当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	· 迫加刑执信 / 海丛 / 信坐
運用方針	無期限(2004年1月16日設定) 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 J アグリゲイト アクス・ジャパン インカム ファーバル ファンド オクス・ジボルン インカム ファーバル ファンド オクス・ジボンタ インカム ファーバル ファンド オクス・ジボンタ (ABS) 等に正義 (MBS) では、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きなでは、大きないでは、大きなでは、大きないが、大きないでは、大きないは、大きないいは、大きないは、はいは、大きないは、大きないは、はいは、はいはないは、はいは、はいはいは、はいはいは、はいは、はいはいはいは、はいはいは、はい
主要運用対象	ピムコ ハイ・インカム 毎月 月
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	不真足及注。今の上房区資味では、またで、 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 沢動向等を勘案して、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 (為替ヘッジ付き)



第223期(決算日:2022年8月15日) 第224期(決算日:2022年9月15日) 第225期(決算日:2022年10月17日) 第226期(決算日:2022年11月15日) 第227期(決算日:2022年12月15日) 第228期(決算日:2023年1月16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(為替ヘッジ付き)」は、去る1月16日 に第228期の決算を行いましたので、法令に基づいて 第223期~第228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

お客さま専用 フリーダイヤル 0 1 2 0 - 1 5 1 0 3 4

(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)

お客さまのお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。

〇最近30期の運用実績

			基	進	価	額	合 成	指数	投 資 信 託	
決	算	期			み其		口	期中	投資信託	純資産
	21	791	(分配落)		金属	落 率		騰落率	証券組入比率	総額
			円		円 一	%		%	%	百万円
199期	[(2020年8]	月17日)	8, 165]	.0	1. 7	205. 31	1.5	99. 0	2, 320
200期](2020年9	月15日)	8, 192]	.0	0.5	206.02	0.3	96. 8	2, 279
201期](2020年10	月15日)	8, 209]	.0	0.3	206. 89	0.4	99. 2	2, 179
202期](2020年11	月16日)	8, 242	1	.0	0.5	208.07	0.6	99. 4	2, 159
203期	[(2020年12	月15日)	8, 347]	.0	1. 4	210.85	1. 3	99. 2	2, 178
204期](2021年1	月15日)	8, 343	1	.0	0. 1	211.04	0.1	99. 3	2, 124
205期](2021年2	月15日)	8, 355]	.0	0.3	211. 27	0.1	99. 1	2,095
206期](2021年3	月15日)	8, 220	1	.0	△1.5	208. 40	△1.4	98. 9	2, 041
207期](2021年4.	月15日)	8, 238]	.0	0.3	209.63	0.6	99. 0	2,050
208期](2021年5	月17日)	8, 221	1	.0	△0.1	209. 44	△0.1	99. 0	2, 036
209期](2021年6	月15日)	8, 293	1	.0	1.0	211. 56	1.0	98. 6	2,040
210期](2021年7	月15日)	8, 309	1	.0	0.3	213.08	0.7	99. 3	2,023
211期](2021年8	月16日)	8, 316	1	.0	0.2	213.66	0.3	99. 1	2,021
212期](2021年9	月15日)	8, 336	1	.0	0.4	214. 69	0.5	99. 1	2,020
213期](2021年10	月15日)	8, 238	1	.0	$\triangle 1.1$	212. 51	△1.0	99. 2	1, 976
214期](2021年11.	月15日)	8, 225]	.0	△0.0	212. 92	0.2	99. 1	1, 957
215期](2021年12	月15日)	8, 215]	.0	0.0	213. 15	0.1	99. 4	1,940
216期](2022年1	月17日)	8, 126]	.0	△1.0	210. 96	△1.0	99. 4	1, 924
217期](2022年2	月15日)	7, 849]	.0	△3.3	204. 26	△3. 2	99. 0	1,847
218期](2022年3	月15日)	7, 696	1	.0	△1.8	200. 81	△1.7	99. 0	1, 799
219期](2022年4)	月15日)	7, 559	1	.0	△1. 7	197. 56	△1.6	98. 9	1, 748
220期](2022年5	月16日)	7, 350]	.0	$\triangle 2.6$	192. 53	$\triangle 2.5$	99. 3	1,687
221期](2022年6	月15日)	7, 069]	.0	△3. 7	184. 87	△4. 0	99. 0	1,613
222期](2022年7)	月15日)	7, 120]	.0	0.9	187. 24	1. 3	98. 9	1,571
223期	[(2022年8]	月15日)	7, 359	1	.0	3. 5	193. 33	3. 3	99. 3	1,611
224期	(2022年9	月15日)	7, 058		.0	△4.0	185. 55	△4. 0	99. 2	1, 531
225期	(2022年10	月17日)	6, 724	1	.0	△4.6	177. 29	△4. 5	99. 0	1, 454
226期	(2022年11	月15日)	6, 909]	.0	2.9	182. 24	2.8	99. 3	1, 485
227期	1(2022年12	月15日)	7, 052]	.0	2. 2	186. 53	2.3	99. 2	1,508
228期	1(2023年1	月16日)	7, 060		.0	0.3	186. 99	0.3	99. 3	1, 481

- (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、円ヘッジベース)×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(円ヘッジベース)×50%の合成指数です。ただし、設定から2013年10月15日までは、 $\operatorname{Bof} A$ 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、円ヘッジベース) $\times 50\%$ +バークレイズ・グローバル総合 (日本円除く) インデックス (円ヘッジベース) ×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、円ヘッジベース)×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(円ヘッジベース)×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、円ヘッジベース)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 UF I 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(円ヘッジベース)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・ピ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UFI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。

〇当作成期中の基準価額と市況等の推移

νh	算	期	年 月 日	基 準	価	額	合 成	指 数	投資信託
決	异	别	年 月 日		騰落	率		騰落率	証券と
			(期 首)	円		%		%	%
			2022年7月15日	7, 120		_	187. 24	_	98. 9
	第223期		7月末	7, 324		2.9	192. 40	2.8	99. 4
			(期 末)						
			2022年8月15日	7, 369		3.5	193. 33	3. 3	99. 3
			(期 首)						
			2022年8月15日	7, 359		_	193. 33	_	99. 3
	第224期		8月末	7, 144		△2.9	187. 66	△2. 9	99. 2
			(期 末)						
			2022年9月15日	7, 068		△4.0	185. 55	△4. 0	99. 2
			(期 首)						
			2022年9月15日	7, 058		_	185. 55	_	99. 2
	第225期		9月末	6, 787		△3.8	178. 62	△3. 7	99. 0
			(期 末)						
			2022年10月17日	6, 734		$\triangle 4.6$	177. 29	△4. 5	99. 0
			(期 首)						
			2022年10月17日	6, 724		_	177. 29	_	99. 0
	第226期		10月末	6, 846		1.8	180. 88	2.0	99. 4
			(期 末)						
			2022年11月15日	6, 919		2.9	182. 24	2.8	99. 3
			(期 首)						
			2022年11月15日	6, 909		_	182. 24	_	99. 3
	第227期		11月末	6, 968		0.9	183. 97	0.9	98. 9
			(期 末)						
			2022年12月15日	7,062		2.2	186. 53	2. 3	99. 2
			(期 首)						
			2022年12月15日	7, 052			186. 53	_	99. 2
	第228期		12月末	6, 881		$\triangle 2.4$	182. 00	△2. 4	99. 1
			(期 末)						
			2023年1月16日	7,070		0.3	186. 99	0. 3	99. 3

⁽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。

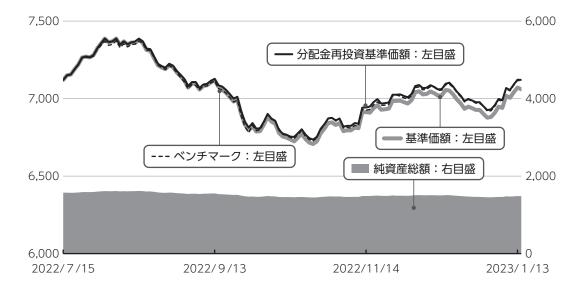
運用経過

第223期~第228期:2022年7月16日~2023年1月16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

(円)	(百万円)
8,000 —	8,000



第223期首	7,120円
第228期末	7,060円
既払分配金	60円
騰落率	0.0%

(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

基準価額は期間の初めに比べ0.0%(分配金再投資ベース)と概 ね横ばいとなりました。

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(-0.1%)を 0.1%上回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

高利回り債券市況が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

投資適格債券市況が下落したことや、為替ヘッジコスト等が基準 価額の下落要因となりました。 第223期~第228期:2022年7月16日~2023年1月16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上昇しました。

高利回り債券市況は、米欧中銀による積極的な利上げ姿勢を背景に、企業収益が 圧迫されるとの懸念が高まった局面等で スプレッド(国債に対する上乗せ金利) が拡大した一方、一部の物価指標が市場 予想を下回り米国の利上げペースが鈍化 するとの観測が高まった局面等でスプ レッドは縮小しました。当期間を通じて みるとスプレッドは縮小し、高利回り債 券市況は上昇しました。

▶ 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、世界的なインフレ への懸念や、米欧中銀による積極的な利 上げ姿勢等が下落要因となった一方、米 国の利上げペースが鈍化するとの観測等 が上昇要因となりました。当期間を通じ てみると、投資適格債券市況は下落しま 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(為替ヘッジ付き)

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12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5.2%、フレディ・マックは2.8%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ヘッジ

当期間では、多くの企業が手元資金の確保に努めてきている一方で、米欧中銀による積極的な金融引き締めなどを受けて、企業収益が圧迫される可能性が高まっている点には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、経済活動の再開以降に個人 消費が持ち直していることなどから消費 財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した。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持し、 為替変動リスクの低減を図りました。

▶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へッジ 当期間では、インフレ率の上昇や主要中 銀による急速な金融引き締めに加え、ロシアによるウクライナ侵攻といった地政 学リスクの高まりを受けて、先進国を中心に今後景気後退に陥る可能性が高まってい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

セクター戦略については、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。

整しました。

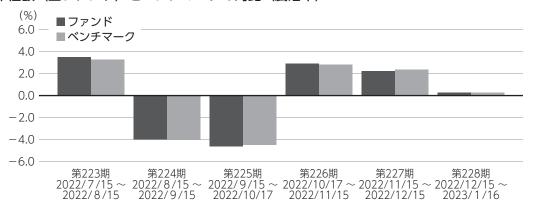
外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持し、

為替変動リスクの低減を図りました。

第223期~第228期:2022/7/16~2023/1/16

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(為替ヘッジ付き)

ファンドの騰落率はベンチマークの騰落率(-0.1%)を0.1%上回りました。

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へッジ (プラス要因)

医薬品セクターや通信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)

包装・梱包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ヘッジ

(プラス要因)

米国や欧州のデュレーション(平均回収期間や金利感応度)をアンダーウェイトとしていたこと。

(マイナス要因)

デンマークのカバードボンドへの投資をしたこと。

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した。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223期 2022年7月16日~ 2022年8月15日	第224期 2022年8月16日~ 2022年9月15日	第225期 2022年9月16日~ 2022年10月17日	第226期 2022年10月18日~ 2022年11月15日	第227期 2022年11月16日~ 2022年12月15日	第228期 2022年12月16日~ 2023年1月16日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 (0.136%)	10 (0.141%)	10 (0.149%)	10 (0.145%)	10 (0.142%)	10 (0.141%)
当期の収益	10	9	9	10	10	6
当期の収益以外		1	0			3
翌期繰越分配対象額	476	475	475	485	488	486

⁽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(為替ヘッジ付き)
 - 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 JPYヘッジ

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、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。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リ スクについては、為替予約取引を活用し てほぼ100%ヘッジした状態を維持する 方針です。

▶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 JPYヘッジ

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。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リ スクについては、為替予約取引を活用し てほぼ100%ヘッジした状態を維持する 方針です。

2022年7月16日~2023年1月16日

🌎 1万口当たりの費用明細

項目	第223期~	~第228期	項目の概要
	金額(円)	比率 (%)	- 現日の概安
(a)信 託 報 酬	51	0.725	(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)	(29)	(0.418)	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)	(0.279)	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)	(0.028)	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	51	0.727	

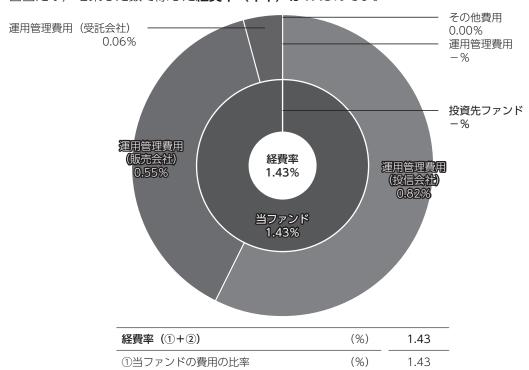
作成期中の平均基準価額は、7.017円です。

- (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。



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。

〇売買及び取引の状況

(2022年7月16日~2023年1月16日)

投資信託証券

	銘 柄			第223期~第228期						
			買		付		売		付	
			П	数	金	額	П	数	金	額
玉				千口		千円		千口		千円
	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲハ	イト エクス・シャパン インカム ファント JPYヘッシ		3		34, 488		5		46,500
内	ピムコ ケイマン グローバル	ハイ インカム ファンド JPYヘッジ		2		18,081		12		77, 241
	合	計		6		52, 569		17	•	123, 741

⁽注) 金額は受渡代金。

〇利害関係人との取引状況等

(2022年7月16日~2023年1月16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

(2023年1月16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222期	期末	第228期末					
更白	173	П	数	П	数	評 価 額	比	率	
			千口		千口	千円		%	
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ヘッジ		80		79	724, 477		48.9	
ピムコ ケイマン グローバル ハ	イ インカム ファンド JPYヘッジ		126		117	747, 029		50.4	
合	計		207		196	1, 471, 506		99.3	

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

○投資信託財産の構成

(2023年1月16日現在)

項	П	第228期末						
- 現	目	評	価	額	比	率		
				千円		%		
投資信託受益証券				1, 471, 506		99. 0		
コール・ローン等、その他				14, 382		1. 0		
投資信託財産総額				1, 485, 888		100. 0		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

		1 11. 11-1	re 11= 1	77. 11= 1	77. 11- 1	re. 11= 1	
	項目	第223期末	第224期末	第225期末	第226期末	第227期末	第228期末
	· 有	2022年8月15日現在	2022年9月15日現在	2022年10月17日現在	2022年11月15日現在	2022年12月15日現在	2023年1月16日現在
		円	円	円	円	円	円
(A)	資産	1, 616, 147, 056	1, 544, 711, 411	1, 458, 994, 166	1, 489, 144, 730	1, 513, 531, 525	1, 485, 888, 576
	コール・ローン等	15, 875, 289	26, 220, 593	18, 630, 285	14, 345, 791	17, 079, 213	14, 381, 742
	投資信託受益証券(評価額)	1, 600, 271, 767	1, 518, 490, 818	1, 440, 363, 881	1, 474, 798, 939	1, 496, 452, 312	1, 471, 506, 834
(B)	負債	4, 232, 282	13, 360, 466	4, 034, 556	3, 824, 730	5, 417, 738	4, 025, 758
	未払収益分配金	2, 190, 348	2, 169, 768	2, 163, 696	2, 149, 949	2, 138, 497	2, 099, 055
	未払解約金	99, 289	9, 280, 598	10	3, 311	1, 512, 195	76, 017
	未払信託報酬	1, 936, 396	1, 903, 934	1, 864, 795	1, 666, 064	1, 761, 328	1, 844, 722
	未払利息	4	27	39	31	38	14
	その他未払費用	6, 245	6, 139	6, 016	5, 375	5, 680	5, 950
(C)	純資産総額(A-B)	1, 611, 914, 774	1, 531, 350, 945	1, 454, 959, 610	1, 485, 320, 000	1, 508, 113, 787	1, 481, 862, 818
	元本	2, 190, 348, 183	2, 169, 768, 843	2, 163, 696, 677	2, 149, 949, 284	2, 138, 497, 835	2, 099, 055, 271
	次期繰越損益金	△ 578, 433, 409	△ 638, 417, 898	△ 708, 737, 067	△ 664, 629, 284	△ 630, 384, 048	△ 617, 192, 453
(D)	受益権総口数	2, 190, 348, 183 🗆	2, 169, 768, 843 □	2, 163, 696, 677□	2, 149, 949, 284口	2, 138, 497, 835□	2, 099, 055, 271 □
	1万口当たり基準価額(C/D)	7,359円	7, 058円	6, 724円	6, 909円	7,052円	7,060円

〇損益の状況

		第223期	第224期	第225期	第226期	第227期	第228期
	項目	2022年7月16日~	2022年8月16日~	2022年9月16日~	2022年10月18日~	2022年11月16日~	2022年12月16日~
		2022年8月15日	2022年9月15日	2022年10月17日	2022年11月15日	2022年12月15日	2023年1月16日
		Ħ	円	Ħ	H	円	Ħ
(A)	配当等収益	4, 452, 532	3, 863, 761	3, 931, 409	4, 526, 126	2, 942, 025	2, 106, 904
	受取配当金	4, 452, 666	3, 864, 287	3, 932, 146	4, 526, 841	2, 943, 077	2, 107, 561
	受取利息	-	-	4	-	-	35
	支払利息	△ 134	△ 526	△ 741	△ 715	△ 1,052	△ 692
(B)	有価証券売買損益	51, 819, 002	△ 64, 872, 412	△ 71, 694, 368	38, 788, 532	31, 555, 258	3, 372, 394
	売買益	51, 880, 970	745, 956	357, 750	38, 908, 620	31, 710, 076	5, 344, 448
	売買損	△ 61,968	△ 65, 618, 368	△ 72,052,118	△ 120,088	△ 154,818	△ 1,972,054
(C)	信託報酬等	△ 1, 942, 641	△ 1, 910, 073	△ 1,870,811	△ 1,671,439	Δ 1, 767, 008	△ 1,850,672
(D)	当期損益金(A+B+C)	54, 328, 893	△ 62, 918, 724	△ 69, 633, 770	41, 643, 219	32, 730, 275	3, 628, 626
(E)	前期繰越損益金	△309, 862, 292	△252, 375, 993	△314, 463, 565	△382, 111, 707	△338, 735, 776	△301, 486, 441
(F)	追加信託差損益金	△320, 709, 662	△320, 953, 413	△322, 476, 036	△322, 010, 847	△322, 240, 050	△317, 235, 583
	(配当等相当額)	(47, 290, 892)	(47, 473, 453)	(47, 714, 226)	(47, 647, 665)	(47, 728, 506)	(47, 011, 166)
	(売買損益相当額)	$(\triangle 368, 000, 554)$	$(\triangle 368, 426, 866)$	(△370, 190, 262)	$(\triangle 369, 658, 512)$	$(\triangle 369, 968, 556)$	$(\triangle 364, 246, 749)$
(G)	計(D+E+F)	△576, 243, 061	△636, 248, 130	△706, 573, 371	△662, 479, 335	△628, 245, 551	△615, 093, 398
(H)	収益分配金	△ 2, 190, 348	Δ 2, 169, 768	Δ 2, 163, 696	△ 2, 149, 949	Δ 2, 138, 497	△ 2,099,055
	次期繰越損益金(G+H)	△578, 433, 409	△638, 417, 898	△708, 737, 067	△664, 629, 284	△630, 384, 048	△617, 192, 453
	追加信託差損益金	△320, 709, 662	△320, 953, 413	$\triangle 322, 476, 036$	△322, 010, 847	△322, 240, 050	△317, 235, 583
	(配当等相当額)	(47, 290, 892)	(47, 473, 453)	(47, 714, 226)	(47, 647, 665)	(47, 728, 506)	(47, 011, 166)
	(売買損益相当額)	(△368, 000, 554)	$(\triangle 368, 426, 866)$	(△370, 190, 262)	$(\triangle 369, 658, 512)$	$(\triangle 369, 968, 556)$	$(\triangle 364, 246, 749)$
	分配準備積立金	56, 990, 604	55, 705, 687	55, 123, 545	56, 776, 147	56, 831, 021	55, 007, 726
	繰越損益金	△314, 714, 351	△373, 170, 172	△441, 384, 576	△399, 394, 584	△364, 975, 019	△354, 964, 596

- (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 2,207,193,469円 作成期中追加設定元本額 75,472,223円 作成期中一部解約元本額 183,610,421円 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7060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617,192,453円です。

③分配金の計算過程

071 HE TE 17 HI 57 NO IL						
項目	2022年7月16日~ 2022年8月15日	2022年8月16日~ 2022年9月15日	2022年9月16日~ 2022年10月17日	2022年10月18日~ 2022年11月15日		2022年12月16日~ 2023年1月16日
費用控除後の配当等収益額	4, 298, 869円	1, 953, 688円	2,060,598円	4, 351, 461円	2,791,299円	1, 395, 321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	一円	-円	-円	-円
収益調整金額	47, 290, 892円	47, 473, 453円	47, 714, 226円	47, 647, 665円	47, 728, 506円	47,011,166円
分配準備積立金額	54,882,083円	55, 921, 767円	55, 226, 643円	54, 574, 635円	56, 178, 219円	55, 711, 460円
当ファンドの分配対象収益額	106, 471, 844円	105, 348, 908円	105,001,467円	106, 573, 761円	106, 698, 024円	104, 117, 947円
1万口当たり収益分配対象額	486円	485円	485円	495円	498円	496円
1万口当たり分配金額	10円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金金額	2, 190, 348円	2, 169, 768円	2, 163, 696円	2, 149, 949円	2, 138, 497円	2,099,055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。

〇分配金のお知らせ

	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期	第228期
1万口当たり分配金(税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10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

ファンド名	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト			
7 7 7 1 4	ファンド JPYヘッジ	エクス・ジャパン インカム ファンド JPY			
	JYJE JETOS				
		ヘッジ			
運用方針	ベンチマークであるICE BofA 先進国ハイ・	ベンチマークであるブルームバーグ・グロー			
	イールド・コンストレインド指数(BB-B、	バル総合(日本円除く、新興国除く)イン			
	円ヘッジベース)を上回る投資成果をめざし	デックス(円ヘッジベース)を上回る投資成			
	ます。	果をめざします。			
主要運用対象	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			
主な組入制限	・通常、ファンドの80%以上をBBB-格相	・投資する公社債は原則として取得時におい			
그 '아 에다 / 기에 ()	当未満の格付けを取得している公社債に投	てBBB-格相当以上の格付けを取得して			
	省します。	いるものに限ります。			
		12,000			
	・投資する公社債は原則として取得時におい	・投資する公社債の平均格付けは、ポート			
	てBー格相当以上の格付けを取得している	フォリオ全体で原則としてAA-格相当以			
	ものに限ります。	上に維持します。			
	・投資する公社債の平均格付けは、ポートフ	・ポートフォリオの平均デュレーションは、			
	ォリオ全体で原則としてB-格相当以上に	原則としてベンチマーク±2年の範囲で調			
	維持します。	整します。			
	・ポートフォリオの平均デュレーションは、	・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率			
	原則としてベンチマーク±2年の範囲で調	は、取得時において純資産総額の3%以内			
	整します。	とします(国債や政府機関債等を除きま			
	・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率	す。)。			
	は、取得時において純資産総額の3%以内	・エマージング債への投資は行いません。			
	とします(国債や政府機関債等を除きま	・原則として、円に対して為替ヘッジを行い			
	す。)。	ます。			
	・エマージング債への投資は行いません。				
	・原則として、円に対して為替ヘッジを行い				
	ます。				
決 算 日					
W 1 21	原則として毎年2月28日	= = # L I / 지 # # # # # # # # # # # # # # # # # #			
分配方針	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、分配を行わた	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
投資収入:		
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
費用:		
支払利息	4	0
法務費用	0	0
費用合計	4	0
投資純収入	22, 869	5, 712
実現純利益(損失):		
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)
	(32)	1, 068
実現純利益 (損失)	21, 734	(4, 014)
未実現評価益(評価損)の純変動:		
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)
運用による純資産の純増(減)額	(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
純資産の増加 (減少):		
運用:		
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)
分配 : JPY	(29, 626)	(7, 620)
JPY Hedged	(468)	(233)
分配金額合計	(30, 094)	(7, 853)
ファンドユニット取引:		
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)
純資産の増(減)額合計	(91, 018)	(36, 091)
純資産:		
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) 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。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)

(A) ピムコ ケイマン グローバル ハイ 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:
INVESTMENTS IN SECURITIES 9 BERMUDA 0.5%	9.6%	
CORPORATE BONDS & NOTES 0.	.5%	
NCL Corp. Ltd. 5.875% due 02/15/2027	\$ 100 \$	10
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd 5.625% due 02/15/2029	i. 100	ę
VOC Escrow Ltd. 5.000% due 02/15/2028	2,700_	
Total Bermuda (Cost \$2,900)	-	2,76
BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.1% Corporate Bonds & Notes 0.	1%	
Studio City Finance Ltd. 5.000% due 01/15/2029	500	39
Total British Virgin Islands (Cost \$503)	_	35
CANADA 4.1%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.2%		
Garda World Security Corp. 4.750% due 02/01/2029	1,000_	99
CORPORATE BONDS & NOTES 3. Air Canada	.9%	
3.875% due 08/15/2026	4,400	4,2
Bausch Health Cos., Inc. 5.000% due 02/15/2029	2,600	2,10
Bombardier, Inc. 7.500% due 12/01/2024	500	51
7.500% due 03/15/2025 7.875% due 04/15/2027	1,300 500	1,31 50
GFL Environmental, Inc. 4.000% due 08/01/2028	1,600	1,4
New Red Finance, Inc. 3.875% due 01/15/2028	4,400	4,28
Northriver Midstream Finance LP 5.625% due 02/15/2026	3,000	3,01
Parkland Corp.	900	85
4.625% due 05/01/2030 5.875% due 07/15/2027	1,500	1,52
Precision Drilling Corp. 6.875% due 01/15/2029	200	20
0.07070 000 01710/2020		20,09
Total Canada (Cost \$21,672)	-	21,08
CAYMAN ISLANDS 0.3% Bank Loan Obligations 0.1%		
AAdvantage Loyalty IP Ltd.		
5.500% due 04/20/2028 CORPORATE BONDS & NOTES 0.	300_	30
Sitka Holdings LLC 5.250% due 07/06/2026	800	80
Transocean Pontus Ltd. 6.125% due 08/01/2025	461	45
	_	1,25
Total Cayman Islands		1,56

	額	面金額	時価で
FRANCE 5.8% Bank Loan obligations o		位:千)(単位:千)
Casino, Guichard-Perrachon 9 4.000% due 08/31/2025	S.A. Eur	2,100 \$	2,297
CORPORATE BONDS & NOTE	\$ 5.4%		
Accor S.A. 2.375% due 11/29/2028		500	541
Air France-KLM 1.875% due 01/16/2025		500	520
Altice France S.A. 2.125% due 02/15/2025		4,700	4,996
CAB SELAS 3.375% due 02/01/2028		3,800	3,935
CGG S.A. 7.750% due 04/01/2027		3,800	4,228
Electricite de France S.A. (a)			
2.625% due 12/01/2027 5.375% due 01/29/2025		1,200 2,200	1,173 2,509
Faurecia SE 2.750% due 02/15/2027		800	863
Bliad Holding SASU 6.500% due 10/15/2026	\$	3,175	3,171
La Financiere Atalian SASU 4.000% due 05/15/2024	EUR	2,800	2,905
Loxam SAS 3.250% due 01/14/2025		600	650
Renault S.A. 2.500% due 04/01/2028		1,900	1,953
Societe Generale S.A. 7.875% due 12/18/2023 (a)(b)	\$	200	210 27,654
Total France		_	29,951
(Cost \$31,890)		_	29,991
GERMANY 2.3% Bank Loan obligations o	.8%		
BK LC Lux SPV Sarl 3.000% due 04/28/2028		1,000	1,101
CTEC III GmbH 3.760% due 01/19/2029		1,000	1,114
Nidda Healthcare Holding Gn 3.500% due 08/21/2026	nbH	2,000	2,142
CORPORATE BONDS & NOTE	S 1.5%	_	4,357
Nidda Healthcare Holding Gn 3.500% due 09/30/2024	n bH EUR	800	838
Schaeffler AG 3.375% due 10/12/2028		1,400	1,596
Techem Verwaltungsgesellse 2.000% due 07/15/2025	haft 6	75 mbH 3,150	3,395
ZF Finance GmbH 3.750% due 09/21/2028		1,700	
		_	7,685
Total Germany (Cost \$13,278)		-	12,042

		面金額 立:千)	時価 (単位:千)
ITALY 4.3% Corporate Bonds & Not			(42.17
Atlantia SpA 1.625% due 02/03/2025 1.875% due 07/13/2027 1.875% due 02/12/2028	EUR	400 \$ 400 3,000	440 428 3,153
Banca Monte dei Paschi di S 2.625% due 04/28/2025	Siena Sp	A 7,600	8,074
Castor SpA 6.000% due 02/15/2029		300	332
FIS Fabbrica Italiana Sinteti 5.625% due 08/01/2027	ci SpA	1,000	1,102
Inter Media & Communication 6.750% due 02/09/2027	on SpA	2,100	2,335
Intesa Sanpaolo SpA (a)(b) 7.700% due 09/17/2025 7.750% due 01/11/2027	\$ EUR	1,000 500	1,055 626
UniCredit SpA 4.875% due 02/20/2029		3,800	4,471
Total Italy (Cost \$23,748)		_	22,016
JERSEY, CHANNEL ISLANDS	0.9%	_	_
CORPORATE BONDS & NOT AA Bond Co. Ltd.			
3.250% due 07/31/2028 4.875% due 07/31/2024	GBP	100 2,000	126 2,754
Adient Global Holdings Ltd. 3.500% due 08/15/2024	EUR	1,700_	1,892
Total Jersey, Channel Islands		_	4,772
(Cost \$5,150)			
LUXEMBOURG 3.0% BANK LOAN OBLIGATIONS (
Ortho-Clinical Diagnostics, I 3.500% due 06/30/2025		1,315_	1,468
CORPORATE BONDS & NOT Albion Financing 1 Sarl	ES 2.7%		
6.125% due 10/15/2026	\$	400	389
Altice Financing S.A. 2.250% due 01/15/2025 5.750% due 08/15/2029	EUR \$	850 550	896 502
BK LC Lux Finco1 Sarl 5.250% due 04/30/2029	EUR	200	219
Camelot Finance S.A. 4.500% due 11/01/2026	\$	750	752
Cirsa Finance International 3 4.500% due 03/15/2027 6.250% due 12/20/2023	Sarl EUR	100 1,613	106 1,819
Herens Holdco Sarl 4.750% due 05/15/2028	\$	400	374
Lincoln Financing Sarl 3.625% due 04/01/2024	EUR	1,500	1,685
Matterhorn Telecom S.A. 3.125% due 09/15/2026		2,750	2,938
Signa Development Finance 5.500% due 07/23/2026	SCS	1,300	1,298

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

	額	面金額	時価
	(単位	立:千)	(単位:千)
Cellnex Finance Co. S.A.			
1.500% due 06/08/2028	EUR	1,800 \$	1,850
Grifols Escrow Issuer S.A.			
3.875% due 10/15/2028		1,200	1,240
International Consolidated Ai	rlines G		
3.750% due 03/25/2029		2,400	2,572
Neinor Homes S.A.			
4.500% due 10/15/2026		2,500	2,754
Via Celere Desarrollos Inmob	liarins	S A	
5.250% due 04/01/2026		2,400	2,696
Total Spain		2,100_	
		-	14,908
(Cest \$16,586)			
SWEDEN 0.9%			_
CORPORATE BONDS & NOTE	C n a%		
	0.0.0%		
Intrum AB		0.000	0.015
3.125% due 07/15/2024		2,900	3,219
Verisure Holding AB			
3.250% due 02/15/2027		1,100	1,164
Total Sweden			4,383
(Cost \$4.717)		-	4,000
(0031 44,717)			
SWITZERLAND 0.5% CORPORATE BONDS & NOTE	S N 5%		
	0.0.0		
Credit Suisse Group AG (a)(b) 7.500% due 07/17/2023	\$	800	816
7.500% due 12/11/2023	ş	1,800	1,891
		1,000_	
Total Switzerland		_	2,707
(Cost \$2,791)			
UNITED KINGDOM 6.8%	_		
BANK LOAN OBLIGATIONS O.	ARL.		
BCP V Modular Services Hold	lings IV		400
4.500% due 12/15/2028		100	109
Ineos Finance PLC			
2.500% due 04/01/2024		1,661_	1,836
		_	1,945
CORPORATE BONDS & NOTE	S 6.4%		
Argiva Broadcast Finance PL	C		
6.750% due 09/30/2023	GBP	750	1,011
			.,
Barclays PLC (a)(b) 7.250% due 03/15/2023		1,200	1,646
7.250% due U3/15/2023 7.750% due 09/15/2023	ŝ	800	838
7.875% due 09/15/2022	GBP	600	822
		000	022
BCP V Modular Services Fina			
4.750% due 11/30/2028	EUR	1,300	1,393
Harbour Energy PLC			
5.500% due 10/15/2026	\$	2,800	2,768
HSBC Holdings PLC (a)(b)			
5.250% due 09/16/2022	EUR	800	910
6.250% due 03/23/2023	\$	200	204
INEOS Quattro Finance 2 PLC			
3.375% due 01/15/2026	'	2,500	2.390
		2,000	2,000
Ithaca Energy North Sea PLC		4 000	
9.000% due 07/15/2026		1,600	1,615
Jaguar Land Rover Automotiv	re PLC		
7.750% due 10/15/2025		6,000	6,326
Miller Homes Group Holdings	PLC		
		1,600	2,171
5.500% due 10/15/2024	UDF	1,000	

	額(単	面金額 位:千)	時価 (単位:千)
Rolls-Royce PLC 5.750% due 10/15/2027	\$	1,350 \$	1,393
Santander UK Group Holdin			
7.375% due 06/24/2022 (a)(b)	GBP	800	1,080
Virgin Media Secured Finan 5.000% due 04/15/2027		1,000	1,354
Vmed 02 UK Financing I PL 3.250% due 01/31/2031	C Eur	1.000	1,029
4.000% due 01/31/2029	GBP	1,000	1,216
4.250% due 01/31/2031 Vodafone Group PLC	\$	1,500	1,382
6.250% due 10/03/2078		2,700	2,803
Zenith Finco PLC 6.500% due 06/30/2027	GBP	400	495
		_	32,846
Total United Kingdom (Cost \$36,011)		-	34,791
UNITED STATES 58.0%			
BANK LOAN OBLIGATIONS BK LC Lux SPV Sarl	1.7%		
3.750% due 04/28/2028	\$	896	889
Carnival Corp. 3.750% due 06/30/2025	FUR	985	1,099
3.750% due 06/30/2025	\$	1,182	1,171
Embecta Corp. 3.500% due 01/27/2029		100	99
GIP II Blue Holding LP 5.500% due 09/29/2028		399	398
Instant Brands Holdings, In 5.750% due 04/12/2028	c.	866	814
LifePoint Health, Inc. 3.959% due 11/16/2025		2,849	2,823
Polaris Newco LLC 4.500% due 06/02/2028		100	99
SCIH Salt Holdings, Inc. 4.750% due 03/16/2027		205	202
Team Health Holdings, Inc. 3.750% due 02/06/2024		1,484	1,416
			9,010
CORPORATE BONDS & NOT 180 Medical, Inc.	ES 51.79	%	
3.875% due 10/15/2029		300	289
ADT Security Corp. 4.125% due 08/01/2029		2,000	1,889
Advantage Sales & Marketi 6.500% due 11/15/2028	ng, Inc.	3,100	3,125
AMC Networks, Inc. 4.250% due 02/15/2029		3,200	3,001
5.000% due 04/01/2024		596	596
AmWINS Group, Inc. 4.875% due 06/30/2029		400	382
ASP Unifrax Holdings, Inc. 5.250% due 09/30/2028		200	192
Avantor Funding, Inc.			
3.875% due 11/01/2029 4.625% due 07/15/2028		2,650 1,600	2,554 1,626
Berry Global, Inc. 4.500% due 02/15/2026		892	895
4.000% 008 02/10/2020		092	695

	額(単	面金額 位:千)	時価 (単位:千)
Block, Inc. 2.750% due 06/01/2026	\$	900 \$	874
Booz Allen Hamilton, Inc. 4.000% due 07/01/2029		200	198
British Airways 2021-1 Class 2.900% due 03/15/2035	ss A Pas	s-Through 100	Trust 98
Builders FirstSource, Inc. 4.250% due 02/01/2032		575	553
Burford Capital Global Finan 6.250% due 04/15/2028	nce LLC	400	415
Calpine Corp. 3.750% due 03/01/2031		2,900	2,644
CCO Holdings LLC 4.250% due 02/01/2031 4.500% due 08/15/2030 4.500% due 08/01/2033 4.500% due 03/01/2033 5.125% due 03/01/2027 5.375% due 06/01/2029		2,000 1,000 1,050 1,000 2,500 1,000	1,877 965 986 984 2,528 1,017
Cheniere Energy Partners Lt 3.250% due 01/31/2032	P	3,725	3,508
Cheniere Energy, Inc. 4.625% due 10/15/2028		2,800	2,864
Chesapeake Energy Corp. 5.500% due 02/01/2026 5.875% due 02/01/2029 6.750% due 04/15/2029 Cinemark USA, Inc. 5.250% due 07/15/2028 (f)		100 100 2,700	103 104 2,858
Clarivate Science Holdings 3.875% due 07/01/2028	Corp.	300	284
Clearway Energy Operating 3.750% due 01/15/2032	LLC	900	843
Colfax Corp. 3.250% due 05/15/2025	EUR	500	557
CommScope, Inc. 4.750% due 09/01/2029	\$	3,700	3,456
Community Health Systems 4.750% due 02/15/2031	, Inc.	3,600	3,393
Comstock Resources, Inc. 5.875% due 01/15/2030 6.750% due 03/01/2029 7.500% due 05/15/2025		200 1,600 600	194 1,630 614
Conduent Business Services 6.000% due 11/01/2029	s LLC	2,275	2,171
Coty, Inc. 3.875% due 04/15/2026 5.000% due 04/15/2026	EUR \$	1,400 2,225	1,537 2,241
Crestwood Midstream Partr 6.000% due 02/01/2029	ners LP	600	606
Crocs, Inc. 4.125% due 08/15/2031		3,700	3,159
CrownRock LP 5.000% due 05/01/2029 5.625% due 10/15/2025		100 2,150	102 2,177
Curo Group Holdings Corp. 7.500% due 08/01/2028		2,650	2,357
DaVita, Inc. 3.750% due 02/15/2031		1,675	1,533

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
DCP Midstream Operating LP 3.250% due 02/15/2032 5.625% due 07/15/2027	\$ 950 \$ 1,000	887 1,076
Diamond Sports Group LLC 5.375% due 08/15/2026	2,275	937
Directy Financing LLC 5.875% due 08/15/2027	1,400	1,402
DISH DBS Corp. 5.250% due 12/01/2026 5.750% due 12/01/2028	3,000 1,400	2,947 1,341
Encino Acquisition Partners Ho 8.500% due 05/01/2028		1,699
Endeavor Energy Resources LP 5.750% due 01/30/2028	1,075	1,296
EQM Midstream Partners LP	,,,,,,	
4.750% due 01/15/2031 EQT Corp.	2,350	2,206
3.125% due 05/15/2026 3.625% due 05/15/2031	200 200	197 195
First Student Bidco, Inc. 4.000% due 07/31/2029	2,000	1,894
Ford Motor Credit Co. LLC 3.625% due 06/17/2031	13,900	13,388
Fortress Transportation & Infra		
5.500% due 05/01/2028 6.500% due 10/01/2025	2,500 750	2,392 760
Freedom Mortgage Corp. 6.625% due 01/15/2027	3,000	2,773
Frontier Communications Holdin 6.000% due 01/15/2030	ngs LLC 750	700
Full House Resorts, Inc. 8.250% due 02/15/2028	1,000	1,004
GCP Applied Technologies, Inc. 5.500% due 04/15/2026	1,250	1,275
Genesis Energy LP 7.750% due 02/01/2028	2,200	2,176
Genworth Holdings, Inc. 4.800% due 02/15/2024	300	308
Graphic Packaging Internationa		000
3.750% due 02/01/2030	5,175	4,938
GYP Holdings III Corp. 4.625% due 05/01/2029	400	374
Harvest Midstream I LP 7.500% due 09/01/2028	1,725	1,743
HAT Holdings I LLC 3.375% due 06/15/2026	1,775	1,685
HealthEquity, Inc. 4.500% due 10/01/2029	300	286
Hilton Grand Vacations Borrow 5.000% due 06/01/2029	er Escrow LLC 1,400	1,374
Howard Hughes Corp.		
4.125% due 02/01/2029	600	569
4.375% due 02/01/2031 5.375% due 08/01/2028	540 1,900	510 1,923
5.3/5% due 06/01/2026	1,300	1,923
5.000% due 12/15/2029	200	200
Imola Merger Corp. 4.750% due 05/15/2029	2,650	2,574

(額面金額 単位:千)	時価 (単位:千)		額面(単位	金額 (三千)	時価 (単位:升
DCP Midstream Operating LP 8.250% due 02/15/2032	950 \$	887	LABL, Inc. 5.875% due 11/01/2028	Ś	200 \$	19
i.625% due 07/15/2027	1,000	1,076	Ladder Capital Finance Hold	*		
Diamond Sports Group LLC 5.375% due 08/15/2026	2,275	937	4.750% due 06/15/2029 Leeward Renewable Energy	Operation	2,700	2,60
Directy Financing LLC i.875% due 08/15/2027	1,400	1,402	4.250% due 07/01/2029		2,700	2,6
DISH DBS Corp.	.,	,,	Legacy LifePoint Health LLC 4.375% due 02/15/2027	;	500	4
5.250% due 12/01/2026 5.750% due 12/01/2028	3,000 1,400	2,947 1,341	LFS Topco LLC 5.875% due 10/15/2026		100	11
Encino Acquisition Partners Holdi 8.500% due 05/01/2028	ings LLC 1,675	1,699	Lindblad Expeditions LLC 6.750% due 02/15/2027		100	11
Endeavor Energy Resources LP 5.750% due 01/30/2028	1,250	1,296	Live Nation Entertainment, I	inc.	100	
OM Midstream Partners LP		,	3.750% due 01/15/2028 4.750% due 10/15/2027		200 750	1:
4.750% due 01/15/2031 E QT Corp .	2,350	2,206	Lumen Technologies, Inc. 4.000% due 02/15/2027		100	(
3.125% due 05/15/2026 3.625% due 05/15/2031	200 200	197 195	Mauser Packaging Solution: 5.500% due 04/15/2024	s Holding	Co. 2.000	1.9
First Student Bidco, Inc. 4.000% due 07/31/2029	2,000	1,894	Midas OpCo Holdings LLC 5.625% due 08/15/2029		2,725	2.6
Ford Motor Credit Co. LLC 3.625% due 06/17/2031	13.900	13.388	Midcap Financial Issuer Tru	st	-	-
Fortress Transportation & Infrast	ructure Inve	stors LLC	5.625% due 01/15/2030 6.500% due 05/01/2028		200 400	31
5.500% due 05/01/2028 5.500% due 10/01/2025	2,500 750	2,392 760	Mozart Debt Merger Sub, In 3.875% due 04/01/2029	c.	2,725	2,5
Freedom Mortgage Corp. 3.625% due 01/15/2027	3,000	2,773	MPH Acquisition Holdings L 5.500% due 09/01/2028	LC	2,000	1,9
Frontier Communications Holding 6.000% due 01/15/2030	s LLC 750	700	Netflix, Inc. 3.625% due 06/15/2030	EUR	1,900	2,2
Full House Resorts, Inc. 3.250% due 02/15/2028	1,000	1.004	Nielsen Finance LLC			
GCP Applied Technologies, Inc. 5.500% due 04/15/2026	1,250	1,275	4.750% due 07/15/2031 Novelis Corp.	\$	1,025	9
Genesis Energy LP			3.250% due 11/15/2026 NSG Holdings LLC		1,100	1,0
7.750% due 02/01/2028 Genworth Holdings, Inc.	2,200	2,176	7.750% due 12/15/2025 Occidental Petroleum Corp.		845	8
4.800% due 02/15/2024	300	308	5.875% due 09/01/2025 6.125% due 01/01/2031 (d)(f)		1,825 1.600	1,96
Graphic Packaging International I 3.750% due 02/01/2030	5,175	4,938	6.375% due 09/01/2028		2,750	3,1
GYP Holdings III Corp. 4.625% due 05/01/2029	400	374	6.625% due 09/01/2030 Olympus Water U.S. Holding	Corp.	4,650	5,41
Harvest Midstream I LP 7.500% due 09/01/2028	1,725	1.743	3.875% due 10/01/2028 OneMain Finance Corp.	EUR	3,000	3,14
HAT Holdings I LLC		1.685	3.500% due 01/15/2027	\$	4,625	4,3
3.375% due 06/15/2026 HealthEquity, Inc.	1,775	1,685	Option Care Health, Inc. 4.375% due 10/31/2029		300	2
4.500% due 10/01/2029 Hilton Grand Vacations Borrower	300 Eccross II C	286	Organon & Co. 2.875% due 04/30/2028	EUR	4,200	4,4:
5.000% due 06/01/2029	1,400	1,374	5.125% due 04/30/2031 Oxford Finance LLC	\$	900	91
Howard Hughes Corp. 4.125% due 02/01/2029	600	569	6.375% due 02/01/2027		410	42
4.375% due 02/01/2031 5.375% due 08/01/2028	540 1,900	510 1,923	Pactiv Evergreen Group Issu 4.375% due 10/15/2028	ier LLC	600	58
II-VI, Inc. 5.000% due 12/15/2029	200	200	Papa John's International, I 3.875% due 09/15/2029	nc.	200	11
Imola Merger Corp. 4,750% due 05/15/2029	2,650	2,574	Par Pharmaceutical, Inc. 7.500% due 04/01/2027		1,000	1,0
	2,000	2,074			1,000	1,01

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Park Intermediate Holdings LLC 4.875% due 05/15/2029	\$ 600 \$	579	Sunnova Energy Corp. 5.875% due 09/01/2026	\$ 100 \$	92
PDC Energy, Inc. 5.750% due 05/15/2026	1,000	1,016	Switch Ltd. 4.125% due 06/15/2029	1,100	1,056
PennyMac Financial Services,	nc.		Tallgrass Energy Partners LP		
4.250% due 02/15/2029 5.750% due 09/15/2031	2,600 900	2,331 849	6.000% due 12/31/2030 Targa Resources Partners LP	800	772
Performance Food Group, Inc.			4.000% due 01/15/2032	275	271
5.500% due 10/15/2027	3,300	3,362	4.875% due 02/01/2031	1,800	1,853
PetSmart, Inc.			5.875% due 04/15/2026	750	775
4.750% due 02/15/2028	600	599	6.875% due 01/15/2029 TEGNA, Inc.	625	681
PGT Innovations, Inc. 4.375% due 10/01/2029	700	659	5.000% due 09/15/2029	750	749
Post Holdings, Inc.			Tenet Healthcare Corp.	2 400	2.00
4.500% due 09/15/2031	1,300	1,206	4.875% due 01/01/2026	7,100	7,158
4.625% due 04/15/2030	1,000	943	Terminix Co. LLC		
5.750% due 03/01/2027	2,400	2,428	7.450% due 08/15/2027	100	117
PRA Group, Inc.	2.000	2.154	TerraForm Power Operating LI		1.000
7.375% due 09/01/2025	3,000	3,154	4.250% due 01/31/2023 4.750% due 01/15/2030	1,000 500	1,002 492
Prime Healthcare Services, Inc 7.250% due 11/01/2025	. 100	102	5.000% due 01/31/2028	1,500	1,506
		102	Thor Industries, Inc.		
Prime Security Services Borron 3.375% due 08/31/2027	2.000	1.853	4.000% due 10/15/2029	3,100	2,833
	2,000	1,000	TopBuild Corp.		
Range Resources Corp. 4.750% due 02/15/2030	100	98	4.125% due 02/15/2032	400	381
Revion Consumer Products Cor	р.		TransDigm, Inc.		
6.250% due 08/01/2024	25	11	4.625% due 01/15/2029 5.500% due 11/15/2027	1,400 1,500	1,323 1,496
RHP Hotel Properties LP			6.250% due 03/15/2026	500	515
4.500% due 02/15/2029	1,500	1,419	6.375% due 06/15/2026	2,900	2,960
Ritchie Bros Holdings, Inc. 4.750% due 12/15/2031	200	199	Travel + Leisure Co. 4.500% due 12/01/2029	2,750	2,631
RLJ Lodging Trust LP			Triumph Group, Inc.		
3.750% due 07/01/2026	300	293	8.875% due 06/01/2024	726	776
4.000% due 09/15/2029	300	282	U.S. Acute Care Solutions LLC		
ROBLOX Corp. 3.875% due 05/01/2030	300	286	6.375% due 03/01/2026	1,375	1,356
	300	200	Uber Technologies, Inc.		
Rockcliff Energy II LLC 5.500% due 10/15/2029	200	199	4.500% due 08/15/2029	4,575	4,388
Sabre GLBL, Inc.	200	100	United Airlines, Inc.		
7.375% due 09/01/2025	1,800	1,867	4.375% due 04/15/2026	400	400
9.250% due 04/15/2025	700	790	4.625% due 04/15/2029	500	489
Scientific Games International,			Univision Communications, Inc 4.500% due 05/01/2029		0.451
	UR 2,900	3,241		3,600	3,451
Select Medical Corp.			Venture Global Calcasieu Pass 3.875% due 08/15/2029	400	392
6.250% due 08/15/2026	\$ 1,500	1,521	3.875% due 11/01/2033	1,800	1,736
Southwestern Energy Co.			4.125% due 08/15/2031	300	297
4.750% due 02/01/2032	200	199	Viasat, Inc.		
5.375% due 02/01/2029	3,320	3,420	5.625% due 09/15/2025	750	717
Spirit AeroSystems, Inc.			5.625% due 04/15/2027	500	500
5.500% due 01/15/2025	3,400	3,498	Viavi Solutions, Inc.		
Standard Industries, Inc.			3.750% due 10/01/2029	200	190
4.375% due 07/15/2030	1,375	1,304	Vistra Operations Co. LLC		
Staples, Inc.	0.000		5.625% due 02/15/2027	1,250	1,282
7.500% due 04/15/2026	3,050	3,019	WMG Acquisition Corp.	0.400	0.171
Starwood Property Trust, Inc.	500	400	3.000% due 02/15/2031	2,400	2,174
3.750% due 12/31/2024	500	490	Wynn Las Vegas LLC	1.000	004
Station Casinos LLC 4.625% due 12/01/2031	300	283	5.250% due 05/15/2027 5.500% due 03/01/2025	1,000 1,500	991 1,523
4.02.070 008 12/01/2031	300	203	5.500 N 000 00/01/2020	1,000	1,020

	額(単	面金額 位:千)	時価 (単位:千)
Zayo Group Holdings, Inc. 4.000% due 03/01/2027	\$	1,900 \$	1,808
ZipRecruiter, Inc. 5.000% due 01/15/2030		400_	394
U.S. TREASURY OBLIGATION	DNS 4.6%	_	265,229
U.S. Treasury Notes 2.250% due 11/15/2024		23,000	23,393
Total United States (Cost \$305,675)		_	297,632
SHORT-TERM INSTRUMEN	TS 3.4%		_
REPURCHASE AGREEMENT	rs (e) 0.5	%	
TIME DEPOSITS 0.5%	-	-	2,528
Australia and New Zealand	l Banking		
0.005% due 03/01/2022 Bank of Nova Scotia		6	6
0.005% due 03/01/2022		1	1
BNP Paribas Bank	FUE		
(0.780%) due 03/01/2022 0.005% due 03/01/2022	EUR \$	2 235	2 235
0.090% due 03/01/2022	GBP	1	1
Citibank N.A. 0.005% due 03/01/2022	\$	302	302
Credit Suisse AG (1.450%) due 03/01/2022	CHF	1	1
DBS Bank Ltd. 0.005% due 03/01/2022	\$	60	60
HSBC Bank PLC (0.780%) due 03/01/2022	EUR	131	147
0.090% due 03/01/2022 JPMorgan Chase Bank N.A	GBP	1	2
0.005% due 03/01/2022	\$	69	69
Royal Bank of Canada 0.005% due 03/01/2022		603	603
Sumitomo Mitsui Banking	Corp. EUR	273	207
(0.780%) due 03/01/2022 0.005% due 03/01/2022	EUN \$	945	307 945
0.090% due 03/01/2022	GBP	3	4
Sumitomo Mitsui Trust Ba (0.780%) due 03/01/2022	n k Ltd. EUR	5	6
0.005% due 03/01/2022	\$	45	45
0.090% due 03/01/2022	GBP	15_	20 2,756
		_	
U.S. TREASURY CASH MA 0.200% due 05/17/2022 (cl(h)	######################################	12,000	
Total Short-Term Instrume		12,000	17,277
(Cost \$17,313) Total Investments in Secur	itios 99 f	1% s	511.198
(Cost \$530,210)	55.0	•	311,130
Financial Derivative Instruments (g)(i) 0.1% (Cost or Premiums, net \$0)			613
Other Assets and Liabilitie	s. net N 3	%	1,353
Net Assets 100.0%	o, mot 0.0	* \$	

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	i 金額	担保	3	担保 を取価値	レポ価値	L	·ポ契約の 受取②
BPS	0.150%	02/24/2022	TBD ⁽¹⁾	GBP	1,884	Kane Bidco Ltd 6.500% due 02/15/2027	\$	(2,535)	\$ 2,528	\$	2,536
Total Repurchase Ag	preements.						\$	(2,535)	\$ 2,528	\$	2,536

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ^③	決済日	満期日	借,	入金額(3)	リバースレボ の支払
JML	(0.070%)	02/09/2022	04/12/2022	\$	(2,704)	\$ (2,704)
Total Reverse Re	purchase Agreements	5				\$ (2,704)

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	残存期間											
	オーバー 総	ナイト/ !続		30日迄	;	31-90日	90日	以上		合計		
Reverse Repurchase Agreements												
U.S. Corporate Debt	\$	0	\$	0	\$	(2,704)	\$	0	\$	(2,704)		
Total Reverse Repurchase Agreements	\$	0	\$	0	\$	(2,704)	\$	0	\$	(2,704)		
Total Borrowings	\$	0	\$	0	\$	(2,704)	\$	0	\$	(2,704)		
Payable for Reverse Repurchase Agreements									\$	(2,704)		

SHORT SALES:

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

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	レポ契約 の受取		レポ契約 リバースレホ の受取 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		担保の (受取)/差入れ		ネッ ポー	トエクス ジャー ⁽⁴⁾
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)		
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$	2,536	\$	(2,704)	\$	0	\$	(2,523)								

- (1) Open maturity repurchase agreement.
- Includes accrued interest.
- 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.
- ** 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:

				未実現					
銘柄	種類	限月	契約数	(損)	益		資産	1	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
Total Futures Contracts				\$	(224)	\$	163	\$	(29)

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE SOVEREIGN AND U.S. MUNICIPAL ISSUES, SELL PROTECTION

		未実	現評価	変動証拠金									
参照債券	固定受取金利	満期日	ンプライド クレジッ スプレッド ^②	想定:	元本③	市場	価格(4)	(†	員) 益	資	産	負債	責
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

									変動	証拠金	È
参照指標	固定受取金利	満期日	想知	E元本 ⁽³⁾	市場	価格(4)	未実現評	評価(損)益	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	変動金利							未実	現評価		変動証	拠金	
支払/受取 (5)	インデックス	固定金利	満期日	想定	と 元本	市場	価格	(抽) 益	資	産	負	責
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
Total Swap Agree	ements					\$	846	\$	275	\$	438	\$	0

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.

		金融派生商品資産				貴		
	市場価格	変動証	[拠金資産		市場価格	変動証拠金負債	<u></u>	
	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
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0 \$	163	\$ 438 \$	601	\$ 0 \$	(29) \$	0 \$	(29)

- 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 [iii] 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.
- 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.
- 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. 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/solid 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.
- 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:

						未	実現評価	(損) 益	
取引相手	決済月	受渡	し通貨	受取	通貨	資産		負	債
BOA	05/2022	EUR	376	\$	428	\$	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:

						未	実現評価	(損) 益	
取引相手	決済月	受測	度し通貨	受	取通貨	資産		負	责
BOA	03/2022	CAD	0	\$	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)
Total Forward	Foreign Currency Cor	ntracts				\$	69	\$	(28)

(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)

INVESTMENTS IN SECUR		額面金額単位:千)	時価 (単位:千
INVESTMENTS IN SECURI AUSTRALIA 6.9% ASSET-BACKED SECURITI			
Flexi Asset-Backed Securi 0.915% due 04/14/2025	ties Trus AUD	t 243 \$	177
Pepper SPARKZ Trust No. 1.065% due 08/17/2028	3	516	375 552
CORPORATE BONDS & NO	TES 1.29	6	
GAIF Bond Issuer Pty Ltd. 1.900% due 12/14/2028		1,300	868
Lendlease Finance Ltd. 3.700% due 03/31/2031		500	348
Pacific National Finance P 4.750% due 03/22/2028	ty Ltd.	900	938
Volkswagen Financial Ser 1.200% due 04/08/2024	vices Aus AUD	stralia Pty Lt 500	d. 356
Woodside Finance Ltd. 3.650% due 03/05/2025	\$	200	206
WSO Finance Pty Ltd. 4.500% due 03/31/2027	AUD	600	465 3,181
MORTGAGE-BACKED SEC	URITIES 4	1.3%	3,101
Bluestone Prime Trust 0.760% due 06/21/2053		577	416
Bluestone Sapphire XXV 1.060% due 09/21/2053		1,053	764
Firstmac Mortgage Fundin 0.749% due 10/24/2052 0.810% due 02/19/2053	g Trust N	1,656 452	1,194 325
La Trobe Financial Capital	Markets		020
0.815% due 01/14/2053 Liberty		1,514	1,092
1.261% due 10/10/2049 Liberty PRIME		467	339
0.715% due 01/25/2053 National RMBS Trust		1,669	1,204
1.280% due 12/20/2047 Pepper I-Prime Trust		289	212
0.715% due 07/15/2053 Pepper Residential Securi	tion Truct	1,200	865
1.087% due 08/18/2060	\$	80	80
Pepper Residential Securit 0.845% due 10/14/2062	AUD	698	505
Pepper Residential Securion 0.815% due 01/15/2063	ues Trus	1,097	792
Progress Trust 0.810% due 07/20/2046		443	321
RedZed Trust 0.815% due 06/09/2053		670	486
Resimac Bastille Trust 0.865% due 09/07/2052		604	438
RESIMAC Premier 0.695% due 02/13/2053		1,729	1,246
0.826% due 07/10/2052 1.315% due 02/07/2052	\$ AUD	630 278	628 203
Securitised Australian Mo 0.790% due 02/20/2046	rtgage Ti	r ust 437	317
0.7 00 74 000 02/20/2040		707	317

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

	(<u>i</u>	領面金額 単位:千)	時価 (単位:千)
Total Chile (Cost \$930)		\$	
DENMARK 4.0%			
CORPORATE BONDS & NOTE	S 4.0%		
Jyske Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2050 1.500% due 10/01/2037	DKK	30,401 139	4,076 21
1.500% due 10/01/2057 1.500% due 10/01/2053		598	82
2.000% due 10/01/2050		122	17
Nordea Kredit Realkreditaktie	selska	ab	
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
Nykredit Realkredit A/S			
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	947 149
2.000% due 10/01/2050 2.500% due 10/01/2047		1,026 39	149
		33	0
Realkredit Danmark A/S 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
		18_	3
2.500% due 04/01/2047 Total Denmark (Cost \$12,246)		18_	1 0,943
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7%	8 n 2	_	
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE:	S 0.4%	_	
Total Denmark (Cost \$12,246) France 1.7% Corporate Bonds & Note BNP Paribas S.A.		-	10,943
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE:	S 0.4% \$	_	1,000
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE: BMP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2030		900	10,943
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 5.188% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (a)(b)		900	1,000 218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond	\$	900 200 _	1,000 218 1,218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BRIP Paribas S.A. 5. 189% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/20/28 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 08/25/2082		900 200 _	1,000 218 1,218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBMP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2030 7.000% due 01/10/2028 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052	\$	900 200	1,000 218 1,218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBMP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2030 7.000% due 01/10/2028 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052	\$	900 200 _	1,000 218 1,218 1,218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBNP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (allb) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2050 3.250% due 05/25/2050 3.250% due 05/25/2045	\$	900 200	1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 5. 189% due 01/10/2030 7. 000% due 08/16/2028 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052 3.250% due 05/25/2055	\$	900 200	1,000 218 1,218 1,218
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 5. 198% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (alib) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3%	\$ EUR	900 200	1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBNP Paribas S.A. 5. 198% due 01/10/2030 7.000% due 01/10/2038 (alib) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052 5.250% due 05/25/2055 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE	\$ EUR	900 200	1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBMP Paribas S.A. 5.188% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (al(b)) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GGRMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG	\$ EUR	900 200 200 300 1,820	1,000 218 1,218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 1.589% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (allb) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2053 3.250% due 05/25/2053 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030	\$ EUR	900 200_ 200_ 200 300 1,820_ 500	10,943 1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BNP Paribas S.A. 6. 198% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/2028 (alib) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030 3.035% due 05/23/2032 (i)	\$ EUR	900 200 200 300 1,820	1,000 218 1,218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBNP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2020 7.000% due 08/16/2028 (allb) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2050 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030 3.035% due 05/28/2032 (i) 3.047% due 08/18/2031 Kreditanstalt fuer Wiederauf!	\$ EUR \$ 2.3%	900 200 200 300 1,820 500 200	10,943 1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BBNP Paribas S.A. 5.198% due 01/10/2020 7.000% due 08/16/2028 (allb) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2050 3.250% due 05/25/2050 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% ECORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030 3.035% due 05/28/2032 (i) 3.47% due 09/18/2031 Kreditanstalt fuer Wiederauff 1.125% due 05/09/2033	\$ EUR \$ \$ 2.3%	900 200 200 300 1,820 500 200 300	10,943 1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BRIP Paribas S.A. 1.58% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/20/28 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 08/25/2052 1.500% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2053 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030 3.035% due 05/12/8/2032 (i) 3.547% due 09/18/2031 Xreditanstalt fuer Wiederauft 1.125% due 05/09/2033 Landwirtschaftliche Rentenbi	\$ EUR \$ \$ 2.3%	900 200 200 300 1,820 500 200 300	10,943 1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742 538 188 296 1,054
Total Denmark (Cost \$12,246) FRANCE 1.7% CORPORATE BONDS & NOTE BRIP Paribas S.A. 1.58% due 01/10/2030 7.000% due 08/16/20/28 (a)(b) SOVEREIGN ISSUES 1.3% France Government Bond 0.750% due 08/25/2052 1.500% due 05/25/2052 1.500% due 05/25/2053 3.250% due 05/25/2045 Total France (Cost \$4,301) GERMANY 2.3% CORPORATE BONDS & NOTE Deutsche Bank AG 1.750% due 11/19/2030 3.035% due 05/12/8/2032 (i) 3.547% due 09/18/2031 Xreditanstalt fuer Wiederauft 1.125% due 05/09/2033 Landwirtschaftliche Rentenbi	\$ EUR \$ 2.3% \$ cur EUR ank	900 200 300 1,820 500 200 300	10,943 1,000 218 1,218 199 366 2,959 3,524 4,742 538 188 296 1,054

CHEDNOLA V	割()	面金額 位:千)	時価 (単位:千
GUERNSEY 0.2% Corporate Bonds & Not	ES 0.2%		
Amdocs Ltd. 2.538% due 06/15/2030	\$	600 \$	566
Total Guernsey (Cost \$600)		-	566
HONG KONG 0.3% Sovereign Issues 0.3%			
Airport Authority 2.100% due 03/08/2026 (b)		800	770
Total Hong Kong (Cost \$800)		-	770
IRELAND 3.3% ASSET-BACKED SECURITIE	S 2.7%		
Accunia European CLO I DA 0.950% due 07/15/2030	EUR	659	739
Aqueduct European CLO DA 0.640% due 07/20/2030	С	793	887
Aurium CLO IV DAC 0.730% due 01/16/2031	II D40	600	672
BlueMountain Fuji EUR CLO 0.650% due 07/15/2030 Cairn CLO IV DAC	II DAC	451	505
0.600% due 04/30/2031 Contego CLO IV DAC		300	336
0.640% due 01/23/2030 Harvest CLO XVI DAC		600	672
0.640% due 10/15/2031 Harvest CLO XXII DAC		1,300	1,459
0.850% due 01/15/2032 Man GLG Euro CLO III DAC		700	791
0.680% due 10/15/2030 OCP Euro CLO DAC 0.880% due 09/22/2034		1,000	1,121
CORPORATE BONDS & NOT	ES 0.4%		7,293
AerCap Ireland Capital DAC		500	400
2.450% due 10/29/2026 Perrigo Finance Unlimited C 3.900% due 06/15/2030	\$ 0.	500 600	482 551
		_	1,033
MORTGAGE-BACKED SECUI Dilosk Rmbs No.3 DAC 0.190% due 10/20/2057	EUR	561	631
Total Ireland (Cost \$9,482)	LOIT	_	8,957
ISRAEL 0.1% Sovereign Issues 0.1%			
Israel Government Internati 4.125% due 01/17/2048	onal Bon	d 200	222
Total Israel (Cost \$205)		-	222
ITALY 0.4% Corporate Bonds & Not	ES 0.1%		
AMCO-Asset Management C			

SOVEREIGN ISSUES 0.3%	(額面金額 単位:千)	時価 (単位:干
Italy Buoni Poliennali del Te 2.150% due 03/01/2072		400 \$	201
2.800% due 03/01/2067	EUR		391 231
2.800% due 03/01/206/		200	
		_	622
Total Italy (Cost \$1,026)		-	966
JAPAN 3.7% Corporate Bonds & Not	ES 2.6	4	-
East Japan Railway Co.			
0.773% due 09/15/2034		200	205
1.104% due 09/15/2039		300	301
			301
Mitsubishi UFJ Financial Gr 3.195% due 07/18/2029	\$	c. 1,600	1,616
Mizuho Financial Group, Inc			
2.591% due 05/25/2031		500	479
Nippon Life Insurance Co.			
5.000% due 10/18/2042		1,600	1,621
		1,000	1,021
Nissan Motor Co. Ltd.	FLIF	000	
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
Nomura Holdings, Inc.			
2.172% due 07/14/2028		300	282
2.329% due 01/22/2027		200	193
2.710% due 01/22/2029		300	291
			291
Sumitomo Mitsui Financial	Group,	Inc.	
4.436% due 04/02/2024 (a)		700	729
			6,997
SOVEREIGN ISSUES 1.1%			
Japan Government Internati	anal D		
Japan Government Internati 0.100% due 09/20/2030	onai B ¥	310,000	2,689
0.700% due 06/20/2051	*		2,009
U./UU% due U6/20/2051		50,000	
		_	3,105
Total Japan			10,102
(Cost \$10,600)		_	
LUXEMBOURG 0.2%			_
CORPORATE BONDS & NOT Aroundtown S.A.	ES 0.2	%	
5.375% due 03/21/2029	ŝ	400	437
	*	400_	
Total Luxembourg (Cost \$398)		-	437
NETHERLANDS 1.3% Corporate Bonds & Not	ES 0.6	%	
ING Bank NV 2.625% due 12/05/2022		300	303
		000	000
ING Groep NV		4.000	4.007
4.550% due 10/02/2028		1,000	1,087
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)		200_	189
		_	1,579
MORTGAGE-BACKED SECU	RITIES	0.1%	
Dutch Property Finance BV			
0.096% due 07/28/2058	EUR	201	205
	EUR	291	325
SOVEREIGN ISSUES 0.6%			
Nederlandse Waterschapsba	nk NV		
0.125% due 01/17/2024	IE V	1,400	1,579
0.12370 008 01/17/2024		1,400	1,5/9

	部(単	面金額 位:千)	時価 (単位:千)
Total Netherlands		\$	3,483
(Cost \$3,475)		_	
NEW ZEALAND 0.1% SOVEREIGN ISSUES 0.1%			
New Zealand Government 2.310% due 09/20/2025 (c)	Inflation-L NZD	inked Bon 200_	
Total New Zealand			168
(Cost \$163)			
NORWAY 2.1% Corporate Bonds & No	TES 1.9%		
DNB Boligkreditt A/S 2.500% due 03/28/2022	\$	2,600	2,604
SR-Boligkreditt A/S 2.500% due 04/12/2022		2,650	2,657
		_	5,261
SOVEREIGN ISSUES 0.2%			
Norway Government Bond 1.750% due 03/13/2025	NOK	4,100	465
Total Norway		.,	5,726
(Cost \$5,754)		_	
QATAR 0.3%			
CORPORATE BONDS & NO	TES 0.1%		
Qatar Energy 3.125% due 07/12/2041	\$	100	94
3.300% due 07/12/2051		100	
SOVEREIGN ISSUES 0.2%	_	_	188
Qatar Government Interna	tional Bon	ıd	
4.400% due 04/16/2050		600	694
Total Qatar (Cost \$908)		_	882
SAUDI ARABIA 0.4% Corporate Bonds & No	TES 0.1%		
Saudi Arabian Oil Co.			
3.250% due 11/24/2050		200	178
SOVEREIGN ISSUES 0.3%			
Saudi Government Interna 3.250% due 10/26/2026	tional Bon	ı d 200	208
3.625% due 03/04/2028		400	422
4.625% due 10/04/2047		300	331 961
Total Saudi Arabia		-	1,139
(Cost \$1,199)		_	1,100
SINGAPORE 0.5% Corporate Bonds & No	TES 0.2%		
BOC Aviation Ltd.			
3.500% due 01/31/2023 SOVEREIGN ISSUES 0.3%		600_	607
Singapore Government Bo			
2.875% due 07/01/2029	SGD	900	708
Total Singapore			1,315
(Cost \$1,335)			

SOUTH KOREA 0.1%	(単	質面金額 単位:干)	時価 (単位:干
CORPORATE BONDS & NO	TES 0.1%		
Hyundai Capital Services, I		400.4	
0.750% due 09/15/2023	\$	400 \$	391
Total South Korea (Cost \$400)		_	391
SPAIN 4.9% SOVEREIGN ISSUES 4.9%			
Spain Government Bond			
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 5.150% due 10/31/2028		900 1.600	1,379
5.250% due 04/06/2029	GBP	1,200	1,952
	UDF	1,200	
Total Spain (Cost \$13,953)		_	13,483
SUPRANATIONAL 0.6% Sovereign Issues 0.6%			
Nordic Investment Bank	AUD	0.000	4.00
5.000% due 04/19/2022	AUD	2,200	1,607
Total Supranational		_	1,607
(Cost \$2,254)			
SWEDEN 1.4% Corporate Bonds & No	TES 1.4%		
Stadshypotek AB			
2.500% due 04/05/2022	\$	3,400	3,408
Sveriges Sakerstallda Obli 2.000% due 06/17/2026	gationer A SEK		221
	SEK	3,000	329
Total Sweden (Cost \$3,746)		_	3,735
SWITZERLAND 3.2% Corporate Bonds & No	TES 3.2%		
Credit Suisse AG			
6.500% due 08/08/2023 (a)	\$	3,400	3,570
Credit Suisse Group AG		4 400	
3.750% due 03/26/2025		1,400	1,437
3.869% due 01/12/2029 4.194% due 04/01/2031		500 500	507 520
		300	321
UBS AG		2 700	2.70
7.625% due 08/17/2022 (a)		2,700	
Total Switzerland (Cost \$8,722)		_	8,799
UNITED ARAB EMIRATES (Sovereign Issues 0.5%	0.5%		
	ernational		1.40
Abu Dhabi Government Into 3.125% due 04/16/2030 Total United Arab Emirates		1,400	1,463

UNITED KINGDOM 10.7%	(額面金額 単位:千)	時価 (単位:千)
CURPURATE BUNDS & NUT	ES 3.6	79	
Amcor UK Finance PLC 1.125% due 06/23/2027	EUR	500 \$	557
Barclays Bank PLC 7.625% due 11/21/2022 (a)	\$	700	726
Barclays PLC			
3.250% due 02/12/2027	GBP	1,200	1,644
3.250% due 01/17/2033		600	810
3.650% due 03/16/2025	\$	200	206
7.125% due 06/15/2025 (a)(b)	GBP	300	419
HSBC Holdings PLC			
5.250% due 09/16/2022 (a)(b)	EUR	200	227
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	GRP	1,800	2,124
6.000% due 03/29/2040	GBP	50	82
Lloyds Banking Group PLC 4.582% due 12/10/2025	\$	400	421
Nationwide Building Society	,		
3.960% due 07/18/2030		200	210
NatWest Group PLC		000	015
4.800% due 04/05/2026 4.892% due 05/18/2029		200 600	215
4.892% due U5/18/2029 5.076% due 01/27/2030		800	654 883
		000	003
Santander UK Group Holding	js PLC		
4.750% due 09/15/2025		600	630
		_	9,808
MORTGAGE-BACKED SECUR	RITIES	4.3%	
Canada Square Funding PLC 1.194% due 06/17/2058	GBP	672	904
Eurosail PLC 0.000% due 12/10/2044	EUR	5	5
Eurosail-UK PLC 0.255% due 03/13/2045	GBP	12	15
Finsbury Square PLC 0.000% due 12/16/2071		500	672
Great Hall Mortgages No.1 F 0.344% due 06/18/2039	PLC \$	17	17
Hawksmoor Mortgages 1.240% due 05/25/2053	GBP	819	1,100
Lanebrook Mortgage Transa	ction F	LC	
0.961% due 07/20/2058 Mansard Mortgages PLC		296	394
0.748% due 12/15/2049		3,072	4,065
Newgate Funding PLC 0.000% due 12/15/2050	EUR	49	54
Paragon Mortgages No.12 P 0.726% due 11/15/2038	LC \$	29	29
Pierpont BTL PLC 0.000% due 12/22/2053	GBP	500	672
Polaris PLC 1.094% due 12/23/2058		390	522
Residential Mortgage Accep	tance (Corporation	Securities
No.1 PLC 0.245% due 06/12/2044		36	46
Stratton Mortgage Funding 1.133% due 03/12/2052	PLC	335	450
Towd Point Mortgage Fundi 1.236% due 10/20/2051		nite4 PLC	568
		761	000

	90	三 本部	n±./30
	(単	面金額 位:千)	時価 (単位:千)
Tower Bridge Funding PLC 1.225% due 11/20/2063	GBP	387 \$	518
Trinity Square PLC 0.936% due 07/15/2059		926	1,244
Twin Bridges PLC 1.083% due 03/12/2055			
1.083% due 03/12/2055		383	514 11,789
SOVEREIGN ISSUES 2.8%			
United Kingdom Gilt			
0.625% due 07/31/2035		1,150	1,360
3.250% due 01/22/2044		500	868
3.500% due 01/22/2045		1,320 470	2,396 800
4.250% due 06/07/2032 4.250% due 03/07/2036		250	447
4.250% due 12/07/2040		220	419
4.500% due 09/07/2034		700	1,253
		_	7,543
Total United Kingdom (Cost \$29,194)		_	29,140
UNITED STATES 35.0% ASSET-BACKED SECURITIE	ES 0.2%		
Navient Private Education	Refi Loan	Trust	
2.120% due 01/15/2069 CORPORATE BONDS & NO	\$ TES 9 7%	618	615
AbbVie, Inc.	120 3.7 %		
3.200% due 11/21/2029		600	608
3.850% due 06/15/2024		200	207
American Airlines 2019-1 (Class AA I	Pass-Throu	gh Trust
3.150% due 02/15/2032		713	703
American Tower Corp. 4.000% due 06/01/2025		200	208
Arrow Electronics, Inc. 3.875% due 01/12/2028		200	208
AT&T, Inc.			
2.250% due 02/01/2032		200	
3.550% due 09/15/2055			185
D		608	185 552
		608	552
3.419% due 12/20/2028		608	1,185
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030		608	552
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp.		608	552 1,185
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047		608 1,158 1,000	1,185 1,049
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp.		608 1,158 1,000	1,185 1,049
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030		1,158 1,000 200	1,185 1,049
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026		608 1,158 1,000 200 600 300	1,185 1,049
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Beeing Co. 2.750% due 02/01/2026		1,158 1,000 200 600	1,185 1,049 185
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.825% due 02/01/2031 Boston Scientific Corp.		608 1,158 1,000 200 600 300	1,185 1,049 185 567
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2031 Boston Scientific Corp.		608 1,158 1,000 200 600 300	1,185 1,049 185 567
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2031 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029		1,158 1,000 200 600 300 300	1,185 1,049 185 567 300 303
3.4 19% due 12/20/2028 3.74% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Beeing Co. 2.750% due 02/01/2036 3.625% due 02/01/2031 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 2.450% due 02/15/2031		1,158 1,000 200 600 300 300 800	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2021 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Braadcom, Inc. 2.450% due 02/15/2031		608 1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2027 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 2.450% due 02/15/2031 3.469% due 04/15/2034		608 1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850
3.4 19% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 08/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.625% due 02/01/2026 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 2.450% due 02/15/2031 3.469% due 02/15/2031 4.500% due 11/15/2034 4.300% due 11/15/2034	perating !	1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193 316
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 06/15/2031 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 2.450% due 02/15/2031 3.469% due 04/15/2034 4.300% due 11/15/2032 Charter Communications 0 3.850% due 04/01/2061	perating (1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300 LLC	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193 316
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 20/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.825% due 02/01/2026 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 4.000% due 03/01/2029 Charter Communications 0 3.850% due 04/15/2034 4.300% due 11/15/2032 Charter Communications 0 3.850% due 04/01/2051	perating (1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300 LLC	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193 316
Bank of America Corp. 3, 419% due 12/20/2028 3,974% due 02/07/2030 BAT Capital Corp. 4,540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2,500% due 08/15/2030 Boeing Co. 2,750% due 02/01/2026 3,825% due 02/01/2026 Boston Scientific Corp. 4,000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 2,450% due 02/15/2031 4,380% due 04/15/2034 4,300% due 11/15/2032 Charter Communications 0,380% due 06/01/2051 3,800% due 06/01/2052 3,850% due 06/01/2052 3,850% due 06/01/2052	perating (1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300 LLC 150 180 200	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193 316 125 157 168
3.419% due 12/20/2028 3.974% due 20/07/2030 BAT Capital Corp. 4.540% due 08/15/2047 Black Hills Corp. 2.500% due 06/15/2030 Boeing Co. 2.750% due 02/01/2026 3.825% due 02/01/2026 Boston Scientific Corp. 4.000% due 03/01/2029 Broadcom, Inc. 4.000% due 03/01/2029 Charter Communications 0 3.850% due 04/15/2034 4.300% due 11/15/2032 Charter Communications 0 3.850% due 04/01/2051	perating (1,158 1,000 200 600 300 300 800 320 200 300 LLC	552 1,185 1,049 185 567 300 303 850 296 193 316

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	額面金奢 (単位:3	頁 時価 F) (単位:千)	
Comcast Corp. 2.937% due 11/01/2056	\$ 294 \$	248	Wells Fargo & Co. 4.150% due 01/24/2029 \$ 1.00		First NLC Trust 0.257% due 08/25/20
		240	4.478% due 04/04/2031 60		Freddie Mac Multi
Crown Castle International Co. 2.250% due 01/15/2031	r p. 600	541	Westinghouse Air Brake Technologies Cor		Certificates
3.700% due 06/15/2026	200	207	3.200% due 06/15/2025 50		3.600% due 01/25/20
	200	207	0.2007/ 000 00/10/2020	26,287	Freddie Mac Struc
CVS Health Corp. 4.300% due 03/25/2028	66	71	MORTGAGE-BACKED SECURITIES 5.7%	20,207	0.467% due 09/25/20
	00	/1			1.288% due 02/25/20
Dell International LLC	400	447	Adjustable Rate Mortgage Trust 2.583% due 09/25/2035 (d) 3	19 37	1.304% due 10/25/20
5.450% due 06/15/2023	400	417		19 37	GreenPoint Mortga
Energy Transfer LP			Alternative Loan Trust		0.367% due 01/25/20
4.750% due 01/15/2026	500	531		14 13 18 92	0.727% due 11/25/20
4.950% due 05/15/2028	300	321	1100 111 000 1 112012000	8 92 8 94	
5.150% due 03/15/2045	100	102	6.250% due 08/25/2037 (d) 17		Greenpoint Mortga 2.459% due 10/25/20
EPR Properties				, 12,	
4.500% due 06/01/2027 Equinix, Inc.	100	102	Amortizing Residential Collateral Trust 0.887% due 10/25/2031	2 2	GS Mortgage Secu 1.915% due 11/10/20
2.150% due 07/15/2030	300	272	Asset-Backed Funding Certificates Trust		GSR Mortgage Loa
3.000% due 07/15/2050	250	210	0.887% due 06/25/2034 93	86 920	1.840% due 03/25/20
	2.00	210	Asset-Backed Securities Corporation Home		2.908% due 09/25/20
Essential Utilities, Inc. 3.351% due 04/15/2050	200	185	Trust	s Equity Luan	HarborView Mortg
		103		80 24	0.642% due 03/19/20
Fidelity National Financial, Inc. 5.500% due 09/01/2022	200	204	Banc of America Funding Trust		2.668% due 07/19/20
	200	204		9 9	Home Equity Asset
Ford Motor Credit Co. LLC					0.487% due 11/25/20
4.250% due 09/20/2022	600	606	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Tr 2.324% due 10/25/2033	rust 13 24	
Goldman Sachs Group, Inc.				51 51	IndyMac INDX Mo
	EUR 500	564		5 5	2.929% due 12/25/20
1.431% due 03/09/2027	\$ 1,700	1,607		57 55	JPMCC Commercia
3.814% due 04/23/2029	600	623	Bear Stearns Alternative-A Trust		3.723% due 03/15/20
HCA, Inc.				7 8	JPMDB Commerci
4.125% due 06/15/2029	700	735	21.0.110.000.0.12012000	5 13	3.694% due 03/15/20
Hyundai Capital America			2.880% due 09/25/2035 (d) 51		JP Morgan Chase
0.800% due 04/03/2023	400	394	3.290% due 08/25/2036 (d) 1	3 8	2.812% due 01/16/20
JPMorgan Chase & Co.			Bear Stearns Structured Products, Inc. Tru	ıst	JP Morgan Mortga
2.522% due 04/22/2031	700	670	2.724% due 01/26/2036 (d) 37		1.822% due 11/25/20
2.580% due 04/22/2032	900	863	Citigroup Mortgage Loan Trust		Long Beach Mortg
2.739% due 10/15/2030	700	685	0.247% due 07/25/2045 29	0 247	0.747% due 10/25/20
Nissan Motor Acceptance Co. L	TC			8 8	LUXE Trust
2.750% due 03/09/2028	200	191		4 5	1.241% due 10/15/20
Oracle Corp. (i)			Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
3.950% due 03/25/2051	100	92		4 4	Mellon Residential Through Trust
4.100% due 03/25/2061	200	182		1 74	0.631% due 12/15/20
Pacific Gas & Electric Co.			Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Ti	hrough Trust	
3.500% due 08/01/2050	400	332	0.647% due 05/25/2035 41		Merrill Lynch Mort 0.347% due 09/25/20
3.750% due 08/15/2042	600	515		7 17	0.427% due 03/25/20
Sabine Pass Liquefaction LLC			0.827% due 03/25/2035 16	2 145	0.847% due 06/25/20
4.500% due 05/15/2030	300	324		61 62	1.799% due 02/25/20
5.000% due 03/15/2027	700	760		24 24	Morgan Stanley Ba
5.750% due 05/15/2024	300	319		91	3.102% due 11/15/20
Southern California Edison Co.			2.850% due 09/20/2036 (d) 16		
3.600% due 02/01/2045	300	281	3.010% due 08/25/2034 (d)	3 3	Morgan Stanley C: 3.530% due 06/15/20
Starbucks Corp.			CS First Boston Mortgage Securities Corp.		
3.500% due 11/15/2050	300	282	6.500% due 04/25/2033	1 1	Morgan Stanley IX
Stryker Corp.			CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Th	rough	0.237% due 11/25/20
1.950% due 06/15/2030	800	741	Certificates		Nomura Asset Acc
	000	741	2.103% due 07/25/2033	3 3	Trust
T-Mobile USA, Inc.	300	281	DBUBS Mortgage Trust		2.396% due 10/25/20
2.550% due 02/15/2031 3.600% due 11/15/2060	200	175	0.735% due 11/10/2046 (e) 90	0 0	Reperforming Loan
	200	1/3	First Horizon Mortgage Pass-Through Trus	it	0.527% due 06/25/20
VMware, Inc.	700	769	2.774% due 08/25/2035 (d) 3		
4.700% due 05/15/2030	700	/09			

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
First NLC Trust 0.257% due 08/25/2037	\$ 78 \$	49
Freddie Mac Multifamily Struct Certificates	ured Pass-Thro	
3.600% due 01/25/2029	900	970
Freddie Mac Structured Pass-TI 0.467% due 09/25/2031	hrough Certifica 116	ates 115
1.288% due 02/25/2045	200	203
1.304% due 10/25/2044	219	224
GreenPoint Mortgage Funding 1		
0.367% due 01/25/2037 0.727% due 11/25/2045	254 34	247 31
Greenpoint Mortgage Pass-Thro 2.459% due 10/25/2033	ugn Certificate 5	s 5
GS Mortgage Securities Trust 1.915% due 11/10/2045 (e)	4,122	19
GSR Mortgage Loan Trust		
1.840% due 03/25/2033	14	14
2.908% due 09/25/2035	67	68
HarborView Mortgage Loan Tru 0.642% due 03/19/2036	st (d) 21	21
2.668% due 07/19/2035	30	25
Home Equity Asset Trust 0.487% due 11/25/2032	1	1
IndyMac INDX Mortgage Loan 1 2.929% due 12/25/2034	rust 29	30
JPMCC Commercial Mortgage S	Securities Trust	
3.723% due 03/15/2050	1,000	1,045
JPMDB Commercial Mortgage \$ 3.694% due 03/15/2050	Securities Trus 1,000	t 1,043
JP Morgan Chase Commercial N 2.812% due 01/16/2037	Nortgage Secur	rities Trust
JP Morgan Mortgage Trust	000	000
1.822% due 11/25/2033	30	30
Long Beach Mortgage Loan Tru: 0.747% due 10/25/2034	st 407	395
LUXE Trust 1.241% due 10/15/2038	500	494
Mellon Residential Funding Cor	poration Mortg	age Pass-
Through Trust 0.631% due 12/15/2030	31	30
Merrill Lynch Mortgage Investo	-	00
0.347% due 09/25/2037	51	29
0.427% due 02/25/2037	10	4
0.847% due 06/25/2028	5	4
1.799% due 02/25/2033	34	33
Morgan Stanley Bank of Americ 3.102% due 11/15/2049	a Merrill Lynch 500	h Trust 508
Morgan Stanley Capital I Trust 3.530% due 06/15/2050	400	416
Morgan Stanley IXIS Real Estat 0.237% due 11/25/2036	e Capital Trust	10
Nomura Asset Acceptance Corp		
Trust 2.396% due 10/25/2035	178	156
Reperforming Loan REMIC Trus		100
0.527% due 06/25/2035 (d)	66	64

	額面金額(単位:千)	時価 (単位:千
Residential Accredit Loans, In		\ -
0.547% due 06/25/2046 0.607% due 04/25/2046	\$ 101 \$ 1,493	30 545
Residential Asset Mortgage Po 8.500% due 10/25/2031	roducts Trust 150	162
Residential Funding Mortgage 2.970% due 09/25/2035 (d)	Securities I Tru: 106	5 t 77
Securitized Asset-Backed Reco 0.317% due 05/25/2037 (d)	eivables LLC Tru: 50	st 44
Sequoia Mortgage Trust 0.862% due 10/19/2026	15	15
Soundview Home Loan Trust 0.247% due 11/25/2036	36	14
Structured Adjustable Rate M		
2.278% due 04/25/2034 2.459% due 02/25/2034	54 46	55 46
		10
Structured Asset Mortgage In 0.407% due 09/25/2047	vestments II Tru 30	st 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 2	489
0.742% due 07/19/2034 0.822% due 10/19/2034	162	160
0.862% due 03/19/2034	6	6
Structured Asset Mortgage In	vestments Trust	
0.822% due 09/19/2032	29	29
Structured Asset Securities C	orporation Mort	jage Loan
Trust 1.606% due 04/25/2035	79	80
Thornburg Mortgage Securitie		00
1.766% due 10/25/2043	88	89
WaMu Mortgage Pass-Throug		
0.767% due 10/25/2045	143	143
0.807% due 01/25/2045 0.898% due 12/25/2046	49 1,172	49 1,131
1.304% due 12/25/2042	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 2.441% due 03/25/2034	162 89	163 92
2.580% due 05/25/2033	24	24
2.723% due 08/25/2034	155	159
	_	15,645
MUNICIPAL BONDS & NOTES		1 - ab la -
Macoupin, Illinois, Pasadena F Revenue Bonds, Series 2010		Authority
7.148% due 03/01/2043	1,140	1,773
U.S. GOVERNMENT AGENCIES	10.5%	
Fannie Mae		
0.168% due 07/25/2037 0.238% due 03/25/2036	4 2	4
0.238% due 03/25/2036 0.307% due 03/25/2034	7	7
0.458% due 09/25/2042	8	8
	21	21
0.537% due 03/25/2044		
0.587% due 06/25/2029	6	
0.587% due 06/25/2029 1.288% due 07/01/2044	6 149	153
0.537% due 03/25/2044 0.587% due 06/25/2029 1.288% due 07/01/2044 1.288% due 10/01/2044	6 149 6	6 153 6
0.587% due 06/25/2029 1.288% due 07/01/2044	6 149	153

	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	60 778	61 794
3.000% due 10/01/2046 3.500% due 04/01/2048	1,502	1,557
3.500% due 06/01/2048	1,002	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
Fannie Mae, TBA (f)		
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
Freddie Mac 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
Ginnie Mae		
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
Small Business Administration 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
	_	28,530
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 8		
Treasury Inflation Protected Sec 1.000% due 02/15/2049 (c)	curities 443	581
U.S. Treasury Bonds	440	001
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
U.S. Treasury Strips 0.000% due 05/15/2026 (e)	4,300_	4,004
0.000 % 008 03/13/2020 (8)	4,300	22,459

	‡ ()	領面金額 単位:千)	時価 (単位:千
Total United States		\$	
(Cost \$97,995)			
SHORT-TERM INSTRUME	NTS 16.0	%	
TIME DEPOSITS 0.8%			
Australia and New Zealan			
(0.220%) due 03/01/2022 0.005% due 03/01/2022	AUD \$	154 3	113
Bank of Nova Scotia			
0.005% due 03/01/2022		1	
0.005% due 03/01/2022	CAD	11	!
BNP Paribas Bank			
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	1	12
(0.740%) due 03/01/2022 (0.340%) due 03/01/2022	DKK ¥	820 5,386	124
(0.300%) due 03/01/2022	SEK	56	4
(0.220%) due 03/01/2022	AUD	72	5:
0.005% due 03/01/2022	\$	122	12
0.005% due 03/01/2022	CAD	115	9
0.005% due 03/01/2022	HKD	20 79	
0.070% due 03/01/2022 0.070% due 03/01/2022	NOK SGD	79 19	1-
0.090% due 03/01/2022	GBP	2	
0.150% due 03/01/2022	NZD	57	3
Brown Brothers Harriman			
(0.340%) due 03/01/2022	¥	3	1
Citibank N.A.		453	45
0.005% due 03/01/2022	\$	157	15
Credit Suisse AG (1.450%) due 03/01/2022	CHF	66	7:
DBS Bank Ltd.			
0.005% due 03/01/2022	\$	31	3
HSBC Bank 0.005% due 03/01/2022	HKD	1	
HSBC Bank PLC			
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	43	4
0.090% due 03/01/2022	GBP	4	
JPMorgan Chase Bank N.		00	
0.005% due 03/01/2022	\$	36	3
MUFG Bank Ltd. (0.340%) due 03/01/2022	¥	5,158	4
Royal Bank of Canada		0,100	
0.005% due 03/01/2022	\$	312	31:
0.005% due 03/01/2022	CAD	52	4
Sumitomo Mitsui Banking			
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	91	10:
(0.340%) due 03/01/2022 0.005% due 03/01/2022	¥	3,332 490	49
0.090% due 03/01/2022	GBP	9	1:
Sumitomo Mitsui Trust Ba	ank Ltd.		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	2	
(0.340%) due 03/01/2022	¥	182	
0.005% due 03/01/2022 0.090% due 03/01/2022	\$ GBP	23 45	2
0.030 % 008 03/01/2022	upr	40_	2,10
ISRAEL TREASURY BILLS	0.6%		
(0.037%) due 03/02/2022 (g)		5.700	1,77
IN OUR OUTUELEUEZ IGI	ILU	0,700_	1,77

		額面金額 単位:千)	時価 (単位:千)
JAPAN TREASURY BILLS (h) 7.	3%		
(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
		_	19,798
U.S. TREASURY BILLS 7.0%			
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
		_	19,095
U.S. TREASURY CASH MANAG	EME	NT BILLS O	.3%
0.200% due 05/17/2022 (h)(k)(m)	\$	800	799
Total Short-Term Instruments		_	43,573
(Cost \$43,661) Total Investments in Securities (Cost \$292,743)	s 104	1.4% \$	284,372
Financial Derivative Instruments (j)(l) (0.1%) (Cost or Premiums, net \$(194))			(198)
Other Assets and Liabilities, ne	t (4.	3%)	(11,774)
Net Assets 100.0%		\$	272,400
		_	

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. Contingent convertible security. Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- Principal amount of security is adjusted for inflation.
- Security is in default.
- Security is an Interest Only ("IO") or IO Strip.
- When-Issued security.

 Coupon represents a weighted average yield to maturity.

 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%
Total Restricted Securities					\$	530	\$	462	0.17%

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)
Total Short	t Sales (3.4%)				\$ (9,214)	\$ (9,270)

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	レポ契約の 受取				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		担保の(受取)/ 差入れ		ネットエクス ポージャー	
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)	
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$	0	\$ 0	\$	0	\$	(9,270)							

¹⁰ Net exposure represents the net receivable/lipayable/ 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:

				未実現評価	<u> 変動</u> 記			
銘柄	種類	限月	契約数	(損)益	資産		負	
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 ⁽¹⁾	Short	03/2022	3	2		0		(4)
Put Option Strike @ EUR 166.000 on Euro-Bund 10-Year Bond April 2022								
Futures ⁽¹⁾	Short	03/2022	3	(3)		0		(5)
Total Futures Contracts				\$ (337)	\$	432	\$	(235)

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION²

			2022年2月28日時点の インプライド クレジット					未実現	見評価		変動	証拠金	È
参照債券	固定受取金利	満期日	スプレッド ⁽⁴⁾	想定	元本(5)	市場	価格	(損) 益	資	産	Í	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
						\$	0	\$	(1)	\$	1	\$	0

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - BUY PROTECTION

	固定(支払)								変動	証拠金	:	
参照指標	金利	満期日	想	定元本 ®	市均	易価格 (6)	未実現評価	i(損)益	資産	1	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⁽²⁾

										加拠金	
参照指標	固定受取金利	満期日	想》	を元本 ®	市場	画格 ^⑥	未実現評価	(損)益	資産	1	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								変動証	
支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日		2元本	市場価格	未実現評価(損)益	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 ⁽⁷⁾	6-Month EURIBOR	(0.250%)	03/16/2027	EUR	16,800	(755)	(606)	28	0
Pay ⁽⁷⁾	6-Month EURIBOR	0.250%	03/16/2032		10,700	(704)	(927)	0	(36)
Pay ⁽⁷⁾	6-Month EURIBOR	0.250%	09/21/2032		2,700	(205)	(183)	0	(10)
Receive ⁽⁷⁾	6-Month EURIBOR	0.500%	03/16/2052		1,000	97	139	5	0
Receive ⁽⁷⁾	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				- 0,000				
,	Overnight Call Rate	0.000%	05/12/2022		115,000	0	0	0	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralised	0100074	OU TELEVEE		110,000				
,	Overnight Call Rate	0.000%	06/16/2022		115,000	0	0	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised	0.00074	00/10/2022		110,000	•			
TIGGGIRG	Overnight Call Rate	0.143%	02/19/2031		300,000	23	23	0	(1)
Receive	Bank of Japan Uncollateralised	0.14070	02/10/2001		300,000	2.0	25	0	(+)
HOGENYG	Overnight Call Rate	0.383%	11/12/2050		115,000	97	97	2	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised	0.00074	11/12/2000		110,000	07	37	2	
Hocere	Overnight Call Rate	0.250%	12/16/2050		115,000	134	94	40	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised	0.20074	12/10/2000		110,000	104	54	40	
HOCCING	Overnight Call Rate	0.350%	03/17/2051		70,000	65	49	17	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralised	0.00070	03/17/2031		70,000	00	43	17	U
HOUSING	Overnight Call Rate	0.450%	06/16/2051		10,000	5	7	0	0
Dave	Bank of Japan Uncollateralised	0.43070	00/10/2001		10,000	9	,	U	U
Pay	Overnight Call Rate	0.400%	12/15/2051		179,000	(130)	(114)	0	(4)
Receive ⁽⁷⁾		1.320%	12/15/2051	\$		(130)	(114)	0	(16)
	Secured Overnight Financing Rate	1.320%	12/21/2023	Þ	8,300	33	(17)	U	(10)
Pay	Sterling Overnight Interbank	0.0100/	00/07/0000	GBP	6 500	(107)	(107)	5	0
Dec. (7)	Average Rate	0.010%	02/07/2023	UBP	6,500	(107)	(107)	5	U
Pay ⁽⁷⁾	Sterling Overnight Interbank	0.5000/	02/46/0002		1 000	1100	(110)		
D1(f)	Average Rate	0.500%	03/16/2027		1,800	(122)	(113)	9	0
Receive ⁽⁷⁾	Sterling Overnight Interbank	0.7500/	00/40/0000		200		**		
	Average Rate	0.750%	03/16/2032		300	26	18	0	0

INTEREST DATE SWARS (Cont.

変動金利の											変動証	拠金	
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	易価格	未実現評	F価(損)益	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)
Total Swap Ag	reements					\$	(3,132)	\$	(3,209)	\$	289	\$	(89)

EINANCIAL DEDIVATIVE INCIDIMENTO: EVOLANCE TRADED OD CENTRALLY CLEADED CHMMAD

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.

			金融派生商				金融派生			
	市場価格		変動証 資産	拠金		市場価格	変動	証拠金 負債		
	置い オブション		先物	スワップ	合計	——売り オブション		スワップ	_	合計
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	1 \$	432	\$ 289	\$ 721	\$ 0	\$ (235)	\$ (89)	\$	(324)

111 Future styled option.

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 (ii) 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 obligation or underlying securities.

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 obligation or underlying securities obligation or underlying securities

If 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.

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.

The prices and resulting values for credit default awap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability for 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.

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

ORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

	亞海1 深位					未実現評価	(損)益	
決済月	受渡	し通貨	3	を取通貨	資産		負債	t
04/2022	\$	5,462	JPY	630,000	\$	13	\$	0
03/2022	JPY	750,000	\$	6,616		101		0
03/2022		510,000		4,516		86		0
03/2022	\$	1,315	NOK	11,822		30		0
04/2022	DKK	13,750	\$	2,172		93		0
05/2022	\$	1,177	SEK	11,028		0		(7)
03/2022	AUD	661	\$	470		0		(10)
03/2022	CAD	199		156		0		0
03/2022	GBP	699		950		12		0
04/2022	DKK	3,745		573		6		0
04/2022	\$	429	DKK	2,795		0		(6)
05/2022		46,868	EUR	41,309		0		(334)
03/2022	ILS	3,301	\$	996		0		(34)
03/2022	NZD	1,493		987		0		(23)
03/2022	\$	394	AUD	545		2		0
03/2022		892	GBP	657		0		(11)
04/2022	DKK	11,960	\$	1,876		68		0
05/2022	\$	3,116	EUR	2,745		0		(24)
03/2022	AUD	2,060	\$	1,454		0		(41)
03/2022	\$	13	PLN	52		0		(1)
03/2022	ILS	2,401	\$	731		0		(18)
03/2022	\$	5	ILS	15		0		0
03/2022		691	NZD	1,038		12		0
	03/2022 03/2022 04/2022 04/2022 05/2022 05/2022 03/2022 04/2022 04/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022 05/2022	04/2022 \$ 03/2022 JPY 03/2022 JPY 03/2022 \$ 03/2022 DKK 05/2022 \$ 03/2022 CAD 03/2022 CAD 03/2022 CAD 03/2022 CBP 04/2022 DKK 04/2022 SBP 05/2022 SBP	04/2022 \$ 5,462 03/2022 JPY 750,000 03/2022 510,000 03/2022 \$ 1,315 04/2022 DKK 13,750 05/2022 \$ 1,177 03/2022 AUD 661 03/2022 CAD 199 04/2022 BKK 3,745 04/2022 \$ 429 05/2022 46,868 03/2022 ILS 3,301 03/2022 NZD 1,493 03/2022 NZD 1,493 03/2022 DKK 11,960 03/2022 DKK 11,960 05/2022 CKK 11,960 05/2022 AUD 2,060 03/2022 AUD 2,060 03/2022 S 13	04/2022 \$ 5,462 JPY 03/2022 JPY 750,000 \$ 03/2022 510,000 \$ 03/2022 \$ 1,315 NOK 04/2022 DKK 13,750 \$ 1,177 SEK 03/2022 \$ 1,177 SEK 03/2022 CAU 199 04/2022 DKK 3,745 O4/2022 \$ 429 DKK 05/2022 \$ 45,868 EUR 03/2022 NZO 1,493 03/2022 \$ 394 AUD 03/2022 \$ 3116 EUR 05/2022 \$ 3,116 EUR 05/2022 \$ 3,116 EUR 05/2022 \$ 3,116 EUR 05/2022 \$ 11.5 2,401 \$ 1.5 EUR 03/2022 \$ 11.5 2,401 \$ 11.5 EUR 03/2022 \$ 5 5 EUS 03/2022 \$ 5 5 EUS	04/2022 \$ 5,462 JPY 630,000 03/2022 JPY 750,000 \$ 6,616 03/2022 \$ 10,000 \$ 6,616 03/2022 \$ 1,315 NOK 11,822 04/2022 DKK 13,750 \$ 2,172 05/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 03/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 03/2022 CAO 199 156 03/2022 CAO 199 156 03/2022 CAO 199 5 156 03/2022 CAO 199 5 156 03/2022 CAO 199 9 990 05/2022 CAO 1,493 996 05/2022 CAO 1,493 996 05/2022 CAO 1,493 997 05/2023 CAO 1,493 997 05/2023 CAO 1,493 997 05/2023 CAO 1,493 997 05/2024 CAO 1,493 997 05/2025 CAO 1,494 997 05/2025 CAO 1,494 997 05/2025 CAO 1,494 997 05/2026 CAO 1,494 997 05/2026 CAO 1,494 997 05/2026 CAO 1,494 997 05/2026 CAO 1	04/2022 \$ 5,462 JPY 630,000 \$ 6,616 0 03/2022 510,000 \$ 6,616 0 03/2022 \$ 10,000 \$ 4,516 0 03/2022 \$ 1,315 NOK 11,822 0 04/2022 DKK 13,750 \$ 2,172 0 05/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 0 03/2022 CAD 199 156 0 03/2022 GBP 689 9 950 0 04/2022 DKK 3,745 573 0 04/2022 \$ 429 DKK 2,795 0 05/2022 \$ 429 DKK 2,795 0 05/2022 \$ 46,868 EUR 41,309 0 03/2022 \$ 46,868 EUR 41,309 0 03/2022 \$ 1,174	決済月 受邀し通貨 安取通貨 資産 04/2022 \$ 5,462 JPY 630,000 \$ 13 03/2022 JPY 750,000 \$ 6,616 101 03/2022 \$ 510,000 \$ 4,516 86 03/2022 \$ 1,315 NOK 11,822 30 04/2022 DKX 13,750 \$ 2,172 93 05/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 0 03/2022 AUD 661 \$ 470 0 03/2022 GBP 699 950 12 04/2022 DKX 3,745 573 6 04/2022 S 429 DKK 2,795 0 05/2022 48,668 EUR 41,309 0 03/2022 ILS 3,301 \$ 996 0 03/2022 NZD 1,493 987 0 03/2022 NZD 1,493 987 0 03/2022 \$ 394 AUD 545 2 04/2022 DKK 11,960 \$ 1,876 68 05/2022 \$ 3,116 EUR 2,745 0 <	04/2022 \$ 5,462 JPY 630,000 \$ 13 \$ 03/2022 JPY 750,000 \$ 6,616 101 03/2022 \$ 510,000 4,516 86 03/2022 \$ 1,315 NOK 11,822 30 04/2022 DKK 13,750 \$ 2,172 93 05/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 0 05/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 0 03/2022 \$ 1,177 SEK 11,028 0 03/2022 CAU 199 156 0 03/2022 CAU 199 156 0 03/2022 GBP 699 950 12 04/2022 DKK 3,745 573 6 04/2022 BKK 3,745 573 6 04/2022 \$ 429 DKK 2,795 0 05/2022 \$ 48,868 EUR 41,309 0 03/2022 \$ 48,868 EUR 41,309 0 03/2022 \$ 48,868 EUR 41,309 0 03/2022 \$ 3,301 \$ 996 0 03/2022 \$ 3,301 \$ 996 0 03/2022 \$ 3,301 \$ 996 0 03/2022 \$ 394 AUD 545 2 2 03/2022 \$ 394 AUD 545 2 2 03/2022 \$ 394 AUD 545 2 0 03/2022 \$ 3,116 EUR 2,745 0 03/2022 \$ 11S 3,116 EUR 2,745 0 03/2022 \$ 11S 1,960 \$ 1,876 68 05/2022 \$ 3,116 EUR 2,745 0 03/2022 \$ 11S 2,401 \$ 731 0 03/2022 \$ 11S 2,401 \$ 731 0

EORW					

						未実現評価	(損)益
取引相手	決済月		し通貨		双通貨	資産	負債
GLM	03/2022	\$	8	PLN	31	\$ 0	\$ 0
GLM	04/2022	JPY	1,330,000	\$	11,483	0	(75
HUS	03/2022	\$	15	SGD	21	0	0
HUS	04/2022	DKK	3,870	\$	602	17	0
HUS	04/2022	\$	303	DKK	1,940	0	(10
JPM	03/2022	GBP	186	\$	253	3	0
JPM	03/2022	\$	705	CAD	898	3	0
JPM	03/2022		321	GBP	237	0	(3
JPM	03/2022		59	HKD	461	0	0
JPM	03/2022		731	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	\$	173	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	Ō
MYI	03/2022	\$	2,063	AUD	2,884	29	Ō
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	\$	762	DKK	5,042	0	0
MYI	05/2022	EUR	265	\$	299	0	0
MYI	05/2022	\$	175	EUR	154	0	(2
RBC	05/2022		1,697	CHF	1,565	14	0
SCX	03/2022	GBP	5,207	\$	6,985	0	12
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	Ö
SOG	03/2022	AUD	1,252		877	0	(32
TOR	03/2022		848		592	0	(23
TOR	03/2022	CAD	10,840		8,547	0	0
TOR	03/2022	\$	12,594	AUD	17,555	145	0
TOR	03/2022	*	8,035	CAD	10,219	22	Ö
TOR	04/2022	AUD	17,555	\$	12,598	0	(147
TOR	04/2022	\$	8,547	CAD	10,838	0	(147)
UAG	03/2022	AUD	18,145	\$	12,859	0	(307
unu	0012022	AUU	10,170	*	12,000	\$ 958	\$ (1,140

JPY HEDGED			

							未実現評価	(損) 益	
取引相手	決済月	受渡	とし 通貨		受取通貨	資産		負債	į
BOA	03/2022	CAD	2	\$	1	\$	0	\$	0
B0A	03/2022	CHF	57		62		0		0
BPS	03/2022	\$	15	EUR	13		0		0
BPS	03/2022		3	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		2,281		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		10	CHF	9		0		0
MYI	03/2022		49	EUR	43		0		0
MYI	03/2022		39	GBP	29		0		0
MYI	03/2022		23	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		2,719		312,920		0		0

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

						未実現評価(損)益 資産 負債			
取引相手	決済月	受渡	し通貨	受	取通貨	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)
Total Forwar	d Foreign Currency Cor	itracts				\$	963	\$	(1,153)

PURCHASED OPTIONS:

INTEREST DATE SWARTINGS

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 (1)	Π.	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
Total Purchased Options					\$	102	\$	246		

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPTIONS

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 (1)	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 DEFAILET SWAPTIONS

取引相手	銘柄	元/貝 プロテクション	権利行使 レート	行使期限	フレミアム 想定元本 (*) (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 DEF	AULT 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 (1)	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)
						\$	(18)	\$	(24)
Total Written Options						\$	(296)	\$	(651)

¹¹⁾ Notional amount represents the number of contracts.