証券売買損益	△ 13,645,687	△ 6,383,392
売買益	564,756	230,904
売買損	△ 14,210,443	△ 6,614,296
(C) 信託報酬等	△ 1,007,148	△ 882,908
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,692,904	△ 1,394,360
(E) 前期繰越損益金	△ 59,132,800	△ 67,030,943
(F) 追加信託差損益金	△ 14,678,349	△ 14,417,433
(配当等相当額)	( 30,004,129)	( 29,454,173)
(売買損益相当額)	(△ 44,682,478)	(△ 43,871,606)
(G) 計(D+E+F)	△ 82,504,053	△ 82,842,736
(H) 収益分配金	△ 535,008	△ 524,756
次期繰越損益金(G+H)	△ 83,039,061	△ 83,367,492
追加信託差損益金	△ 14,678,349	△ 14,417,433
(配当等相当額)	( 30,004,129)	( 29,454,173)
(売買損益相当額)	(△ 44,682,478)	(△ 43,871,606)
分配準備積立金	85,396,279	88,199,403
繰越損益金	△153,756,991	△157,149,462

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程（2023年6月6日～2023年12月5日）は以下の通りです。

項 目	2023年6月6日～ 2023年9月5日	2023年9月6日～ 2023年12月5日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,952,783円	4,989,032円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	30,004,129円	29,454,173円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	80,978,504円	83,735,127円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	115,935,416円	118,178,332円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,166円	2,252円
g. 分配金	535,008円	524,756円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円

## ○分配金のお知らせ

---

	第23期	第24期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

■ストラテジック・インカム・ファンド クラス A（円建て為替ヘッジあり）

●ファンドの概要

運用会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント（US）LLC
運用方針	主に世界（新興国を含みます。）の政府および政府機関が発行する債券、事業債（ハイ・イールド債券も含みます。）などに投資することで、あらゆる市場環境において安定したインカムゲインの確保と値上がり益の追求によりトータルリターンの最大化を目指します。
主要投資対象	世界（新興国を含みます。）の政府および政府機関が発行する債券、事業債（ハイ・イールド債券も含みます。）等を主要投資対象とします。
組入制限	<p>①債券への投資割合は、原則として取得時において投資信託財産の純資産総額の65%以上とします。</p> <p>②同一発行体の事業債への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③同一業種（事業債）への投資割合は、原則として取得時において投資信託財産の純資産総額の25%以内とします。</p> <p>④米国以外の単一国への投資割合は、原則として取得時において投資信託財産の純資産総額の25%以内とします。</p> <p>⑤新興国諸国の債券への投資割合は、原則として取得時において投資信託財産の純資産総額の50%以内とします。</p> <p>⑥株式への直接投資は行いません。債券投資の結果、株式を保有することとなった場合は適時に売却します。</p> <p>⑦流動性の乏しい資産への投資は、ファンドの純資産総額の15%以内とします。</p> <p>⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p>

以下の「損益の状況」は「MANULIFE INVESTMENTS TRUST - STARATEGIC INCOME FUND REPORTS AND FINANCIAL STATEMENTS FOR THE YEAR ENDED 31 DECEMBER 2022」の情報を基に掲載しています。「投資明細表」は当ファンドの管理事務代行会社であるHSBC インスティテューショナル・トラスト・サービシーズ (アジア) リミテッドからの情報を基に掲載しています。

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)

● 損益の状況 (2022年1月1日～2022年12月31日)

	2022 USD	2021 USD
<b>Income</b>		
Interest from interest-bearing securities	11,859,644	7,733,286
Bank interest	23,520	-
Net realized losses on financial assets at fair value through profit or loss and derivative financial instruments	(59,309,259)	(18,763,335)
Net change in unrealized losses on financial assets at fair value through profit or loss and derivative financial instruments	(20,416,455)	(19,979,255)
Sundry income	223	12,850
Net exchange (losses)/gains	(306,014)	65,499
	<u>(68,148,341)</u>	<u>(30,930,955)</u>
<b>Expenses</b>		
Investment management fee	(1,148,844)	(1,556,095)
Safe custody and processing fee	(179,835)	(213,028)
Trustee fee	(12,000)	(12,000)
Auditor's remuneration	(45,956)	(42,368)
Valuator fee	(174,300)	(175,000)
Transaction handling fee	(35,406)	(24,930)
Annual authority fee	(1,940)	(1,959)
Accounting and other professional fees	(5,335)	(5,616)
Other operating expenses	(52,351)	(67,712)
	<u>(1,655,967)</u>	<u>(2,098,708)</u>
<b>Total operating expenses</b>	<u>(1,655,967)</u>	<u>(2,098,708)</u>
<b>Operating loss</b>	<u>(69,804,308)</u>	<u>(33,029,663)</u>
<b>Finance cost</b>		
Interest expenses	(1,130)	(7,548)
Distribution to unitholders	(2,939,773)	(4,975,243)
	<u>(72,745,211)</u>	<u>(38,012,454)</u>
<b>Loss after distribution and before taxation</b>	<u>(72,745,211)</u>	<u>(38,012,454)</u>
<b>Taxation</b>		
Withholding taxes	(103,986)	(165,008)
	<u>(72,849,197)</u>	<u>(38,177,462)</u>
<b>Decrease in net assets attributable to unitholders</b>	<u>(72,849,197)</u>	<u>(38,177,462)</u>

	2022 USD	2021 USD
<b>Net assets attributable to unitholders at the beginning of the year</b>	338,542,054	389,905,203
Subscription of units	23,259,796	18,676,114
Re-investment of distributions	2,358,362	3,284,147
Redemption of units	(65,688,964)	(35,145,948)
	(40,070,806)	(13,185,687)
Decrease in net assets attributable to unitholders	(72,849,197)	(38,177,462)
<b>Net assets attributable to unitholders at the end of the year</b>	<b>225,622,051</b>	<b>338,542,054</b>

●投資明細表 (2022年12月31日現在)

AS AT 31 DECEMBER 2022

Debt securities	Quantity / Par Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Denominated in Australian Dollar</b>			
Asian Development Bank Ser(Mtn) (Reg S) 3.4% 10/09/2027	430,000	280,321	0.12
Australia (Govt Of) (Ser I59) (Reg S) 2.5% 21/11/2024	2,065,000	1,327,565	0.59
Australia (Govt Of) (Ser I64) (Reg S) 5% 21/09/2026	355,000	216,173	0.10
Australian Government (Reg S) 1% 21/11/2031	685,000	362,239	0.16
Australian Government (Ser I60) (Reg S) 1% 21/12/2030	415,000	225,986	0.10
Inter American Devel Bk 2.75% 30/10/2025	355,000	232,857	0.10
Inter-American Devel Bk (Ser Mtn) 2.7% 29/01/2026	186,000	121,171	0.05
Intl Finance Corp (Ser Mtn) 3.6% 24 /02/2026	520,000	348,345	0.15
Kommunalbanken As (Ser Mtn) 5.25% 07/15/2024	260,000	179,973	0.08
Kommunalbanken As (Ser Mtn) (Reg S) 4.25% 16/07/2025	760,000	517,257	0.23
New S Wales Treasury Crp (Reg S) (R Eg) 1.25% 20/03/2025	590,000	380,137	0.17
New S Wales Treasury Crp Ser 27 (Reg) 3% 20/05/2027	1,475,000	961,395	0.43
Queensland Treasury Corp (Ser 27) (Reg S) (Reg) 2.75% 20/08/2027	585,000	376,163	0.17
		<b>5,529,582</b>	<b>2.45</b>
<b>Denominated in Brazilian Real</b>			
Brazil (Rep Of) (Ser Ntnf) 10% 01/01/2025 (Dirty)	4,525	861,338	0.38
Intl Bk Recon & Develop (Ser Gdf) (Reg) 6.75% 04/02/2024	610,000	109,061	0.05
Nota Do Tesouro Nacional Ser Ntnf 10% 01/01/2027 (Dirty)	3,855	710,407	0.32
Simpair Finance Sarl 10.75% 12/02/2028	1,009,000	137,784	0.06
Swiss Insured Brazil Ser 144A (Reg) 9.85% 16/07/2032	3,845,000	566,582	0.25
		<b>2,385,172</b>	<b>1.06</b>
<b>Denominated in British Pound</b>			
Berkshire Hathaway Fin 2.375% 19/06 /2039	245,000	209,422	0.09
European Investment Bank (Ser Emtn) (Br) (Reg S) Fm 29/06/2023	235,000	284,636	0.13
Ford Motor Credit Co Llc (Ser Emtn) 2.748% 14/06/2024	255,000	291,377	0.13
Province Of Quebec (Reg S) (Br) 1.5 % 15/12/2023	277,000	327,803	0.14
Uk (Gilts) (Reg S) (Reg) .125% 31/0 /12/024	1,535,000	1,797,228	0.80
Uk (Gilts) (Reg S) (Reg) .25% 31/01 /2025	395,000	443,745	0.20
		<b>3,554,211</b>	<b>1.49</b>
<b>Denominated in Canadian Dollar</b>			
Bank Of Montreal (Ser 14) (Reg) Fm 01/02/2023	625,000	461,555	0.20
British Columbia Prov Of 2.85% 18/06/2025	290,000	208,336	0.09
Canada (Govt Of) (Reg) 2.25% 01/03/ 2024	1,441,000	1,040,004	0.46
Canada Housing Trust 1.25% 15/06/20 26	790,000	535,509	0.24
Canada Housing Trust 1.56% 15/12/2025	270,000	188,802	0.08
Canovus Energy Inc 3.5% 07/02/2029	410,000	287,142	0.13
Cpnb Capital Inc (Ser 144A) 2.25% 01/12/2031	485,000	309,980	0.14
Intl Bk Recon & Develop (Ser Gdf) (Reg) 1.9% 16/01/2025	365,000	257,412	0.11
Intl Bk Recon & Develop 1.8% 19/01/ 2027	480,000	327,682	0.14
Ontario (Prov Of) 3.45% 02/06/2045	580,000	376,301	0.17
Ontario (Province Of) 1.35% 02/12/2 030	1,835,000	1,117,323	0.50
Ontario (Province Of) 2.9% 02/06/20 28	505,000	356,428	0.16
Province Of Alberta 2.55% 01/06/202 7	565,000	396,635	0.18
Province Of Alberta 3.4% 01/12/2023	1,150,000	839,643	0.37
Province Of Quebec 3.75% 01/09/2024	375,000	274,932	0.12
Royal Bank Of Canada (Ser Bt) (Reg) Var Perp 31/12/2049	470,000	269,169	0.12
		<b>7,246,853</b>	<b>3.21</b>
<b>Denominated in Chinese Yuan Renminbi</b>			
China (Govt Of) (Ser Inbk) (Reg) 1 .99% 09/04/2025 (Interbank)	2,310,000	331,909	0.15
China (Govt Of) (Ser Inbk) (Reg) 2 .69% 12/08/2026 (Interbank)	3,500,000	509,544	0.23
China (Govt Of) (Ser Inbk) (Reg) 2.88% 05/11/2023 (Interbank)	5,560,000	810,720	0.36
Intl Finance Corp (Ser Gmnt) (Reg) 2.55% 18/09/2023	2,220,000	321,463	0.14
		<b>1,973,636</b>	<b>0.88</b>
<b>Denominated in Danish Krone</b>			
Nykredit Raalkredit As (Ser 13H) (R Eg S) 1% 01/07/2025	1,670,000	226,307	0.10
Raalkredit Danmark (Ser 10F) (Reg S ) 1% 01/01/2026	2,520,000	338,535	0.15
		<b>564,832</b>	<b>0.25</b>
<b>Denominated in Euro</b>			
Airbus Se (Ser Emtn) (Reg S) (Br) 1 .625% 09/06/2030	200,000	186,381	0.08
Allergan Funding Scs (Reg S) 2.625% 1 5/11/2028	335,000	329,503	0.15
Allergan Funding Scs 1.25% 01/06/2024	215,000	222,512	0.10
American Tower Corp (Reg) 1.95% 03/03/2025	100,000	99,029	0.04
American Tower Corp 0.5% 15/01/2028	210,000	184,295	0.08
Apple Inc (Reg) 0% 15/11/2025	255,000	250,772	0.11
Apple Inc .875% 24/05/2025	400,000	406,968	0.18
Ardagh Metal Packaging (Ser 144A) ( Reg) 3% 01/09/2029	260,000	202,957	0.09
Austria (Rep Of) (Reg S) .5% 20/02/ 2029	155,000	142,435	0.06
Avery Dennison Corp (Reg) 1.25% 03/03/2025	215,000	222,430	0.10
Becton Dickinson Euro 1.208% 04/06/ 2026	455,000	445,627	0.20
Berkshire Hathaway Inc 0% 12/03/202 5	530,000	526,026	0.23
Bmw Finance Nv (Ser Emtn) (Reg S) ( Br) 1% 14/11/2024	90,000	92,621	0.04
Bng Bank N.V. Ser Emtn (Reg S) (Br) 0.25% 07/06/2024	290,000	297,866	0.13
Boston Scientific Corp. 625% 01/12/ 2027	475,000	436,984	0.19
Buoni Poliennali Del Tes (Reg S) 1.85% 01/07/2025	620,000	637,603	0.28
Capital One Financial Co .8% 12/06/2024	110,000	111,957	0.05
Cellnex Telecom Sa 1.675% 26/06/2029	300,000	261,812	0.12
E.On Se (Ser Emtn) (Reg S) (Br) .37 8% 29/09/2027	245,000	229,054	0.10
Ecobac Inc 1% 15/01/2024	295,000	309,360	0.14
Edp Finance Bv (Ser Emtn) (Reg S) . 375% 16/09/2026	100,000	94,553	0.04
Engle Sa (Ser Emtn) (Reg S) (Br) .375% 21/06/2027	200,000	185,127	0.08
Fidelity Natl Info Serv 1.5% 21/05/ 2027	220,000	211,661	0.09

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)

Finland (Rep Of) (Reg S) .5% 15/09/2028	460,000	429,556	0.19
Fiserv Inc 1.125% 01/07/2027	295,000	279,947	0.13
Goldman Sachs Group Inc (Reg S) (Reg) Ser Emtn 1.375% 15/05/2024	320,000	334,181	0.15
Goldman Sachs Group Inc (Ser Emtn) (Reg S) (Reg) .25% 26/01/2028	60,000	52,539	0.02
Goldman Sachs Group Inc Ser Emtn (Reg) 2% 01/11/2028	287,000	272,228	0.12
Indonesia (Rep Of) 1.1% 12/03/2033	221,000	173,413	0.08
Ireland (Govt Of) (Reg S) (Reg) .35 % 18/10/2032	305,000	251,792	0.11
Ireland (Govt Of) (Reg S) (Reg) 1.1 % 15/05/2029	245,000	233,938	0.10
Italy (Rep Of) (Reg S) .6% 01/08/20 31	320,000	249,705	0.11
Johnson Controls/Tyco Fi .375% 15/0 9/2027	195,000	177,819	0.08
Kingdom Of Sweden Ser (1444) 0.125% 24/04/2023	495,000	430,430	0.19
Netherlands (Govt Of) 2% 15/07/2024	282,000	298,321	0.13
Obrigacoes Do Tesouro (Reg S) 0.7% 15/10/2027	335,000	323,545	0.14
Philippines (Rep Of) (Ser Emtn) .87 5% 17/05/2027	670,000	629,752	0.28
Province Of Quebec (Reg S) (Br) 2% 07/04/2025	100,000	99,851	0.05
Republic Of Indonesia (Reg) Ser 144A 2.15% 18/07/2024	270,000	282,383	0.13
Spain (Govt Of) (Ser 5Yr) (Reg S) . 25% 30/07/2024	405,000	416,481	0.19
Spain (Govt Of) (Ser Regs) (Reg S) .8% 30/07/2027	490,000	472,768	0.21
Thermo Fisher Scientific (Reg) 0.75% 12/09/2024	279,000	285,661	0.13
Thermo Fisher Scientific (Reg) 1.375% 12/09/2028	150,000	142,890	0.06
Thermo Fisher Scientific (Reg) Ser . 1.4% 23/01/2026	286,000	287,198	0.13
Thermo Fisher Scientific .5% 01/03/ 2028	310,000	284,250	0.13
Treasury (Reg) (Reg S) 0.2% 15/05/2027	510,000	486,810	0.22
Us Bancorp Ser Emtn 0.85% 07/06/2024	920,000	900,981	0.42
Vmed O2 Uk Financing I (Ser 144A) 3.25% 31/01/2031	590,000	504,597	0.22
		<b>14,438,569</b>	<b>6.40</b>
<b>Denominated in Indonesian Rupiah</b>			
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr77) 8.125% 15/05/2024	6,143,000,000	407,646	0.18
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr80) 7.5% 15/06/2035	1,623,000,000	107,597	0.05
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr81) 6.5% 15/06/2025	14,775,000,000	957,872	0.42
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr90) 5.125% 15/04/2027	3,340,000,000	206,332	0.09
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr91) 0.375% 15/04/2032	14,271,000,000	883,166	0.39
Indonesia (Rep Of) Ser Fr64 6.125% 15/05/2028	3,519,000,000	221,629	0.10
Indonesia (Rep Of) Ser Fr73 8.75% 15/05/2031	7,193,000,000	515,350	0.23
Indonesia (Republic Of) Ser Fr65 6.625% 15/05/2033	2,619,000,000	163,373	0.07
Indonesia (Republic Of) Ser Fr71 (Reg) 9% 15/03/2029	4,545,000,000	324,756	0.14
Indonesia Government Ser Fr56 8.375% 15/09/2026	5,599,000,000	384,044	0.17
Indonesia Government Ser Fr75 7.5% 15/05/2038	1,876,000,000	124,297	0.06
		<b>4,296,064</b>	<b>1.90</b>
<b>Denominated in Japanese Yen</b>			
Japan (Govt Of) (Ser 138) .1% 20/12/ 2023	392,800,000	3,000,583	1.33
Japan (Govt Of) (Ser 151) .005% 20/ 03/2027	54,000,000	408,991	0.18
		<b>3,409,574</b>	<b>1.51</b>
<b>Denominated in Malaysian Ringgit</b>			
Malaysia Government (Ser 419) 3.828% 05/07/2034	1,905,000	417,891	0.18
Malaysia Government Ser 0118 3.882% 14/03/2025	1,480,000	337,558	0.15
Malaysia Government Ser 0217 4.059% 30/09/2024	1,785,000	408,123	0.18
Malaysia Government Ser 0413 3.844% 15/04/2033	2,021,000	446,717	0.20
Malaysia Government Ser 0417 3.899% 16/11/2027	1,744,000	396,547	0.18
Malaysia Government Ser 0513 3.733% 15/06/2028	1,510,000	338,706	0.15
Malaysia Government Ser 316 3.9% 30/11/2026	495,000	112,659	0.05
		<b>2,458,201</b>	<b>1.09</b>
<b>Denominated in Mexican Peso</b>			
Banco Actinver Sa (Ser 144A) (Reg) 9.5% 18/12/2032	7,900,000	223,514	0.10
Mex Bonos De Desarr Fix Rt Ser M 20 7.5% 03/06/2027	22,350,000	1,080,776	0.48
Mex Bonos Desarr Fix Rt Ser M 5.75% 05/03/2026	9,440,000	438,025	0.19
Mex Bonos Desarr Fix Rt Ser M 7.75% 29/05/2031	18,040,000	806,562	0.38
Mexico (Utd States Of) (Ser M) 5% 0 6/03/2025	18,040,000	839,919	0.37
		<b>3,438,796</b>	<b>1.52</b>
<b>Denominated in New Zealand Dollar</b>			
Asian Development Bank Ser Mtn 3.5% 30/05/2024	425,000	262,282	0.12
Asian Development Bank Ser Mtn 3.75% 18/08/2025	405,000	246,618	0.11
Intl Bk Recon & Develop (Ser Mtn) ( Reg) 2.5% 24/01/2024	365,000	236,620	0.10
Intl Bk Recon & Develop (Ser Mtn) 2. 875% 30/11/2026	540,000	314,551	0.14
Intl Bk Recon & Develop (Ser Mtn) 4. 25% 29/07/2027	352,000	230,908	0.10
New Zealand (Govt Of) (Ser 526) .5% 15/05/2026	2,020,000	1,117,222	0.50
New Zealand (Govt Of) .5% 15/05/2024	1,395,000	832,294	0.37
New Zealand (Govt Of) Ser 420 (Reg S) (Reg) 4.5% 15/04/2027	1,530,000	968,868	0.43
Nz Local Govt Fund Agenc (Reg S) 2. 25% 15/04/2024	165,000	100,516	0.04
Nz Local Govt Fund Agenc (Reg) 2.75 % 15/04/2025	545,000	326,032	0.14
Nz Local Govt Fund Agenc 1.5% 15/04/2026	505,000	283,965	0.13
Nz Local Govt Fund Agenc 4.5% 15/04/ 2027	215,000	132,717	0.06
		<b>5,042,593</b>	<b>2.24</b>
<b>Denominated in Norwegian Krone</b>			
Intl Finance Corp (Ser Gmtn) (Reg) .5% 08/10/2025	5,030,000	475,622	0.21
KfW (Ser Emtn) (Br) 1.25% 28/08/202 3	2,810,000	283,165	0.12
Nordea Eiendoms kreditt (Reg) Fm 21 06/2023	3,000,000	306,853	0.13
Nordea Eiendoms kreditt Fm 19/06/20 24	5,000,000	512,061	0.23
Norway (Govt Of) (Ser 478) (Reg S) 1.5% 19/02/2026	5,240,000	510,335	0.23
Norway (Govt Of) (Ser 482) (Reg S) 1.375% 19/08/2030	2,205,000	197,908	0.09
Norway (Govt Of) (Ser 484) (Reg S) 2.125% 18/05/2032	6,900,000	644,127	0.28
Norway (Govt Of) (Ser 485) (Reg S) 3.5% 06/10/2042	1,516,000	157,792	0.07
Norwegian (Govt Of) Ser 475 2% 24/05/2023	4,360,000	443,643	0.20
Norwegian Government (Reg S) Ser 479 1.75% 17/02/2027	5,540,000	537,500	0.24
Norwegian Government Ser 477 (Reg S) 1.75% 13/03/2025	6,065,000	603,591	0.27
		<b>4,672,897</b>	<b>2.07</b>
<b>Denominated in Philippine Peso</b>			

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)

Philippines (Rep Of) (Ser R512) 6.2.5% 12/03/2024	42,805,000	773,079	0.34
		<b>773,079</b>	<b>0.34</b>
<b>Denominated in Singapore Dollar</b>			
Singapore (Govt Of) 3.375% 01/09/2033	705,000	539,232	0.24
Singapore Government 2.375% 01/06/2025	2,300,000	1,695,689	0.75
		<b>2,234,921</b>	<b>0.99</b>
<b>Denominated in South Korean won</b>			
Korea (Rep Of) (Ser 2409) 3.125% 1 0/09/2024 (Dirty)	726,140,000	576,713	0.26
Korea (Rep Of) (Ser 2703) 2.375% 10/03/2027 (Dirty)	1,819,540,000	1,374,509	0.61
Korea (Rep Of) (Ser 2706) (Br) 2.125% 10/06/2027 (Dirty)	851,860,000	631,880	0.28
		<b>2,583,102</b>	<b>1.15</b>
<b>Denominated in United States Dollar</b>			
1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 3.5% 15/02/2029	517,000	445,912	0.20
1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 3.875% 15/01/2028	345,000	310,500	0.14
1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 4% 15/10/2030	1,625,000	1,332,500	0.59
Advantage Loyalty Ip Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +475Bps 24/03/2028	375,000	373,628	0.17
Abu Dhabi Govt IntL (Ser 144A) 1.7% 02/03/2031	425,000	350,296	0.16
Abu Dhabi Govt IntL (Ser 144A) 3.125% 16/04/2030	310,000	287,535	0.13
Abu Dhabi Govt IntL (Ser 144A) 3.875% 16/04/2050	235,000	199,590	0.09
Aecom (Reg) Ser 144A 5.125% 15/03/2027 W/I	620,000	601,400	0.27
Aercap Ireland Cap/Globa (Reg) 1.15 % 29/10/2023	740,000	710,897	0.31
Aes Corp/The (Ser 144A) (Reg) 3.95% 15/07/2030	125,000	110,306	0.05
Air Canada (Reg) Conv 4% 01/07/2025	375,000	450,416	0.20
Air Ber Asa (Ser 144A) (Reg) 3.75% 15/01/2030	510,000	448,162	0.20
American Airlines Group (Reg) Conv 6.5% 01/07/2025	945,000	1,001,502	0.44
American Airlines/Aadvan (Ser 144A) (Reg) 5.5% 20/04/2026	520,000	501,800	0.22
American Airlines/Aadvan (Ser 144A) (Reg) 5.75% 20/04/2029	695,000	637,014	0.28
American Intl Group (Reg) Var 15/05/2068	1,435,000	1,595,354	0.71
Antero Resources Corp (Ser 144A) 5.375% 01/03/2030	640,000	595,200	0.26
Ardayh Metal Packaging (Ser 144A) 3.25% 01/09/2028	475,000	402,266	0.18
Arroyo Mortgage Trust 2019-1 Ser C1 A1 Fm 25/01/2049	990,000	205,505	0.09
Asurion Llc Tranche B9 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 325Bps 31/07/2027	281	246	-
At&T Inc (Reg) 9% 25/03/2024	203,000	192,692	0.09
Ball Corp (Reg) 6.875% 15/03/2028	680,000	700,400	0.31
Ball Corp 2.875% 15/08/2030	415,000	332,519	0.15
Ball Corp 4.875% 15/03/2026	545,000	529,331	0.23
Bally'S Corp Franche B Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 325Bps	16	-	-
Bamf Commercial Mortgage Securities Trust 2018-Dany	565,000	555,571	0.25
Banco ActInver Sa (Ser 144A) (Reg) 4.8% 18/12/2032	200,000	111,000	0.05
Bacle Sa De Cv (Ser 144A) 2.5% 14/10/2031	630,000	490,621	0.22
Berkshire Hathaway Fin (Reg) 4.2% 1 5/08/2048	300,000	264,609	0.12
Berry Global Escrow Corp (Ser 144A) (Reg) 5.625% 15/07/2027	350,000	340,812	0.15
Bnp Paribas (Ser 144A) (Reg) Var 09 /06/2026	470,000	432,122	0.19
Boca Commercial Mortgage Trust 2022-Boca Ser Boca C1 A Fm	320,000	313,869	0.14
Boeing Co 5.04% 01/05/2027	440,000	435,786	0.19
Boeing Co 5.15% 01/05/2030	1,380,000	1,329,631	0.59
Braskem Idesa Sapi (Ser 144A) (Reg) 6.99% 20/02/2032	380,000	271,823	0.12
Braskem Netherlands (Ser 144A) (Reg) 4.5% 31/01/2030	205,000	175,531	0.08
Braskem Netherlands (Ser 144A) (Reg) 5.875% 31/01/2050	200,000	156,250	0.07
Brazos Securitized Llc (Ser 144A) 5.014% 01/09/2031	425,000	422,994	0.19
Burlington Stores Inc (Reg) Conv 2.25% 15/04/2027	475,000	546,521	0.24
Bx Commercial Mortgage Trust 2019-XI Ser XI C1 A Fm 15/10/2036	900,000	669,025	0.30
Bx Commercial Mortgage Trust 2021-Cip Ser Cip C1 A Fm	315,000	304,358	0.13
Bx Commercial Mortgage Trust 2021-Volt Ser Volt C1 A Fm	125,000	120,390	0.05
Bx Trust 2022-Cls Ser Cls C1 A Fm 13/10/2027	375,000	371,475	0.16
Bx Trust 2022-Gpa Ser Gpa C1 A Fm 15/10/2039	510,000	507,122	0.22
Bx Trust 2022-Gpa Ser Gpa C1 B Fm 15/10/2039	305,000	302,561	0.13
Camb Commercial Mortgage Trust 2019-Life Ser Life C1 A Fm 15/12/2037	245,100	241,922	0.11
Canadian Pacific Railway (Reg) 1.35 % 02/12/2024	200,000	186,693	0.08
Carnival Corp (Ser 144A) (Reg) 5.75% 01/03/2027	935,000	667,356	0.30
Carnival Corp Conv 5.75% 01/12/2027	475,000	427,073	0.19
Cco Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.25% 01/02/2031	135,000	108,338	0.05
Cco Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.5% 01/06/2033	400,000	309,000	0.14
Cco Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/08/2030	505,000	419,150	0.19
Cco Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.75% 01/03/2030	800,000	677,000	0.30
Cco Holdings Llc / Cco Holdings Capital Corp Ser 144A 01/05/2027	200,000	148,326	0.06
Cdw Llc/Cdw Finance (Reg) 4.25% 01 /04/2028	315,000	290,588	0.13
Cemex Sab De Cv (Ser 144A) (Reg) 3.875% 11/07/2031	715,000	606,856	0.27
Cenovus Energy Inc (Reg) 5.25% 15/0 6/2037	163,000	148,571	0.07
Cenovus Energy Inc (Reg) 5.4% 15/06/2047	603,000	545,271	0.24
Cenovus Energy Inc (Reg) 6.75% 15/1 1/2039	910,000	947,699	0.42
Centene Corp (Reg) (Ser W1) 3.375% 15/02/2030 When Issued	825,000	698,156	0.31
Centene Corp (Reg) 2.5% 01/03/2031	550,000	435,680	0.19
Centene Corp (Reg) 4.625% 15/12/2029	215,000	196,456	0.09
Centene Corp 3% 15/10/2030	995,000	819,631	0.36
Century Plaza Towers 2019-Cpt Ser Cpt C1 A Fm 13/11/2039	600,000	478,451	0.21
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 2.8% 01/04/2031	360,000	280,923	0.12
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.12 5% 01/07/2049	1,110,000	840,446	0.37
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.75% 01/04/2048	660,000	543,367	0.24
Charter Communications Operating Llc/Cap (Reg) 6.484% 23/10/2045	455,000	262,366	0.12
Cheniere Energy Partners (Reg) 4% 0 1/03/2031	665,000	567,744	0.25
Cheniere Energy Partners (Reg) 4.5% 01/10/2029	310,000	282,875	0.13
Cleveland-Cliffs Inc (Ser 144A) (Reg) 4.875% 01/03/2031	440,000	387,750	0.17
Colombia (Rep Of) (Reg) 4.5% 15/03/ 2029	205,000	177,366	0.08
Colombia (Rep Of) 3.25% 22/04/2032	415,000	302,441	0.13
Colt 2022-5 Mortgage Loan Trust Ser 5 C1 A1 Fm 25/04/2067	265,000	235,805	0.10
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R05 Ser R05 C1 2M1 Fm	455,000	362,746	0.16
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R06 Ser R06 C1 1M1 Fm	300,000	261,937	0.12
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R07 Ser R07 C1 1M1 Fm 25/06/	460,000	410,435	0.18
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R09 Ser R09 C1 2M1 Fm	285,000	269,928	0.12
Continental Resources (Ser 144A) (R Eg) 5.75% 15/01/2031	817,000	760,831	0.34
Continental Resources (Ser 144A) 2.875% 01/04/2032	474,000	353,722	0.16

Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 2019-Ice4 Ser Ice4 CI A Fr	405,000	400,764	0.18
Credit Suisse Mortgage Trust Ser 19-Nqm1 CI A1 Fm 25/10/2059	680,000	82,357	0.04
ROWN Castle Inc (Reg) 1.35% 15/07/2025	101,000	91,898	0.04
Crown Castle Intl Corp 2.25% 15/01/2031	175,000	139,852	0.06
Csn Islands Xi Corp (Ser 144A) (Reg) 6.75% 28/01/2028	510,000	488,325	0.22
Ct Trust (Ser 144A) (Reg) 5.125% 03/02/2032	275,000	243,375	0.11
Dae Funding Llc (Ser 144A) 3.375% 2/03/2028	315,000	279,563	0.12
Darling Ingredients Inc (Ser 144A) 6% 15/06/2030	375,000	370,312	0.16
Db Master Finance Llc Fm 20/05/2049	195,000	174,530	0.08
Db Master Finance Llc Ser A1 CI A2II Fm 20/11/2047	335,000	286,255	0.13
Ddog Mortgage Trust Ser 2017-Bbg CI A Fm 15/06/2034	275,000	270,690	0.12
Dell Intl Lc / Emc Corp (Reg) 8.35% 15/07/2046	413,000	472,670	0.21
Delta Air Lines 2020-A (Ser A) 2.5% 10/06/2028	465,000	305,035	0.14
Delta Air Lines Inc (Reg) 2.9% 28/1/2024	610,000	576,186	0.26
Delta Air Lines Inc (Reg) 4.375% 19/04/2028	465,000	413,850	0.18
Delta Air Lines Inc (Reg) 7.375% 15/01/2026	130,000	133,099	0.06
Delta Air Lines/Skymiles (Ser 144A) (Reg) 4.5% 20/10/2025	175,000	171,444	0.08
Delta Air Lines/Skymiles (Ser 144A) (Reg) 4.75% 20/10/2028	2,222,000	2,091,846	0.93
Dominos Pizza Master Issuer Llc Ser 2015-1A CI A2II Fm 25/10/2045	330,000	295,450	0.13
Dpl Inc (Reg) 4.125% 01/07/2025	740,000	699,300	0.31
Dte Energy Co (Ser F) (Reg) 1.05% 0/1/06/2025	215,000	194,695	0.09
Ecopetrol (Reg) 5.375% 26/06/2026	180,000	169,763	0.08
Ecopetrol Sa (Reg) 4.625% 02/11/2031	330,000	254,100	0.11
Ecopetrol Sa (Reg) 6.875% 29/04/2030	135,000	122,850	0.05
Ecopetrol Sa Ser (Reg) 5.875% 28/05/2045	160,000	126,450	0.06
Enbridge Inc (Reg) 3.125% 15/11/2029	650,000	587,585	0.25
Encana Corp (Reg) 6.5% 01/02/2038	230,000	229,436	0.10
Enterprise Products Oper (Reg) 3.12 5% 31/07/2029	845,000	744,477	0.33
Eq Corp (Reg) 3.9% 01/10/2027	266,000	246,050	0.11
Eq Corp (Ser 144A) (Reg) 3.125% 15/05/2026	150,000	138,000	0.06
Eq Corp (Ser 144A) (Reg) 3.625% 15/05/2031	1,015,000	867,825	0.38
Export-Import Bk India (Ser 144A) (Reg) 3.875% 01/02/2028	405,000	375,777	0.17
Fannie Mae - Cas Fm 25/03/2042	90,000	71,299	0.03
Fannie Mae - Cas Fm 25/12/2041	275,000	175,992	0.08
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Ser R04 CI 1M1 Fm	245,000	195,416	0.09
Fannie Mae Pool Fm 01/09/2052	1,150,015	1,104,444	0.49
Fannie Mae Pool Fm 01/10/2052	350,000	350,959	0.16
Fannie Mae Pool Fm 01/11/2052	2,001,000	1,984,514	0.88
Fannie Mae Pool Fm 01/12/2052	875,000	885,283	0.39
Firstenergy Corp (Reg) 2.65% 01/03/2030	620,000	608,372	0.23
Firstenergy Corp (Ser B) (Reg) 2.25 5% 01/09/2030	430,000	341,651	0.15
Firstenergy Corp (Ser B) (Reg) 3.9% 15/07/2027	490,000	459,545	0.20
Firstenergy Corp Ser C (Reg) 7.375% 15/11/2031	870,000	971,230	0.43
Firstkey Homes 2020-Sfr2 Trust Ser Sfr2 CI A Fm 19/10/2037	350,000	306,920	0.14
Firstkey Homes Trust Ser Sfr3 CI A Fm 17/07/2026	240,000	226,890	0.10
Florida St Bd of Admin Fin Co 2.150% 01/07/2030	215,000	81,347	0.04
Fmg Resources Aug 2006 (Ser 144A) (Reg) 4.375% 01/04/2031	300,000	250,125	0.11
Ford Motor Company (Reg) 3.25% 12/02/2032	440,000	332,303	0.15
Ford Motor Credit (Reg) 3.625% 17/06/2031	665,000	525,879	0.23
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4% 13/11/2030	210,000	173,246	0.08
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.125% 17/08/2027	205,000	184,207	0.08
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.542% 01/09/2026	370,000	341,632	0.15
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.95 5% 28/05/2027	590,000	486,702	0.22
Freddie Mac Pool Fm 01/08/2052	1,565,000	1,480,890	0.65
Freddie Mac Pool Fm 01/10/2052	475,000	471,308	0.21
Freddie Mac Pool Fm 01/11/2052	1,586,000	1,575,817	0.69
Freddie Mac Stacrr Remic Trust 2022-Dna4 Ser Dna4 CI M1B Fm 25/05/2042	1,325,000	1,254,029	0.56
Freddie Mac Stacrr Remic Trust 2022-Dna3 Ser Dna3 CI M1A Fm	565,000	467,301	0.21
Freddie Mac Stacrr Remic Trust 2022-Dna7 Ser Dna7 CI M1A Fm	415,000	388,045	0.17
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debtl Notes Ser Hqa2 CI	210,000	211,671	0.09
Freddie Mac Stacrr Fm 25/03/2042	55,000	54,527	0.02
Freeport-Mcmoran Inc (Reg) 4.125% 0/1/03/2028	110,000	102,300	0.05
Freeport-Mcmoran Inc (Reg) 4.625% 0/1/08/2030	515,000	482,812	0.21
Freeport-Mcmoran Inc (Reg) 5.45% 15/03/2043	1,030,000	937,300	0.42
Fs Luxembourg Sarl (Ser 144A) (Reg) 10% 15/12/2025	335,000	337,512	0.15
Gartner Inc (Ser 144A) (Reg) 3.75% 01/10/2030	625,000	541,406	0.24
Gcat 2022-Nqm4 Trust Ser Nqm4 CI A1 Fm 25/09/2067	265,000	261,565	0.12
General Motors Finl Co (Reg) 1.2% 15/10/2024	645,000	597,185	0.26
General Motors Finl Co (Reg) 3.5% 07/11/2024	275,000	265,267	0.12
Globo Communicacoes Part (Ser 144A) (Reg) 4.875% 22/01/2030	320,000	271,200	0.12
Globo Communicacoes Part (Ser 144A) 5.5% 14/01/2032	420,000	360,150	0.16
Greenko Dutch Bv (Ser 144A) 3.85% 29/03/2026	500,000	415,425	0.18
Greenko Solar Mauritius (Ser 144A) (Reg) 5.55% 29/01/2025	200,000	188,000	0.08
Greenko Wind Projects Mu (Ser 144A) 5.5% 06/04/2025	555,000	521,006	0.23
Hca Inc (Reg) 3.5% 01/09/2030	2,505,000	2,166,825	0.96
Hca Inc (Reg) 4.125% 15/06/2029	1,135,000	1,048,456	0.46
Hca Incorporation 5.375% 01/02/2025	773,000	773,966	0.34
Heinz (H.J.) Finance Co Ser 144A (Reg) 7.125% 01/08/2039	140,000	154,368	0.07
Hertz Corp/The (Ser 144A) 5% 01/12/2029	600,000	456,000	0.20
Hertz Corp/The Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M 350Bps 14/06/2028	1,138	1,119	-
Hilton Domestic Operatin (Reg) 4.875% 15/01/2030	40,000	398,200	0.18
Hilton Domestic Operatin (Ser 144A) (Reg) 5.375% 01/05/2025	95,000	93,991	0.04
Hilton Domestic Operatin (Ser 144A) 3.625% 15/02/2032	410,000	330,352	0.15
Host Hotels & Resorts Lp (Ser H) (R Eg) 3.375% 15/12/2029	210,000	175,993	0.08
Host Hotels & Resorts Lp (Ser I) (R Eg) 3.5% 15/09/2030	205,000	169,175	0.07
Hyatt Hotels Corp (Reg) 5.75% 23/04/2030	338,000	332,276	0.15
Ioon Luxembourg Sarl Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba +250Bps	4,702	4,696	-
Indian Railway Finance (Ser 144A) 3.245% 13/02/2030	580,000	502,663	0.22
Indigo Merger Sub Inc Term B Term Usd-Libor-Bba 3M + 250Bps	1,171	1,170	-
Indonesia (Rep Of) (Reg) 3.05% 12/03/2025	655,000	478,094	0.21
Indonesia (Rep Of) (Reg) 3.85% 15/1/02/2030	345,000	324,616	0.14
Intesa Sanpaolo Spa (Reg) 4.198% 01/06/2032	427,000	313,496	0.14
Intown 2022-Stay Mortgage Trust Ser Stay CI A Fm 15/08/2037	420,000	418,067	0.19
Intown 2022-Stay Mortgage Trust Ser Stay CI C Fm 15/08/2037	145,000	142,380	0.06
Israel (Govt Of) (Reg) 2.5% 15/01/2/030	245,000	219,292	0.10

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジあり)

Italy (Rep Of) (Reg) 1.25% 17/02/20 26	337,000	292,496	0.13
Jazz Financing Lux Sarl Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +350Bps	1,378	1,368	-
Jbs Usa/Food/Finance (Reg) (Ser 144A) 3.625% 15/01/2032	625,000	512,500	0.23
Jbs Usa/Food/Finance (Reg) (Ser 144A) (Reg) 5.75% 01/04/2033	280,000	276,950	0.12
Jpmorgan Chase & Co Var 16/09/2024	450,000	471,024	0.21
Kinder Morgan Inc (Reg) 5.3% 01/12/2034	225,000	210,746	0.09
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 3% 01/06/2026	301,000	281,024	0.12
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 3.875% 1 5/05/2027	80,000	76,560	0.03
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.25% 01 /03/2031	580,000	545,202	0.24
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.375% 1/06/2046	220,000	178,858	0.08
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.625% 0 1/10/2039	465,000	359,268	0.16
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 6.875% 2 8/01/2039	760,000	829,580	0.37
Lprr Sr Secured Fin Dac (Ser 144A) 5.125% 15/07/2029	340,000	283,900	0.13
Liberty Broadband Corp (Reg) Conv 1 .25% 30/09/2050	970,000	945,374	0.42
Liberty Broadband Corp Conv 2.75% 30/09/2050	705,000	688,398	0.30
Liberty Media Corp Conv .5% 01/12/2 050	395,000	393,182	0.17
Life Mortgage Trust Us Ser Bmr2 CI A1 Fm 15/05/2039	600,000	586,126	0.26
Life Mortgage Trust Us Ser Bmr2 CI B Fm 15/05/2039	530,000	514,464	0.23
Life Mortgage Trust Us Ser Bmr2 CI C Fm 15/05/2039	340,000	329,584	0.15
Marb Bondco Plc (Ser 144A) 3.95% 29/01/2031	945,000	728,005	0.32
Marriott Vacation Worldw Conv 3.25% 15/12/2027	295,000	291,482	0.13
Match Group Inc (Ser 144A) (Reg) 4.125% 01/08/2030	270,000	220,725	0.10
Mc Brazil Dwnstrm (Ser 144A) (Reg) 6.75% 30/06/2031	460,000	384,100	0.17
Medco Bell Pte Ltd (Ser 144A) (Reg) 3.375% 30/01/2027	215,000	194,575	0.09
Medco Oak Tree Pte Ltd (Ser 144A) (Reg) 7.375% 14/05/2026	355,000	339,025	0.15
Mercadolibre Inc 3.125% 14/01/2031	470,000	364,250	0.16
Metronet Infrastructure Issuer Llc Ser 1A CI A2 Fm 20/10/2052	405,000	386,460	0.17
Mgm Resorts Intl (Reg) 4.75% 15/10/2028	85,000	74,588	0.03
Mileage Plus Holdings Llc Term B Te Rm Loan Usd-Libor-Bba3M 525 20/06/2	634,500	654,064	0.29
Miller (Herman) Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +200Bps	407	396	-
Millicom Intl Cellular (Ser 144A) ( Reg) 6.25% 25/03/2029	285,000	246,240	0.11
Millicom Intl Cellular (Ser 144A) 4 .5% 27/04/2031	315,000	287,356	0.12
Movida Europe Sa (Ser 144A) (Reg) 2.5% 08/02/2031	200,000	150,500	0.07
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.25% 15/ 08/2033	305,000	237,138	0.11
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.625% 01 /09/2030	985,000	822,475	0.36
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.875% 15/02/2031	600,000	498,750	0.22
Msci Inc (Ser 144A) 3.625% 01/11/20 31	307,000	256,345	0.11
Mwv 2022-2 Llc Ser 2A CI A Fm 2/10/2041	560,000	568,462	0.25
Mwv Owner Trust 2018-1 Ser 1A CI A Fm 2/10/2036	785,000	740,596	0.06
Natura & Co Lux Hid Sarl (Ser 144A) 6% 19/04/2029	280,000	245,000	0.11
Natura Cosmeticos Sa (Ser 144A) (Re G) 4.125% 03/05/2028	445,000	366,569	0.16
Nbm Us Holdings Inc (Ser 144A) (Reg ) 7% 14/05/2026	205,000	204,744	0.09
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-5 Ser 5A CI A1 Fm 25/07/2056	765,000	122,717	0.05
News Corp (Ser 144A) 3.875% 15/05/2 029	761,000	652,557	0.29
Occidental Petroleum Cor (Reg) 3.2% 15/08/2026	127,000	117,133	0.05
Occidental Petroleum Cor (Reg) 01.125% 01/01/2031	360,000	354,500	0.16
Occidental Petroleum Cor (Reg) 6.625% 01/09/2030	650,000	675,187	0.30
Occidental Petroleum Cor (Reg) 7.5% 01/05/2031	275,000	295,630	0.13
Occidental Petroleum Corp (Reg) 3.4% 15/04/2026	377,000	353,301	0.16
Occu Auto Receivables Trust 2022-1 Ser 1A CI A2 Fm 15/03/2026	645,000	646,283	0.29
Organon & Co Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +300Bps 08/04/2028	1,805	1,791	-
Orvintv Inc 6.5% 15/08/2034	385,000	386,717	0.17
Owens Corning (Reg) 3.95% 15/06/202 9	275,000	226,478	0.11
Perusahaan Listrik Neger (Reg) Ser (144A) 4.125% 15/05/2027	200,000	189,750	0.08
Perusahaan Listrik Neger Ser 144A (Reg) 5.45% 21/05/2028	420,000	415,275	0.18
Petrorio Luxembourg Sarl (Ser 144A) 6.125% 09/06/2026	200,000	190,250	0.08
Pinnacle West Capital (Reg) 1.3% 15 /06/2025	235,000	213,250	0.09
Pnc Financial Services (Reg) Var Perp	133,000	132,834	0.06
Post Holdings Inc (Reg) Ser 144A 5.625% 15/01/2028	750,000	706,875	0.31
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/09/2031	405,000	340,200	0.15
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 4.625% 15/04/2030	640,000	553,676	0.25
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 5.5% 15/12/2029	120,000	109,200	0.05
Pt Pertamina (Persero) (Ser 144A) ( Reg) 3.65% 30/07/2029	310,000	284,425	0.13
Qatar Petroleum (Ser 144A) 2.25% 12 /07/2031	295,000	244,767	0.11
Qatar Petroleum (Ser 144A) 3.3% 12/ 07/2051	230,000	170,566	0.08
Rede D'Or Finance Sari (Ser 144A) (Reg) 4.375% 17/01/2028	245,000	226,931	0.10
Rede D'Or Finance Sari (Ser 144A) (Reg) 4.5% 22/01/2030	170,000	148,325	0.07
Republic Of Colombia (Reg) 5.625% 26/02/2044	205,000	150,992	0.07
Republic Of Indonesia (Reg) 3.55% 31/03/2032	235,000	213,377	0.09
Royal Caribbean Cruises (Ser 144A) (Reg) 6.5% 01/04/2028	540,000	433,350	0.19
Sabre Gbl Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +350Bps 17/12/2027	2	-	-
Sba Communications Corp (Reg) 3.125 % 01/02/2029	610,000	510,112	0.23
Sba Communications Corp (Reg) 3.875 % 15/02/2027	1,305,000	1,187,591	0.53
Sba Senior Finance II Llc Term B Te Rm Loan Usd-Libor-Bba3M 175 11/04/2	161	160	-
Sirius Xm Radio Inc (Ser 144A) (Reg) 4.125% 01/07/2030	380,000	315,400	0.14
Sk Hynix Inc (Ser 144A) (Reg) 1.5% 19/01/2026	415,000	359,899	0.16
Southwest Airlines Co (Reg) Conv 1.25% 01/05/2025	725,000	883,659	0.39
Southwestern Energy Co. 4.95% 23/01/2025	14,000	13,808	0.01
St Marys Cement Inc (Ser 144A) (Reg ) 5.75% 28/01/2027	530,000	531,987	0.24
Stanwood Property Trust (Ser 144A) (Reg) 4.375% 15/01/2027	255,000	224,364	0.10
State Of Qatar (Ser 144A) (Reg) 4.17% 14/03/2049	395,000	374,221	0.17
Stryker Corp (Reg) 6% 01/12/2023	129,000	123,944	0.05
Stryker Corp (Reg) 1.15% 15/06/2025	405,000	370,512	0.16
Taco Bell Funding Llc Fm 25/05/2046	730,000	663,135	0.29
Targa Resources Partners (Reg) 4% 15/01/2032	445,000	375,469	0.17
T-Mobile Us Trust 2022-1 Ser 1A CI A Fm 22/05/2028	460,000	458,582	0.20
T-Mobile Usa Inc (Reg) 2.625% 15/02 /2029	360,000	305,566	0.14
T-Mobile Usa Inc (Reg) 2.875% 15/02 /2031	395,000	271,279	0.12
T-Mobile Usa Inc (Reg) 3.5% 15/04/2 031	300,000	261,081	0.12
T-Mobile Usa Inc (Reg) 3.875% 15/04 /2030	610,000	552,723	0.24
T-Mobile Usa Inc 3.375% 15/04/2029	385,000	339,873	0.15
Trans Union Llc Term B6 Term Loan U Sd-Libor-Bba3M 225 18/11/2028	54,283	53,808	0.02
Transcanada Pipelines (Reg) 1% 12/1 0 /2024	407,000	377,874	0.17
Transcanada Pipelines (Reg) 4.1% 15/04/2030	670,000	617,956	0.27
Transcont Gas Pipe Line (Reg) 3.25% 15/05/2030	115,000	100,176	0.04

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建てで為替ヘッジあり)

Travel + Leisure Co (Ser 144A) (Reg) 4.5% 01/12/2029	503,000	412,460	0.18
Uber Technologies Inc (Reg) Conv 0% 15/12/2025	820,000	690,160	0.31
Uber Technologies Inc (Ser 144A) (R Eg) 8% 01/11/2026	205,000	205,855	0.09
United Airlines Inc (Ser 144A) 4.62 5% 15/04/2029	220,000	192,160	0.09
United Airlines Inc Tranche B Term Loan Used Libor-Bba +375Bps	489,761	484,659	0.21
United Rentals North Am (Reg) 3.875 % 15/02/2031	910,000	767,122	0.34
United Rentals North Am (Reg) 4.875% 15/01/2028	830,000	790,575	0.35
United Rentals North Am (Reg) 5.5% 15/05/2027	72,000	71,305	0.03
United Rentals North America Inc (Reg) 4% 15/07/2030	140,000	120,400	0.05
Unitedhealth Group Inc (Reg) .55% 1 5/05/2024	255,000	240,446	0.11
Us Bancorp (Reg) Var Perp 4/12/2049	440,000	361,350	0.16
Us Bancorp (Ser Mtn) (Reg) 1.375% 2 2/07/2030	370,000	287,197	0.13
Us Treasury .5% 28/02/2026	245,000	218,292	0.10
Us Treasury 1.5% 31/01/2027	1,860,000	1,678,911	0.74
Us Treasury 1.875% 15/02/2032	7,291,000	6,180,135	2.74
Us Treasury 2% 15/02/2050	1,500,000	993,332	0.44
Us Treasury 2.375% 15/02/2042	1,990,000	1,520,863	0.67
Us Treasury 2.375% 31/03/2029	865,000	787,183	0.35
Us Treasury 2.625% 31/05/2027	695,000	655,145	0.29
Us Treasury 2.75% 15/08/2032	2,360,000	2,146,850	0.95
Us Treasury 2.875% 15/05/2032	6,290,000	5,795,597	2.57
Us Treasury 3% 15/02/2049	2,755,000	2,272,701	1.01
Us Treasury 3% 15/08/2052	685,000	567,260	0.25
Us Treasury Bond 2.75% 15/11/2042	660,000	530,323	0.23
Var Energi Asa (Ser 144A) 7.5% 15/0 1/2028	495,000	504,210	0.22
Verizon Communications (Reg) 7.5% 2 2/03/2024	152,000	143,689	0.06
Verus Securitization Trust 2022-4 Ser 4 Cl A1 Fm 25/04/2067	530,000	445,257	0.20
Verus Securitization Trust 2022-8 Ser 8 Cl A2 Fm 25/10/2067	160,000	152,353	0.07
Verus Securitization Trust 2022-Inv1 Ser Inv1 Cl A1 Fm	235,000	220,479	0.10
Vici Properties / Note (Ser 144A) ( Reg) 4.625% 01/12/2029	125,000	113,823	0.05
Vici Properties / Note (Ser 144A) (Reg) 4.125% 15/08/2030	450,000	392,625	0.17
Vici Properties Lp 5.125% 15/05/203 2	510,000	472,606	0.21
Virgin Media Secured Fin (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/08/2030	425,000	355,810	0.16
Virgin Media Secured Fin (Ser 144A) (Reg) 5.5% 15/05/2029	386,000	349,330	0.15
Vmed O2 Uk Financing I (Ser 144A) 4.25% 31/01/2031	1,380,000	1,110,900	0.49
Vtr Comunicaciones Spa (Ser 144A) ( Reg) 4.375% 15/04/2029	255,000	149,175	0.07
Vtr Comunicaciones Spa (Ser 144A) ( Reg) 5.125% 15/01/2028	455,000	284,375	0.13
Vtr Finance Bv (Ser 144A) (Reg) 6.3 75% 15/07/2028	455,000	179,725	0.08
Wec Energy Group Inc (Reg) .8% 15/0 3/2024	202,000	191,648	0.08
Western Midstream Operat (Reg) 5.3% 01/02/2030	440,000	386,100	0.17
Westlake Corp (Reg) .875% 15/08/202 4	305,000	283,664	0.13
Williams Companies Inc (Reg) 3.5% 15/11/2030	900,000	788,206	0.35
Wmng Acquisition Corp (Ser 144A) (Re G) 3% 15/02/2031	135,000	108,675	0.05
Wyndham Destinations Inc (Ser 144A) (Reg) 6.625% 31/07/2026	302,000	296,337	0.13
Yum! Brands Inc (Ser 144A) (Reg) 4. 75% 15/01/2030	535,000	493,537	0.22
Yum! Brands Inc 3.625% 15/03/2031	1,175,000	987,000	0.44
Yum! Brands Inc 4.625% 31/01/2032	450,000	400,500	0.18
Zimmer Biomet Holdings (Reg) 1.45% 22/11/2024	390,000	363,208	0.16
	<b>147,789,839</b>	<b>65.50</b>	
<b>Total investments</b>	<b>212,191,621</b>	<b>94.05</b>	
<b>Other net assets</b>	<b>13,430,430</b>	<b>5.95</b>	
<b>Total net assets</b>	<b>225,622,051</b>	<b>100.00</b>	

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／国内／債券	
信託期間	信託期間は2010年6月14日から無期限です。	
運用方針	主として、「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	短期金融資産 マザーファンド	わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	外貨建資産への投資は行いません。
	短期金融資産 マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。</p> <p>(1) 分配対象額の範囲 経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>(2) 分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。</p>	

## FOFs用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)

### 運用報告書(全体版)

第13期(決算日 2023年9月25日)

### 受益者のみなさまへ

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

### 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

**【本運用報告書の記載について】**

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 配 分	期 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
第 9 期 (2019年9月25日)	9,897	0	△0.2	—	—	115
第10期 (2020年9月25日)	9,879	0	△0.2	—	—	15
第11期 (2021年9月27日)	9,860	0	△0.2	—	—	13
第12期 (2022年9月26日)	9,842	0	△0.2	—	—	13
第13期 (2023年9月25日)	9,822	0	△0.2	—	—	13

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率		
(当 期 首) 2022年 9月26日	円	%	%	%
9月末	9,842	—	—	—
10月末	9,841	△0.0	—	—
11月末	9,840	△0.0	—	—
12月末	9,838	△0.0	—	—
2023年 1月末	9,836	△0.1	—	—
2月末	9,835	△0.1	—	—
3月末	9,833	△0.1	—	—
4月末	9,832	△0.1	—	—
5月末	9,831	△0.1	—	—
6月末	9,829	△0.1	—	—
7月末	9,829	△0.1	—	—
8月末	9,827	△0.2	—	—
9月末	9,825	△0.2	—	—
(当 期 末) 2023年 9月25日	9,823	△0.2	—	—
	9,822	△0.2	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

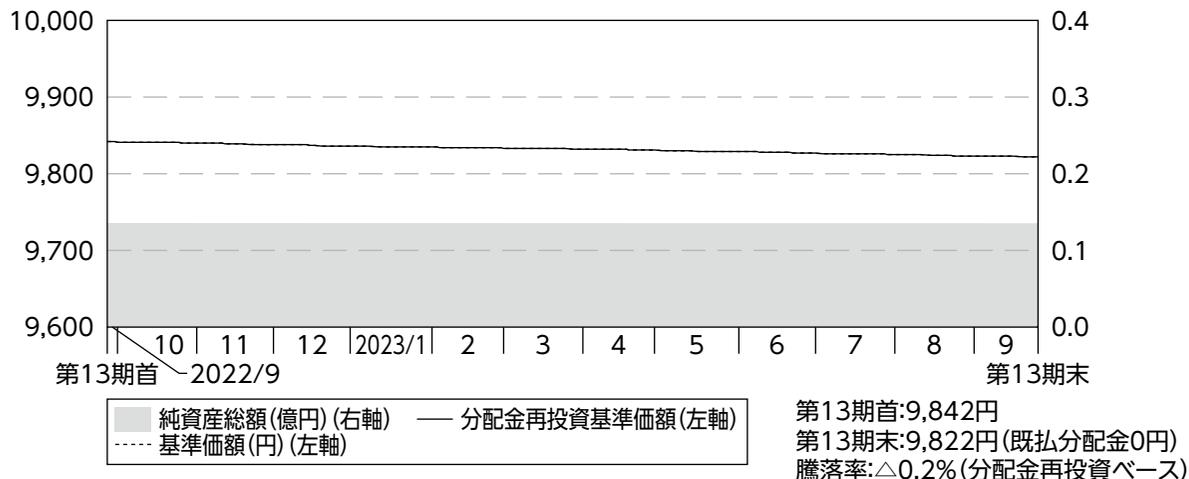
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



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

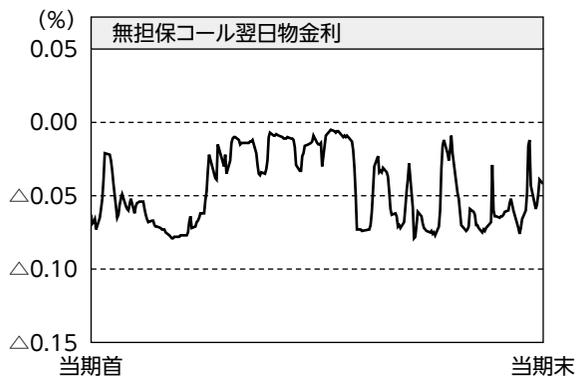
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2022年9月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の残存1年未満の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.09~0.00%近辺で推移しました。このような中、短期金融資産 マザーファンドではコールローン等にて運用を行いました。無担保コール翌日物金利のマイナス利回りや信託報酬などの要因により、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)は小幅に下落しました。

## 投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の残存1年未満の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.09～0.00%近辺で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象である「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れ、これを維持しました。

### 【「短期金融資産 マザーファンド」の運用経過】

日銀の金融緩和継続により残存1年未満の短期国債のマイナス利回り推移が概ね続いたことから、コールローン等にて運用を行いました。

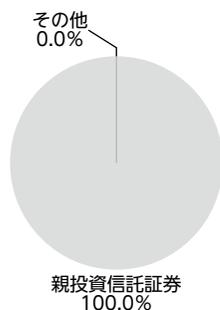
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

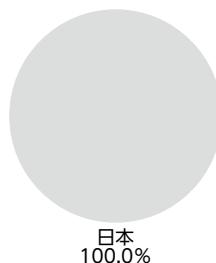
	当期末
	2023年9月25日
短期金融資産 マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

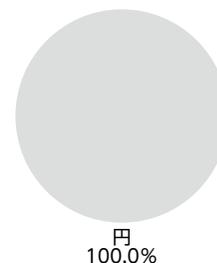
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第13期	
	2022年9月27日~2023年9月25日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	483

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

主として、短期金融資産 マザーファンドの受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年9月27日~2023年9月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.143%	(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9,832円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(11)	(0.110)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(商品)	(—)	(—)	
(先物・オプション)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(公社債)	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.148	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 9	千円 9	千口 29	千円 29

## 利害関係人<sup>\*</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2	0.328431	16.4	2	0.330484	16.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <短期金融資産 マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.716259	百万円 0.716259	% 100.0	百万円 0.716259	百万円 0.716259	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,418,040	287,035	11.9	2,417,473	288,145	11.9

<平均保有割合 0.1%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 13,408	千口 13,388	千円 13,537

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,613,014千口です。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
短期金融資産 マザーファンド	千円 13,537	% 99.9
コール・ローン等、その他	17	0.1
投資信託財産総額	13,554	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年9月25日現在
(A)資 産	13,554,460円
コール・ローン等	16,977
短期金融資産 マザーファンド(評価額)	13,537,428
未 収 入 金	55
(B)負 債	10,427
未 払 信 託 報 酬	9,699
そ の 他 未 払 費 用	728
(C)純 資 産 総 額(A-B)	13,544,033
元 本	13,789,273
次 期 繰 越 損 益 金	△245,240
(D)受 益 権 総 口 数	13,789,273口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,822円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年9月27日 至 2023年9月25日
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	△6,856円
売 買 損	△6,856
(B)信 託 報 酬 等	△20,020
(C)当 期 損 益 金(A+B)	△26,876
(D)前 期 繰 越 損 益 金	△100,384
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△117,980
(配 当 等 相 当 額)	(654,985)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,965)
(F) 計 (C+D+E)	△245,240
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△245,240
追 加 信 託 差 損 益 金	△117,980
(配 当 等 相 当 額)	(654,985)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,965)
分 配 準 備 積 立 金	11,103
繰 越 損 益 金	△138,363

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は13,789,186円、期中追加設定元本額は10,168円、期中一部解約元本額は10,081円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	－円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	654,985円
(D) 分配準備積立金額	11,103円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	666,088円
(F) 期末残存口数	13,789,273口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	483円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 短期金融資産 マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2023年9月25日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2007年9月26日から無期限です。
運用方針	わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債券先物率 債組入比率	純資産額
	円 騰落率	% 騰落率	10,000 騰落率	% 騰落率		
第12期(2019年9月25日)	10,129	△0.1	10,100	△0.1	—	百万円 8,839
第13期(2020年9月25日)	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	9,348
第14期(2021年9月27日)	10,120	△0.0	10,093	△0.0	—	10,085
第15期(2022年9月26日)	10,116	△0.0	10,091	△0.0	—	9,151
第16期(2023年9月25日)	10,111	△0.0	10,087	△0.0	—	9,719

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券先物率 債組入比率
	円 騰落率	% 騰落率	10,000 騰落率	% 騰落率	
(当期首) 2022年 9月26日	10,116	—	10,091	—	—
9月末	10,116	0.0	10,091	△0.0	—
10月末	10,116	0.0	10,091	△0.0	—
11月末	10,115	△0.0	10,090	△0.0	—
12月末	10,114	△0.0	10,090	△0.0	—
2023年 1月末	10,114	△0.0	10,089	△0.0	—
2月末	10,114	△0.0	10,089	△0.0	—
3月末	10,114	△0.0	10,089	△0.0	—
4月末	10,114	△0.0	10,089	△0.0	—
5月末	10,113	△0.0	10,088	△0.0	—
6月末	10,112	△0.0	10,088	△0.0	—
7月末	10,112	△0.0	10,088	△0.0	—
8月末	10,111	△0.0	10,087	△0.0	—
(当期末) 2023年 9月25日	10,111	△0.0	10,087	△0.0	—

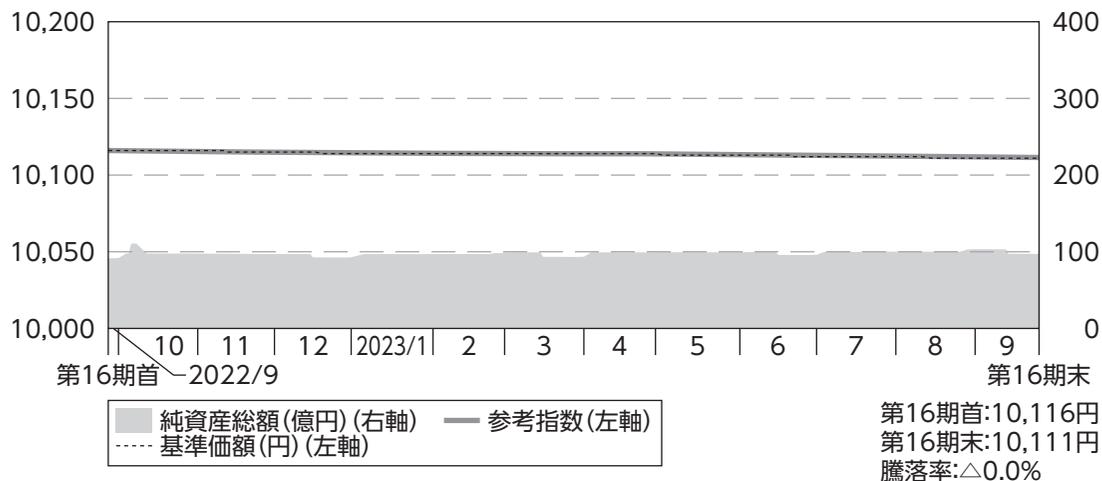
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

参考指数は、無担保コール翌日物金利の累積投資収益率で、設定日を10,000として指数化しております。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

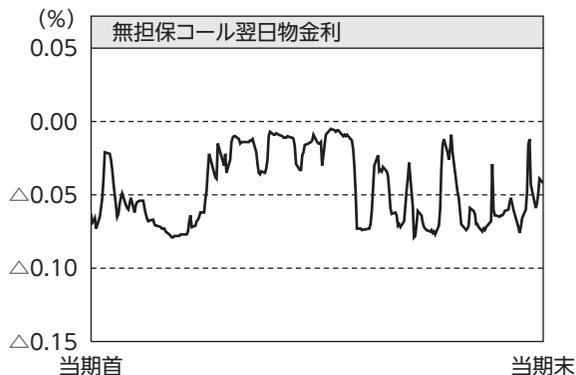


(注)参考指数は、2022年9月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の残存1年未満の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.09～0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等にて運用を行い、基準価額は横ばい推移となりました。

## 投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の残存1年未満の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.09～0.00%近辺で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

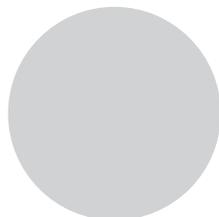
日銀の金融緩和継続により残存1年未満の短期国債のマイナス利回り推移が概ね続いたことから、コールローン等にて運用を行いました。

## 当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

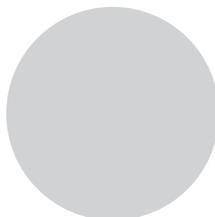
当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



短期金融資産等  
100.0%

○国別配分



日本  
100.0%

○通貨別配分



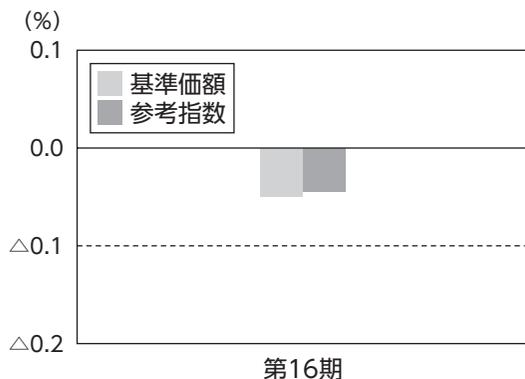
円  
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



## 今後の運用方針

わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年9月27日~2023年9月25日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,113円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.716259	百万円 0.716259	% 100.0	百万円 0.716259	百万円 0.716259	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,418,040	287,035	11.9	2,417,473	288,145	11.9

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 9,719,406	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	9,719,406	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年9月25日現在
(A)資 産	9,719,406,273円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,719,406,273
(B)負 債	137,944
未 払 解 約 金	120,055
未 払 利 息	17,889
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	9,719,268,329
元 本	9,613,014,242
次 期 繰 越 損 益 金	106,254,087
(D)受 益 権 総 口 数	9,613,014,242口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,111円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年9月27日 至 2023年9月25日
(A)配 当 等 収 益	△5,558,154円
受 取 利 息	31,265
支 払 利 息	△5,589,419
(B)そ の 他 費 用	△2
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	△5,558,156
(D)前 期 繰 越 損 益 金	105,248,698
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	47,186,266
(F)解 約 差 損 益 金	△40,622,721
(G)計 (C+D+E+F)	106,254,087
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	106,254,087

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は9,046,164,083円、期中追加設定元本額は4,122,189,011円、期中一部解約元本額は3,555,338,852円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	5,278,040,765円
DCターゲット・イヤールファンド2025	4,110,866,399円
DCターゲット・イヤールファンド2035	128,301,288円
DCターゲット・イヤールファンド2045	69,091,985円
FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,388,813円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
DCターゲット・イヤールファンド2055	2,950,938円
米国成長株式ファンド	493,486円

## お知らせ

該当事項はありません。