

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（U S）L L Cが運用する「ストラテジック・インカム・ファンド クラス A（円建て為替ヘッジなし）」を主要投資対象とします。
組 入 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株主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（為替ヘッジなし）

運 用 報 告 書（全 体 版）

第17期（決算日 2022年 3 月 7 日）
第18期（決算日 2022年 6 月 6 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（為替ヘッジなし）」は2022年 6 月 6 日に第18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 (分配落)	価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率		
	円	円		%	%	百万円
9期(2020年3月5日)	9,614	60		0.6	98.7	3,297
10期(2020年6月5日)	9,617	60		0.7	98.6	3,279
11期(2020年9月7日)	9,580	60		0.2	98.7	3,155
12期(2020年12月7日)	9,535	60		0.2	98.4	2,964
13期(2021年3月5日)	9,783	60		3.2	97.7	2,969
14期(2021年6月7日)	9,960	60		2.4	98.1	2,799
15期(2021年9月6日)	9,922	60		0.2	97.7	2,714
16期(2021年12月6日)	9,926	60		0.6	97.3	2,512
17期(2022年3月7日)	9,748	60	△1.2		97.9	2,398
18期(2022年6月6日)	10,547	60	8.8		98.2	2,378

(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

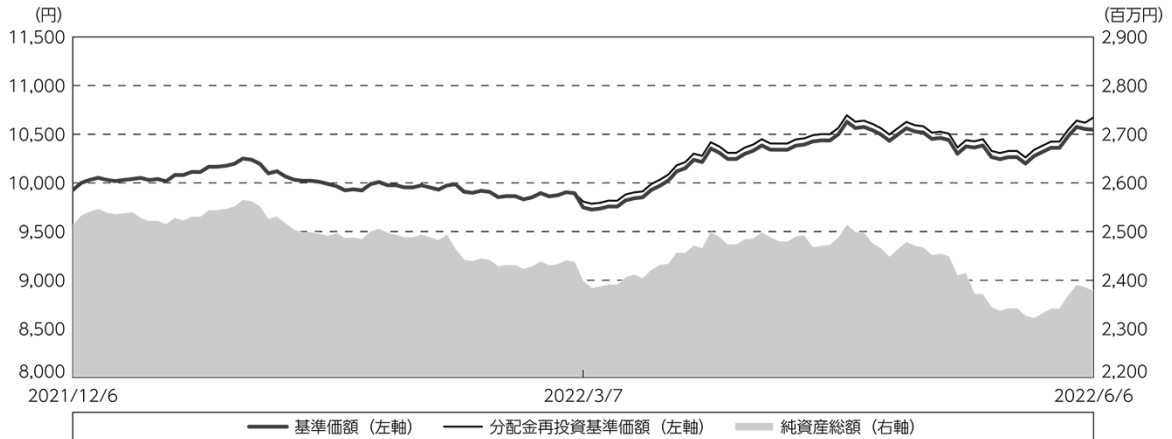
決 算 期	年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落	率	
第17期	(期 首) 2021年12月6日	円 9,926		% —	% 97.3
	12月末	10,176		2.5	98.5
	2022年1月末	9,976		0.5	98.1
	2月末	9,895		△0.3	98.4
	(期 末) 2022年3月7日	9,808		△1.2	97.9
第18期	(期 首) 2022年3月7日	9,748		—	97.9
	3月末	10,246		5.1	98.6
	4月末	10,498		7.7	98.7
	5月末	10,361		6.3	98.0
	(期 末) 2022年6月6日	10,607		8.8	98.2

(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

（2021年12月7日～2022年6月6日）

作成期間中の基準価額等の推移



第17期首：9,926円

第18期末：10,547円（既払分配金（税込み）：120円）

騰落率：7.5%（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（2021年12月6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（円建て為替ヘッジなし）」の基準価額（分配金再投資ベース）が上昇したことから、当ファンドの基準価額（分配金再投資ベース）も上昇しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
ストラテジック・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなし）	世界の公社債等	98.2%	8.1%
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（2021年12月6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1.3%台で始まった後、ロシアのウクライナ侵攻や中国の上海ロックダウン（都市封鎖）の長期化などによる世界景気の減速懸念などが低下要因となった一方、堅調な米国雇用環境、物価上昇、FRB（米連邦準備制度理事会）による量的金融緩和縮小の加速化決定、2022年3月及び5月の利上げ、利上げの加速化観測などが上昇要因となり作成期を通じて上昇し、2.9%台で作成期末を迎えました。

米投資適格社債及び米ハイ・イールド債券は、安定的な利息収入がプラスに寄与した一方、米国長期金利の上昇やスプレッドの拡大がマイナスに影響し下落しました。その他の先進国では、物価上昇などを背景として、英国、ドイツ、カナダ、オーストラリアなどで国債利回りが上昇しました。新興国でも、作成期を通じて全体的に国債利回りが上昇しました。

外国為替市場では、円安米ドル高となりました。作成期初1米ドル113円台で始まった後、米国長期金利の上昇、3月及び5月の利上げ、利上げの加速化観測などが米ドル買い要因となり、作成期末には129円台となりました。

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（円建て為替ヘッジなし）」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（円建て為替ヘッジなし）

ポートフォリオの平均残存年数はインフレ率や金利の上昇リスクに対して慎重な姿勢を維持しています。

債券種別では、米国以外の先進国債、資産証券化商品、バンクローン、米投資適格社債、米国国債などの比率を引き上げ、米ハイ・イールド債券などの比率を引き下げました。通貨構成に関しては、イギリスポンド、ユーロ、ノルウェークローネ、カナダドルなどの売り建てを縮小しました。

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17期	第18期
	2021年12月7日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年6月6日
当期分配金	60	60
（対基準価額比率）	0.612%	0.566%
当期の収益	60	60
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	838	1,064

（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（円建て為替ヘッジなし）」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（円建て為替ヘッジなし）

経済活動の再開や堅調な雇用環境が世界経済を下支えする一方、インフレ率の上昇、ウクライナ情勢などが不確実性を高める要因となっています。市場では、経済再開の動向のほかインフレ率の上昇、金融引き締め規模やペース、ウクライナ情勢などをめぐり、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、インフレ率や金利の上昇リスクに対して慎重な姿勢を維持するとともに、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。

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。

投資適格社債やハイ・イールド債券は、経済再開に伴い投資機会があると考えていますが、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。

バンクローンについては、金利上昇リスクにも対応できることから、引き続き戦略的に活用していきます。

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、長期的には米ドルの下落圧力が強まると思われますが、短期的には各国の金融引き締め動向やウクライナ情勢などを受けて一定範囲内で推移すると考え、ボラティリティの高まる局面に応じて通貨配分を機動的に調整します。

・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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

項 目	第17期～第18期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 41	% 0.400	(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)	(17)	(0.165)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(22)	(0.219)	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)	(2)	(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	41	0.403	
作成期間の平均基準価額は、10,192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。

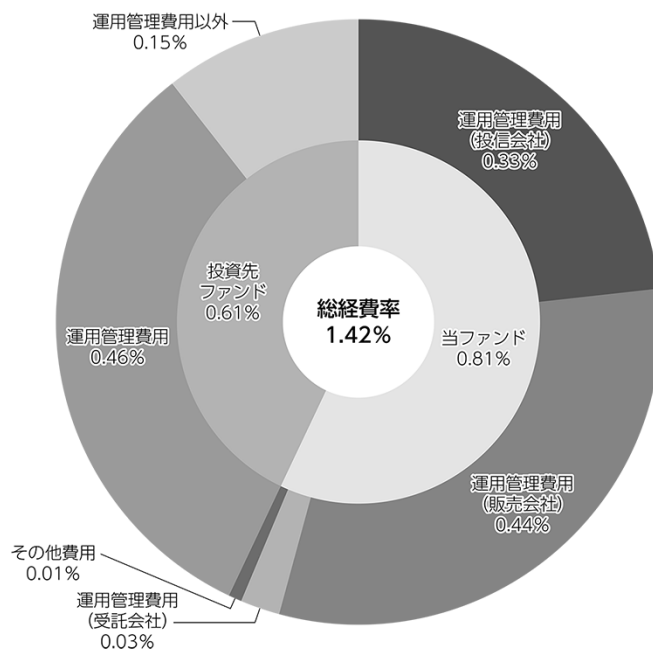
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.42%です。



(単位:%)

総経費率 (①+②+③)	1.42
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	0.15

(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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

投資信託証券

銘 柄		第17期～第18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 (円建て為替ヘッジなし)	口	千円	口	千円
		50,688	46,930	312,879	293,000

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月7日～2022年6月6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 (2021年12月7日～2022年6月6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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年6月6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16期末	第18期末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
	F O F s 用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	100,645	100,645	99	0.0
	ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジなし)	2,673,398	2,411,207	2,336,460	98.2
	合 計	2,774,043	2,511,852	2,336,559	98.2

(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

(2022年6月6日現在)

項 目	第18期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,336,559	97.3
コール・ローン等、その他	65,603	2.7
投資信託財産総額	2,402,162	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17期末	第18期末
	2022年3月7日現在	2022年6月6日現在
	円	円
(A) 資産	2,422,480,883	2,402,162,325
コール・ローン等	74,381,329	52,602,755
投資信託受益証券(評価額)	2,348,099,554	2,336,559,570
未収入金	—	13,000,000
(B) 負債	24,177,898	23,768,691
未払収益分配金	14,762,323	13,530,730
未払解約金	4,380,861	5,297,830
未払信託報酬	5,000,296	4,872,431
未払利息	203	144
その他未払費用	34,215	67,556
(C) 純資産総額(A－B)	2,398,302,985	2,378,393,634
元本	2,460,387,267	2,255,121,676
次期繰越損益金	△ 62,084,282	123,271,958
(D) 受益権総口数	2,460,387,267口	2,255,121,676口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,748円	10,547円

(注) 当ファンドの第17期首元本額は2,530,911,741円、第17～18期中追加設定元本額は23,407,382円、第17～18期中一部解約元本額は299,197,447円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第17期0.9748円、第18期1.0547円です。

○損益の状況

項 目	第17期	第18期
	2021年12月7日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年6月6日
	円	円
(A) 配当等収益	23,660,642	22,021,676
受取配当金	23,673,438	22,032,633
支払利息	△ 12,796	△ 10,957
(B) 有価証券売買損益	△ 47,837,412	176,210,439
売買益	148,091	186,229,980
売買損	△ 47,985,503	△ 10,019,541
(C) 信託報酬等	△ 5,034,511	△ 4,905,772
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 29,211,281	193,326,343
(E) 前期繰越損益金	44,343,140	337,561
(F) 追加信託差損益金	△ 62,453,818	△ 56,861,216
(配当等相当額)	(64,930,309)	(59,976,492)
(売買損益相当額)	(△127,384,127)	(△116,837,708)
(G) 計 (D + E + F)	△ 47,321,959	136,802,688
(H) 収益分配金	△ 14,762,323	△ 13,530,730
次期繰越損益金 (G + H)	△ 62,084,282	123,271,958
追加信託差損益金	△ 62,453,818	△ 56,861,216
(配当等相当額)	(64,930,309)	(59,976,492)
(売買損益相当額)	(△127,384,127)	(△116,837,708)
分配準備積立金	141,267,436	180,133,174
繰越損益金	△140,897,900	—

(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（2021年12月7日～2022年6月6日）は以下の通りです。

項 目	2021年12月7日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年6月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	18,626,131円	21,476,645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	43,143,520円
c. 信託約款に定める収益調整金	64,930,309円	59,976,492円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	137,403,628円	129,043,739円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	220,960,068円	253,640,396円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	898円	1,124円
g. 分配金	14,762,323円	13,530,730円
h. 分配金(1万口当たり)	60円	60円

○分配金のお知らせ

	第17期	第18期
1 万口当たり分配金（税込み）	60円	60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（円建て為替ヘッジなし）

●ファンドの概要

運用会社	マニュライフ・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	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。 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。 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。 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。 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。 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。 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。 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。

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 2021」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 (円建て為替ヘッジなし)

●損益の状況（2021年1月1日～2021年12月31日）

	2021 USD	2020 USD
Income		
Interest from interest-bearing securities	7,733,286	9,239,277
Bank interest	-	4,628
Net realized (losses)/gains on financial assets at fair value through profit or loss and derivative financial instruments	(18,763,335)	18,726,180
Net change in unrealized (losses)/gains on financial assets at fair value through profit or loss and derivative financial instruments	(19,979,255)	7,382,373
Sundry income	12,850	36,930
Net exchange gains/(losses)	65,499	(435,370)
	<u>(30,930,955)</u>	<u>34,954,018</u>
Expenses		
Investment management fee	(1,556,095)	(1,613,654)
Safe custody and processing fee	(213,028)	(216,638)
Interest expenses	(7,548)	(2,188)
Trustee fee	(12,000)	(12,000)
Auditor's remuneration	(42,368)	(41,140)
Valuation fee	(175,000)	(175,700)
Transaction handling fee	(24,930)	(28,552)
Annual authority fee	(1,959)	(1,211)
Accounting and other professional fees	(5,616)	(5,865)
Other operating expenses	(67,712)	(71,329)
Total operating expenses	<u>(2,106,256)</u>	<u>(2,168,277)</u>
Operating (loss)/profit	<u>(33,037,211)</u>	<u>32,785,741</u>
Finance cost		
Distribution to unitholders	(4,975,243)	(6,074,020)
(Loss)/profit after distribution and before taxation	<u>(38,012,454)</u>	<u>26,711,721</u>
Taxation		
Withholding taxes	(165,008)	(313,848)
Total comprehensive (loss)/income for the year	<u><u>(38,177,462)</u></u>	<u><u>26,397,873</u></u>

	2021 USD	2020 USD
Net assets attributable to unitholders at the beginning of the year	389,905,203	408,925,004
Proceeds on subscription	18,676,114	34,494,556
Proceeds on re-investment of distributions	3,284,147	4,911,783
Payments on redemption	(35,145,948)	(84,824,013)
	(13,185,687)	(45,417,674)
Total comprehensive (loss)/income for the year	(38,177,462)	26,397,873
Net assets attributable to unitholders at the end of the year	338,542,054	389,905,203

●投資明細表 (2021年12月31日現在)

AS AT 31 DECEMBER 2021

Debt securities	Quantity / Par Value	Market Value USD	% of Net Assets
Denominated in Australian Dollar			
Australia (Govt Of) (Ser 159) (Reg S) .25% 21/11/2024	2,530,000	1,805,591	0.53
Australia (Govt Of) (Ser 164) (Reg S) .5% 21/09/2026	620,000	433,863	0.13
New S Wales Treasury Crp (Reg S) (R Eg) 1.25% 20/03/2025	880,000	640,415	0.19
New S Wales Treasury Crp 1% 08/02/2024	2,250,000	1,641,320	0.48
Queensland Treasury Corp Ser 23 (Reg S) (Reg) 4.25% 21/07/2023	550,000	422,891	0.12
Wells Fargo & Company 3.25% 27/04/2022	810,000	594,468	0.18
		5,538,548	1.63
Denominated in Brazilian Real			
Brazil (Rep Of) (Ser Ntnf) 10% 01/01/2025 (Dirty)	9,110	1,611,397	0.47
Intl Bk Recon & Develop (Ser Gdif) (Reg) 6.75% 04/02/2024	610,000	103,017	0.03
Nota Do Tesouro Nacional Ser Ntnf 10% 01/01/2023 (Dirty)	1,990	351,697	0.10
Nota Do Tesouro Nacional Ser Ntnf 10% 01/01/2027 (Dirty)	2,630	461,525	0.14
Simpair Finance Sarl 10.75% 12/02/2028	2,440,000	368,165	0.11
Swiss Insured Brazil Ser 144A (Reg) 9.85% 16/07/2032	5,145,000	810,451	0.24
		3,706,252	1.09
Denominated in British Pound			
Berkshire Hathaway Fin 2.375% 19/06 /2039	495,000	699,458	0.21
Bp Capital Markets Plc (Ser Bp) (Re G S) (Reg) Conv 1% 28/04/2023	700,000	971,044	0.29
European Investment Bank (Ser Emtn) (Br) (Reg S) Frn 29/06/2023	340,000	461,862	0.14
Ford Motor Credit Co Llc (Ser Emtn) 2.748% 14/06/2024	255,000	347,534	0.10
Province Of Quebec (Reg S) (Br) 1.5 % 15/12/2023	387,000	529,132	0.15
Uk (Gilts) (Reg S) (Reg) .125% 31/0 /2024	170,000	227,308	0.07
Uk Tsy (Reg) (Reg S) 0.5% 22/07/2022	1,585,000	2,147,710	0.63
		5,384,048	1.59
Denominated in Canadian Dollar			
Bank Of Montreal (Ser 14) (Reg) Frn 01/02/2023	885,000	702,080	0.21
British Columbia Prov Of 2.85% 18/06/2025	775,000	642,449	0.19
Canada (Govt Of) (Reg) 2.25% 01/03/ 2024	2,491,000	2,022,452	0.60
Canada Housing Trust 1.25% 15/06/2026	225,000	176,018	0.05
Canada Housing Trust 1.95% 15/12/2025	270,000	217,632	0.06
Cenovus Energy Inc 3.5% 07/02/2028	410,000	338,866	0.10
Intl Bk Recon & Develop (Ser Gdif) (Reg) 1.9% 16/01/2025	765,000	614,211	0.18
Ontario (Prov Of) 3.45% 02/06/2045	560,000	520,599	0.15
Ontario (Province Of) 1.35% 02/12/2030	5,830,000	4,378,965	1.29
Ontario (Province Of) 2.9% 02/06/2028	865,000	731,018	0.22
Province Of Alberta 3.4% 01/12/2023	1,150,000	948,101	0.28
Province Of Quebec 3.75% 01/09/2024	1,065,000	896,528	0.27
Royal Bank Of Canada (Ser Bt) (Reg) Var Perp 31/12/2049	470,000	372,358	0.11
		12,561,277	3.71
Denominated in Colombian Peso			
Colombia (Rep Of) (Ser B) (Reg) 10% 24/07/2024	3,897,700,000	1,027,475	0.31
Colombia (Rep Of) (Ser B) 6.25% 26/11/2025	3,010,000,000	713,363	0.21
Titulos De Tesoreria B (Reg) Ser B 7.5% 26/08/2026	1,845,000,000	450,540	0.13
		2,191,378	0.65
Denominated in Euro			
Airbus Se (Ser Emtn) (Reg S) (Br) 1 .625% 09/06/2030	200,000	244,309	0.07
Allergan Funding Scs (Reg) 2.625% 1 5/11/2028	335,000	414,749	0.12
Allergan Funding Scs 1.25% 01/06/2024	215,000	248,311	0.07
American Tower Corp (Reg) 1.95% 22/ 05/2026	340,000	410,372	0.12
American Tower Corp 0.5% 15/01/2028	210,000	235,076	0.07
Apple Inc (Reg) 0% 15/11/2025	525,000	597,941	0.18
Apple Inc .875% 24/05/2025	470,000	551,208	0.16
Ardagh Metal Packaging (Ser 144A) (Reg) 3% 01/09/2029	260,000	290,421	0.09
Austria (Rep Of) (Reg S) .5% 20/02/ 2029	440,000	522,681	0.15
Avery Dennison Corp (Reg) 1.25% 03/03/2025	460,000	540,794	0.16
Becton Dickinson Euro 1.208% 04/06/ 2026	455,000	535,829	0.16
Berkshire Hathaway Inc 0% 12/03/2025	545,000	619,687	0.18
Bmw Finance Nv (Ser Emtn) (Reg S) (Br) 1% 14/11/2024	430,000	504,705	0.15
Bng Bank N.V. Ser Emtn (Reg S) (Br) 0.25% 07/06/2024	290,000	334,688	0.10
Boston Scientific Corp .625% 01/12/ 2027	745,000	847,295	0.25
Buoni Poliennali Del Tes (Reg S) 1.85% 01/07/2025	790,000	950,427	0.28
Capital One Financial Co .8% 12/06/2024	110,000	127,485	0.04
Celnex Telecom Sa 1.875% 26/06/2029	300,000	339,885	0.10
E.On Se (Ser Emtn) (Reg S) (Br) .37 5% 29/09/2027	245,000	281,097	0.08
Ecolab Inc 1% 15/01/2024	430,000	499,090	0.15
Edp Finance Bv (Ser Emtn) (Reg S) . 375% 16/09/2026	100,000	114,091	0.03
Etsf (Reg S) (Br) Ser Emtn 0.5% 20/01/2023	215,000	247,600	0.07
Engie Sa (Ser Emtn) (Reg S) (Br) .375% 21/06/2027	200,000	228,303	0.07

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジなし)

Fidelity Natl Info Serv 1.5% 21/05/ 2027	535,000	637,191	0.19
Finland (Rep Of) (Reg S) .5% 15/09/ 2028	435,000	517,597	0.15
Fiserv Inc 1.125% 01/07/2027	295,000	347,308	0.10
Goldman Sachs Group Inc (Reg S) (Re G) 3.375% 27/03/2025	146,000	183,146	0.05
Goldman Sachs Group Inc (Reg S) (Reg) Ser Emtn 1.375% 15/05/2024	337,000	391,460	0.12
Goldman Sachs Group Inc Ser Emtn (Reg) 2% 01/11/2028	194,000	239,961	0.07
Indonesia (Rep Of) 1.1% 12/03/2033	221,000	242,791	0.07
Irish (Govt Of) (Reg S) 3.9% 20/03/2023	380,000	455,319	0.13
Irish Tsy (Reg S) (Reg) 3.4% 18/03/2024	1,237,000	1,529,901	0.45
Johnson Controls/Tyco Fi .375% 15/0 9/2027	195,000	220,220	0.07
Jp Morgan Chase & Co Emtn 2.75% 24/08/2022	540,000	627,358	0.19
Kfw (Br) 0% 15/09/2023	110,000	126,386	0.04
Kingdom Of Sweden Ser (144A) 0.125% 24/04/2023	775,000	889,576	0.26
Obrigacoes Do Tesouro (Reg S) 0.7% 15/10/2027	335,000	398,148	0.12
Philippines (Rep Of) (Ser Emtn) .87 5% 17/05/2027	855,000	985,586	0.29
Province Of Quebec (Reg S) (Br) .2% 07/04/2025	535,000	615,598	0.18
Republic Of Indonesia (Reg) Ser 144A 2.15% 18/07/2024	720,000	856,762	0.25
Spain (Govt Of) (Ser 5Yr) (Reg S) . 25% 30/07/2024	680,000	788,395	0.23
Spain (Govt Of) (Ser Regs) (Reg S) .8% 30/07/2027	675,000	800,511	0.24
Thermo Fisher Scientific (Reg) 0.75% 12/09/2024	279,000	323,800	0.10
Thermo Fisher Scientific (Reg) 1.375% 12/09/2028	425,000	510,731	0.15
Thermo Fisher Scientific (Reg) Ser . 1.4% 23/01/2026	466,000	555,051	0.16
Thermo Fisher Scientific .5% 01/03/ 2028	310,000	354,176	0.11
Treasury (Reg) (Reg S) 0.2% 15/05/2027	165,000	191,433	0.06
Us Bancorp Ser Emtn 0.85% 07/06/2024	1,470,000	1,708,083	0.51
Vmed O2 Uk Financing I (Ser 144A) 3.25% 31/01/2031	590,000	668,494	0.20
		24,851,026	7.34
Denominated in Indonesian Rupiah			
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr77) 8.125% 15/05/2024	6,721,000,000	513,253	0.15
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr80) 7.5% 15/06/2035	5,491,000,000	405,800	0.12
Indonesia (Rep Of) (Ser Fr81) 6.5% 15/06/2025	20,275,000,000	1,505,991	0.45
Indonesia (Rep Of) Ser Fr73 8.75% 15/05/2031	7,193,000,000	585,433	0.17
Indonesia (Republic Of) Ser Fr65 6.625% 15/05/2033	6,409,000,000	453,228	0.13
Indonesia (Republic Of) Ser Fr71 (Reg) 9% 15/03/2029	4,545,000,000	369,117	0.11
Indonesia Government (Ser Fr78) 8.25% 15/05/2029	5,615,000,000	439,745	0.13
Indonesia Government (Ser Fr82) 7% 15/09/30	13,755,000,000	1,003,505	0.30
Indonesia Government Ser Fr56 8.375% 15/09/2026	8,780,000,000	697,410	0.21
Indonesia Government Ser Fr74 7.5% 15/08/2032	1,863,000,000	139,321	0.04
Indonesia Government Ser Fr75 7.5% 15/05/2038	5,288,000,000	387,811	0.11
		6,500,614	1.92
Denominated in Japanese Yen			
Japan (Govt Of) (Ser 138) .1% 20/12 /2023	332,250,000	2,899,193	0.86
		2,899,193	0.86
Denominated in Malaysian Ringgit			
Malaysia Government (Ser 419) 3.828% 05/07/2034	1,905,000	453,766	0.13
Malaysia Government Ser 0118 3.882% 14/03/2025	1,615,000	398,862	0.12
Malaysia Government Ser 0217 4.059% 30/09/2024	2,830,000	700,078	0.21
Malaysia Government Ser 0413 3.844% 15/04/2033	3,301,000	792,854	0.23
Malaysia Government Ser 0417 3.899% 16/11/2027	1,744,000	431,994	0.13
Malaysia Government Ser 0513 3.733% 15/06/2028	2,440,000	596,781	0.18
Malaysia Government Ser 316 3.9% 30/11/2026	1,405,000	348,619	0.10
		3,722,954	1.10
Denominated in Mexican Peso			
Banco Actinver Sa (Ser 144A) (Reg) 9.5% 18/12/2032	10,900,000	361,451	0.11
Mex Bonos De Desarr Fix Rt Ser M 20 7.5% 03/06/2027	29,990,000	1,468,970	0.43
Mex Bonos Desarr Fix Rt Ser M 5.75% 05/03/2026	19,160,000	881,869	0.26
Mex Bonos Desarr Fix Rt Ser M 7.75% 29/05/2031	21,040,000	1,039,794	0.31
Mexico (Utd States Of) (Ser M) 6.75 % 09/03/2023	17,050,000	833,275	0.24
		4,585,359	1.35
Denominated in New Zealand Dollar			
Intl Bk Recon & Develop (Ser Mtn) (Reg) 2.5% 24/01/2024	795,000	546,734	0.16
Intl Bk Recon & Develop (Ser Mtn) 2. 875% 30/11/2026	540,000	372,286	0.11
New Zealand (Govt Of) .5% 15/05/202 4	1,110,000	734,074	0.22
New Zealand (Govt Of) Ser 423 (Reg S) (Reg) 5.5% 15/04/2023	1,225,000	879,488	0.26
		2,532,582	0.75
Denominated in Norwegian Krone			
European Investment Bank (Ser Emtn) (Br) 1.75% 13/03/2025	1,170,000	133,267	0.04
European Investment Bank (Ser Emtn) (Reg S) (Br) 1.5% 12/05/2022	6,760,000	768,764	0.23
Kfw (Ser Emtn) (Br) 1.25% 28/08/202 3	5,440,000	616,489	0.18
Nordea Eiendoms kreditt (Reg) Frn 21 /06/2023	5,000,000	569,234	0.17
Nordea Eiendoms kreditt Frn 19/06/20 24	8,000,000	912,680	0.27
Norway (Govt Of) (Ser 478) (Reg S) 1.5% 19/02/2026	6,080,000	687,844	0.20
Norway (Govt Of) (Ser 482) (Reg S) 1.375% 19/08/2030	7,005,000	775,675	0.23
Norwegian (Govt Of) Ser 475 2% 24/05/2023	15,660,000	1,799,189	0.53
		6,263,142	1.85

Denominated in Philippine Peso

Philippines (Rep Of) (Ser R512) 6.2 5% 12/03/2024	42,805,000	903,855	0.27
		903,855	0.27

Denominated in Singapore Dollar

Singapore (Govt Of) 3.375% 01/09/2033	975,000	837,210	0.25
Singapore Government 2.375% 01/06/2025	3,110,000	2,403,538	0.71
		3,240,748	0.96

Denominated in United States Dollar

1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 3.5% 15/02/2029	497,000	493,272	0.15
1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 3.875% 15/01/2028	345,000	350,175	0.10
1011778 Bc / New Red Fin (Ser 144A) (Reg) 4% 15/10/2030	1,745,000	1,727,550	0.51
Abu Dhabi Govt Int'L (Ser 144A) 1.7% 02/03/2031	740,000	718,842	0.21
Abu Dhabi Govt Int'L (Ser 144A) 3.125% 16/04/2030	310,000	335,172	0.10
Abu Dhabi Govt Int'L (Ser 144A) 3.875% 16/04/2050	235,000	274,252	0.08
Adani Green Energy Ltd (Ser 144A) (Reg) 4.375% 08/09/2024	245,000	249,900	0.07
Adani Green Energy Up (Ser 144A) (R Eg) 6.25% 10/12/2024	470,000	512,887	0.15
Adani Ports And Special (Ser 144A) (Reg) 4.2% 04/08/2027	290,000	301,962	0.09
Adani Ports And Special Ser 144A (Reg) 4% 30/07/2027	490,000	505,865	0.15
Aecom (Reg) Ser 144A 5.125% 15/03/2027 W/I	460,000	501,400	0.15
Aecom Technology Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba +175 Bps	1,049,370	1,051,993	0.31
Aes Corp/The (Ser 144A) (Reg) 3.95% 15/07/2030	125,000	132,453	0.04
Air Canada (Reg) Conv 4% 01/07/2025	375,000	501,994	0.15
Air Canada Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba-3M+ 350Bps 27/07/2028	845,000	845,528	0.25
Aker Bp Asa (Ser 144A) (Reg) 3.75% 15/01/2030	1,100,000	1,167,375	0.34
Altioe Financing Sa (Ser 144A) (Reg) 5% 15/01/2028	775,000	755,625	0.22
American Airlines Group (Reg) Conv 6.5% 01/07/2025	1,140,000	1,574,500	0.47
American Airlines/Aadvan (Ser 144A) (Reg) 5.5% 20/04/2026	775,000	815,143	0.24
American Airlines/Aadvan (Ser 144A) (Reg) 5.75% 20/04/2029	630,000	674,509	0.20
American Intl Group (Reg) Var 15/05/2068	1,435,000	2,124,624	0.63
Angi Homeservices Inc (Ser 144A) 3. 875% 15/08/2028	520,000	510,900	0.15
Antero Resources Corp (Ser 144A) 5. 375% 01/03/2030	640,000	684,400	0.20
Ap Core Holdings Ii Llc Tranche B1 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +550Bps	548,063	549,775	0.16
Ap Core Holdings Ii Llc Tranche B2 Term Loan Usd-Libor-Bba	385,000	385,722	0.11
Apx Group Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 33M+ 375Bps	280,000	279,883	0.08
Aramark Services Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +175Bps	800,000	791,666	0.23
Arcelormittal (Reg) 4.55% 11/03/202 6	80,000	87,800	0.03
Arcelormittal (Reg) 7.75% 15/10/2039	105,000	145,425	0.04
Arcelormittal (Reg) Stp 01/03/2041	400,000	543,000	0.16
Ardagh Metal Packaging (Ser 144A) (Reg) 4% 01/09/2029	1,347,000	1,336,056	0.39
Ardagh Metal Packaging (Ser 144A) 3. 25% 01/09/2028	770,000	759,894	0.22
Arroyo Mortgage Trust 2019-1 Ser 1 Cl A1 Fm 25/01/2049	990,000	371,332	0.11
Asurion Llc Tranche B4 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 525Bps 14/01/2029	510,000	509,044	0.15
Asurion Llc Tranche B9 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 325Bps 31/07/2027	378,376	376,366	0.11
Atento Luxco 1 Sa (Ser 144A) 8% 10/ 02/2026	396,000	422,730	0.12
Avantor Funding Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 225Bps	982,538	982,384	0.29
Ball Corp (Reg) 5.25% 01/07/2025	1,065,000	1,175,494	0.35
Ball Corp 2.875% 15/08/2030	415,000	405,144	0.12
Ball Corp 4.875% 15/03/2026	845,000	932,669	0.28
Bally'S Corp Tranche B Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 325Bps	395,000	395,568	0.12
Bamill Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DsmY	795,000	793,533	0.23
Banco Actinver Sa (Ser 144A) (Reg) 4.8% 18/12/2032	200,000	143,500	0.04
Banco Santander Sa (Ser D) Var Perp 31/12/2049	600,000	600,439	0.18
Bank Of America Corp Var 29/04/2031	705,000	711,766	0.21
Barclays Plc Var Perp (31/12/2049)	390,000	382,980	0.11
Becle Sa De Cv (Ser 144A) 2.5% 14/10/2031	630,000	618,708	0.18
Berry Global Escrow Corp (Ser 144A) (Reg) 5.625% 15/07/2027	605,000	634,494	0.19
Bnp Paribas (Ser 144A) (Reg) Var Perp 31/12/2049	1,591,000	1,592,731	0.47
Boeing Co 5.04% 01/05/2027	895,000	1,008,218	0.30
Boeing Co 5.15% 01/05/2030	2,220,000	2,592,384	0.77
Braskem Idesa Sapi (Ser 144A) (Reg) 6.99% 20/02/2032	380,000	384,016	0.11
Braskem Netherlands (Reg) Ser 144A 4.5% 10/01/2028	205,000	218,069	0.06
Braskem Netherlands (Ser 144A) (Reg) 5.875% 31/01/2050	475,000	546,250	0.16
Brf Sa (Ser 144A) (Reg) 4.875% 24/0 1/2030	310,000	315,011	0.09
Brown Group Holding Llc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +275Bps	418,415	417,630	0.12
Burger King Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +175Bps	1,256,169	1,238,256	0.37
Burlington Coat Factory Tranche B6 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M + 200Bps	721,375	718,219	0.21
Burlington Stores Inc (Reg) Conv 2.25% 15/04/2025	475,000	705,774	0.21
Bx Commercial Mortgage Trust 2019-Xi Ser Xi Cl A Fm 15/10/2036	765,000	638,811	0.19
Bx Commercial Mortgage Trust 2021-Volt Ser Volt Cl A Fm	425,000	424,142	0.13
Bx Trust Ser Bioa Cl D Fm 15/03/2037	435,000	420,051	0.12
Carnival Corp (Ser 144A) (Reg) 5.75% 01/03/2027	935,000	936,169	0.28
Carnival Corp Term B Term Loan-Libo R-Bba 3M +300Bps 30/06/2025	726,313	720,866	0.21
Carnival Corp Term B Term Loan-Libo R-Bba 3M +325Bps 08/10/2028	375,000	372,187	0.11
Coo Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.25% 01/02/2031	135,000	136,519	0.04
Coo Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.5% 01/06/2033	400,000	408,250	0.12
Coo Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/08/2030	800,000	824,000	0.24
Coo Hldgs Llc/Cap Corp (Ser 144A) (Reg) 4.75% 01/03/2030	800,000	835,500	0.25

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジなし)

Cco Holdings Llc / Cco Holdings Capital Corp Ser 144A 01/05/2027	1,185,000	1,229,438	0.36
Cdw Llc/Cdw Finance (Reg) 4.25% 01/ 04/2028	315,000	326,419	0.10
Cdw Llc/Cdw Finance 4.125% 01/05/2025	330,000	339,900	0.10
Cemex Sab De Cv (Ser 144A) (Reg) 3. 875% 11/07/2031	685,000	685,856	0.20
Cengage Learning Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 475Bps	413,963	415,585	0.12
Cenovus Energy Inc (Reg) 5.25% 15/0 6/2037	163,000	192,654	0.06
Cenovus Energy Inc (Reg) 5.4% 15/06/2047	628,000	780,837	0.23
Cenovus Energy Inc (Reg) 6.75% 15/1 1/2039	1,750,000	2,373,691	0.70
Centene Corp (Reg) (Ser Wi) 3.375% 15/02/2030 When Issued	1,480,000	1,520,700	0.45
Centene Corp (Reg) 2.5% 01/03/2031	735,000	715,446	0.21
Centene Corp (Reg) 4.625% 15/12/202 9	215,000	231,931	0.07
Centene Corp 3% 15/10/2030	1,475,000	1,506,344	0.45
Century Plaza Towers 2019-Cpt Ser Cpt Cl A Fm 13/11/2039	1,000,000	1,040,290	0.31
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 2.8% 01/04/2031	530,000	525,942	0.16
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.12 % 01/07/2049	1,795,000	2,065,958	0.61
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.75% 01/04/2048	835,000	1,046,283	0.31
Charter Communications Operating Llc/Cap (Reg) 6.484% 23/10/2045	675,000	923,348	0.27
Cheniere Energy Partners (Reg) 4% 0 1/03/2031	1,000,000	1,057,500	0.31
Cheniere Energy Partners (Reg) 4.5% 01/10/2029	310,000	331,313	0.10
Clean Harbors Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M + 200Bps	375,000	375,234	0.11
Cleveland-Cliffs Inc (Ser 144A) (Reg) 4.875% 01/03/2031	625,000	650,000	0.19
Colombia (Rep Of) (Reg) 4.5% 15/03/ 2029	205,000	209,729	0.06
Colombia (Rep Of) 3.25% 22/04/2032	755,000	677,016	0.20
Continental Resources (Ser 144A) (R Eg) 5.75% 15/01/2031	1,057,000	1,247,260	0.37
Continental Resources (Ser 144A) 2. 875% 01/04/2032	859,000	833,052	0.25
Costar Group Inc (Ser 144A) 2.8% 15/ 07/2030	435,000	436,396	0.13
Credit Agricole Sa (Ser 144A) (Reg) Var Perp 31/12/2049	950,000	1,043,757	0.31
Credit Suisse Group Ag (Ser 144A) (Reg) Var Perp 31/12/2049	1,095,000	1,157,367	0.34
Credit Suisse Mortgage Trust Ser 19-Nqm1 Cl A1 Fm 25/10/2059	680,000	169,341	0.05
Crown Ameri/Cap Corp V (Reg) 4.25% 3 0/09/2026	85,000	91,163	0.03
Crown Castle Intl Corp 2.25% 15/01/2031	175,000	170,222	0.05
Crown Cork & Seal Co Inc (Reg) 7.375% 15/12/2026	211,000	255,574	0.08
Cyrusone Lp/Cyrusone Fin (Reg) 3.45 % 15/11/2029	1,070,000	1,161,617	0.34
Dae Funding Llc (Ser 144A) 3.375% 2 0/03/2028	540,000	548,100	0.16
Db Master Finance Llc Fm 20/05/2049	195,000	198,164	0.06
Db Master Finance Llc Ser A1 Cl A2li Fm 20/11/2047	645,000	645,651	0.19
Dbcg Mortgage Trust Ser 2017-Bbg Cl A Fm 15/06/2034	675,000	674,443	0.20
Dell Int Llc / Emc Corp (Reg) 8.35% 15/07/2046	588,000	982,761	0.29
Delta Air Lines 2020-A (Ser A) 2.5% 10/06/2028	465,000	401,017	0.12
Delta Air Lines Inc (Reg) 2.9% 28/1 0/2024	920,000	937,330	0.28
Delta Air Lines Inc (Reg) 4.375% 19/04/2028	225,000	240,635	0.07
Delta Air Lines Inc (Reg) 7.375% 15 /01/2026	130,000	153,262	0.05
Delta Air Lines/Skymiles (Ser 144A) (Reg) 4.5% 20/10/2025	605,000	634,660	0.19
Delta Air Lines/Skymiles (Ser 144A) (Reg) 4.75% 20/10/2028	3,962,000	4,342,857	1.28
Deutsche Bank Ag (Ser #) Var Perp 3 1/12/2049	800,000	834,000	0.25
Dish Network Corp Conv (Ser 144A) 3.375% 15/08/2026	425,000	400,379	0.12
Dominos Pizza Master Issuer Llc Ser 2015-1A Cl A2li Fm 25/10/2045	775,000	762,913	0.23
Dpl Inc (Reg) 4.125% 01/07/2025	1,045,000	1,089,413	0.32
Ecopetrol (Reg) 5.375% 26/06/2026	180,000	190,687	0.06
Ecopetrol Sa (Reg) 4.625% 02/11/203 1	330,000	322,080	0.10
Ecopetrol Sa (Reg) 6.875% 29/04/203 0	360,000	402,467	0.12
Ecopetrol Sa Ser (Reg) 5.875% 28/05/2045	180,000	172,434	0.05
Enbridge Inc (Reg) 3.125% 15/11/202 9	945,000	992,473	0.29
Encana Corp (Reg) 6.5% 01/02/2038	420,000	543,261	0.16
Enterprise Products Oper (Reg) 3.12 5% 31/07/2029	1,120,000	1,189,113	0.35
Eqm Midstream Partners L (Ser 144A) (Reg) 4.75% 15/01/2031	495,000	522,225	0.15
Eqst Corp (Reg) 3.9% 01/10/2027	266,000	283,955	0.08
Eqst Corp (Ser 144A) (Reg) 3.125% 15 /05/2026	150,000	153,750	0.05
Eqst Corp (Ser 144A) (Reg) 3.625% 15 /05/2031	1,770,000	1,840,800	0.54
Expedia Group Inc (Ser Wi) (Reg) 3.25% 15/02/2030	330,000	337,806	0.10
Firstenergy Corp (Ser B) (Reg) 3.9% 15/07/2027	715,000	771,606	0.23
Firstenergy Corp Ser C (Reg) 7.375% 15/11/2031	1,010,000	1,371,037	0.40
Firstkey Homes 2020-Sfr2 Trust Ser Sfr2 Cl A Fm 19/10/2037	315,000	306,509	0.09
Fmg Resources Aug 2006 (Ser 144A) (Reg) 4.375% 01/04/2031	2,780,000	2,943,325	0.87
Ford Motor Company (Reg) 3.25% 12/0 2/2032	440,000	452,497	0.13
Ford Motor Credit (Reg) 3.625% 17/06 /2031	965,000	1,010,650	0.30
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 2.979% 03/08/2022	355,000	357,323	0.11
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 3.087% 09/01/2023	240,000	243,478	0.07
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 3.35% 01/11/2022	270,000	273,576	0.08
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4% 1 3/11/2030	210,000	226,969	0.07
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.125% 17/08/2027	205,000	222,021	0.07
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.25% 20/09/2022	200,000	203,822	0.06
Ford Motor Credit Co Llc (Reg) 4.542% 01/08/2026	370,000	402,981	0.12
Ford Motor Credit Co Llc 2.9% 16/02/2028	285,000	287,180	0.08
Ford Motor Credit Co Llc 3.37% 17/1 1/2023	615,000	633,033	0.19
Freeport-Memoran Inc (Reg) 4.125% 0 1/03/2028	110,000	114,263	0.03
Freeport-Memoran Inc (Reg) 4.625% 0 1/08/2030	825,000	886,875	0.26
Freeport-Memoran Inc (Reg) 5.45% 15 /03/2043	1,305,000	1,650,825	0.49
Fs Luxembourg Sarl (Ser 144A) (Reg) 10% 15/12/2025	735,000	807,537	0.24
Gartner Inc (Ser 144A) (Reg) 3.75% 01/10/2030	970,000	989,400	0.29

Gci Lic (Ser 144A) 4.75% 15/10/2028	315,000	324,450	0.10
Globo Comunicacoes Part (Ser 144A) (Reg) 4.875% 22/01/2030	560,000	548,100	0.16
Government Ust.375%0425	168,000	164,273	0.05
Greenko Dutch Bv (Ser 144A) 3.85% 2 9/03/2026	500,000	499,887	0.15
Greenko Solar Mauritius (Ser 144A) (Reg) 5.55% 29/01/2025	460,000	471,500	0.14
Hca Inc (Reg) 3.5% 01/09/2030	2,055,000	2,173,163	0.64
Hca Inc (Reg) 4.125% 15/06/2029	1,595,000	1,766,463	0.52
Hca Incorporation 5.375% 01/02/2025	1,013,000	1,110,501	0.33
Heinz (H.J.) Finance Co Ser 144A (Reg) 7.125% 01/08/2039	140,000	212,713	0.06
Hertz Corp/The (Ser 144A) 5% 01/12/2029	600,000	605,625	0.18
Hertz Corp/The Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M 350Bps 14/06/2028	551,119	552,152	0.16
Hertz Corp/The Term C Team Loan Usd-Libor-Bba 3M 350Bps 14/06/2028	104,343	104,538	0.03
Hilton Domestic Operatin (Reg) 4.875% 15/01/2030	240,000	256,800	0.08
Hilton Domestic Operatin (Ser 144A) (Reg) 5.375% 01/05/2025	365,000	378,459	0.11
Hilton Domestic Operatin (Ser 144A) 3.625% 15/02/2032	410,000	408,820	0.12
Hilton Grand Vac Borrower Term B Usd-Libor-Bba-3M +300Bps 20/05/2028	334,163	335,207	0.10
Hilton Worldwide Finance Term B2 Term Loan Usd-Libor Bba 3M +175Bps	625,000	620,660	0.18
Host Hotels & Resorts Lp (Ser H) (R Eg) 3.375% 15/12/2029	210,000	214,829	0.06
Host Hotels & Resorts Lp (Ser I) (R Eg) 3.5% 15/09/2030	205,000	210,194	0.06
Hyatt Hotels Corp (Reg) 5.75% 23/04/2030	638,000	763,994	0.23
Icon Luxembourg Sarl Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba +250Bps	761,980	763,409	0.23
Indian Railway Finance (Ser 144A) 3.249% 13/02/2030	580,000	588,487	0.17
Indigo Merger Sub Inc Term B Term Usd-Libor-Bba 3M + 250Bps	189,856	190,132	0.06
Indonesia (Rep Of) (Reg) 3.05% 12/03/2051	425,000	421,741	0.12
Indonesia (Rep Of) (Reg) 3.85% 15/1 0/2030	345,000	388,429	0.11
Ing Groep Nv (Ser Nc10) (Reg) Var P Erp 31/12/2049	630,000	593,843	0.18
Ing Groep Nv Var Perp	809,000	873,720	0.26
International Game Tech Ser 144A (Reg) 6.5% 15/02/2025	925,000	1,008,250	0.30
Intesa Sanpaolo Spa (Reg) 4.198% 01/06/2032	427,000	430,785	0.13
Intesa Sanpaolo Spa (Reg) Var Perp 31/12/2049	200,000	226,000	0.07
Israel (Govt Of) (Reg) 2.5% 15/01/2 030	465,000	483,820	0.14
Israel Electric Corp Ltd (Reg) Ser 144A 6.875% 21/06/2023	425,000	458,773	0.14
Italy (Rep Of) (Reg) 1.25% 17/02/20 26	597,000	581,050	0.17
J2 Global (Ser 144A) (Reg) 4.625% 15/10/2030	240,000	246,900	0.07
Jazz Financing Lux Sarl Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +350Bps	960,175	964,976	0.28
Jazz Securities Dac (Ser 144A) (Reg) 4.375% 15/01/2029	200,000	207,000	0.06
Jbs Finance Luxembourg (Ser 144A) (Reg) 3.625% 15/01/2032	890,000	900,012	0.27
Jeld-Wen Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 225Bps 16/07/2028	263,675	263,840	0.08
Kenbourne Invest Sa (Ser 144A) 4.7% 22/01/2028	305,000	298,445	0.09
Kfc Holding Co Term B Term Loan -Libor-Bba 3M +175Bps 15/03/2028	1,076,270	1,076,047	0.32
Kinder Morgan Inc (Reg) 2% 15/02/2031	540,000	514,342	0.15
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 3% 01/06/2026	551,000	576,807	0.17
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 3.875% 1 15/05/2027	80,000	86,292	0.03
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.25% 01/03/2031	925,000	1,054,585	0.31
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.375% 0 1/06/2046	220,000	257,616	0.08
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 4.625% 0 1/10/2039	925,000	1,082,669	0.32
Kraft Heinz Foods Co (Reg) 6.875% 2 6/01/2039	790,000	1,159,311	0.34
Lcpr Sr Secured Fin Dac (Ser 144A) 5.125% 15/07/2029	625,000	633,594	0.19
Liberty Broadband Corp (Reg) Conv 1.25% 30/09/2050	970,000	961,302	0.28
Liberty Broadband Corp Conv 2.75% 30/09/2050	705,000	717,930	0.21
Liberty Media Corp Conv .5% 01/12/2 050	395,000	567,880	0.17
Life Time Inc (Ser 144A) (Reg) 5.75% 15/01/2026	1,010,000	1,047,875	0.31
Lions Gate Capital Hold (Ser 144A) (Reg) 5.5% 15/04/2029	785,000	798,738	0.24
Lloyds Banking Group Plc (Reg) Var Perp 31/12/2049	585,000	663,975	0.20
Marb Bondco Plc (Ser 144A) 3.95% 29/01/2031	690,000	665,292	0.20
Marriott Ownership Resorts Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +175Bps	620,000	611,165	0.18
Match Group Inc (Ser 144A) (Reg) 4.125% 01/08/2030	595,000	604,669	0.18
Mc Brazil Dwnstrm (Ser 144A) (Reg) 7.25% 30/06/2031	745,000	745,931	0.22
Medco Bell Pte Ltd (Ser 144A) (Reg) 6.375% 30/01/2027	215,000	213,387	0.06
Medco Oak Tree Pte Ltd (Ser 144A) (Reg) 7.375% 14/05/2026	630,000	653,625	0.19
Mercadolibre Inc 2.375% 14/01/2026	220,000	213,400	0.06
Mercadolibre Inc 3.125% 14/01/2031	805,000	765,756	0.23
Mgm Resorts Intl (Reg) 4.75% 15/10/ 2028	85,000	88,400	0.03
Mileage Plus Hldings Llc (Ser 144A) (Reg) 6.5% 20/06/2027	700,000	750,629	0.22
Miller (Herman) Inc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +200Bps	648,375	648,896	0.19
Millicom Intl Cellular (Ser 144A) (Reg) 6.25% 25/03/2029	285,000	278,944	0.08
Millicom Intl Cellular (Ser 144A) 4.5% 27/04/2031	315,000	319,331	0.09
Movida Europe Sa (Ser 144A) (Reg) 5.25% 08/02/2031	200,000	186,500	0.06
Mozart Borrower Lp Term B Term Loan Usd-Libor-Bba +325Bps 30/09/2028	965,000	965,000	0.29
Mozart Debt Merger Sub (Ser 144A) (Reg) 3.875% 01/04/2029	935,000	932,663	0.28
Mozart Debt Merger Sub (Ser 144A) (Reg) 5.25% 01/10/2029	1,035,000	1,050,525	0.31
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.25% 15/08/2033	305,000	310,338	0.09
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.625% 01/09/2030	1,280,000	1,315,200	0.39
Msci Inc (Ser 144A) (Reg) 3.875% 15/02/2031	630,000	658,350	0.19
Msci Inc (Ser 144A) 3.625% 01/11/20 31	667,000	695,348	0.21
Mwv Owner Trust 2018-1 Ser 1A C1A Fm 21/01/2036	785,000	221,816	0.07
Mx Remit Fund Fiduc Est (Ser 144A) 4.875% 15/01/2028	535,000	502,900	0.15
Natura Cosmeticos Sa (Ser 144A) (Re G) 4.125% 03/05/2028	695,000	686,312	0.20
Natwest Group Pl Var Perp 31/12/204 9	320,000	316,800	0.09
Nbm Us Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 7% 14/05/2026	205,000	215,506	0.06

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジなし)

Netflix Inc (Reg) 4.375% 15/11/2026	265,000	293,653	0.09
Netflix Inc (Reg) Ser 144A 4.875% 15/04/2028	430,000	490,738	0.14
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-5 Ser 5A Cl A1 Fm 25/07/2056	765,000	175,666	0.05
Newell Rubbermaid Inc (Reg) 4.2% 4.2% 01/04/2026	135,000	147,062	0.04
News Corp (Ser 144A) 3.875% 15/05/2 029	1,340,000	1,355,075	0.40
Occidental Petroleum Cor (Reg) 3.2% 15/08/2026	127,000	131,217	0.04
Occidental Petroleum Cor (Reg) 6.125% 01/01/2031	625,000	761,719	0.23
Occidental Petroleum Cor (Reg) 6.625% 01/09/2030	980,000	1,217,650	0.36
Occidental Petroleum Cor (Reg) 7.5% 01/05/2031	275,000	363,564	0.11
Occidental Petroleum Corp (Reg) 3.4% 15/04/2026	377,000	387,989	0.11
Organon & Co Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +300Bps 08/04/2028	995,641	998,752	0.30
Oriflame Investment Hldg (Ser 144A) 5.125% 04/05/2026	370,000	343,637	0.10
Ovintiv Inc 6.5% 15/08/2034	590,000	761,838	0.23
Owens Corning (Reg) 3.95% 15/08/202 9	570,000	624,496	0.18
Padagis Llc Term B Tearn Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 475Bps 30/06/2028	531,765	530,103	0.16
Papa John'S Internationa (Ser 144A) (Reg) 3.875% 15/09/2029	430,000	426,775	0.13
Perusahaan Listrik Negar Ser 144A (Reg) 5.45% 21/05/2028	720,000	826,200	0.24
Petrobras Global Finance (Reg) 6.9% 19/03/2049	910,000	974,089	0.29
Petrorio Luxembourg Sarl (Ser 144A) 6.125% 09/06/2026	405,000	406,717	0.12
Pilot Travel Centers Llc Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +200Bps	1,218,950	1,211,626	0.36
Post Holdings Inc (Reg) Ser 144A 5.625% 15/01/2028	735,000	781,856	0.23
Post Holdings Inc (Reg) Ser 144A 5.75% 01/03/2027	345,000	356,227	0.11
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/09/2031	810,000	807,975	0.24
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 4.625% 15/04/2030	1,015,000	1,031,881	0.30
Post Holdings Inc (Ser 144A) (Reg) 5.5% 15/12/2029	260,000	274,300	0.08
Prime Secsncv BrwFinanc (Ser 144A) (Reg) 3.375% 31/08/2027	85,000	81,813	0.02
Pt Pertamina (Persero) (Ser 144A) (Reg) 3.65% 30/07/2029	310,000	330,537	0.10
Pt Pertamina (Persero) (Ser 144A) 3 -1% 21/01/2030	215,000	220,106	0.06
Qatar Petroleum (Ser 144A) 2.25% 12 /07/2031	295,000	291,737	0.09
Qatar Petroleum (Ser 144A) 3.3% 12/ 07/2051	230,000	237,639	0.07
Qnb Finance Ltd (Ser Emtm) (Reg S) (Reg) 3.5% 28/03/2024	325,000	340,637	0.10
Rackspace Technology (Ser 144A) (Re G) 3.5% 15/02/2028	765,000	730,575	0.22
Rede D'Or Finance Sarl (Ser 144A) (Reg) 4.95% 17/01/2028	245,000	250,206	0.07
Rede D'Or Finance Sarl (Ser 144A) (Reg) 4.5% 22/01/2030	170,000	166,600	0.05
Republic Of Colombia (Reg) 5.625% 26/02/2044	205,000	198,414	0.06
Rh Tranche B Term Loan-Libor-Bba 3M + 250Bps 15/10/2028	593,513	592,400	0.18
Royal Bk Scottdn Grp Plc (Reg) Var Perp 31/12/2049	685,000	753,500	0.22
Royal Caribbean Cruises (Ser 144A) (Reg) 4.25% 01/07/2026	545,000	530,694	0.16
Royal Caribbean Cruises (Ser 144A) (Reg) 5.5% 01/04/2028	985,000	1,004,700	0.30
Sabre Gbl Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +350Bps 17/12/2027	305,773	302,099	0.08
Saudi Arabian Oil Co (Ser 144A) (Re G) 3.5% 16/04/2029	495,000	529,333	0.16
Saudi Arabian Oil Co (Ser 144A) (Re G) 4.25% 16/04/2039	365,000	413,592	0.12
Saudi Arabian Oil Co (Ser 144A) (Re G) 4.375% 16/04/2049	370,000	431,381	0.13
Saudi Arabian Oil Co (Ser 144A) 2.2 5% 24/11/2030	325,000	317,078	0.09
Sba Communications Corp (Reg) 3.875 % 15/02/2027	1,650,000	1,700,887	0.50
Sba Communications Corp (Ser 144A) (Reg) 3.125% 01/02/2029	810,000	781,650	0.23
Sba Senior Finance Ii Llc Term B Te Rm Loan Usd-Libor-Bba3M 175 11/04/2	1,341,534	1,314,703	0.39
Sba Senior Finance Ii Llc Term B1 Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +175	938	929	-
Soh Salt Holdings Inc (Ser 144A) 4 .875% 01/05/2028	1,105,000	1,066,325	0.31
Soh Salt Holdings Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba +400Bps	704,100	698,379	0.21
Setanta Aircraft Leasing Term B Ter M Loan Usd-Libor-Bba3M 200 05/11/20	350,000	350,437	0.10
Simpar Europe Sa (Ser 144A) (Reg) 5.2% 26/01/2031	280,000	262,850	0.08
Sirius Xm Radio Inc (Ser 144A) (Reg) 4.125% 01/07/2030	80,000	80,600	0.02
Sk Hynix Inc (Ser 144A) (Reg) 1.5% 19/01/2026	415,000	406,543	0.12
Societe Generale (Ser 144A) (Reg) Var Perp 31/12/2049	915,000	1,042,712	0.31
Southwest Airlines Co (Reg) Conv 1.25% 01/05/2025	725,000	969,122	0.29
Southwestern Energy Co. 4.95% 23/01/2025	14,000	15,418	-
Sprint Capital Corp (Reg) 8.75% 15/03/2032	655,000	988,231	0.29
Sprint Corp (Reg) 7.125% 15/06/2024	130,000	146,088	0.04
Square Inc (Ser 144A) 3.5% 01/06/20 31	255,000	263,925	0.08
St Marys Cement Inc (Ser 144A) (Reg) 5.75% 28/01/2027	530,000	595,587	0.18
Standard Industries Inc (Ser 144A) (Reg) 3.375% 15/01/2031	200,000	193,617	0.06
Standard Industries Inc Tranche B Term B Term Loan 250Bps 06/08/2028	67,489	67,657	0.02
State Of Qatar (Ser 144A) (Reg) 4.8 17% 14/03/2049	385,000	506,266	0.15
Sunshine Software Merger Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M + 375Bps	275,000	274,656	0.08
Taco Bell Funding Llc Fm 25/05/2046	960,000	956,957	0.28
Targa Resources Partners (Ser 144A) 4% 15/01/2032	445,000	467,250	0.14
T-Mobile Usa Inc (Reg) 2.25% 15/11/ 2031	1,300,000	1,261,319	0.37
T-Mobile Usa Inc (Reg) 2.625% 15/02 /2029	360,000	355,980	0.11
T-Mobile Usa Inc (Reg) 2.875% 15/02 /2031	335,000	331,231	0.10
T-Mobile Usa Inc (Reg) 3.5% 15/04/2 031	270,000	281,580	0.08
T-Mobile Usa Inc (Reg) 4.75% 01/02/2028	130,000	136,906	0.04
T-Mobile Usa Inc (Ser 144A) (Reg) 3.5% 15/04/2031	370,000	385,869	0.11
T-Mobile Usa Inc 2.625% 15/04/2026	190,000	191,870	0.06
T-Mobile Usa Inc 3.375% 15/04/2029	385,000	393,682	0.12
Trans Union Llc Term B6 Term Loan U Sd-Libor-Bba3M 225 18/11/2028	405,000	404,241	0.12
Transcanada Pipelines (Reg) 4.1% 15/04/2030	1,275,000	1,416,243	0.42
Transcont Gas Pipe Line (Reg) 3.25% 15/05/2030	115,000	120,835	0.04
Travel + Leisure Co (Ser 144A) (Reg) 4.5% 01/12/2029	344,000	344,860	0.10
Twilio Inc 3.625% 15/03/2029	370,000	374,625	0.11

ストラテジック・インカム・ファンド クラスA (円建て為替ヘッジなし)

Twilio Inc 3.875% 15/03/2031	500,000	506,250	0.15
Uber Technologies Inc (Reg) Conv 0% 15/12/2025	820,000	813,673	0.24
Ubs Group Ag (Reg S) Var Perp 31/12/2049	448,000	475,330	0.14
Ubs Group Ag (Ser 144A) (Reg) Var P Erp 31/12/2049	435,000	429,702	0.13
Ubs Group Ag (Ser 144A) Var Perp 31 /12/2049	420,000	414,751	0.12
Unicredit Spa (Reg S) Var Perp	400,000	439,318	0.13
Unicredit Spa (Ser 144A) (Reg) Var 30/06/2035	850,000	924,273	0.27
United Air 2020-1 A Ptt (Ser 20-1) 5.875% 15/10/2027	1,055,000	1,043,515	0.31
United Airlines Inc (Ser 144A) 4.37 5% 15/04/2026	375,000	391,020	0.12
United Airlines Inc (Ser 144A) 4.62 5% 15/04/2029	505,000	523,692	0.15
United Airlines Inc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba +375Bps	1,232,230	1,239,931	0.37
United Rentals North Am (Reg) 3.875 % 15/02/2031	900,000	917,494	0.27
United Rentals North Am (Reg) 4.875% 15/01/2028	830,000	875,650	0.26
United Rentals North Am (Reg) 5.5% 15/05/2027	695,000	722,997	0.21
United Rentals North America Inc (Reg) 4% 15/07/2030	595,000	614,337	0.18
United States Treasury Note 4.375% 15/02/2038	2,410,000	3,315,594	0.98
Univision Communications Term B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 325	880,576	883,328	0.26
Us Bancorp (Reg) Var Perp 31/12/2049	875,000	881,344	0.26
Us Bancorp (Ser Mtn) (Reg) 1.375% 2 2/07/2030	370,000	348,771	0.10
Us Treasury .125% 15/01/2030	330,000	366,108	0.11
Us Treasury .375% 30/11/2025	2,065,000	2,002,791	0.59
Us Treasury .5% 28/02/2026	525,000	510,067	0.15
Us Treasury 2% 15/02/2050	1,500,000	1,523,717	0.45
Us Treasury 2.375% 29/02/2024	2,470,000	2,554,471	0.75
Us Treasury 2.625% 15/02/2029	1,430,000	1,545,993	0.46
Us Treasury 3% 15/02/2049	2,970,000	3,651,522	1.08
Us Treasury Bond 2.75% 15/11/2042	960,000	1,093,937	0.32
Us Treasury N/B 2% 15/11/2026	2,385,000	2,467,413	0.73
Vici Properties / Note (Ser 144A) (Reg) 4.625% 01/12/2029	365,000	388,149	0.11
Vici Properties / Note (Ser 144A) (Reg) 4.125% 15/08/2030	755,000	800,300	0.24
Virgin Media Secured Fin (Ser 144A) (Reg) 4.5% 15/08/2030	425,000	428,320	0.13
Virgin Media Secured Fin (Ser 144A) (Reg) 5.5% 15/05/2029	956,000	1,009,775	0.30
Vmed O2 Uk Financing I (Ser 144A) 4.25% 31/01/2031	1,740,000	1,708,019	0.50
Vtr Comunicaciones Spa (Ser 144A) (Reg) 4.375% 15/04/2029	255,000	252,450	0.07
Vtr Comunicaciones Spa (Ser 144A) (Reg) 5.125% 15/01/2028	455,000	464,669	0.14
Vtr Finance Bv (Ser 144A) (Reg) 6.3 75% 15/07/2028	455,000	476,612	0.14
Western Midstream Operat (Reg) 5.3% 01/02/2030	655,000	723,775	0.21
Westlake Automobile Receivables Trust 2019-2 Ser 2A Cl C Frn	610,000	456,294	0.13
Whatabrands Llc Tranche B Term Loan Usd-Libor-Bba 3M +325Bps	618,000	616,841	0.18
Williams Companies Inc (Reg) 3.5% 15/11/2030	1,280,000	1,362,950	0.40
Williams Partners Lp (Reg) 3.75% 15/06/2027	489,000	527,844	0.16
Wmg Acquisition Corp (Ser 144A) (Re G) 3% 15/02/2031	345,000	332,494	0.10
Wmg Acquisition Corp Tranche G Term Loan Usd-Libor-Bba-3M+ 212.5Bps	730,000	727,871	0.22
Worldwide Express Inc Tranche Term Loan Usd-Libor-Bba 3M+ 425Bps	250,000	250,625	0.07
Wr Grace Holdings Llc Tranche B Term B Term Loan Usd-Libor-Bba-3M_+	310,000	310,969	0.09
Wyndham Destinations Inc (Ser 144A) (Reg) 6.625% 31/07/2026	579,000	640,164	0.19
Yum! Brands Inc (Ser 144A) (Reg) 4. 75% 15/01/2030	535,000	579,806	0.17
Yum! Brands Inc 3.625% 15/03/2031	1,710,000	1,710,000	0.51
Yum! Brands Inc 4.625% 31/01/2032	715,000	760,581	0.22
		242,324,411	71.58
Total investments		327,205,387	96.65
Other net assets		11,336,667	3.35
Total net assets		338,542,054	100.00

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	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。 (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。 (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。	

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11期（決算日 2021年9月27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。
- ・－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 騰 落 率	中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
第 7 期 (2017年9月25日)	9,941	0	△0.2	3.9	—	6
第 8 期 (2018年9月25日)	9,920	0	△0.2	3.7	—	9
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

(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

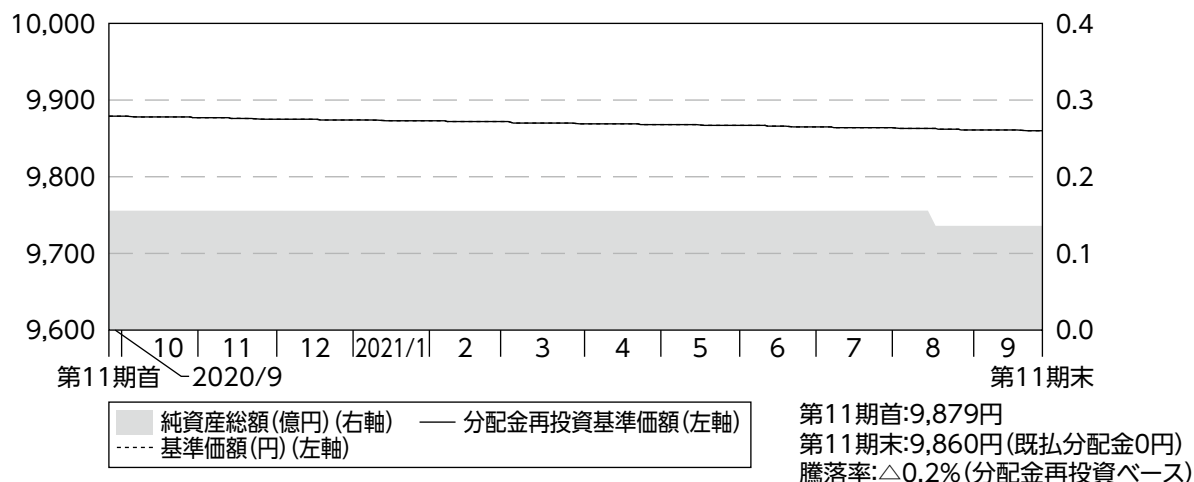
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2020年 9月25日	円 9,879	% —	% —	% —
9月末	9,879	0.0	—	—
10月末	9,877	△0.0	—	—
11月末	9,875	△0.0	—	—
12月末	9,874	△0.1	—	—
2021年 1月末	9,873	△0.1	—	—
2月末	9,872	△0.1	—	—
3月末	9,869	△0.1	—	—
4月末	9,868	△0.1	—	—
5月末	9,867	△0.1	—	—
6月末	9,865	△0.1	—	—
7月末	9,864	△0.2	—	—
8月末	9,861	△0.2	—	—
(当 期 末) 2021年 9月27日	9,860	△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

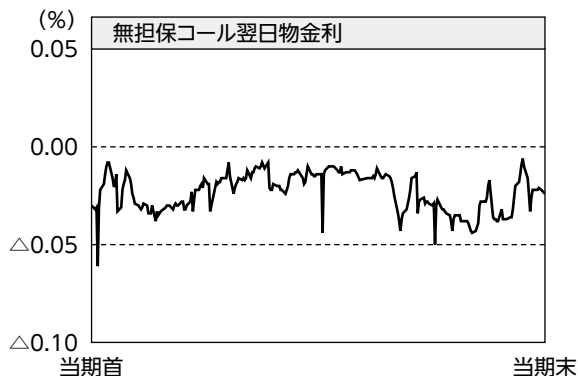


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2020年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、当期の短期国債利回りは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△0.06～0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行いました、マイナス利回りや信託報酬などの要因により、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△0.06～0.00%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短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。

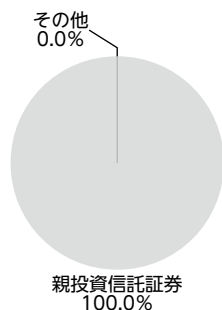
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

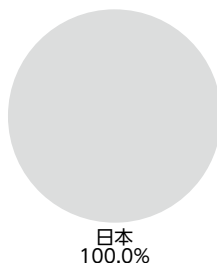
	当期末
	2021年9月27日
短期金融資産 マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

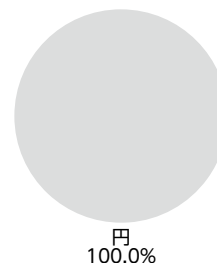
○資産別配分



○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11期
		2020年9月26日～2021年9月27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
	(2020年9月26日～2021年9月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.144%	(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9,870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)	(0.111)	
(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.149	

- (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 39	千円 39	千口 1,988	千円 2,012

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
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	3	0.023493	0.8	3	0.023493	0.8

(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	$\frac{B}{A}$	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 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0	百万円 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,302,445	22,548	0.7	3,301,709	22,548	0.7

<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 15,377	千口 13,428	千円 13,589

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,965,821千口です。

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 13,589	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	13,608	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 2021年9月27日現在
(A) 資 産	13,608,104円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,240
短期金融資産 マザーファンド(評価額)	13,589,758
未 収 入 金	106
(B) 負 債	11,718
未 払 信 託 報 酬	10,936
そ の 他 未 払 費 用	782
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	13,596,386
元 本	13,789,186
次 期 繰 越 損 益 金	△192,800
(D) 受 益 権 総 口 数	13,789,186口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,860円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年9月26日 至 2021年9月27日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,946円
売 買 益	197
売 買 損	△3,143
(B) 信 託 報 酬 等	△22,679
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	△25,625
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△49,277
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
(F) 計 (C+D+E)	△192,800
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	△192,800
追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
分 配 準 備 積 立 金	11,111
繰 越 損 益 金	△86,013

(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15,767,297円、期中追加設定元本額は40,550円、期中一部解約元本額は2,018,661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	654,973円
(D) 分配準備積立金額	11,111円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	666,084円
(F) 期末残存口数	13,789,186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14期（決算日 2021年9月27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
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
第10期(2017年9月25日)	円	%	10,111	%	%	百万円
	10,146	△0.1		△0.0	3.9	7,717
第11期(2018年9月25日)	10,138	△0.1	10,106	△0.1	3.7	8,170
第12期(2019年9月25日)	10,129	△0.1	10,100	△0.1	—	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

(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 組 入 比 率	債 券 先 物 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(当 期 首) 2020年 9月25日	円	%	10,096	%	%	%
	10,124	—		—	—	—
9月末	10,124	0.0	10,096	△0.0	—	—
10月末	10,124	0.0	10,096	△0.0	—	—
11月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—	—
12月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—	—
2021年 1月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—	—
2月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—	—
3月末	10,122	△0.0	10,095	△0.0	—	—
4月末	10,122	△0.0	10,095	△0.0	—	—
5月末	10,122	△0.0	10,094	△0.0	—	—
6月末	10,121	△0.0	10,094	△0.0	—	—
7月末	10,121	△0.0	10,094	△0.0	—	—
8月末	10,120	△0.0	10,094	△0.0	—	—
(当 期 末) 2021年 9月27日	10,120	△0.0	10,093	△0.0	—	—

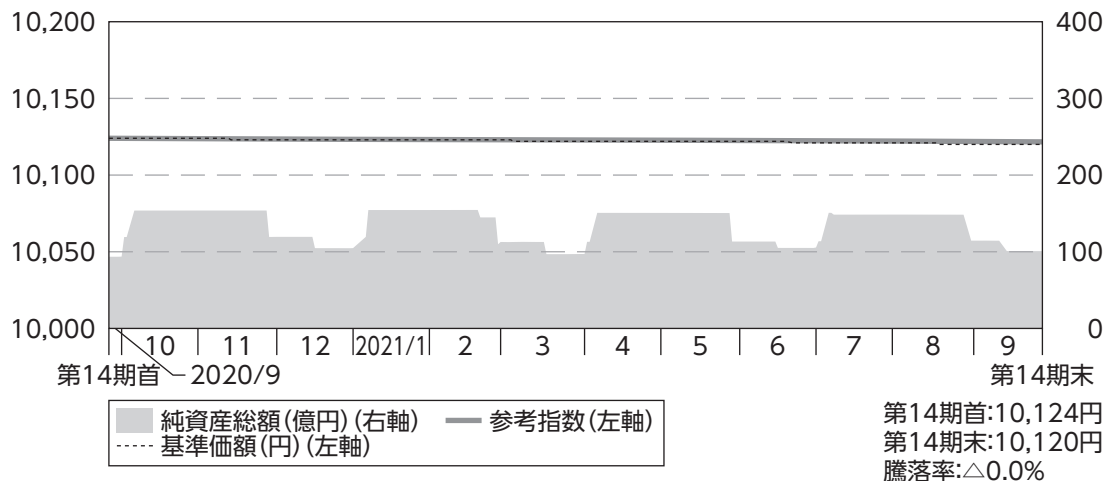
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

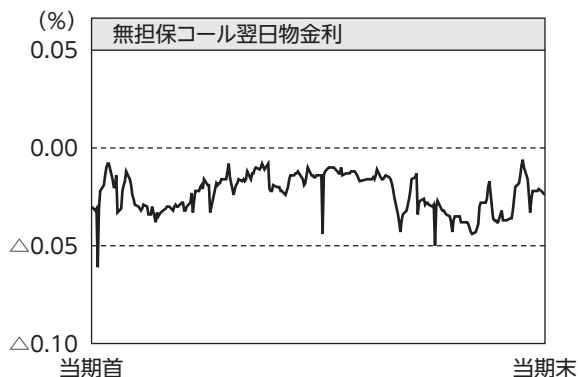


(注)参考指数は、2020年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、当期の短期国債利回りは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△0.06～0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、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△0.06～0.00%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短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

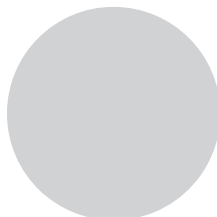
当期末における該当事項はありません。

○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



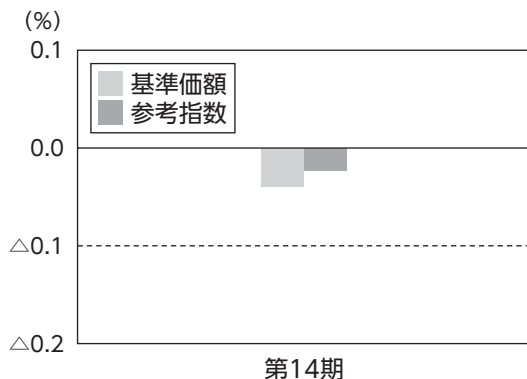
円
100.0%

(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 (2020年9月26日~2021年9月27日)		項目の概要
	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、金銭信託預入に係る手数料等
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(10,122円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	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 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0	百万円 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,302,445	22,548	0.7	3,301,709	22,548	0.7

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 10,085,508	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,085,508	100.0

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年9月27日現在
(A)資 産	10,085,508,259円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,085,508,259
(B)負 債	12,402
未 払 解 約 金	106
未 払 利 息	12,296
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	10,085,495,857
元 本	9,965,821,749
次 期 繰 越 損 益 金	119,674,108
(D)受 益 権 総 口 数	9,965,821,749口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,120円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年9月26日 至 2021年9月27日
(A)配 当 等 収 益	△4,960,031円
受 取 利 息	66,389
支 払 利 息	△5,026,420
(B)そ の 他 費 用	△2
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	△4,960,033
(D)前 期 繰 越 損 益 金	114,414,146
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	263,706,182
(F)解 約 差 損 益 金	△253,486,187
(G)計 (C+D+E+F)	119,674,108
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	119,674,108

(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9,234,430,779円、期中追加設定元本額は21,516,767,055円、期中一部解約元本額は20,785,376,085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)	6,760,615,573円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,021,200,271円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	105,165,876円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,015,983円
FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,428,615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 ファンド2055	1,616,084円
米国成長株式ファンド	493,486円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
北米株配当戦略投信2018-08(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,882円

お知らせ

該当事項はありません。