

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限（2003年8月8日設定）	
運用方針	<p>主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY およびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYの投資信託証券への投資を通じて、世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等に実質的な投資を行います。</p> <p>ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BB-B、円ベース）×50%＋ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く、新興国除く）インデックス（円ベース）×50%の合成指数をベンチマークとします。各投資信託証券の組入比率は、それぞれ純資産総額の50%程度となるように調整します。</p> <p>実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてB-1格相当以上の格付を有しているものに限るものとし、ポートフォリオの実質的な平均格付は原則としてBBB-1格相当以上を維持します。</p> <p>ポートフォリオの実質的な平均デュレーションは原則としてベンチマーク±2年以内で調整します。</p> <p>実質的な組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。運用指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。</p>	
主要運用対象	ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY投資信託証券およびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY投資信託証券を主要投資対象とします。
	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	世界各国の社債等を主要投資対象とします。原則として、為替ヘッジは行いません。
	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等を主要投資対象とします。原則として、為替ヘッジは行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、経費等を控除後の利子等収益等を中心に、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。  
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。  
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）

# ピムコ ハイ・インカム 毎月分配型ファンド

第222期（決算日：2022年2月15日）  
 第223期（決算日：2022年3月15日）  
 第224期（決算日：2022年4月15日）  
 第225期（決算日：2022年5月16日）  
 第226期（決算日：2022年6月15日）  
 第227期（決算日：2022年7月15日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド」は、去る7月15日に第227期の決算を行いましたので、法令に基づいて第222期～第227期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
 フリーダイヤル **0120-151034**  
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、  
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			合 成	指 数		投 資 信 託 証 入 比	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金		期 騰 落	中 率		
	円		円			%	%	%	百万円
198期(2020年2月17日)	7,290		20		278.25	0.0	0.1	99.8	69,392
199期(2020年3月16日)	6,714		20		258.63	△7.6	△7.0	99.7	63,408
200期(2020年4月15日)	6,837		20		260.80	2.1	0.8	99.8	64,019
201期(2020年5月15日)	6,736		20		258.65	△1.2	△0.8	99.8	62,817
202期(2020年6月15日)	7,039		20		270.99	4.8	4.8	99.8	65,427
203期(2020年7月15日)	7,094		20		274.24	1.1	1.2	99.8	65,654
204期(2020年8月17日)	7,234		20		280.06	2.3	2.1	99.8	66,654
205期(2020年9月15日)	7,197		20		279.10	△0.2	△0.3	99.8	65,983
206期(2020年10月15日)	7,150		20		278.26	△0.4	△0.3	99.8	65,332
207期(2020年11月16日)	7,151		20		279.19	0.3	0.3	99.8	65,015
208期(2020年12月15日)	7,259		20		284.02	1.8	1.7	99.8	65,721
209期(2021年1月15日)	7,244		20		284.27	0.1	0.1	99.8	65,306
210期(2021年2月15日)	7,324		20		287.79	1.4	1.2	99.8	65,679
211期(2021年3月15日)	7,440		20		293.66	1.9	2.0	99.8	66,286
212期(2021年4月15日)	7,450		20		295.60	0.4	0.7	99.8	66,104
213期(2021年5月17日)	7,497		20		298.27	0.9	0.9	99.8	66,254
214期(2021年6月15日)	7,589		20		302.74	1.5	1.5	99.8	66,753
215期(2021年7月15日)	7,532		20		302.42	△0.5	△0.1	99.8	65,935
216期(2021年8月16日)	7,507		20		302.42	△0.1	△0.0	99.8	65,474
217期(2021年9月15日)	7,504		20		303.43	0.2	0.3	99.8	65,180
218期(2021年10月15日)	7,637		20		309.78	2.0	2.1	99.8	65,947
219期(2021年11月15日)	7,594		20		309.53	△0.3	△0.1	99.8	65,239
220期(2021年12月15日)	7,516		20		307.54	△0.8	△0.6	99.8	64,211
221期(2022年1月17日)	7,475		20		306.48	△0.3	△0.3	99.8	63,583
222期(2022年2月15日)	7,292		20		300.15	△2.2	△2.1	99.8	61,851
223期(2022年3月15日)	7,223		20		298.61	△0.7	△0.5	99.8	60,984
224期(2022年4月15日)	7,534		20		312.44	4.6	4.6	99.8	63,183
225期(2022年5月16日)	7,417		20		308.94	△1.3	△1.1	99.8	61,815
226期(2022年6月15日)	7,412		20		309.36	0.2	0.1	99.8	61,316
227期(2022年7月15日)	7,632		20		320.61	3.2	3.6	99.8	62,856

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

- (注) 合成指数はICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数 (BB-B、円ベース) ×50%+ブルームバーグ・グローバル総合 (日本円除く、新興国除く) インデックス (円ベース) ×50%の合成指数です。ただし、設定から2013年10月15日までは、BofAメリルリンチ グローバル・ハイイールド・インデックス (BB-B、円ベース) ×50%+バークレイズ・グローバル総合 (日本円除く) インデックス (円ベース) ×50%の合成指数、2013年10月16日から2019年10月15日までは、ICE BofAML 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数 (BB-B、円ベース) ×50%+ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合 (日本円除く) インデックス (円ベース) ×50%の合成指数です。ベンチマークはこれらを連続させて合成指数化したものです。ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数 (BB-B、円ベース) とは、ICE Data Indices, LLCが算出する主な先進国のハイイールド債券の値動きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJ国際投信は許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。ブルームバーグ・グローバル総合 (日本円除く、新興国除く) インデックス (円ベース) とは、ブルームバーグが算出する世界の投資適格債券 (円建てのものを除く、新興国除く) の値動きを表す指数を円換算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ビーおよびその関係会社 (以下「ブルームバーグ」と総称します。) のサービスマークであり、三菱UFJ国際投信による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信の関係会社ではなく、ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信が運用するファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

○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		合 成	指 数		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率			騰 落 率	
第222期	(期 首) 2022年 1月17日	円 7,475	% —	306.48	% —	% 99.8	
	1月末	7,414	△0.8	304.27	△0.7	99.8	
	(期 末) 2022年 2月15日	7,312	△2.2	300.15	△2.1	99.8	
第223期	(期 首) 2022年 2月15日	7,292	—	300.15	—	99.8	
	2月末	7,301	0.1	300.28	0.0	99.8	
	(期 末) 2022年 3月15日	7,243	△0.7	298.61	△0.5	99.8	
第224期	(期 首) 2022年 3月15日	7,223	—	298.61	—	99.8	
	3月末	7,544	4.4	311.96	4.5	99.8	
	(期 末) 2022年 4月15日	7,554	4.6	312.44	4.6	99.8	
第225期	(期 首) 2022年 4月15日	7,534	—	312.44	—	99.8	
	4月末	7,542	0.1	313.18	0.2	99.8	
	(期 末) 2022年 5月16日	7,437	△1.3	308.94	△1.1	99.8	
第226期	(期 首) 2022年 5月16日	7,417	—	308.94	—	99.8	
	5月末	7,467	0.7	312.55	1.2	99.8	
	(期 末) 2022年 6月15日	7,432	0.2	309.36	0.1	99.8	
第227期	(期 首) 2022年 6月15日	7,412	—	309.36	—	99.8	
	6月末	7,567	2.1	316.39	2.3	99.8	
	(期 末) 2022年 7月15日	7,652	3.2	320.61	3.6	99.8	

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

# 運用経過

第222期～第227期：2022年1月18日～2022年7月15日

## ▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第222期首	7,475円
第227期末	7,632円
既払分配金	120円
騰落率	3.8%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

### 基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ3.8%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

### ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（4.6%）を0.8%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

米ドルやユーロが対円で上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

### 下落要因

高利回り債券市況と投資適格債券市況が下落したことや、信託報酬等が基準価額の下落要因となりました。

第222期～第227期：2022年1月18日～2022年7月15日

## ▶ 投資環境について

### ▶ 高利回り債券市況

**高利回り債券市況は下落しました。**

高利回り債券市況は、米連邦準備制度理事会（F R B）など各国中央銀行による早期の金融政策正常化への警戒感や、ロシアによるウクライナ侵攻等を背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと等を受けて、当作成期を通じてみるとスプレッド（国債に対する上乗せ金利）は拡大しました。スプレッドが拡大したこと等から、高利回り債券市況は下落しました。

### ▶ 投資適格債券市況

**投資適格債券市況は下落しました。**

投資適格債券市況は、米国や欧州での金融政策正常化の動き等が下落要因となり、当作成期を通じてみると下落しました。

### ▶ 為替市況

**米ドルとユーロは対円で上昇しました。**

欧米の中央銀行が積極的な金融引き締めを進める姿勢を示した一方で、日本銀行が大規模な金融緩和策を維持する姿勢を示したこと等から、日米金利差および日独金利差の拡大観測が強まり、当作成期を通じて見ると、米ドルとユーロは対円で上昇しました。

## ▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ ピムコ ハイ・インカム毎月分配型 ファンド

2本の円建外国投資信託への投資を通じて、日本を除く世界の高利回り債券と投資適格債券を概ね50%程度ずつ組み入れた運用を行いました。

なお、2022年6月末時点で、2本の円建外国投資信託を通じて投資した信用リスク管理上、政府機関の発行または保証する有価証券と同等と判断した銘柄の実質的な組入比率は、ファニーメイは4.2%、フレディ・マックは2.0%としました（ネットベース）。

### ▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY

当作成期では、企業のファンダメンタルズの回復やデフォルト率が低位で推移していること等がプラス材料となる一方で、欧米の中央銀行による金融政策正常化に向けた動きやロシアによるウクライナ侵攻等を背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まった中、リスク性資産の価格変動が大きくなるリスクに注視する必要があるとみておりました。このような環境下、運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行いました。

具体的には、経済活動の再開の恩恵を受けるホテルや航空等のセクターに対して積極姿勢としました。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進む中で構造的な変化に直面している電力等のセクターや、Eコマース市場の拡大が加速する中、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターに対して消極姿勢としました。

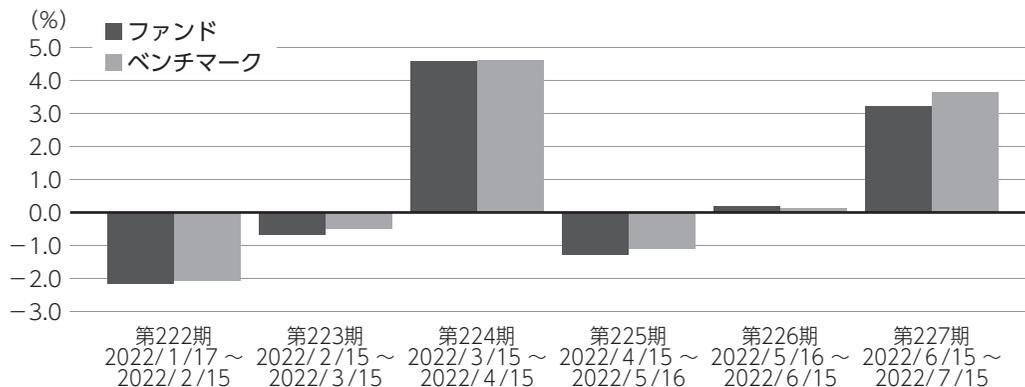
### ▶ ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY

当作成期では、ロシアのウクライナ侵攻とそれに伴うロシアへの経済制裁の影響等から、先進国の実質国内総生産成長率は鈍化するとみておりました。金融政策については、主要中央銀行による金融政策の正常化に向けた動きが継続するとみておりました。このような環境下、金利戦略については、各国の金融政策の動向等を見極めながら、柔軟に調整しました。具体的には、社債や資産担保証券のなかで、リスクを考慮しても魅力的と考えられる利回りを提供する銘柄に選択的に投資を行いました。

第222期～第227期：2022/1/18～2022/7/15

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額（当ファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

### ▶ ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド

ファンドの騰落率はベンチマークの騰落率（4.6%）を0.8%下回りました。

主な要因は以下の通りです。

#### 外国投資信託保有以外の要因

信託報酬などの運用上の費用を計上したことなどがマイナス要因となりました。

#### 外国投資信託保有による要因

**ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY**  
(プラス要因)

積極姿勢としたエネルギーセクターのパフォーマンスが他のセクターを上回ったこと。  
ヘルスケアセクターの銘柄選択効果がプラスに寄与したこと。

#### (マイナス要因)

自動車セクターの銘柄選択効果がマイナスに影響したこと。

## ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY

### (プラス要因)

英国のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）をアンダーウェイトとしたこと。

### (マイナス要因)

米非政府系モーゲージ債へ投資したこと。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

## 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第222期 2022年1月18日~ 2022年2月15日	第223期 2022年2月16日~ 2022年3月15日	第224期 2022年3月16日~ 2022年4月15日	第225期 2022年4月16日~ 2022年5月16日	第226期 2022年5月17日~ 2022年6月15日	第227期 2022年6月16日~ 2022年7月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	<b>20</b> (0.274%)	<b>20</b> (0.276%)	<b>20</b> (0.265%)	<b>20</b> (0.269%)	<b>20</b> (0.269%)	<b>20</b> (0.261%)
当期の収益	10	14	20	18	20	20
当期の収益以外	9	5	-	1	-	-
翌期繰越分配対象額	518	512	517	515	517	531

(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 (作成対象期間末での見解です。)

### ▶ ピムコ ハイ・インカム毎月分配型 ファンド

2本の円建外国投資信託への投資を通じて日本を除く世界の高利回り債券と投資適格債券を概ね50%程度ずつ組み入れた運用を維持し、毎月の安定した分配をめざす方針です。

### ▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y

運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行う方針です。

具体的には、生活必需品の価格や借入コストの上昇による影響には注視が必要なものの、経済活動の再開以降に個人消費が持ち直していること等から消費財等のセクターに対して積極姿勢とします。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進む中で構造的な変化に直面している電力等のセクターや、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターに対して消極姿勢とします。

### ▶ ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド J P Y

金利戦略では、各国の金融政策の動向等を見極めながら柔軟に調整する方針です。セクター戦略では、社債や資産担保証券のなかで、リスクを考慮しても魅力的と考えられる利回りを提供する銘柄に選択的に投資を行う方針です。

2022年1月18日～2022年7月15日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第222期～第227期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	52	0.701	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(30)	(0.405)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(20)	(0.270)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	52	0.703	

作成期中の平均基準価額は、7,455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。

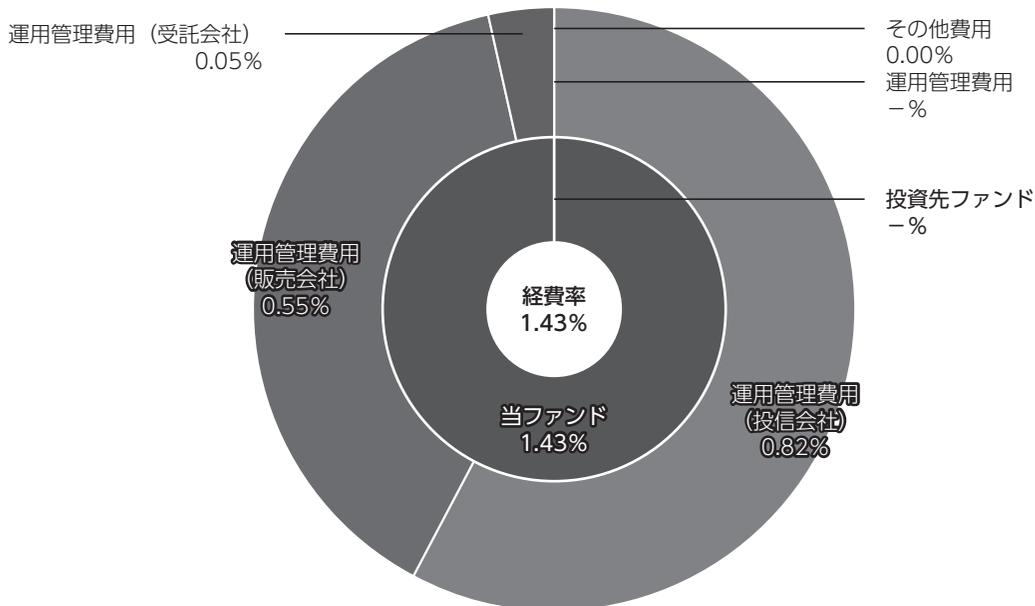
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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)

### ■経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**経費率（年率）は1.43%**です。



経費率 (①+②)	(%)	1.43
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.43
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	-

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

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

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

(注) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 前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。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、前記には含まれておりません。

○売買及び取引の状況

(2022年1月18日～2022年7月15日)

投資信託証券

銘柄		第222期～第227期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY	34	393,403	153	1,730,000
	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	128	937,832	234	1,730,000
	合計	162	1,331,235	388	3,460,000

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月18日～2022年7月15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。

○組入資産の明細

(2022年7月15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221期末	第227期末		
		口数	口数	評価額	比率
国内	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY	2,767	2,648	30,834,996	49.1
	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	4,378	4,271	31,896,818	50.7
	合計	7,145	6,920	62,731,814	99.8

(注) 比率はピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンドの純資産総額に対する比率。

○投資信託財産の構成

(2022年7月15日現在)

項目	第227期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	62,731,814	99.4
コール・ローン等、その他	397,892	0.6
投資信託財産総額	63,129,706	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第222期末	第223期末	第224期末	第225期末	第226期末	第227期末
	2022年2月15日現在	2022年3月15日現在	2022年4月15日現在	2022年5月16日現在	2022年6月15日現在	2022年7月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	62,111,373,207	61,266,261,345	63,495,268,126	62,086,983,095	61,590,204,174	63,129,706,590
コール・ローン等	181,785,311	180,678,666	247,753,846	189,811,683	189,054,340	217,892,196
投資信託受益証券(評価額)	61,739,587,896	60,865,582,679	63,057,514,280	61,697,171,412	61,191,149,834	62,731,814,394
未収入金	190,000,000	220,000,000	190,000,000	200,000,000	210,000,000	180,000,000
(B) 負債	260,322,102	282,069,196	312,062,567	271,572,979	273,822,350	273,080,513
未払収益分配金	169,642,772	168,850,435	167,734,182	166,689,226	165,457,467	164,729,396
未払解約金	18,754,986	45,517,314	67,692,866	27,993,846	34,791,555	35,436,547
未払信託報酬	71,692,702	67,483,402	76,388,599	76,642,197	73,336,274	72,679,679
未払利息	27	33	137	104	134	88
その他未払費用	231,615	218,012	246,783	247,606	236,920	234,803
(C) 純資産総額(A-B)	61,851,051,105	60,984,192,149	63,183,205,559	61,815,410,116	61,316,381,824	62,856,626,077
元本	84,821,386,393	84,425,217,695	83,867,091,071	83,344,613,418	82,728,733,760	82,364,698,228
次期繰越損益金	△22,970,335,288	△23,441,025,546	△20,683,885,512	△21,529,203,302	△21,412,351,936	△19,508,072,151
(D) 受益権総口数	84,821,386,393口	84,425,217,695口	83,867,091,071口	83,344,613,418口	82,728,733,760口	82,364,698,228口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,292円	7,223円	7,534円	7,417円	7,412円	7,632円

○損益の状況

項 目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日	2022年5月17日～ 2022年6月15日	2022年6月16日～ 2022年7月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	161,924,491	186,681,418	209,279,170	231,475,849	253,886,601	287,544,376
受取配当金	161,926,592	186,682,450	209,279,874	231,477,758	253,890,633	287,547,773
受取利息	-	46	8	-	-	87
支払利息	△ 2,101	△ 1,078	△ 712	△ 1,909	△ 4,032	△ 3,484
(B) 有価証券売買損益	△ 1,472,054,171	△ 528,985,757	2,636,190,129	△ 963,145,181	△ 58,253,852	1,758,940,248
売買益	1,597,643	1,875,823	2,652,488,631	3,522,936	157,082,777	1,763,484,442
売買損	△ 1,473,651,814	△ 530,861,580	△ 16,298,502	△ 966,668,117	△ 215,336,629	△ 4,544,194
(C) 信託報酬等	△ 71,924,317	△ 67,701,414	△ 76,635,382	△ 76,889,803	△ 73,573,194	△ 72,914,482
(D) 当期繰損益金(A+B+C)	△ 1,382,053,997	△ 410,005,753	2,768,833,917	△ 808,559,135	122,059,555	1,973,570,142
(E) 前期繰越損益金	△ 7,004,080,181	△ 8,510,753,109	△ 9,023,479,626	△ 6,377,250,580	△ 7,291,614,520	△ 7,295,655,475
(F) 追加信託差損益金	△ 14,414,558,338	△ 14,351,416,249	△ 14,261,505,621	△ 14,176,704,361	△ 14,077,339,504	△ 14,021,257,422
(配当等相当額)	( 2,090,724,541)	( 2,082,082,712)	( 2,069,651,526)	( 2,058,178,172)	( 2,044,641,270)	( 2,037,627,599)
(売買損益相当額)	(△ 16,505,282,879)	(△ 16,433,498,961)	(△ 16,331,157,147)	(△ 16,234,882,533)	(△ 16,121,980,774)	(△ 16,058,885,021)
(G) 計(D+E+F)	△ 22,800,692,516	△ 23,272,175,111	△ 20,516,151,330	△ 21,362,514,076	△ 21,246,894,469	△ 19,343,342,755
(H) 収益分配金	△ 169,642,772	△ 168,850,435	△ 167,734,182	△ 166,689,226	△ 165,457,467	△ 164,729,396
次期繰越損益金(G+H)	△ 22,970,335,288	△ 23,441,025,546	△ 20,683,885,512	△ 21,529,203,302	△ 21,412,351,936	△ 19,508,072,151
追加信託差損益金	△ 14,414,558,338	△ 14,351,416,249	△ 14,261,505,621	△ 14,176,704,361	△ 14,077,339,504	△ 14,021,257,422
(配当等相当額)	( 2,090,724,541)	( 2,082,082,712)	( 2,069,651,526)	( 2,058,178,172)	( 2,044,641,270)	( 2,037,627,599)
(売買損益相当額)	(△ 16,505,282,879)	(△ 16,433,498,961)	(△ 16,331,157,147)	(△ 16,234,882,533)	(△ 16,121,980,774)	(△ 16,058,885,021)
分配準備積立金	2,309,233,223	2,248,355,511	2,268,735,902	2,242,193,671	2,239,882,278	2,341,340,905
繰越損益金	△ 10,865,010,173	△ 11,337,964,808	△ 8,691,115,793	△ 9,594,692,612	△ 9,574,894,710	△ 7,828,155,634

(注) (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) (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) (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。

<注記事項>

- ① 作成期首(前作成期末)元本額 85,064,246,652円  
 作成期中追加設定元本額 349,154,734円  
 作成期中一部解約元本額 3,048,703,158円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7632円です。
- ② 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は19,508,072,151円です。
- ③ 分配金の計算過程

項 目	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日	2022年5月17日～ 2022年6月15日	2022年6月16日～ 2022年7月15日
費用控除後の配当等収益額	90,000,174円	118,980,004円	203,646,469円	154,586,046円	180,313,407円	277,299,891円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円	-円	-円	-円	-円	-円
収益調整金額	2,090,724,541円	2,082,082,712円	2,069,651,526円	2,058,178,172円	2,044,641,270円	2,037,627,599円
分配準備積立金額	2,388,875,821円	2,298,225,942円	2,232,823,615円	2,254,296,851円	2,225,026,338円	2,228,770,410円
当ファンドの分配対象収益額	4,569,600,536円	4,499,288,658円	4,506,121,610円	4,467,061,069円	4,449,981,015円	4,543,697,900円
1万口当たり収益分配対象額	538円	532円	537円	535円	537円	551円
1万口当たり分配金額	20円	20円	20円	20円	20円	20円
収益分配金金額	169,642,772円	168,850,435円	167,734,182円	166,689,226円	165,457,467円	164,729,396円

④ 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○分配金のお知らせ

	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
1 万口当たり分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

### ◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

<b>ファンド名</b>	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPY
<b>運用方針</b>	ベンチマークであるICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BB-B、円ベース）を上回る投資成果をめざします。	ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く、新興国除く）インデックス（円ベース）を上回る投資成果をめざします。
<b>主要運用対象</b>	世界各国の社債等	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等
<b>主な組入制限</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・通常、ファンドの80%以上をBBB一格相当未満の格付けを取得している公社債に投資します。</li> <li>・投資する公社債は原則として取得時においてB一格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。</li> <li>・投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB一格相当以上に維持します。</li> <li>・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。</li> <li>・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。</li> <li>・エマージング債への投資は行いません。</li> <li>・原則として、為替ヘッジは行いません。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資する公社債は原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。</li> <li>・投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてAA一格相当以上に維持します。</li> <li>・ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。</li> <li>・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。</li> <li>・エマージング債への投資は行いません。</li> <li>・原則として、為替ヘッジは行いません。</li> </ul>
<b>決算日</b>	原則として毎年2月28日	
<b>分配方針</b>	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。	

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Cayman Trust Annual Report February 28, 2022版から抜粋して作成しています。なお、開示情報につきましては、アニュアルレポートがシェアクラス分けされていないため「ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド」と「ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド」で掲載しています。

## (1) 運用計算書

(2021年3月1日～2022年2月28日)

	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド
	千米ドル	千米ドル
<b>投資収入：</b>		
受取利息（外国税額控除後＊）	22,873	5,696
雑収入	0	16
収入合計	22,873	5,712
<b>費用：</b>		
支払利息	4	0
法務費用	0	0
費用合計	4	0
<b>投資純収入</b>	22,869	5,712
<b>実現純利益（損失）：</b>		
投資有価証券	17,265	(263)
マスターファンド	0	0
為替取引、中央清算金融派生商品	3,418	(3,174)
店頭金融派生商品	1,083	(1,645)
外貨	(32)	1,068
実現純利益（損失）	21,734	(4,014)
<b>未実現評価益（評価損）の純変動：</b>		
投資有価証券	(52,183)	(17,364)
マスターファンド	0	0
為替取引、中央清算金融派生商品	(584)	(736)
店頭金融派生商品	564	(1,461)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	(105)	(10)
未実現評価益（評価損）の純変動	(52,308)	(19,571)
純利益（損失）	(30,574)	(23,585)
<b>運用による純資産の純増（減）額</b>	(7,705)	(17,873)
＊外国税控除後	14	0

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

## (2) 純資産変動計算書

(2021年3月1日～2022年2月28日)

	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド
	千米ドル	千米ドル
<b>純資産の増加（減少）：</b>		
<b>運用：</b>		
投資純収入（費用）	22,869	5,712
実現純利益（損失）	21,734	(4,014)
未実現評価益（評価損）の純変動	(52,308)	(19,571)
運用による純資産の純増（減）額	(7,705)	(17,873)
<b>分配：</b>		
JPY	(29,626)	(7,620)
JPY Hedged	(468)	(233)
分配金額合計	(30,094)	(7,853)
<b>ファンドユニット取引：</b>		
ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額	(53,219)	(10,365)
<b>純資産の増（減）額合計</b>	<b>(91,018)</b>	<b>(36,091)</b>
<b>純資産：</b>		
期首	604,182	308,491
期末	513,164	272,400

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。



	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Summer BC Holdco B SARL</b>		
5.750% due 10/31/2026	EUR 2,600	\$ 2,949
		<u>13,927</u>
<b>Total Luxembourg (Cost \$15,969)</b>		<u>15,395</u>
<b>MULTINATIONAL 2.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.6%</b>		
<b>Allied Universal Holdco LLC</b>		
3.625% due 06/01/2028	1,100	1,157
4.625% due 06/01/2028	\$ 1,200	1,134
4.875% due 06/01/2028	GBP 1,000	1,240
<b>American Airlines, Inc.</b>		
5.500% due 04/20/2026	\$ 875	897
5.750% due 04/20/2029	5,200	5,325
<b>Ardagh Packaging Finance PLC</b>		
4.125% due 08/15/2026	1,250	1,212
5.250% due 08/15/2027	750	714
<b>Clarios Global LP</b>		
4.375% due 05/15/2026	EUR 500	552
<b>Delta Air Lines, Inc.</b>		
4.750% due 10/20/2028	\$ 900	939
<b>Total Multinational (Cost \$13,861)</b>		<u>13,170</u>
<b>NETHERLANDS 2.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.4%</b>		
<b>AerCap Holdings NV</b>		
5.875% due 10/10/2079	1,250	1,233
<b>Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV</b>		
3.750% due 01/15/2025	EUR 2,000	2,211
<b>Dufry One BV</b>		
2.000% due 02/15/2027	2,600	2,633
<b>LeasePlan Corp. NV</b>		
7.375% due 05/29/2024 (a)(b)	2,100	2,519
<b>Schoeller Packaging BV</b>		
6.375% due 11/01/2024	625	687
<b>Sensata Technologies BV</b>		
5.000% due 10/01/2025	\$ 1,000	1,035
<b>WP/AP Telecom Holdings IV BV</b>		
3.750% due 01/15/2029	EUR 300	319
<b>Ziggo Bond Co. BV</b>		
6.000% due 01/15/2027	\$ 1,750	1,774
<b>Total Netherlands (Cost \$12,571)</b>		<u>12,411</u>
<b>PANAMA 0.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.8%</b>		
<b>Carnival Corp.</b>		
4.000% due 08/01/2028	2,100	2,015
10.500% due 02/01/2026	1,700	1,911
<b>Total Panama (Cost \$4,012)</b>		<u>3,926</u>
<b>SPAIN 2.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.9%</b>		
<b>Aedas Homes Opco SLU</b>		
4.000% due 08/15/2026	EUR 3,200	3,557
<b>CaixaBank S.A.</b>		
6.750% due 06/13/2024 (a)(b)	200	239

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Cellnex Finance Co. S.A.</b>		
1.500% due 06/08/2028	EUR 1,800	\$ 1,850
<b>Grifols Escrow Issuer S.A.</b>		
3.875% due 10/15/2028	1,200	1,240
<b>International Consolidated Airlines Group S.A.</b>		
3.750% due 03/25/2029	2,400	2,572
<b>Neinor Homes S.A.</b>		
4.500% due 10/15/2026	2,500	2,754
<b>Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A.</b>		
5.250% due 04/01/2026	2,400	2,696
<b>Total Spain (Cost \$16,586)</b>		<u>14,908</u>
<b>SWEDEN 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>Intrum AB</b>		
3.125% due 07/15/2024	2,900	3,219
<b>Verisure Holding AB</b>		
3.250% due 02/15/2027	1,100	1,164
<b>Total Sweden (Cost \$4,717)</b>		<u>4,383</u>
<b>SWITZERLAND 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>Credit Suisse Group AG (a)(b)</b>		
7.500% due 07/17/2023	\$ 800	816
7.500% due 12/11/2023	1,800	1,891
<b>Total Switzerland (Cost \$2,791)</b>		<u>2,707</u>
<b>UNITED KINGDOM 6.8%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.4%</b>		
<b>BCP V Modular Services Holdings IV Ltd.</b>		
4.500% due 12/15/2028	100	109
<b>Ineos Finance PLC</b>		
2.500% due 04/01/2024	1,661	1,836
<b>Total United Kingdom (Cost \$4,717)</b>		<u>1,945</u>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 6.4%</b>		
<b>Arqiva Broadcast Finance PLC</b>		
6.750% due 09/30/2023	GBP 750	1,011
<b>Barclays PLC (a)(b)</b>		
7.250% due 03/15/2023	1,200	1,646
7.750% due 09/15/2023	\$ 800	838
7.875% due 09/15/2022	GBP 600	822
<b>BCP V Modular Services Finance II PLC</b>		
4.750% due 11/30/2028	EUR 1,300	1,393
<b>Harbour Energy PLC</b>		
5.500% due 10/15/2026	\$ 2,800	2,768
<b>HSBC Holdings PLC (a)(b)</b>		
5.250% due 09/16/2022	EUR 800	910
6.250% due 03/23/2023	\$ 200	204
<b>INEOS Quattro Finance 2 PLC</b>		
3.375% due 01/15/2026	2,500	2,390
<b>Ithaca Energy North Sea PLC</b>		
9.000% due 07/15/2026	1,600	1,615
<b>Jaguar Land Rover Automotive PLC</b>		
7.750% due 10/15/2025	6,000	6,326
<b>Miller Homes Group Holdings PLC</b>		
5.500% due 10/15/2024	GBP 1,600	2,171

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Rolls-Royce PLC</b>		
5.750% due 10/15/2027	\$ 1,350	\$ 1,393
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>		
7.375% due 06/24/2022 (a)(b)	GBP 800	1,080
<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>		
5.000% due 04/15/2027	1,000	1,354
<b>Vmed O2 UK Financing I PLC</b>		
3.250% due 01/31/2031	EUR 1,000	1,029
4.000% due 01/31/2029	GBP 1,000	1,216
4.250% due 01/31/2031	\$ 1,500	1,382
<b>Vodafone Group PLC</b>		
6.250% due 10/03/2078	2,700	2,803
<b>Zenith Finco PLC</b>		
6.500% due 08/30/2027	GBP 400	495
<b>Total United Kingdom (Cost \$36,011)</b>		<u>34,791</u>
<b>UNITED STATES 58.0%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 1.7%</b>		
<b>BK LC Lux SPV Sarl</b>		
3.750% due 04/28/2028	\$ 896	889
<b>Carnival Corp.</b>		
3.750% due 08/30/2025	EUR 985	1,099
3.750% due 08/30/2025	\$ 1,182	1,171
<b>Embecka Corp.</b>		
3.500% due 01/27/2029	100	99
<b>GIP II Blue Holding LP</b>		
5.500% due 03/29/2028	399	398
<b>Instant Brands Holdings, Inc.</b>		
5.750% due 04/12/2028	866	814
<b>LifePoint Health, Inc.</b>		
3.959% due 11/16/2025	2,849	2,823
<b>Polaris Newco LLC</b>		
4.500% due 06/02/2028	100	99
<b>SCH Salt Holdings, Inc.</b>		
4.750% due 03/16/2027	205	202
<b>Team Health Holdings, Inc.</b>		
3.750% due 02/06/2024	1,484	1,416
<b>Total United States (Cost \$10,910)</b>		<u>9,010</u>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 51.7%</b>		
<b>180 Medical, Inc.</b>		
3.875% due 10/15/2029	300	289
<b>ADT Security Corp.</b>		
4.125% due 08/01/2029	2,000	1,889
<b>Advantage Sales &amp; Marketing, Inc.</b>		
6.500% due 11/15/2028	3,100	3,125
<b>AMC Networks, Inc.</b>		
4.250% due 02/15/2029	3,200	3,001
5.000% due 04/01/2024	596	596
<b>AmWINS Group, Inc.</b>		
4.875% due 06/30/2029	400	382
<b>ASP Unifrax Holdings, Inc.</b>		
5.250% due 09/30/2028	200	192
<b>Avantor Funding, Inc.</b>		
3.875% due 11/01/2029	2,650	2,554
4.625% due 07/15/2028	1,600	1,626
<b>Berry Global, Inc.</b>		
4.500% due 02/15/2026	892	895

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Block, Inc.</b>			<b>DCP Midstream Operating LP</b>			<b>LABL, Inc.</b>		
2.750% due 06/01/2026	\$ 900	\$ 874	3.250% due 02/15/2032	\$ 950	\$ 887	5.875% due 11/01/2028	\$ 200	\$ 192
<b>Booz Allen Hamilton, Inc.</b>			5.625% due 07/15/2027	1,000	1,076	<b>Ladder Capital Finance Holdings LLLP</b>		
4.000% due 07/01/2029	200	198	<b>Diamond Sports Group LLC</b>			4.750% due 06/15/2029	2,700	2,620
<b>British Airways 2021-1 Class A Pass-Through Trust</b>			5.375% due 08/15/2026	2,275	937	<b>Leeward Renewable Energy Operations LLC</b>		
2.900% due 03/15/2035	100	98	<b>Directv Financing LLC</b>			4.250% due 07/01/2029	2,700	2,619
<b>Builders FirstSource, Inc.</b>			5.875% due 08/15/2027	1,400	1,402	<b>Legacy LifePoint Health LLC</b>		
4.250% due 02/01/2032	575	553	<b>DISH DBS Corp.</b>			4.375% due 02/15/2027	500	474
<b>Burford Capital Global Finance LLC</b>			5.250% due 12/01/2026	3,000	2,947	<b>LFS Topco LLC</b>		
6.250% due 04/15/2028	400	415	5.750% due 12/01/2028	1,400	1,341	5.875% due 10/15/2026	100	100
<b>Calpine Corp.</b>			<b>Encino Acquisition Partners Holdings LLC</b>			<b>Lindblad Expeditions LLC</b>		
3.750% due 03/01/2031	2,900	2,644	8.500% due 05/01/2028	1,675	1,699	6.750% due 02/15/2027	100	101
<b>CCO Holdings LLC</b>			<b>Endeavor Energy Resources LP</b>			<b>Live Nation Entertainment, Inc.</b>		
4.250% due 02/01/2031	2,000	1,877	5.750% due 01/30/2028	1,250	1,296	3.750% due 01/15/2028	200	192
4.500% due 08/15/2030	1,000	965	<b>EQM Midstream Partners LP</b>			4.750% due 10/15/2027	750	738
4.500% due 06/01/2033	1,050	986	4.750% due 01/15/2031	2,350	2,206	<b>Lumen Technologies, Inc.</b>		
4.750% due 03/01/2030	1,000	984	<b>EQT Corp.</b>			4.000% due 02/15/2027	100	95
5.125% due 05/01/2027	2,500	2,528	3.125% due 05/15/2026	200	197	<b>Mauser Packaging Solutions Holding Co.</b>		
5.375% due 06/01/2029	1,000	1,017	3.625% due 05/15/2031	200	195	5.500% due 04/15/2024	2,000	1,992
<b>Cheniere Energy Partners LP</b>			<b>First Student Bidco, Inc.</b>			<b>Midas OpCo Holdings LLC</b>		
3.250% due 01/31/2032	3,725	3,508	4.000% due 07/31/2029	2,000	1,894	5.625% due 08/15/2029	2,725	2,674
<b>Cheniere Energy, Inc.</b>			<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>			<b>Midcap Financial Issuer Trust</b>		
4.625% due 10/15/2028	2,800	2,864	3.625% due 06/17/2031	13,900	13,388	5.625% due 01/15/2030	200	183
<b>Chesapeake Energy Corp.</b>			<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>			6.500% due 05/01/2028	400	391
5.500% due 02/01/2026	100	103	5.500% due 05/01/2028	2,500	2,392	<b>Mozart Debt Merger Sub, Inc.</b>		
5.875% due 02/01/2029	100	104	6.500% due 10/01/2025	750	760	3.875% due 04/01/2029	2,725	2,590
6.750% due 04/15/2029	2,700	2,858	<b>Freedom Mortgage Corp.</b>			<b>MPH Acquisition Holdings LLC</b>		
<b>Cinemark USA, Inc.</b>			6.625% due 01/15/2027	3,000	2,773	5.500% due 09/01/2028	2,000	1,944
5.250% due 07/15/2028 (f)	1,600	1,528	<b>Frontier Communications Holdings LLC</b>			<b>Netflix, Inc.</b>		
<b>Clarivate Science Holdings Corp.</b>			6.000% due 01/15/2030	750	700	3.625% due 06/15/2030	EUR 1,900	2,292
3.875% due 07/01/2028	300	284	<b>Full House Resorts, Inc.</b>			<b>Nielsen Finance LLC</b>		
<b>Clearway Energy Operating LLC</b>			8.250% due 02/15/2028	1,000	1,004	4.750% due 07/15/2031	\$ 1,025	914
3.750% due 01/15/2032	900	843	<b>GCP Applied Technologies, Inc.</b>			<b>Novelis Corp.</b>		
<b>Colfax Corp.</b>			5.500% due 04/15/2026	1,250	1,275	3.250% due 11/15/2026	1,100	1,045
3.250% due 05/15/2025	EUR 500	557	<b>Genesis Energy LP</b>			<b>NSG Holdings LLC</b>		
<b>CommScope, Inc.</b>			7.750% due 02/01/2028	2,200	2,176	7.750% due 12/15/2025	845	894
4.750% due 09/01/2029	\$ 3,700	3,456	<b>Genworth Holdings, Inc.</b>			<b>Occidental Petroleum Corp.</b>		
<b>Community Health Systems, Inc.</b>			4.800% due 02/15/2024	300	308	5.875% due 09/01/2025	1,825	1,960
4.750% due 02/15/2031	3,600	3,393	<b>Graphic Packaging International LLC</b>			6.125% due 01/01/2031 (d1f)	1,600	1,822
<b>Comstock Resources, Inc.</b>			3.750% due 02/01/2030	5,175	4,938	6.375% due 09/01/2028	2,750	3,112
5.875% due 01/15/2030	200	194	<b>GYP Holdings III Corp.</b>			6.625% due 09/01/2030	4,650	5,418
6.750% due 03/01/2029	1,600	1,630	4.625% due 05/01/2029	400	374	<b>Olympus Water U.S. Holding Corp.</b>		
7.500% due 05/15/2025	600	614	<b>Harvest Midstream I LP</b>			3.875% due 10/01/2028	EUR 3,000	3,148
<b>Conduent Business Services LLC</b>			7.500% due 09/01/2028	1,725	1,743	<b>OneMain Finance Corp.</b>		
6.000% due 11/01/2029	2,275	2,171	<b>HAT Holdings I LLC</b>			3.500% due 01/15/2027	\$ 4,625	4,382
<b>Coty, Inc.</b>			3.375% due 06/15/2026	1,775	1,685	<b>Option Care Health, Inc.</b>		
3.875% due 04/15/2026	EUR 1,400	1,537	<b>HealthEquity, Inc.</b>			4.375% due 10/31/2029	300	290
5.000% due 04/15/2026	\$ 2,225	2,241	4.500% due 10/01/2029	300	286	<b>Organon &amp; Co.</b>		
<b>Crestwood Midstream Partners LP</b>			<b>Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC</b>			2.875% due 04/30/2028	EUR 4,200	4,420
6.000% due 02/01/2029	600	606	5.000% due 06/01/2029	1,400	1,374	5.125% due 04/30/2031	\$ 900	900
<b>Crocs, Inc.</b>			<b>Howard Hughes Corp.</b>			<b>Oxford Finance LLC</b>		
4.125% due 08/15/2031	3,700	3,159	4.125% due 02/01/2029	600	569	6.375% due 02/01/2027	410	420
<b>CrownRock LP</b>			4.375% due 02/01/2031	540	510	<b>Pactiv Evergreen Group Issuer LLC</b>		
5.000% due 05/01/2029	100	102	5.375% due 08/01/2028	1,900	1,923	4.375% due 10/15/2028	600	555
5.625% due 10/15/2025	2,150	2,177	<b>II-VI, Inc.</b>			<b>Papa John's International, Inc.</b>		
<b>Curo Group Holdings Corp.</b>			5.000% due 12/15/2029	200	200	3.875% due 09/15/2029	200	186
7.500% due 08/01/2028	2,650	2,357	<b>Imola Merger Corp.</b>			<b>Par Pharmaceutical, Inc.</b>		
<b>DaVita, Inc.</b>			4.750% due 05/15/2029	2,650	2,574	7.500% due 04/01/2027	1,000	1,003
3.750% due 02/15/2031	1,675	1,533						

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Park Intermediate Holdings LLC</b>			<b>Sunnova Energy Corp.</b>			<b>Zayo Group Holdings, Inc.</b>		
4.875% due 05/15/2029	\$ 600	\$ 579	5.875% due 09/01/2026	\$ 100	\$ 92	4.000% due 03/01/2027	\$ 1,900	\$ 1,808
<b>PDC Energy, Inc.</b>			<b>Switch Ltd.</b>			<b>ZipRecruiter, Inc.</b>		
5.7500% due 05/15/2026	1,000	1,016	4.125% due 06/15/2029	1,100	1,056	5.000% due 01/15/2030	400	394
<b>PennyMac Financial Services, Inc.</b>			<b>Tallgrass Energy Partners LP</b>					<b>265,229</b>
4.250% due 02/15/2029	2,600	2,331	6.000% due 12/31/2030	800	772	<b>U.S. TREASURY OBLIGATIONS 4.6%</b>		
5.750% due 09/15/2031	900	849	<b>Targa Resources Partners LP</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
<b>Performance Food Group, Inc.</b>			4.000% due 01/15/2032	275	271	2.250% due 11/15/2024	23,000	23,393
5.500% due 10/15/2027	3,300	3,362	4.875% due 02/01/2031	1,800	1,853	<b>Total United States</b>		<b>297,632</b>
<b>PetSmart, Inc.</b>			5.875% due 04/15/2026	750	775	<b>(Cost \$305,675)</b>		
4.750% due 02/15/2028	600	599	6.875% due 01/15/2029	625	681	<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 3.4%</b>		
<b>PGT Innovations, Inc.</b>			<b>TEGNA, Inc.</b>			<b>REPURCHASE AGREEMENTS (e) 0.5%</b>		
4.375% due 10/01/2029	700	659	5.000% due 09/15/2029	750	749			<b>2,528</b>
<b>Post Holdings, Inc.</b>			<b>Tenet Healthcare Corp.</b>			<b>TIME DEPOSITS 0.5%</b>		
4.500% due 09/15/2031	1,300	1,206	4.875% due 01/01/2026	7,100	7,158	<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
4.625% due 04/15/2030	1,000	943	<b>Terminix Co. LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	6	6
5.750% due 03/01/2027	2,400	2,428	7.450% due 08/15/2027	100	117	<b>Bank of Nova Scotia</b>		
<b>PRA Group, Inc.</b>			<b>TerraForm Power Operating LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	1	1
7.375% due 09/01/2025	3,000	3,154	4.250% due 01/31/2023	1,000	1,002	<b>BNP Paribas Bank</b>		
<b>Prime Healthcare Services, Inc.</b>			4.750% due 01/15/2030	500	492	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 2	2
7.250% due 11/01/2025	100	102	5.000% due 01/31/2028	1,500	1,506	0.005% due 03/01/2022	\$ 235	235
<b>Prime Security Services Borrower LLC</b>			<b>Thor Industries, Inc.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 1	1
3.375% due 08/31/2027	2,000	1,853	4.000% due 10/15/2029	3,100	2,833	<b>Citibank N.A.</b>		
<b>Range Resources Corp.</b>			<b>TopBuild Corp.</b>			0.005% due 03/01/2022	\$ 302	302
4.750% due 02/15/2030	100	98	4.125% due 02/15/2032	400	381	<b>Credit Suisse AG</b>		
<b>Revlon Consumer Products Corp.</b>			<b>TransDigm, Inc.</b>			(1.450%) due 03/01/2022	CHF 1	1
6.250% due 08/01/2024	25	11	4.625% due 01/15/2029	1,400	1,323	<b>DBS Bank Ltd.</b>		
<b>RHP Hotel Properties LP</b>			5.500% due 11/15/2027	1,500	1,496	0.005% due 03/01/2022	\$ 60	60
4.500% due 02/15/2029	1,500	1,419	6.250% due 03/15/2026	500	515	<b>HSBC Bank PLC</b>		
<b>Ritchie Bros Holdings, Inc.</b>			6.375% due 06/15/2026	2,900	2,960	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 131	147
4.750% due 12/15/2031	200	199	<b>Travel + Leisure Co.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 1	2
<b>RLJ Lodging Trust LP</b>			4.500% due 12/01/2029	2,750	2,631	<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
3.750% due 07/01/2026	300	293	<b>Triumph Group, Inc.</b>			0.005% due 03/01/2022	\$ 69	69
4.000% due 09/15/2029	300	282	8.875% due 06/01/2024	726	776	<b>Royal Bank of Canada</b>		
<b>ROBLOX Corp.</b>			<b>U.S. Acute Care Solutions LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	603	603
3.875% due 05/01/2030	300	286	6.375% due 03/01/2026	1,375	1,356	<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
<b>Rockcliff Energy II LLC</b>			<b>Uber Technologies, Inc.</b>			(0.780%) due 03/01/2022	EUR 273	307
5.500% due 10/15/2029	200	199	4.500% due 08/15/2029	4,575	4,388	0.005% due 03/01/2022	\$ 945	945
<b>Sabre GLBL, Inc.</b>			<b>United Airlines, Inc.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 3	4
7.375% due 09/01/2025	1,800	1,867	4.375% due 04/15/2026	400	400	<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
9.250% due 04/15/2025	700	790	4.625% due 04/15/2029	500	489	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 5	6
<b>Scientific Games International, Inc.</b>			<b>Univision Communications, Inc.</b>			0.005% due 03/01/2022	\$ 45	45
3.375% due 02/15/2026	EUR 2,900	3,241	4.500% due 05/01/2029	3,600	3,451	0.090% due 03/01/2022	GBP 15	20
<b>Select Medical Corp.</b>			<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>					<b>2,756</b>
6.250% due 08/15/2026	\$ 1,500	1,521	3.875% due 08/15/2029	400	392	<b>U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS 2.4%</b>		
<b>Southwestern Energy Co.</b>			3.875% due 11/01/2033	1,800	1,736	0.200% due 05/17/2022 (cl/h)	\$ 12,000	11,993
4.750% due 02/01/2032	200	199	4.125% due 08/15/2031	300	297	<b>Total Short-Term Instruments</b>		<b>17,277</b>
5.375% due 02/01/2029	3,320	3,420	<b>Viasat, Inc.</b>			<b>(Cost \$17,313)</b>		
<b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>			5.625% due 09/15/2025	750	717	<b>Total Investments in Securities 99.6%</b>		<b>\$ 511,198</b>
5.500% due 01/15/2025	3,400	3,498	5.625% due 04/15/2027	500	500	<b>(Cost \$530,210)</b>		
<b>Standard Industries, Inc.</b>			<b>Viavi Solutions, Inc.</b>			<b>Financial Derivative</b>		
4.375% due 07/15/2030	1,375	1,304	3.750% due 10/01/2029	200	190	<b>Instruments (g)(i) 0.1%</b>		<b>613</b>
<b>Staples, Inc.</b>			<b>Vistra Operations Co. LLC</b>			<b>(Cost or Premiums, net \$0)</b>		
7.500% due 04/15/2026	3,050	3,019	5.625% due 02/15/2027	1,250	1,282	<b>Other Assets and Liabilities, net 0.3%</b>		<b>1,353</b>
<b>Starwood Property Trust, Inc.</b>			<b>WMG Acquisition Corp.</b>			<b>Net Assets 100.0%</b>		<b>\$ 513,164</b>
3.750% due 12/31/2024	500	490	3.000% due 02/15/2031	2,400	2,174			
<b>Station Casinos LLC</b>			<b>Wynn Las Vegas LLC</b>					
4.625% due 12/01/2031	300	283	5.250% due 05/15/2027	1,000	991			
			5.500% due 03/01/2025	1,500	1,523			

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (AMOUNTS IN THOUSANDS\*, EXCEPT NUMBER OF CONTRACTS):

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.  
 (a) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.  
 (b) Contingent convertible security.  
 (c) Coupon represents a yield to maturity.

(d) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Occidental Petroleum Corp.	6.125%	01/01/2031	12/08/2020	\$ 1,600	\$ 1,822	0.36%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(e) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	担保 受取価値	レボ価値	レボ契約の 受取 <sup>(2)</sup>
BPS	0.150%	02/24/2022	TBD <sup>(1)</sup>	GBP 1,884	Kane Bidco Ltd 6.500% due 02/15/2027	\$ (2,535)	\$ 2,528	\$ 2,536
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (2,535)</b>	<b>\$ 2,528</b>	<b>\$ 2,536</b>

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 <sup>(2)</sup>	決済日	満期日	借入金額 <sup>(2)</sup>	リバースレボ の支払
JML	(0.070%)	02/09/2022	04/12/2022	\$ (2,704)	\$ (2,704)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (2,704)</b>

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	残存期間				合計
	オーバーナイト/ 継続	30日迄	31-90日	90日以上	
<b>Reverse Repurchase Agreements</b>					
U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ (2,704)	\$ 0	\$ (2,704)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>
<b>Total Borrowings</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>
<b>Payable for Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (2,704)</b>

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	額面金額	収益	ショートに よる支払	
FBF	Kane Bidco Ltd.	6.500%	02/15/2027	\$ 1,900	\$ (2,557)	\$ (2,523)	
<b>Total Short Sales (0.5%)</b>						<b>\$ (2,557)</b>	<b>\$ (2,523)</b>

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of February 28, 2022:

- (f) Securities with an aggregate market value of \$3,350 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 28, 2022.

取引相手	レボ契約 の受取	リバースレボ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの 支払	合計借入 その他金融取引 (受取)/差入れ	担保の (受取)/差入れ	ネットエク ス ボージャー <sup>(4)</sup>
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 2,536	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,536	\$ (2,535)	\$ 1
JML	0	(2,704)	0	0	(2,704)	3,350	646
Master Securities Forward Transactions Agreement							
FBF	0	0	0	(2,523)	(2,523)	0	(2,523)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 2,536</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,523)</b>			

<sup>(1)</sup> Open maturity repurchase agreement.

<sup>(2)</sup> Includes accrued interest.

<sup>(3)</sup> The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 28, 2022 was \$1,035 at a weighted average interest rate of (0.256%). Average borrowings may include sale buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

<sup>(4)</sup> Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

**(g) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED**

**FUTURES CONTRACTS:**

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Euro-Bobl 5-Year Note March Futures	Long	03/2022	32	\$ (88)	\$ 14	\$ 0
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03/2022	19	(157)	2	0
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03/2022	2	(39)	0	0
Euro-Schatz 2-Year Note June Futures	Short	06/2022	66	(20)	0	(15)
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2022	10	3	0	(13)
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Short	06/2022	1	(1)	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Long	06/2022	33	78	147	0
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (224)</b>	<b>\$ 163</b>	<b>\$ (29)</b>

**SWAP AGREEMENTS:**

**CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(1)</sup>**

参照債券	固定受取金利	満期日	2022年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>		想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格 <sup>(4)</sup>	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
								資産	負債
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	06/20/2026	4.315%	EUR	600	\$ 24	\$ (16)	\$ 3	\$ 0

**CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>(1)</sup>**

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格 <sup>(4)</sup>	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
						資産	負債
iTraxx Europe Crossover Series 36 Index	5.000%	12/20/2026	EUR 9,700	\$ 821	\$ 222	\$ 411	\$ 0

**INTEREST RATE SWAPS**

変動金利の 支払/受取 <sup>(3)</sup>	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	6-Month EURIBOR	0.250%	03/16/2032	EUR 2,900	\$ 191	\$ 245	\$ 10	\$ 0
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.500%	03/16/2027	GBP 2,800	(190)	(176)	14	0
					\$ 1	\$ 69	\$ 24	\$ 0
<b>Total Swap Agreements</b>					<b>\$ 846</b>	<b>\$ 275</b>	<b>\$ 438</b>	<b>\$ 0</b>

**FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY**

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 28, 2022:

(h) Securities with an aggregate market value of \$1,614 and cash of \$1,669 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 28, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格		変動証拠金資産		市場価格		変動証拠金負債	
	買いオプション	先物	スワップ	合計	売りオプション	先物	スワップ	合計
	\$ 0	\$ 163	\$ 438	\$ 601	\$ 0	\$ (29)	\$ 0	\$ (29)

- <sup>10</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- <sup>11</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- <sup>12</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- <sup>13</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- <sup>14</sup> This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

**(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS- OVER THE COUNTER**

**FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:**

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益			
				資産	負債		
BOA	05/2022	EUR	376	\$	4	\$	0
BOA	05/2022	\$	1,969	GBP	1,453	0	(19)
BPS	05/2022	EUR	1,516	\$	1,728	20	0
BPS	05/2022	\$	4,243	CAD	5,384	2	0
BRC	05/2022	EUR	956	\$	1,072	0	(5)
BRC	05/2022	\$	424	EUR	378	2	0
CBK	05/2022	EUR	861	\$	982	12	0
GLM	05/2022		1,343		1,531	18	0
MBC	03/2022	\$	173	JPY	20,000	1	0
MYI	05/2022	EUR	424	\$	483	5	0
MYI	05/2022	\$	370	EUR	330	1	0
				\$	65	\$	(24)

**JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:**

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益			
				資産	負債		
BOA	03/2022	CAD	0	\$	0	\$	0
BPS	03/2022	\$	12	EUR	11	0	0
BRC	03/2022	JPY	263,359	\$	2,287	0	0
BRC	03/2022	\$	2,690	JPY	309,834	0	0
BRC	04/2022		2,287		263,182	0	0
CBK	03/2022	JPY	5,549	\$	48	0	0
MYI	03/2022		57,284		499	2	0
MYI	03/2022	\$	65	EUR	58	0	0
MYI	03/2022		14	GBP	10	0	0
MYI	04/2022		190	JPY	21,801	0	(1)
NAB	03/2022	JPY	326,531	\$	2,835	0	0
NAB	03/2022	\$	2,895	JPY	333,546	1	0
NAB	04/2022		2,835		326,310	0	0
SCX	03/2022	EUR	1,783	\$	2,000	0	(3)
SCX	03/2022	GBP	197		265	0	0
SCX	03/2022	JPY	326,531		2,835	0	0
SCX	03/2022	\$	1,991	EUR	1,772	0	0
SCX	03/2022		265	GBP	197	0	0
SCX	03/2022		2,895	JPY	333,546	1	0
SCX	04/2022	EUR	1,772	\$	1,993	0	0
SCX	04/2022	GBP	197		265	0	0
SCX	04/2022	\$	2,835	JPY	326,310	0	0
TOR	03/2022	CAD	80	\$	63	0	0
TOR	03/2022	JPY	5,356		47	0	0
TOR	04/2022	\$	47	JPY	5,353	0	0
				\$	4	\$	(4)
				\$	69	\$	(28)

**Total Forward Foreign Currency Contracts**

(B) ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド  
(2022年2月28日現在)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 104.4%</b>		
<b>AUSTRALIA 6.9%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 0.2%</b>		
<b>Flexi Asset-Backed Securities Trust</b>		
0.915% due 04/14/2025	AUD	243 \$ 177
<b>Pepper SPARKZ Trust No.3</b>		
1.065% due 08/17/2028	516	375
		<b>552</b>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.2%</b>		
<b>GAIF Bond Issuer Pty Ltd.</b>		
1.900% due 12/14/2028	1,300	868
<b>Leandlease Finance Ltd.</b>		
3.700% due 03/31/2031	500	348
<b>Pacific National Finance Pty Ltd.</b>		
4.750% due 03/22/2028	\$ 900	938
<b>Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.</b>		
1.200% due 04/08/2024	AUD 500	356
<b>Woodside Finance Ltd.</b>		
3.650% due 03/05/2025	\$ 200	206
<b>WSD Finance Pty Ltd.</b>		
4.500% due 03/31/2027	AUD 600	465
		<b>3,181</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 4.3%</b>		
<b>Bluestone Prime Trust</b>		
0.760% due 06/21/2053	577	416
<b>Bluestone Sapphire XXV</b>		
1.060% due 09/21/2053	1,053	764
<b>Firstmac Mortgage Funding Trust No.4</b>		
0.749% due 10/24/2052	1,656	1,194
0.810% due 02/19/2053	452	325
<b>La Trobe Financial Capital Markets Trust</b>		
0.815% due 01/14/2053	1,514	1,092
<b>Liberty</b>		
1.261% due 10/10/2049	467	339
<b>Liberty PRIME</b>		
0.715% due 01/25/2053	1,669	1,204
<b>National RMBS Trust</b>		
1.280% due 12/20/2047	289	212
<b>Pepper I-Prime Trust</b>		
0.715% due 07/15/2053	1,200	865
<b>Pepper Residential Securities Trust No.23</b>		
1.087% due 08/18/2060	\$ 80	80
<b>Pepper Residential Securities Trust No.29</b>		
0.845% due 10/14/2062	AUD 698	505
<b>Pepper Residential Securities Trust No.30</b>		
0.815% due 01/15/2063	1,097	792
<b>Progress Trust</b>		
0.810% due 07/20/2046	443	321
<b>RedZed Trust</b>		
0.815% due 06/09/2053	670	486
<b>Resimac Bastille Trust</b>		
0.865% due 09/07/2052	604	438
<b>RESIMAC Premier</b>		
0.695% due 02/13/2053	1,729	1,246
0.826% due 07/10/2052	\$ 630	628
1.315% due 02/07/2052	AUD 278	203
<b>Securitized Australian Mortgage Trust</b>		
0.790% due 02/20/2046	437	317

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Westpac Securitisation Trust</b>		
0.765% due 07/22/2046	AUD 584	\$ 424
		<b>11,851</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.2%</b>		
<b>Australia Government Bond</b>		
0.250% due 11/21/2025	1,000	689
3.250% due 04/21/2029	1,800	1,414
<b>South Australian Government Financing Authority</b>		
1.750% due 05/24/2032	400	269
<b>Treasury Corp. of Victoria</b>		
4.250% due 12/20/2032	1,100	924
		<b>3,296</b>
<b>Total Australia</b>		<b>18,880</b>
<b>(Cost \$19,520)</b>		
<b>BERMUDA 0.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Bacardi Ltd.</b>		
4.700% due 05/15/2028	\$ 400	435
<b>Total Bermuda</b>		<b>435</b>
<b>(Cost \$392)</b>		
<b>CANADA 1.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.4%</b>		
<b>Province of Ontario</b>		
2.450% due 06/29/2022	1,800	1,811
<b>Province of Quebec</b>		
6.000% due 10/01/2029	CAD 1,000	986
7.295% due 07/22/2026	\$ 900	1,091
<b>Total Canada</b>		<b>3,888</b>
<b>(Cost \$4,005)</b>		
<b>CAYMAN ISLANDS 2.3%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 1.9%</b>		
<b>Bain Capital Credit CLO Ltd.</b>		
1.224% due 07/20/2030	800	795
<b>Elevation CLO Ltd.</b>		
1.471% due 10/15/2029	785	778
<b>HalseyPoint CLO 3 Ltd.</b>		
1.749% due 11/30/2032	1,000	994
<b>Magnetite VIII Ltd.</b>		
1.221% due 04/15/2031	1,100	1,098
<b>Nassau Ltd.</b>		
1.391% due 10/15/2029	1,389	1,390
		<b>5,055</b>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.</b>		
4.600% due 03/27/2024 (a)	700	729
<b>Sands China Ltd.</b>		
2.850% due 03/08/2029	500	421
		<b>1,150</b>
<b>Total Cayman Islands</b>		<b>6,205</b>
<b>(Cost \$6,305)</b>		
<b>CHILE 0.3%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Chile Government International Bond</b>		
2.450% due 01/31/2031	900	850

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Total Chile</b>		
<b>(Cost \$930)</b>		<b>\$ 850</b>
<b>DENMARK 4.0%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 4.0%</b>		
<b>Jyske Realkredit A/S</b>		
1.000% due 10/01/2050	DKK 30,401	4,076
1.500% due 10/01/2037	139	21
1.500% due 10/01/2053	598	82
2.000% due 10/01/2050	122	17
<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>		
1.000% due 10/01/2050	6,707	893
1.500% due 10/01/2053	898	123
2.000% due 10/01/2050	266	39
<b>Nykredit Realkredit A/S</b>		
1.000% due 10/01/2050	25,877	3,469
1.000% due 10/01/2053	298	39
1.500% due 10/01/2053	6,871	947
2.000% due 10/01/2050	1,026	149
2.500% due 10/01/2047	39	6
<b>Realkredit Danmark A/S</b>		
0.720% due 01/01/2038	442	70
1.000% due 10/01/2050	2,083	279
1.000% due 10/01/2053	4,556	594
1.500% due 10/01/2053	697	96
1.500% due 10/01/2053	100	14
2.000% due 10/01/2053	100	14
2.500% due 04/01/2036	77	12
2.500% due 04/01/2047	18	3
<b>Total Denmark</b>		<b>10,943</b>
<b>(Cost \$12,246)</b>		
<b>FRANCE 1.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>BNP Paribas S.A.</b>		
5.198% due 01/10/2030	\$ 900	1,000
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)	200	218
		<b>1,218</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.3%</b>		
<b>France Government Bond</b>		
0.750% due 05/25/2052	EUR 200	199
1.500% due 05/25/2050	300	366
3.250% due 05/25/2045	1,820	2,959
		<b>3,524</b>
<b>Total France</b>		<b>4,742</b>
<b>(Cost \$4,301)</b>		
<b>GERMANY 2.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.3%</b>		
<b>Deutsche Bank AG</b>		
1.750% due 11/19/2030	500	538
3.035% due 05/28/2032 (i)	\$ 200	188
3.547% due 09/18/2031	300	296
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>		
1.125% due 05/09/2033	EUR 900	1,054
<b>Landwirtschaftliche Rentenbank</b>		
4.250% due 01/24/2023	AUD 5,500	4,120
<b>Total Germany</b>		<b>6,196</b>
<b>(Cost \$7,678)</b>		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>GUERNSEY 0.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Amdocs Ltd.</b>		
2.538% due 06/15/2030	\$ 600	\$ 566
<b>Total Guernsey</b>		<b>566</b>
<b>(Cost \$800)</b>		
<b>HONG KONG 0.3%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Airport Authority</b>		
2.100% due 03/08/2026 (b)	800	770
<b>Total Hong Kong</b>		<b>770</b>
<b>(Cost \$800)</b>		
<b>IRELAND 3.3%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 2.7%</b>		
<b>Accunia European CLO I DAC</b>		
0.950% due 07/15/2030	EUR 659	739
<b>Aqueduct European CLO DAC</b>		
0.640% due 07/20/2030	793	887
<b>Aurium CLO IV DAC</b>		
0.730% due 01/16/2031	600	672
<b>BlueMountain Fuji EUR CLO II DAC</b>		
0.650% due 07/15/2030	451	505
<b>Cairn CLO IV DAC</b>		
0.600% due 04/30/2031	300	336
<b>Contego CLO IV DAC</b>		
0.640% due 01/23/2030	600	672
<b>Harvest CLO XVI DAC</b>		
0.640% due 10/15/2031	1,300	1,459
<b>Harvest CLO XXII DAC</b>		
0.850% due 01/15/2032	700	791
<b>Man GLG Euro CLO III DAC</b>		
0.680% due 10/15/2030	1,000	1,121
<b>OCP Euro CLO DAC</b>		
0.880% due 09/22/2034	100	111
		<b>7,293</b>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b>		
2.450% due 10/29/2026	\$ 500	482
<b>Perrigo Finance Unlimited Co.</b>		
3.900% due 06/15/2030	600	551
		<b>1,033</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.2%</b>		
<b>Dilosk Rmbs No.3 DAC</b>		
0.190% due 10/20/2057	EUR 561	631
<b>Total Ireland</b>		<b>8,957</b>
<b>(Cost \$9,482)</b>		
<b>ISRAEL 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Israel Government International Bond</b>		
4.125% due 01/17/2048	\$ 200	222
<b>Total Israel</b>		<b>222</b>
<b>(Cost \$205)</b>		
<b>ITALY 0.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>AMCO Asset Management Co. SpA</b>		
1.500% due 07/17/2023	EUR 300	344

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Italy Buoni Poliennali del Tesoro</b>		
2.150% due 03/01/2072	EUR 400	\$ 391
2.800% due 03/01/2067	200	231
		<b>622</b>
<b>Total Italy</b>		<b>966</b>
<b>(Cost \$1,026)</b>		
<b>JAPAN 3.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.6%</b>		
<b>East Japan Railway Co.</b>		
0.773% due 09/15/2034	200	205
1.104% due 09/15/2039	300	301
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>		
3.195% due 07/18/2029	\$ 1,600	1,616
<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>		
2.591% due 05/25/2031	500	479
<b>Nippon Life Insurance Co.</b>		
5.000% due 10/18/2042	1,600	1,621
<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b>		
3.201% due 09/17/2028	EUR 200	238
4.345% due 09/17/2027	\$ 400	412
4.810% due 09/17/2030	600	630
<b>Nomura Holdings, Inc.</b>		
2.172% due 07/14/2028	300	282
2.329% due 01/22/2027	200	193
2.710% due 01/22/2029	300	291
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>		
4.436% due 04/02/2024 (a)	700	729
		<b>6,997</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.1%</b>		
<b>Japan Government International Bond</b>		
0.100% due 09/20/2030	¥ 310,000	2,689
0.700% due 06/20/2051	50,000	416
		<b>3,105</b>
<b>Total Japan</b>		<b>10,102</b>
<b>(Cost \$10,600)</b>		
<b>LUXEMBOURG 0.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Aroundtown S.A.</b>		
5.375% due 03/21/2029	\$ 400	437
<b>Total Luxembourg</b>		<b>437</b>
<b>(Cost \$398)</b>		
<b>NETHERLANDS 1.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.6%</b>		
<b>ING Bank NV</b>		
2.625% due 12/05/2022	300	303
<b>ING Groep NV</b>		
4.550% due 10/02/2028	1,000	1,087
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)	200	189
		<b>1,579</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1%</b>		
<b>Dutch Property Finance BV</b>		
0.096% due 07/28/2058	EUR 291	325
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.6%</b>		
<b>Nederlandse Waterschapbank NV</b>		
0.125% due 01/17/2024	1,400	1,579

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Total Netherlands</b>		<b>\$ 3,483</b>
<b>(Cost \$3,475)</b>		
<b>NEW ZEALAND 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>New Zealand Government Inflation-Linked Bond</b>		
2.310% due 09/20/2025 (c)	NZD 200	168
<b>Total New Zealand</b>		<b>168</b>
<b>(Cost \$163)</b>		
<b>NORWAY 2.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.9%</b>		
<b>DNB Boligkreditt AIS</b>		
2.500% due 03/28/2022	\$ 2,600	2,604
<b>SR-Boligkreditt AIS</b>		
2.500% due 04/12/2022	2,650	2,657
		<b>5,261</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Norway Government Bond</b>		
1.750% due 03/13/2025	NOK 4,100	465
<b>Total Norway</b>		<b>5,726</b>
<b>(Cost \$5,754)</b>		
<b>QATAR 0.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Qatar Energy</b>		
3.125% due 07/12/2041	\$ 100	94
3.300% due 07/12/2051	100	94
		<b>188</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Qatar Government International Bond</b>		
4.400% due 04/16/2050	600	694
<b>Total Qatar</b>		<b>882</b>
<b>(Cost \$908)</b>		
<b>SAUDI ARABIA 0.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Saudi Arabian Oil Co.</b>		
3.250% due 11/24/2050	200	178
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Saudi Government International Bond</b>		
3.250% due 10/26/2026	200	208
3.625% due 03/04/2028	400	422
4.625% due 10/04/2047	300	331
		<b>961</b>
<b>Total Saudi Arabia</b>		<b>1,139</b>
<b>(Cost \$1,199)</b>		
<b>SINGAPORE 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>BOC Aviation Ltd.</b>		
3.500% due 01/31/2023	600	607
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Singapore Government Bond</b>		
2.875% due 07/01/2029	SGD 900	708
<b>Total Singapore</b>		<b>1,315</b>
<b>(Cost \$1,335)</b>		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>SOUTH KOREA 0.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Hyundai Capital Services, Inc.</b> 0.750% due 09/15/2023	\$ 400	\$ 391
<b>Total South Korea (Cost \$400)</b>		<b>391</b>
<b>SPAIN 4.9%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 4.9%</b>		
<b>Spain Government Bond</b>		
0.800% due 07/30/2027	EUR 700	797
1.250% due 10/31/2030	500	578
1.400% due 04/30/2028	600	706
1.450% due 10/31/2027	1,820	2,145
1.450% due 04/30/2029	2,300	2,716
1.450% due 10/31/2071	400	347
2.700% due 10/31/2048	400	541
3.450% due 07/30/2066	900	1,379
5.150% due 10/31/2028	1,600	2,322
5.250% due 04/06/2029	GBP 1,200	1,952
<b>Total Spain (Cost \$13,953)</b>		<b>13,483</b>
<b>SUPRANATIONAL 0.6%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.6%</b>		
<b>Nordic Investment Bank</b> 5.000% due 04/19/2022	AUD 2,200	1,607
<b>Total Supranational (Cost \$2,254)</b>		<b>1,607</b>
<b>SWEDEN 1.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.4%</b>		
<b>Stadshypotek AB</b> 2.500% due 04/05/2022	\$ 3,400	3,406
<b>Sveriges Sakerstallida Obligationer AB</b> 2.000% due 06/17/2026	SEK 3,000	329
<b>Total Sweden (Cost \$3,746)</b>		<b>3,735</b>
<b>SWITZERLAND 3.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.2%</b>		
<b>Credit Suisse AG</b> 6.500% due 08/08/2023 (a)	\$ 3,400	3,570
<b>Credit Suisse Group AG</b> 3.750% due 03/26/2025 3.869% due 01/12/2029 4.194% due 04/01/2031	1,400 500 500	1,437 507 520
<b>UBS AG</b> 7.625% due 08/17/2022 (a)	2,700	2,765
<b>Total Switzerland (Cost \$8,722)</b>		<b>8,799</b>
<b>UNITED ARAB EMIRATES 0.5%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
<b>Abu Dhabi Government International Bond</b> 3.125% due 04/16/2030	1,400	1,463
<b>Total United Arab Emirates (Cost \$1,496)</b>		<b>1,463</b>

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>UNITED KINGDOM 10.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.6%</b>		
<b>Amcor UK Finance PLC</b> 1.125% due 06/23/2027	EUR 500	\$ 557
<b>Barclays Bank PLC</b> 7.625% due 11/21/2022 (a)	\$ 700	726
<b>Barclays PLC</b> 3.250% due 02/12/2027 3.250% due 01/17/2033 3.650% due 03/16/2025 7.125% due 06/15/2025 (a)(b)	GBP 1,200 600 200 300	1,644 810 206 419
<b>HSBC Holdings PLC</b> 5.250% due 09/16/2022 (a)(b) 6.000% due 09/29/2023 (a)(b) 6.000% due 03/29/2040	EUR 200 1,800 GBP 50	227 2,124 82
<b>Lloyds Banking Group PLC</b> 4.582% due 12/10/2025	\$ 400	421
<b>Nationwide Building Society</b> 3.960% due 07/18/2030	200	210
<b>NatWest Group PLC</b> 4.800% due 04/05/2026 4.892% due 05/18/2029 5.076% due 01/27/2030	200 600 800	215 654 683
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b> 4.750% due 09/15/2025	600	630
		<b>9,808</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 4.3%</b>		
<b>Canada Square Funding PLC</b> 1.194% due 06/17/2058	GBP 672	904
<b>Eurosail PLC</b> 0.000% due 12/10/2044	EUR 5	5
<b>Eurosail-UK PLC</b> 0.255% due 03/13/2045	GBP 12	15
<b>Finsbury Square PLC</b> 0.000% due 12/16/2071	500	672
<b>Great Hall Mortgages No.1 PLC</b> 0.344% due 06/18/2039	\$ 17	17
<b>Hawksmoor Mortgages</b> 1.240% due 05/25/2053	GBP 819	1,100
<b>Lanebrook Mortgage Transaction PLC</b> 0.961% due 07/20/2058	296	394
<b>Mansard Mortgages PLC</b> 0.748% due 12/15/2049	3,072	4,065
<b>Newgate Funding PLC</b> 0.000% due 12/15/2050	EUR 49	54
<b>Paragon Mortgages No.12 PLC</b> 0.726% due 11/15/2038	\$ 29	29
<b>Pierpont BTL PLC</b> 0.000% due 12/22/2053	GBP 500	672
<b>Polaris PLC</b> 1.094% due 12/23/2058	390	522
<b>Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC</b> 0.245% due 06/12/2044	36	46
<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b> 1.133% due 03/12/2052	335	450
<b>Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC</b> 1.236% due 10/20/2051	421	568

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Tower Bridge Funding PLC</b> 1.225% due 11/20/2063		
	GBP 387	\$ 518
<b>Trinity Square PLC</b> 0.936% due 07/15/2059	926	1,244
<b>Twin Bridges PLC</b> 1.083% due 03/12/2055	383	514
		<b>11,789</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 2.8%</b>		
<b>United Kingdom Gilt</b> 0.625% due 07/31/2035 3.250% due 01/22/2044 3.500% due 01/22/2045 4.250% due 06/07/2032 4.250% due 03/07/2036 4.250% due 12/07/2040 4.500% due 09/07/2034	1,150 500 1,320 470 250 220 700	1,360 868 2,396 800 447 419 1,253
		<b>7,543</b>
<b>Total United Kingdom (Cost \$29,194)</b>		<b>29,140</b>
<b>UNITED STATES 35.0%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 0.2%</b>		
<b>Navient Private Education Refi Loan Trust</b> 2.120% due 01/15/2069	\$ 618	615
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 9.7%</b>		
<b>AbbVie, Inc.</b> 3.200% due 11/21/2029 3.850% due 06/15/2024	600 200	608 207
<b>American Airlines 2019-1 Class AA Pass-Through Trust</b> 3.150% due 02/15/2032	713	703
<b>American Tower Corp.</b> 4.000% due 06/01/2025	200	208
<b>Arrow Electronics, Inc.</b> 3.875% due 01/12/2028	200	208
<b>AT&amp;T, Inc.</b> 2.250% due 02/01/2032 3.550% due 09/15/2055	200 608	185 552
<b>Bank of America Corp.</b> 3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030	1,158 1,000	1,185 1,049
<b>BAT Capital Corp.</b> 4.540% due 08/15/2047	200	185
<b>Black Hills Corp.</b> 2.500% due 06/15/2030	600	567
<b>Boeing Co.</b> 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2031	300 300	300 303
<b>Boston Scientific Corp.</b> 4.000% due 03/01/2029	800	850
<b>Broadcom, Inc.</b> 2.450% due 02/15/2031 3.469% due 04/15/2034 4.300% due 11/15/2032	320 200 300	296 193 316
<b>Charter Communications Operating LLC</b> 3.850% due 04/01/2061 3.900% due 06/01/2052 3.950% due 06/30/2062 4.400% due 12/01/2061 4.464% due 07/23/2022	150 180 200 100 200	125 157 168 89 202

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Comcast Corp.</b>			<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>			<b>First NLC Trust</b>		
2.937% due 11/01/2056	\$ 294	\$ 248	4.150% due 01/24/2029	\$ 1,000	\$ 1,068	0.257% due 08/25/2037	\$ 78	\$ 49
<b>Crown Castle International Corp.</b>			4.478% due 04/04/2031	600	656	<b>Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates</b>		
2.250% due 01/15/2031	600	541	<b>Westinghouse Air Brake Technologies Corp.</b>			3.600% due 01/25/2029	900	970
3.700% due 06/15/2026	200	207	3.200% due 06/15/2025	500	505	<b>Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates</b>		
<b>CVS Health Corp.</b>						0.467% due 09/25/2031	116	115
4.300% due 03/25/2028	66	71				1.288% due 02/25/2045	200	203
<b>Dell International LLC</b>						1.304% due 10/25/2044	219	224
5.450% due 06/15/2023	400	417				<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>		
<b>Energy Transfer LP</b>						0.367% due 01/25/2037	254	247
4.750% due 01/15/2026	500	531				0.727% due 11/25/2045	34	31
4.950% due 05/15/2028	300	321				<b>Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates</b>		
5.150% due 03/15/2045	100	102				2.459% due 10/25/2033	5	5
<b>EPR Properties</b>						<b>GS Mortgage Securities Trust</b>		
4.500% due 06/01/2027	100	102				1.915% due 11/10/2045 (e)	4,122	19
<b>Equinix, Inc.</b>						<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>		
2.150% due 07/15/2030	300	272				1.840% due 03/25/2033	14	14
3.000% due 07/15/2050	250	210				2.908% due 09/25/2035	67	68
<b>Essential Utilities, Inc.</b>						<b>HarborView Mortgage Loan Trust (d)</b>		
3.351% due 04/15/2050	200	185				0.642% due 03/19/2036	21	21
<b>Fidelity National Financial, Inc.</b>						2.668% due 07/19/2035	30	25
5.500% due 09/01/2022	200	204				<b>Home Equity Asset Trust</b>		
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>						0.487% due 11/25/2032	1	1
4.250% due 09/20/2022	600	606				<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b>		
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>						2.929% due 12/25/2034	29	30
0.453% due 04/30/2024	EUR 500	564				<b>JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust</b>		
1.431% due 03/09/2027	\$ 1,700	1,607				3.723% due 03/15/2050	1,000	1,045
3.814% due 04/23/2029	600	623				<b>JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust</b>		
<b>HCA, Inc.</b>						3.694% due 03/15/2050	1,000	1,043
4.125% due 06/15/2029	700	735				<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>		
<b>Hyundai Capital America</b>						2.812% due 01/16/2037	600	595
0.800% due 04/03/2023	400	394				<b>JP Morgan Mortgage Trust</b>		
<b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>						1.822% due 11/25/2033	30	30
2.522% due 04/22/2031	700	670				<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>		
2.580% due 04/22/2032	900	863				0.747% due 10/25/2034	407	395
2.739% due 10/15/2030	700	685				<b>LUXE Trust</b>		
<b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>						1.241% due 10/15/2038	500	494
2.750% due 03/09/2028	200	191				<b>Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust</b>		
<b>Oracle Corp. (i)</b>						0.631% due 12/15/2030	31	30
3.950% due 03/25/2051	100	92				<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>		
4.100% due 03/25/2061	200	182				0.347% due 09/25/2037	51	29
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>						0.427% due 02/25/2037	10	4
3.500% due 08/01/2050	400	332				0.847% due 06/25/2028	5	4
3.750% due 08/15/2042	600	515				1.799% due 02/25/2033	34	33
<b>Sabine Pass Liquefaction LLC</b>						<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>		
4.500% due 05/15/2030	300	324				3.102% due 11/15/2049	500	508
5.000% due 03/15/2027	700	760				<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>		
5.750% due 05/15/2024	300	319				3.530% due 06/15/2050	400	416
<b>Southern California Edison Co.</b>						<b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>		
3.600% due 02/01/2045	300	281				0.237% due 11/25/2036	23	10
<b>Starbucks Corp.</b>						<b>Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</b>		
3.500% due 11/15/2050	300	282				2.396% due 10/25/2035	178	156
<b>Stryker Corp.</b>						<b>Reperforming Loan REMIC Trust</b>		
1.950% due 06/15/2030	800	741				0.527% due 06/25/2035 (d)	66	64
<b>T-Mobile USA, Inc.</b>								
2.550% due 02/15/2031	300	281						
3.600% due 11/15/2060	200	175						
<b>VMware, Inc.</b>								
4.700% due 05/15/2030	700	769						

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>		
0.547% due 06/25/2046	\$ 101	30
0.607% due 04/25/2046	1,493	545
<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>		
8.500% due 10/25/2031	150	162
<b>Residential Funding Mortgage Securities I Trust</b>		
2.970% due 09/25/2035 (d)	106	77
<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>		
0.317% due 05/25/2037 (d)	50	44
<b>Sequoia Mortgage Trust</b>		
0.862% due 10/19/2026	15	15
<b>Soundview Home Loan Trust</b>		
0.247% due 11/25/2036	36	14
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>		
2.278% due 04/25/2034	54	55
2.459% due 02/25/2034	46	46
<b>Structured Asset Mortgage Investments II Trust</b>		
0.407% due 09/25/2047	30	28
0.567% due 06/25/2036	50	50
0.627% due 05/25/2036	1,420	1,348
0.647% due 05/25/2045	107	104
0.662% due 07/19/2035	504	489
0.742% due 07/19/2034	2	2
0.822% due 10/19/2034	162	160
0.862% due 03/19/2034	6	6
<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>		
0.822% due 09/19/2032	29	29
<b>Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust</b>		
1.606% due 04/25/2035	79	80
<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>		
1.766% due 10/25/2043	88	89
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>		
0.767% due 10/25/2045	143	143
0.807% due 01/25/2045	49	49
0.898% due 12/25/2046	1,172	1,131
1.304% due 11/25/2042	169	167
1.473% due 02/27/2034	5	5
1.504% due 06/25/2042	2	2
1.504% due 08/25/2042	44	44
2.361% due 03/25/2033	162	163
2.441% due 03/25/2034	89	92
2.580% due 06/25/2033	24	24
2.723% due 08/25/2034	155	159
	<b>15,645</b>	
<b>MUNICIPAL BONDS &amp; NOTES 0.7%</b>		
<b>Macopin, Illinois, Pasadena Public Financing Authority Revenue Bonds, Series 2010</b>		
7.148% due 03/01/2043	1,140	1,773
<b>U.S. GOVERNMENT AGENCIES 10.5%</b>		
<b>Fannie Mae</b>		
0.168% due 07/25/2037	4	4
0.238% due 03/25/2036	2	2
0.307% due 03/25/2034	7	7
0.458% due 09/25/2042	8	8
0.537% due 03/25/2044	21	21
0.587% due 06/25/2029	6	6
1.288% due 07/01/2044	149	153
1.288% due 10/01/2044	6	6
1.640% due 12/01/2034	22	23
1.863% due 10/01/2035	8	8
1.687% due 04/25/2024	4	4

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
1.740% due 01/01/2036	\$ 9	9
1.907% due 05/25/2035	23	24
1.979% due 07/01/2035	18	18
2.030% due 11/01/2035	6	6
2.085% due 10/01/2035	8	8
2.423% due 11/01/2034	126	133
2.500% due 02/01/2043	1,549	1,545
3.000% due 02/01/2046	60	61
3.000% due 10/01/2046	778	794
3.500% due 04/01/2048	1,502	1,557
3.500% due 06/01/2048	1,090	1,129
3.500% due 02/01/2050	568	588
4.000% due 01/01/2041	2	2
4.000% due 10/01/2041	74	79
4.000% due 03/01/2048	1,340	1,407
4.000% due 08/01/2048	289	308
4.000% due 09/01/2048	805	843
4.000% due 10/01/2048	417	439
4.000% due 04/01/2049	180	188
4.500% due 11/01/2023	2	2
6.000% due 04/25/2043	51	56
6.000% due 02/25/2044	42	47
6.500% due 06/25/2044	49	55
<b>Fannie Mae, TBA (f)</b>		
2.500% due 03/01/2052	3,400	3,355
3.000% due 05/15/2042	2,200	2,212
4.000% due 04/01/2052	9,300	9,699
<b>Freddie Mac</b>		
1.976% due 06/01/2035	14	14
1.981% due 08/01/2035	10	11
2.000% due 03/01/2035	5	5
2.021% due 09/01/2035	7	7
2.350% due 01/01/2034	28	29
4.000% due 09/01/2039	73	78
4.000% due 09/01/2048	160	169
4.000% due 12/01/2048	269	281
6.000% due 04/15/2036	17	20
<b>Ginnie Mae</b>		
1.750% due 11/20/2030	7	7
3.000% due 11/20/2046	485	497
3.000% due 04/20/2047	106	109
3.500% due 12/20/2047	1,534	1,600
5.500% due 08/20/2035	718	784
<b>Small Business Administration</b>		
4.625% due 02/01/2025	7	7
4.760% due 09/01/2025	72	73
5.090% due 10/01/2025	31	32
5.980% due 05/01/2022	1	1
	<b>28,530</b>	
<b>U.S. TREASURY OBLIGATIONS 8.2%</b>		
<b>Treasury Inflation Protected Securities</b>		
1.000% due 02/15/2049 (c)	443	581
<b>U.S. Treasury Bonds</b>		
1.625% due 11/15/2050	3,050	2,673
1.875% due 02/15/2041	5,000	4,702
2.000% due 11/15/2041	4,300	4,118
2.500% due 02/15/2045	2,600	2,685
2.875% due 08/15/2045	1,600	1,766
3.125% due 08/15/2044	400	458
4.375% due 05/15/2041	1,100	1,472
<b>U.S. Treasury Strips</b>		
0.000% due 05/15/2026 (e)	4,300	4,004
	<b>22,459</b>	

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Total United States (Cost \$97,995)</b>	\$	<b>95,309</b>
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 16.0%</b>		
<b>TIME DEPOSITS 0.8%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
(0.220%) due 03/01/2022	AUD 154	112
0.005% due 03/01/2022	\$ 3	3
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
0.005% due 03/01/2022	1	1
0.005% due 03/01/2022	CAD 11	9
<b>BNP Paribas Bank</b>		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR 1	1
(0.740%) due 03/01/2022	DKK 820	124
(0.340%) due 03/01/2022	¥ 5,386	47
(0.300%) due 03/01/2022	SEK 56	6
(0.220%) due 03/01/2022	AUD 72	52
0.005% due 03/01/2022	\$ 122	122
0.005% due 03/01/2022	CAD 115	91
0.005% due 03/01/2022	HKD 20	3
0.070% due 03/01/2022	NOK 79	9
0.070% due 03/01/2022	SGD 19	14
0.690% due 03/01/2022	GBP 2	3
0.150% due 03/01/2022	NZD 57	38
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
(0.340%) due 03/01/2022	¥ 3	0
<b>Citibank N.A.</b>		
0.005% due 03/01/2022	\$ 157	157
<b>Credit Suisse AG</b>		
(1.450%) due 03/01/2022	CHF 66	72
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
0.005% due 03/01/2022	\$ 31	31
<b>HSBC Bank</b>		
0.005% due 03/01/2022	HKD 1	0
<b>HSBC Bank PLC</b>		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR 43	49
0.090% due 03/01/2022	GBP 4	5
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
0.005% due 03/01/2022	\$ 36	36
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.340%) due 03/01/2022	¥ 5,158	45
<b>Royal Bank of Canada</b>		
0.005% due 03/01/2022	\$ 312	312
0.005% due 03/01/2022	CAD 52	41
<b>Suitomoto Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR 91	102
(0.340%) due 03/01/2022	¥ 3,332	29
0.005% due 03/01/2022	\$ 490	490
0.005% due 03/01/2022	GBP 9	12
<b>Suitomoto Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR 2	2
(0.340%) due 03/01/2022	¥ 182	2
0.005% due 03/01/2022	\$ 23	23
0.090% due 03/01/2022	GBP 45	60
	<b>2,103</b>	
<b>ISRAEL TREASURY BILLS 0.6%</b>		
(0.037%) due 03/02/2022 (g)	ILS 5,700	1,778

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>JAPAN TREASURY BILLS (h) 7.3%</b>		
(0.155%) due 03/14/2022	¥ 510,000	\$ 4,428
(0.118%) due 03/28/2022	750,000	6,512
(0.105%) due 04/11/2022	700,000	6,079
(0.097%) due 05/16/2022	320,000	2,779
		<b>19,798</b>
<b>U.S. TREASURY BILLS 7.0%</b>		
0.021% due 03/10/2022 (h)	4,900	4,900
0.048% due 03/31/2022 (g)	3,000	3,000
0.055% due 04/07/2022 (h)	2,800	2,800
0.120% due 04/14/2022 (h)(m)	2,100	2,100
0.337% due 05/26/2022 (g)(m)	6,300	6,295
		<b>19,095</b>
<b>U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS 0.3%</b>		
0.200% due 05/17/2022 (h)(k)(m)	\$ 800	799
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<b>43,573</b>
(Cost \$43,661)		
<b>Total Investments in Securities 104.4%</b>	\$	<b>284,372</b>
(Cost \$292,743)		
<b>Financial Derivative</b>		
Instruments (j)(l) (0.1%)		(198)
(Cost or Premiums, net \$(194))		
<b>Other Assets and Liabilities, net (4.3%)</b>		<b>(11,774)</b>
<b>Net Assets 100.0%</b>	\$	<b>272,400</b>

**NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (AMOUNTS IN THOUSANDS\*, EXCEPT NUMBER OF CONTRACTS):**

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Contingent convertible security.  
 (b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.  
 (c) Principal amount of security is adjusted for inflation.  
 (d) Security is in default.  
 (e) Security is an Interest Only ("IO") or IO Strip.  
 (f) When-Issued security.  
 (g) Coupon represents a weighted average yield to maturity.  
 (h) Coupon represents a yield to maturity.

**(i) RESTRICTED SECURITIES:**

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	09/01/2021	\$ 206	\$ 188	0.07%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	09/01/2021	111	92	0.03%
Oracle Corp.	4.100%	03/25/2061	04/15/2021	213	182	0.07%
<b>Total Restricted Securities</b>				<b>\$ 530</b>	<b>\$ 462</b>	<b>0.17%</b>

**BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS**

**SHORT SALES:**

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	額面金額	収益	ショートによる支払
BOS	Fannie Mae, TBA	2.000%	04/01/2052	\$ 7,000	\$ (6,657)	\$ (6,701)
BOS	Fannie Mae, TBA	3.500%	04/01/2052	600	(615)	(617)
MSC	Fannie Mae, TBA	3.500%	04/01/2052	1,900	(1,942)	(1,952)
<b>Total Short Sales (3.4%)</b>					<b>\$ (9,214)</b>	<b>\$ (9,270)</b>

**BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY**

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of February 28, 2022:

取引相手	レボ契約の 受取	リバースレボの 支払	売付買戻取引の 支払	空売りの 支払	会計借入 その他金融取引	担保の(受取)/ 差入れ	ネットエクス ポージャー <sup>(f)</sup>
Master Securities Forward Transactions Agreement							
BOS	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (7,318)	\$ (7,318)	\$ 0	\$ (7,318)
MSC	0	0	0	(1,952)	(1,952)	0	(1,952)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (9,270)</b>			

<sup>(f)</sup> Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 28, 2022 was \$137 at a weighted average interest rate of (0.180%). Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

**(j) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED**

**FUTURES CONTRACTS:**

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Australia Government 3-Year Bond March Futures	Short	03/2022	232	\$ 186	\$ 0	\$ (42)
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Long	06/2022	38	35	25	0
Euro-Bobl 5-Year Note June Futures	Short	06/2022	26	(10)	0	(11)
Euro-BTP 10-Year Bond March Futures	Long	03/2022	114	(1,072)	79	0
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03/2022	136	992	0	(17)
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Long	06/2022	30	7	7	0
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03/2022	11	(216)	0	(1)
Euro-OAT 10-Year Bond March Futures	Long	03/2022	36	(325)	12	0
Euro-Schatz 2-Year Note March Futures	Long	03/2022	114	(27)	21	0
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Long	06/2022	11	3	6	0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Short	06/2022	31	(19)	0	(24)
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2022	206	198	242	0
U.S. Treasury 20-Year Bond June Futures	Short	06/2022	31	(74)	0	(94)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note June Futures	Short	06/2022	14	(26)	0	(28)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Long	06/2022	9	22	40	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2022	16	(10)	0	(9)
Call Option Strike @ EUR 166.000 on Euro-Bund 10-Year Bond April 2022 Futures <sup>(1)</sup>	Short	03/2022	3	2	0	(4)
Put Option Strike @ EUR 166.000 on Euro-Bund 10-Year Bond April 2022 Futures <sup>(1)</sup>	Short	03/2022	3	(3)	0	(5)
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (337)</b>	<b>\$ 432</b>	<b>\$ (235)</b>

**SWAP AGREEMENTS:**

**CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(2)</sup>**

参照債券	固定受取金利	満期日	2022年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(4)</sup>	想定元本 <sup>(5)</sup>	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Boeing Co.	1.000%	06/20/2022	0.421%	\$ 100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2023	0.631%	200	2	1	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2023	0.693%	100	1	0	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	1.127%	300	(1)	0	0	0
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	1.553%	EUR 200	(7)	(4)	1	0
General Electric Co.	1.000%	06/20/2026	0.770%	\$ 500	5	2	0	0
					<b>\$ 0</b>	<b>\$ (1)</b>	<b>\$ 1</b>	<b>\$ 0</b>

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - BUY PROTECTION<sup>(1)</sup>

参照指標	固定(支払) 金利	満期日	想定元本 <sup>(2)</sup>	市場価格 <sup>(3)</sup>	未実現評価(損)益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2026	\$ 2,800	\$ (47)	\$ 9	\$ 1	\$ 0

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>(2)</sup>

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(2)</sup>	市場価格 <sup>(3)</sup>	未実現評価(損)益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.IG-28 Index	1.000%	06/20/2027	\$ 1,300	\$ 3	\$ 11	\$ 0	\$ 0
CDX.IG-35 Index	1.000%	12/20/2030	100	1	0	0	0
CDX.IG-36 Index	1.000%	06/20/2031	300	(1)	(4)	0	(1)
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2031	4,200	(18)	(51)	0	(6)
				\$ (15)	\$ (44)	\$ 0	\$ (7)

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	0.900%	03/10/2024	CAD 4,200	\$ (63)	\$ (64)	\$ 7	\$ 0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	1.900%	12/18/2029	4,700	(86)	(233)	26	0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	12/18/2049	1,800	(98)	(137)	19	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	0.528%	03/17/2024	NZD 700	(20)	(20)	0	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024	12,600	(368)	(337)	0	(7)
Receive	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	0.500%	12/16/2025	600	36	38	0	0
Receive	3-Month SEK-STIBOR	0.750%	03/21/2023	SEK 800	(1)	(1)	0	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.498%	01/25/2027	\$ 3,000	(42)	(42)	21	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.665%	01/12/2029	4,300	(51)	(51)	43	0
Receive	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	AUD 900	(37)	23	0	(1)
Pay	6-Month Australian Bank Bill	1.000%	12/15/2026	6,600	(242)	(231)	17	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	900	(15)	(15)	3	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032	1,900	(36)	(36)	6	0
Pay <sup>(7)</sup>	6-Month EURIBOR (0.250%)	0.250%	03/16/2027	EUR 16,800	(755)	(606)	28	0
Pay <sup>(7)</sup>	6-Month EURIBOR	0.250%	03/16/2032	10,700	(704)	(927)	0	(36)
Pay <sup>(7)</sup>	6-Month EURIBOR	0.250%	09/21/2032	2,700	(205)	(183)	0	(10)
Receive <sup>(7)</sup>	6-Month EURIBOR	0.500%	03/16/2052	1,000	97	139	5	0
Receive <sup>(7)</sup>	6-Month EURIBOR	0.500%	09/21/2052	900	91	121	5	0
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.000%	03/17/2022	¥ 70,000	0	0	0	0
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.000%	05/12/2022	115,000	0	0	0	0
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.000%	06/16/2022	115,000	0	0	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.000%	09/16/2025	PLN 2,700	(42)	(1)	0	(7)
Pay	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.000%	03/17/2022	¥ 70,000	0	0	0	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.000%	05/12/2022	115,000	0	0	0	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.000%	06/16/2022	115,000	0	0	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.143%	02/19/2031	300,000	23	23	0	(1)
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.383%	11/12/2050	115,000	97	97	2	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.250%	12/16/2050	115,000	134	94	40	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.350%	03/17/2051	70,000	65	49	17	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.450%	06/16/2051	10,000	5	7	0	0
Receive <sup>(7)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	0.400%	12/15/2051	\$ 179,000	(130)	(114)	0	(4)
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.320%	12/21/2023	\$ 8,300	35	(17)	0	(16)
Pay <sup>(7)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.010%	02/07/2023	GBP 6,500	(107)	(107)	5	0
Receive <sup>(7)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.500%	03/16/2027	1,800	(122)	(113)	9	0
Receive <sup>(7)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.750%	03/16/2032	300	26	18	0	0

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	Swiss Overnight Rate Average	(0.500%)	09/15/2026	CHF 5,500	\$ (158)	\$ (171)	\$ 12	\$ 0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	11/15/2030	GBP 1,700	(397)	(376)	22	0	
						\$ (3,070)	\$ (3,173)	\$ 287	\$ (82)
<b>Total Swap Agreements</b>						<b>\$ (3,132)</b>	<b>\$ (3,209)</b>	<b>\$ 289</b>	<b>\$ (89)</b>

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 28, 2022:

- (k) **Securities with an aggregate market value of \$734 and cash of \$2,621 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 28, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.**

市場価格	金融派生商品資産				市場価格	金融派生商品負債			
	変動証拠金					変動証拠金			
	買い オプション	先物	スワップ	合計		売り オプション	先物	スワップ	合計
<b>Total Exchange-Traded or Centrally Cleared</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 432</b>	<b>\$ 289</b>	<b>\$ 721</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (235)</b>	<b>\$ (89)</b>	<b>\$ (324)</b>	

<sup>(1)</sup> Future styled option.

<sup>(2)</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(3)</sup> If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(4)</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(5)</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

<sup>(6)</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(7)</sup> This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

(l) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価(損)益			
						資産	負債		
AZD	04/2022	\$	5,462	JPY	630,000	\$	13	\$	0
BOA	03/2022	JPY	750,000	\$	6,616		101		0
BOA	03/2022		510,000		4,516		86		0
BOA	03/2022	\$	1,315	NOK	11,822		30		0
BOA	04/2022	DKK	13,750	\$	2,172		93		0
BOA	05/2022	\$	1,177	SEK	11,028		0		(7)
BPS	03/2022	AUD	661	\$	470		0		(10)
BPS	03/2022	CAD	199		156		0		0
BPS	03/2022	GBP	699		950		12		0
BPS	04/2022	DKK	3,745		573		6		0
BPS	04/2022	\$	429	DKK	2,795		0		(6)
BPS	05/2022		46,868	EUR	41,309		0		(334)
CBK	03/2022	ILS	3,301	\$	996		0		(34)
CBK	03/2022	NZD	1,493		987		0		(23)
CBK	03/2022	\$	394	AUD	545		2		0
CBK	03/2022		892	GBP	657		0		(11)
CBK	04/2022	DKK	11,960	\$	1,876		68		0
CBK	05/2022	\$	3,116	EUR	2,745		0		(24)
DUB	03/2022	AUD	2,060	\$	1,454		0		(41)
DUB	03/2022	\$	13	PLN	52		0		(1)
GLM	03/2022	ILS	2,401	\$	731		0		(18)
GLM	03/2022	\$	5	ILS	15		0		0
GLM	03/2022		691	NZD	1,038		12		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益			
				資産	負債		
GLM	03/2022	\$	PLN 31	\$	0	\$	0
GLM	04/2022	JPY 1,330,000	\$	11,483	0		(75)
HUS	03/2022	\$	SGD 21		0		0
HUS	04/2022	DKK 3,870	\$	602	17		0
HUS	04/2022	\$	DKK 1,940		0		(10)
JPM	03/2022	GBP 186	\$	253	3		0
JPM	03/2022	\$	CAD 898		3		0
JPM	03/2022		GBP 237		0		(3)
JPM	03/2022		HKD 461		0		0
JPM	03/2022		NZD 1,098		12		0
JPM	04/2022	DKK 1,060	\$	162	2		0
JPM	05/2022	EUR 300		342	4		0
MBC	03/2022	\$	JPY 20,019		1		0
MBC	05/2022	JPY 320,000	\$	2,788	5		0
MYI	03/2022	GBP 197		264	0		0
MYI	03/2022	JPY 50,166		436	1		0
MYI	03/2022	SGD 73		54	0		0
MYI	03/2022	\$	AUD 2,884		29		0
MYI	04/2022	AUD 2,884	\$	2,064	0		(29)
MYI	04/2022	DKK 43,392		6,837	277		0
MYI	04/2022	GBP 60		81	0		0
MYI	04/2022	\$	DKK 5,042		0		0
MYI	05/2022	EUR 265	\$	299	0		0
MYI	05/2022	\$	EUR 154		0		(2)
RBC	05/2022		CHF 1,565		14		0
SCX	03/2022	GBP 5,207	\$	6,985	0		(2)
SCX	03/2022	JPY 351,829		3,054	0		(1)
SCX	04/2022	GBP 5,395		7,241	0		0
SCX	04/2022	JPY 380,423		3,305	0		0
SDG	03/2022	AUD 1,252		877	0		(32)
TOR	03/2022			592	0		(23)
TOR	03/2022	CAD 10,840		8,547	0		0
TOR	03/2022	\$	AUD 17,555		145		0
TOR	03/2022		CAD 10,219		22		0
TOR	04/2022	AUD 17,555	\$	12,598	0		(147)
TOR	04/2022	\$	CAD 10,838		0		0
UAG	03/2022	AUD 18,145	\$	12,859	0		(307)
				\$	958	\$	(1,140)

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益				
				資産	負債			
BOA	03/2022	CAD 2	\$	1	\$	0	\$	0
BOA	03/2022	CHF 57		62		0		0
BPS	03/2022	\$ 15	EUR 13			0		0
BPS	03/2022		GBP 2			0		0
BRC	03/2022	JPY 262,710	\$	2,281		0		0
BRC	03/2022	\$ 2,526	JPY 290,953			0		0
BRC	04/2022		262,533			0		0
CBK	03/2022	AUD 51	\$	36		0		(1)
CBK	03/2022	JPY 5,619		49		0		0
CBK	03/2022	NZD 25		17		0		0
CBK	03/2022	SEK 465		50		1		0
MYI	03/2022	DKK 156		24		0		0
MYI	03/2022	JPY 56,215		489		1		0
MYI	03/2022	\$ 18	CAD 23			0		0
MYI	03/2022		CHF 9			0		0
MYI	03/2022		EUR 43			0		0
MYI	03/2022		GBP 29			0		0
MYI	03/2022		SGD 31			0		0
MYI	04/2022	SGD 31	\$	23		0		0
MYI	04/2022	\$ 183	JPY 20,959			0		(1)
NAB	03/2022	JPY 313,131	\$	2,719		0		0
NAB	03/2022	\$ 2,809	JPY 323,624			1		0
NAB	04/2022		312,920			0		0

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	数量	受取通貨	未実現評価(損)益	
					資産	負債
SCX	03/2022	EUR	2,155	\$ 2,417	\$ 0	\$ (3)
SCX	03/2022	GBP	398	534	0	0
SCX	03/2022	JPY	313,131	2,719	0	0
SCX	03/2022	\$	2,406	EUR 2,142	0	(1)
SCX	03/2022	\$	513	GBP 382	0	0
SCX	03/2022	\$	2,809	JPY 323,624	1	0
SCX	04/2022	EUR	2,112	\$ 2,375	0	0
SCX	04/2022	GBP	382	513	0	0
SCX	04/2022	\$	2,719	JPY 312,920	0	0
SOG	03/2022	AUD	99	\$ 70	0	(3)
SOG	03/2022	SGD	32	23	0	0
TOR	03/2022	AUD	67	47	0	(2)
TOR	03/2022	CAD	398	313	0	(1)
TOR	03/2022	JPY	5,149	45	0	0
TOR	03/2022	\$	122	AUD 170	1	0
TOR	03/2022	\$	313	CAD 397	0	0
TOR	04/2022	AUD	170	\$ 122	0	(1)
TOR	04/2022	CAD	397	313	0	0
TOR	04/2022	\$	45	JPY 5,146	0	0
					\$ 5	\$ (13)
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>					\$ <b>963</b>	\$ <b>(1,153)</b>

PURCHASED OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	支払/受取 変動金利	権利行使 レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	コスト	市場価格
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.000%	03/15/2023	600	\$ 67	\$ 164
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.000%	03/15/2023	300	35	82
<b>Total Purchased Options</b>							\$ <b>102</b>	\$ <b>246</b>

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	支払/受取 変動金利	権利行使 レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	(0.175%)	03/15/2023	1,900	\$ (69)	\$ (250)
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.450%	05/09/2022	1,400	(6)	(6)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.650%	05/09/2022	1,400	(12)	(10)
DUB	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.350%	08/08/2022	500	(2)	(2)
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.550%	08/08/2022	500	(2)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0.870%	11/02/2022	29,000	(59)	(9)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	1.270%	11/02/2022	29,000	(59)	(218)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	1.685%	03/07/2022	3,100	(15)	(11)
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.450%	04/08/2022	1,500	(5)	(5)
JPM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.650%	04/08/2022	1,500	(9)	(7)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	(0.175%)	03/15/2023	700	(26)	(92)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	1.655%	05/02/2022	500	(7)	(7)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	1.655%	05/02/2022	500	(7)	(8)
							\$ (278)	\$ (627)

CREDIT DEFAULT SWAPIONS

取引相手	銘柄	売/買 プロテクション	権利行使 レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
BOA	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	0.850%	04/20/2022	600	(1)	(1)
BOA	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	1.000%	06/15/2022	300	(1)	(1)
BRC	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	0.900%	04/20/2022	900	(1)	(1)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	0.850%	05/18/2022	1,600	(2)	(5)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	1.000%	06/15/2022	900	(2)	(3)
CBK	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	0.850%	05/18/2022	900	(1)	(3)
DUB	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.100%	06/15/2022	800	(2)	(1)
JPM	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	0.950%	04/20/2022	900	(1)	(1)

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	売/買 プロテクション	権利行使 レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム (受取)	市場価格
JPM	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.000%	06/15/2022	800	\$ (1)	\$ (2)
MYC	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	0.950%	04/20/2022	1,000	(1)	(1)
MYC	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.100%	06/15/2022	800	(2)	(1)
MYC	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.200%	06/15/2022	200	0	0
MYC	Put - iTraxx Europe Series 36 Index	Sell	0.850%	04/20/2022	1,900	(3)	(4)
<b>Total Written Options</b>						\$ (18)	\$ (24)
						<b>\$ (296)</b>	<b>\$ (651)</b>

<sup>(1)</sup> Notional amount represents the number of contracts.