

CS インベストメント・ファンズ・12

クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

運用報告書 (全体版)

作成対象期間 (第 27 期)

自 2019 年 4 月 1 日

至 2020 年 3 月 31 日

管理会社

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイ
(Credit Suisse Fund Management S.A.)

代行協会員

クレディ・スイス証券株式会社

受益者の皆様へ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚く御礼申し上げます。さて、CSインベストメント・ファンズ・12（以下「ファンド」といいます。）のサブ・ファンドであるクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USDおよびクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD（以下、個別にまたは総称して「サブ・ファンド」といいます。）は、このたび、第27期の決算を行いました。ここに運用状況を ご報告申し上げます。

CSインベストメント・ファンズ・12の仕組みは次の通りです。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

| | | |
|--------------|---|--------|
| ファンドの形態 | ルクセンブルク籍オープン・エンド型契約型追加型外国投資信託 | |
| 信託期間 | 無期限 | |
| 早期償還 | 管理会社は、いつでも、保管受託銀行の承認を受けた上で、ファンドを終了し、個別のサブ・ファンドまたは個別の受益証券クラスを解散することができます。 | |
| 運用方針 | サブ・ファンドは、その資産を世界的規模（新興国を含みます。）で投資し、以下に記載される資産クラスに対する直接的または間接的なエクスポージャーをもたらします。間接的なエクスポージャーは、とりわけ、デリバティブ、仕組商品および投資対象ファンドの利用を通じて達成することができます。投資の主要部分は、サブ・ファンドの参照通貨で行われます。したがって、為替レートの変動に伴うリスクは、長期的に最小限に抑えられます。 | |
| | 資産クラス | 投資幅 |
| | 現金およびその他現金同等物 | 0～50% |
| | 債券 | 35～85% |
| | 株式 | 15～35% |
| | オルタナティブ投資 | 0～20% |
| 主要投資対象 | 現金およびその他現金同等物、債券、株式ならびにオルタナティブ投資 | |
| 主な投資制限 | 特記すべき主な投資制限はありません。 | |
| サブ・ファンドの運用方法 | サブ・ファンドの資産は、リスク分散の原則に従い、ルクセンブルクの2010年12月17日法第41条に定められる譲渡性のある証券およびその他の資産に投資されます。 | |
| 分配方針 | 本書の日付現在、サブ・ファンドのクラスB米ドル（acc）受益証券およびクラスBH円建て（acc）受益証券については分配は予定していません。 | |

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

| | | |
|--------------|---|--------|
| ファンドの形態 | ルクセンブルク籍オープン・エンド型契約型追加型外国投資信託 | |
| 信託期間 | 無期限 | |
| 早期償還 | 管理会社は、いつでも、保管受託銀行の承認を受けた上で、ファンドを終了し、個別のサブ・ファンドまたは個別の受益証券クラスを解散することができます。 | |
| 運用方針 | サブ・ファンドは、その資産を世界的規模（新興国を含みます。）で投資し、以下に記載される資産クラスに対する直接的または間接的なエクスポージャーをもたらします。間接的なエクスポージャーは、とりわけ、デリバティブ、仕組商品および投資対象ファンドの利用を通じて達成することができます。投資の主要部分は、時に、サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で行われることがあります。サブ・ファンドは、その総資産の少なくとも25%を適格持分金融商品に投資します。 | |
| | 資産クラス | 投資幅 |
| | 現金およびその他現金同等物 | 0～60% |
| | 債券 | 10～70% |
| | 株式 | 30～60% |
| | オルタナティブ投資 | 0～20% |
| 主要投資対象 | 現金およびその他現金同等物、債券、株式ならびにオルタナティブ投資 | |
| 主な投資制限 | 特記すべき主な投資制限はありません。 | |
| サブ・ファンドの運用方法 | サブ・ファンドの資産は、リスク分散の原則に従い、ルクセンブルクの2010年12月17日法第41条に定められる譲渡性のある証券およびその他の資産に投資されます。 | |
| 分配方針 | 本書の日付現在、サブ・ファンドのクラスB米ドル（acc）受益証券およびクラスBH円建て（acc）受益証券については分配は予定していません。 | |

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

| | | |
|--------------|--|--------|
| ファンドの形態 | ルクセンブルク籍オープン・エンド型契約型追加型外国投資信託 | |
| 信託期間 | 無期限 | |
| 早期償還 | 管理会社は、いつでも、保管受託銀行の承認を受けた上で、ファンドを終了し、個別のサブ・ファンドまたは個別の受益証券クラスを解散することができます。 | |
| 運用方針 | サブ・ファンドは、その資産を世界的規模（新興国を含みます。）で投資し、以下に記載される資産クラスに対する直接的または間接的なエクスポージャーをもたらします。間接的なエクスポージャーは、とりわけ、デリバティブ、仕組商品および投資対象ファンドの利用を通じて達成することができます。投資の主要部分は、サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で行われることがあります。サブ・ファンドは、その総資産の50%超を適格持分金融商品に投資します。 | |
| | 資産クラス | 投資幅 |
| | 現金およびその他現金同等物 | 0～50% |
| | 債券 | 0～50% |
| | 株式 | 50～80% |
| | オルタナティブ投資 | 0～20% |
| 主要投資対象 | 現金およびその他現金同等物、債券、株式ならびにオルタナティブ投資 | |
| 主な投資制限 | 特記すべき主な投資制限はありません。 | |
| サブ・ファンドの運用方法 | サブ・ファンドの資産は、リスク分散の原則に従い、ルクセンブルクの2010年12月17日法第41条に定められる譲渡性のある証券およびその他の資産に投資されます。 | |
| 分配方針 | 本書の日付現在、サブ・ファンドのクラスB米ドル（acc）受益証券およびクラスBH円建て（acc）受益証券については分配は予定していません。 | |

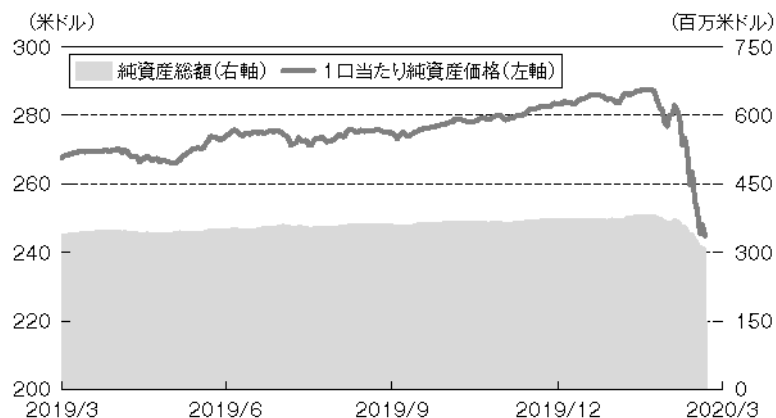
I. 計算期間中における運用の経過および運用状況の推移等

(1) 当期の運用経過および今後の運用方針

当期の受益証券 1 口当たり純資産価格等の推移

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

（クラスB米ドル（acc）受益証券）



| |
|--------------------|
| 第26期末の 1 口当たり純資産価格 |
| 267.37米ドル |
| 第27期末の 1 口当たり純資産価格 |
| 260.56米ドル |
| (分配金額：該当事項なし) |
| 騰落率 |
| -2.55% |

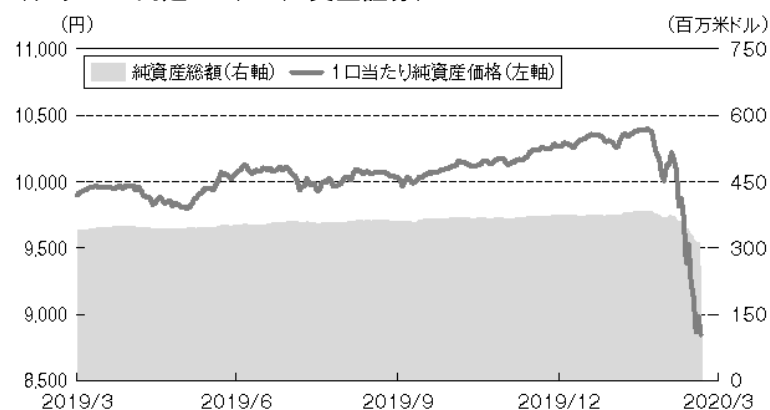
(注1) 騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。以下同じです。なお、サブ・ファンドに分配金の支払実績はありません。

(注2) サブ・ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。以下同じです。

(注3) サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下同じです。

(注4) グラフ中の純資産総額は、サブ・ファンドの純資産総額を表示しています。以下同じです。

（クラスBH円建て（acc）受益証券）



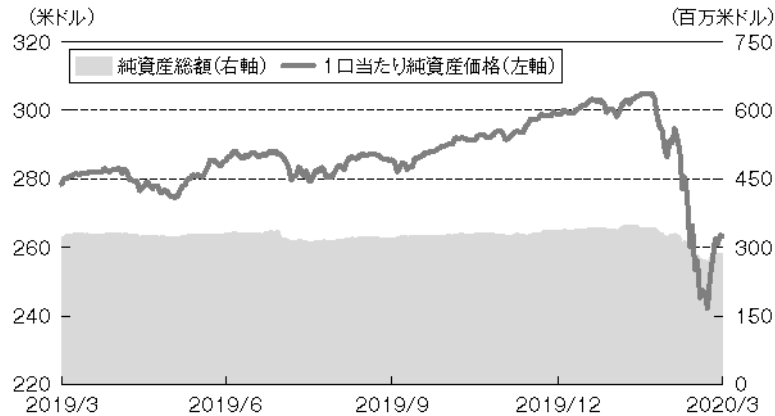
| |
|--------------------|
| 第26期末の 1 口当たり純資産価格 |
| 9,895円 |
| 第27期末の 1 口当たり純資産価格 |
| 9,395円 |
| (分配金額：該当事項なし) |
| 騰落率 |
| -5.05% |

一口当たり純資産価格の主な変動要因

一口当たり純資産価格はポートフォリオの市場価格の変化に応じて変動します。
詳細は後記の「投資環境について」および「ポートフォリオについて」を参照ください。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

（クラスB米ドル（acc）受益証券）



| |
|------------------|
| 第26期末の1口当たり純資産価格 |
| 278.37米ドル |
| 第27期末の1口当たり純資産価格 |
| 263.06米ドル |
| （分配金額：該当事項なし） |
| 騰落率 |
| －5.50% |

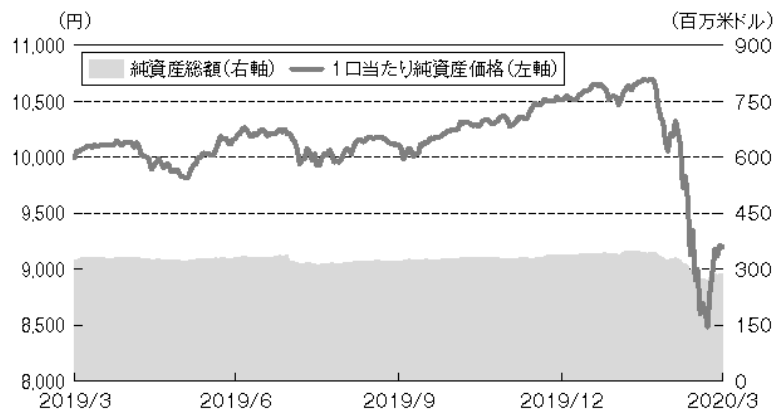
（注1）騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。以下同じです。なお、サブ・ファンドに分配金の支払実績はありません。

（注2）サブ・ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。以下同じです。

（注3）サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下同じです。

（注4）グラフ中の純資産総額は、サブ・ファンドの純資産総額を表示しています。以下同じです。

（クラスBH円建て（acc）受益証券）



| |
|------------------|
| 第26期末の1口当たり純資産価格 |
| 9,994円 |
| 第27期末の1口当たり純資産価格 |
| 9,197円 |
| （分配金額：該当事項なし） |
| 騰落率 |
| －7.97% |

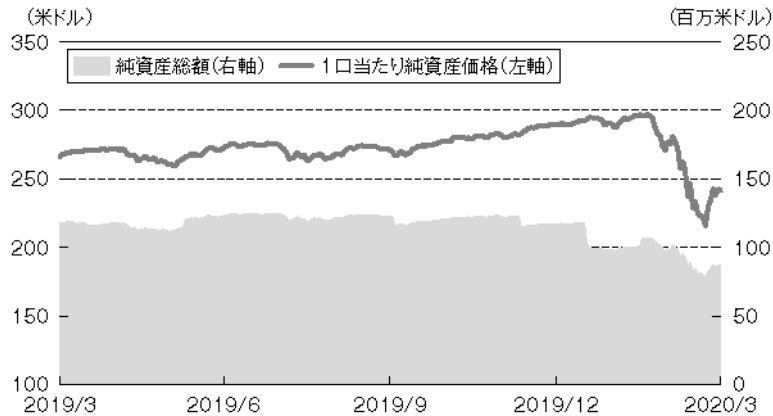
一口当たり純資産価格の主な変動要因

一口当たり純資産価格はポートフォリオの市場価格の変化に応じて変動します。

詳細は後記の「投資環境について」および「ポートフォリオについて」を参照ください。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

（クラスB米ドル（acc）受益証券）



| |
|------------------|
| 第26期末の1口当たり純資産価格 |
| 265.84米ドル |
| 第27期末の1口当たり純資産価格 |
| 241.43米ドル |
| （分配金額：該当事項なし） |
| 騰落率 |
| -9.18% |

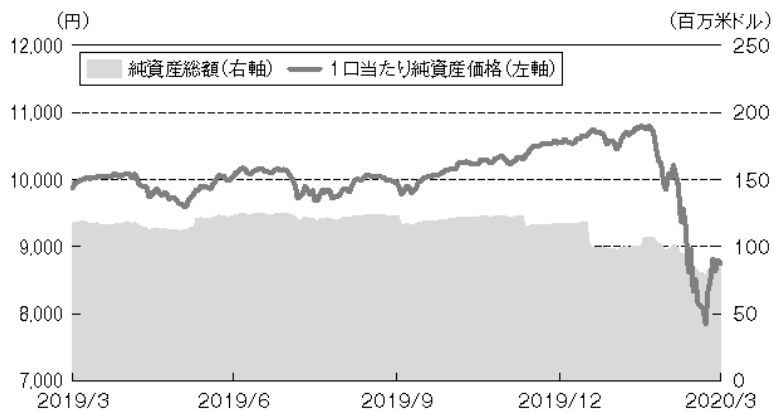
（注1）騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。以下同じです。なお、サブ・ファンドに分配金の支払実績はありません。

（注2）サブ・ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。以下同じです。

（注3）サブ・ファンドにベンチマークは設定されていません。以下同じです。

（注4）グラフ中の純資産総額は、サブ・ファンドの純資産総額を表示しています。以下同じです。

（クラスBH円建て（acc）受益証券）



| |
|------------------|
| 第26期末の1口当たり純資産価格 |
| 9,875円 |
| 第27期末の1口当たり純資産価格 |
| 8,749円 |
| （分配金額：該当事項なし） |
| 騰落率 |
| -11.40% |

一口当たり純資産価格の主な変動要因

一口当たり純資産価格はポートフォリオの市場価格の変化に応じて変動します。

詳細は後記の「投資環境について」および「ポートフォリオについて」を参照ください。

分配金について

該当事項はありません。

投資環境について

2019年4月1日から2020年3月31日までの報告対象期間においては、2020年1月に中国でコロナウィルスが発生し、その後、地球上のほぼすべての地域に広がりました。また、機を同じくして、米国と中国とユーロ圏の間で貿易戦争が始まりました。米国経済は、ユーロ圏より力強く拡大し、英国、日本およびスイスがこれに続きました。新興国市場は、再び先進国を大きく上回る成長を遂げました。コロナウィルスの世界的流行により、世界経済は数週間で事実上停止しました。ある程度のロックダウンを導入しなかった国は殆どありません。結果的に、3月末に向けた利用可能なほぼすべての経済指標は、急速に悪化しました。景気先行指数は急減し、失業率は指数関数的に上昇しています。報告対象期間中、インフレ率は低いままとなっています。企業収益は総じて好調に推移しました。

長期債券市場の利回りは低位を維持し、マイナスでさえあります。米国ではFEDが3月に短期金利をゼロに近くまで非常に積極的に引き下げ、市場に流動性を提供するためのさまざまなプログラムを実施しており、10年物国債利回りは1%を下回りました。ユーロ圏、日本およびスイスでは、利回りは極めて低位を維持するか、マイナスに落ち込む場面さえありました。主要な市場ではイールド・カーブはフラット化しました。

ヨーロッパでコロナウィルスが発生するまで、株式市場は、順調に推移しました。数週間以内に、殆どの株式市場は過去最高値から少なくとも20%下落しました。スイスと日本の株式市場は防御的な性質のため持ちこたえましたが、オーストラリアのようなコモディティに敏感な国は、パフォーマンスが悪化しました。

上場不動産投資は、商業用不動産の需要の低下を受けて、下降トレンドを辿りました。コモディティ・セクターは、サウジアラビアとロシアの間の石油価格戦争の激化により、下降傾向でした。為替は、米ドルがわずかに優勢でユーロがやや弱含みでした。

ポートフォリオについて

《クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

《クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

《クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

サブ・ファンドのパフォーマンスはマイナスでした。

報告対象期間の当初、株式についてややオーバーウェイトしました。多くの政治的・経済的不確実性を踏まえ、当期を通じて株式に対するポジティブな姿勢を維持しました。1月には我々は株式市場でいくらかの利益を得ました。報告対象期間中、我々はコモディティを若干オーバーウェイトし、また上場グローバル不動産も若干オーバーウェイトしました。

投資の対象とする有価証券の主な銘柄

当期末現在における有価証券の主な銘柄については、後記「Ⅲ. ファンドの経理状況、（３）投資有価証券明細表等」をご参照ください。

今後の運用方針

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

世界中の固定または変動利付債券と株式等に国際分散投資を行い、米ドル建てでそれ相当のリターンを獲得することを目指します。債券への配分は少なくとも純資産総額の35%とします。マネー・マーケット投資証券への投資も付随的に行われることがあります。また、20%を上限に不動産関連証券およびコモディティにも投資を行うことができます。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

基本的に固定または変動利付債券および株式等に同等に配分しながら国際分散投資を行い、米ドル建てで最大限のトータル・リターンを獲得することを目指します。株式への配分は30～60%の間で変化することがあります。マネー・マーケット投資証券への投資も付随的に行われることがあります。また、20%を上限に不動産関連証券およびコモディティにも投資を行うことができます。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

世界中の株式等および固定または変動利付債券に分散投資を行い、米ドル建てで最大限のトータル・リターンを獲得することを目指します。株式への配分は少なくとも純資産総額の50%とします。マネー・マーケット投資証券への投資も付随的に行われることがあります。また、20%を上限に不動産関連証券およびコモディティにも投資を行うことができます。

(2) 費用の明細

《クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

| 項目 | 項目の概要 | |
|--------------|--|---|
| 管理報酬 | クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD 上限1.30% (クラスB米ドル (acc) 受益証券、クラスBH円建て (acc) 受益証券ともに) | 本サブ・ファンドの信託財産の管理業務への対価 |
| 保管受託銀行の報酬 | ルクセンブルグにおける一般的な通常の市場レートを基準として随時管理会社との間で合意された率で請求され、各サブ・ファンドの純資産ならびに／もしくは保有されている譲渡性のある証券およびその他の資産の価値を基準とするか、または定額として算出されます。保管受託銀行に支払われる報酬は、年率0.10%を超えないものとしますが、一定の場合において、保管受託銀行の取引手数料および報酬が追加で請求される場合があります。 | 本ファンドの信託財産の保管業務への対価 |
| 中央管理事務代行会社報酬 | 管理報酬の中から中央管理事務代行会社に支払われます。 | 本ファンドの管理事務に関して生じるすべての管理業務への対価 |
| 代行協会員報酬 | 本ファンドの日本の投資家が保有する受益証券に帰属する本ファンドの当該期間における平均純資産総額に対し年率0.01% (該当がある場合、付加価値税を除きます。) | 運用報告書等の日本における販売会社への送付および受益証券1口当たり純資産価格の公表ならびにこれらに付随する業務への対価 |
| その他の費用 (当期) | 0.16% | 管理事務代行費用、印刷および公告費、利息および銀行手数料、年次税、監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 |

(注1) 各報酬については、目論見書に定められている料率を記しています。「その他の費用 (当期)」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、当期のその他の費用の金額をサブ・ファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

(注2) 各項目の費用は、サブ・ファンドが組み入れている投資先ファンドの費用を含みません。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

| 項目 | 項目の概要 | |
|--------------|--|---|
| 管理報酬 | クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD 上限1.50% （クラスB米ドル（acc）受益証券、クラスBH円建て（acc）受益証券ともに） | 本サブ・ファンドの信託財産の管理業務への対価 |
| 保管受託銀行の報酬 | ルクセンブルグにおける一般的な通常の市場レートを基準として随時管理会社との間で合意された率で請求され、各サブ・ファンドの純資産ならびに／もしくは保有されている譲渡性のある証券およびその他の資産の価値を基準とするか、または定額として算出されます。保管受託銀行に支払われる報酬は、年率0.10%を超えないものとしますが、一定の場合において、保管受託銀行の取引手数料および報酬が追加で請求される場合があります。 | 本ファンドの信託財産の保管業務への対価 |
| 中央管理事務代行会社報酬 | 管理報酬の中から中央管理事務代行会社に支払われます。 | 本ファンドの管理事務に関して生じるすべての管理業務への対価 |
| 代行協会員報酬 | 本ファンドの日本の投資家が保有する受益証券に帰属する本ファンドの当該期間における平均純資産総額に対し年率0.01%（該当がある場合、付加価値税を除きます。）。 | 運用報告書等の日本における販売会社への送付および受益証券1口当たり純資産価格の公表ならびにこれらに付随する業務への対価 |
| その他の費用（当期） | 0.17% | 管理事務代行費用、印刷および公告費、利息および銀行手数料、年次税、監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 |

（注1）各報酬については、目論見書に定められている料率を記しています。「その他の費用（当期）」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、当期のその他の費用の金額をサブ・ファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

（注2）各項目の費用は、サブ・ファンドが組み入れている投資先ファンドの費用を含みません。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

| 項目 | 項目の概要 | |
|--------------|--|---|
| 管理報酬 | クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD 上限1.70% （クラスB米ドル（acc）受益証券、クラスBH円建て（acc）受益証券ともに） | 本サブ・ファンドの信託財産の管理業務への対価 |
| 保管受託銀行の報酬 | ルクセンブルグにおける一般的な通常の市場レートを基準として随時管理会社との間で合意された率で請求され、各サブ・ファンドの純資産ならびに／もしくは保有されている譲渡性のある証券およびその他の資産の価値を基準とするか、または定額として算出されます。保管受託銀行に支払われる報酬は、年率0.10%を超えないものとしますが、一定の場合において、保管受託銀行の取引手数料および報酬が追加で請求される場合があります。 | 本ファンドの信託財産の保管業務への対価 |
| 中央管理事務代行会社報酬 | 管理報酬の中から中央管理事務代行会社に支払われます。 | 本ファンドの管理事務に関して生じるすべての管理業務への対価 |
| 代行協会員報酬 | 本ファンドの日本の投資家が保有する受益証券に帰属する本ファンドの当該期間における平均純資産総額に対し年率0.01% （該当がある場合、付加価値税を除きます。）。 | 運用報告書等の日本における販売会社への送付および受益証券1口当たり純資産価格の公表ならびにこれらに付随する業務への対価 |
| その他の費用（当期） | 0.21% | 管理事務代行費用、印刷および公告費、利息および銀行手数料、年次税、監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 |

（注1）各報酬については、目論見書に定められている料率を記しています。「その他の費用（当期）」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、当期のその他の費用の金額をサブ・ファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

（注2）各項目の費用は、サブ・ファンドが組み入れている投資先ファンドの費用を含みません。

Ⅱ. 直近10期の運用実績

(1) 純資産の推移

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD》

| | 純資産総額 | | 1口当たり純資産価格 | | |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------------|--------|----------------------------|
| | 米ドル | 円 | クラスB米ドル（acc） 受益証券 | | クラスBH円建て （acc）受益証券 円 |
| | | | 米ドル | 円 | |
| 第18会計年度末 （2011年3月31日） | 261,883,370.19 | 27,393,000,522 | 233.25 | 24,398 | — |
| 第19会計年度末 （2012年3月31日） | 245,186,986.37 | 25,646,558,774 | 233.85 | 24,461 | — |
| 第20会計年度末 （2013年3月31日） | 258,414,365.67 | 27,030,142,649 | 243.49 | 25,469 | — |
| 第21会計年度末 （2014年3月31日） | 248,673,146.68 | 26,011,211,143 | 244.71 | 25,597 | — |
| 第22会計年度末 （2015年3月31日） | 253,993,303.23 | 26,567,699,518 | 248.99 | 26,044 | — |
| 第23会計年度末 （2016年3月31日） | 257,101,944.01 | 26,892,863,343 | 243.99 | 25,521 | — |
| 第24会計年度末 （2017年3月31日） | 279,726,384.89 | 29,259,379,859 | 253.03 | 26,467 | — |
| 第25会計年度末 （2018年3月31日） | 334,853,152.06 | 35,025,639,705 | 261.57 | 27,360 | 9,952 |
| 第26会計年度末 （2019年3月31日） | 339,693,928.62 | 35,531,984,934 | 267.37 | 27,967 | 9,895 |
| 第27会計年度末 （2020年3月31日） | 322,987,349.64 | 33,784,476,772 | 260.56 | 27,255 | 9,395 |
| 2019年4月末日 | 348,260,965.10 | 36,428,096,949 | 270.08 | 28,250 | 9,971 |
| 5月末日 | 345,209,836.66 | 36,108,948,915 | 266.01 | 27,825 | 9,797 |
| 6月末日 | 351,200,476.61 | 36,735,569,853 | 273.73 | 28,632 | 10,058 |
| 7月末日 | 361,078,556.27 | 37,768,816,986 | 274.39 | 28,701 | 10,058 |
| 8月末日 | 358,160,825.04 | 37,463,622,299 | 274.42 | 28,704 | 10,040 |
| 9月末日 | 361,417,087.08 | 37,804,227,309 | 274.99 | 28,764 | 10,036 |
| 10月末日 | 367,699,959.98 | 38,461,415,814 | 277.98 | 29,077 | 10,121 |
| 11月末日 | 365,912,936.60 | 38,274,493,168 | 279.33 | 29,218 | 10,153 |
| 12月末日 | 373,482,470.19 | 39,066,266,382 | 283.24 | 29,627 | 10,266 |
| 2020年1月末日 | 373,770,365.60 | 39,096,380,242 | 283.57 | 29,661 | 10,262 |
| 2月末日 | 368,100,053.00 | 38,503,265,544 | 276.75 | 28,948 | 10,007 |

| | | | | | |
|---------|----------------|----------------|--------|--------|-------|
| 3 月 末 日 | 322,987,349.64 | 33,784,476,772 | 260.56 | 27,255 | 9,395 |
|---------|----------------|----------------|--------|--------|-------|

(注1) 米ドルの円貨換算は、便宜上、2020年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝104.60円）によります。以下同じです。

(注2) クラスBH円建て（acc）受益証券は、2017年8月3日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始しました。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD》

| | 純資産総額 | | 1口当たり純資産価格 | | |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------------|--------|----------------------------|
| | 米ドル | 円 | クラスB米ドル（acc） 受益証券 | | クラスBH円建て （acc）受益証券 円 |
| | | | 米ドル | 円 | |
| 第18会計年度末 （2011年3月31日） | 111,966,148.42 | 11,711,659,125 | 232.22 | 24,290 | — |
| 第19会計年度末 （2012年3月31日） | 96,760,650.97 | 10,121,164,091 | 227.72 | 23,820 | — |
| 第20会計年度末 （2013年3月31日） | 97,163,367.39 | 10,163,288,229 | 240.55 | 25,162 | — |
| 第21会計年度末 （2014年3月31日） | 115,585,234.51 | 12,090,215,530 | 248.07 | 25,948 | — |
| 第22会計年度末 （2015年3月31日） | 131,245,497.22 | 13,728,279,009 | 251.44 | 26,301 | — |
| 第23会計年度末 （2016年3月31日） | 144,731,669.50 | 15,138,932,630 | 243.41 | 25,461 | — |
| 第24会計年度末 （2017年3月31日） | 206,009,298.61 | 21,548,572,635 | 258.08 | 26,995 | — |
| 第25会計年度末 （2018年3月31日） | 310,484,462.82 | 32,476,674,811 | 273.13 | 28,569 | 10,076 |
| 第26会計年度末 （2019年3月31日） | 322,314,020.43 | 33,714,046,537 | 278.37 | 29,118 | 9,994 |
| 第27会計年度末 （2020年3月31日） | 287,121,088.45 | 30,032,865,852 | 263.06 | 27,516 | 9,197 |
| 2019年4月末日 | 331,167,950.26 | 34,640,167,597 | 282.94 | 29,596 | 10,134 |
| 5月末日 | 321,579,705.80 | 33,637,237,227 | 274.54 | 28,717 | 9,810 |
| 6月末日 | 330,513,657.43 | 34,571,728,567 | 285.25 | 29,837 | 10,166 |
| 7月末日 | 320,428,850.72 | 33,516,857,785 | 286.03 | 29,919 | 10,168 |
| 8月末日 | 316,913,624.71 | 33,149,165,145 | 283.96 | 29,702 | 10,075 |
| 9月末日 | 320,457,768.38 | 33,519,882,573 | 285.59 | 29,873 | 10,109 |
| 10月末日 | 327,317,477.53 | 34,237,408,150 | 290.05 | 30,339 | 10,246 |
| 11月末日 | 328,270,451.49 | 34,337,089,226 | 293.08 | 30,656 | 10,335 |
| 12月末日 | 337,562,468.08 | 35,309,034,161 | 298.93 | 31,268 | 10,512 |
| 2020年1月末日 | 338,184,448.40 | 35,374,093,303 | 298.17 | 31,189 | 10,469 |
| 2月末日 | 322,973,850.52 | 33,783,064,764 | 286.49 | 29,967 | 10,050 |
| 3月末日 | 287,121,088.45 | 30,032,865,852 | 263.06 | 27,516 | 9,197 |

（注）クラスBH円建て（acc）受益証券は、2017年8月4日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始しました。

《クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD》

| | 純資産総額 | | 1口当たり純資産価格 | | |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------------|--------|----------------------------|
| | 米ドル | 円 | クラスB米ドル（acc） 受益証券 | | クラスBH円建て （acc）受益証券 円 |
| | | | 米ドル | 円 | |
| 第18会計年度末 （2011年3月31日） | 83,519,599.82 | 8,736,150,141 | 214.74 | 22,462 | — |
| 第19会計年度末 （2012年3月31日） | 71,383,837.20 | 7,466,749,371 | 204.38 | 21,378 | — |
| 第20会計年度末 （2013年3月31日） | 72,307,055.71 | 7,563,318,027 | 217.47 | 22,747 | — |
| 第21会計年度末 （2014年3月31日） | 72,816,678.85 | 7,616,624,608 | 231.57 | 24,222 | — |
| 第22会計年度末 （2015年3月31日） | 63,583,025.77 | 6,650,784,496 | 233.51 | 24,425 | — |
| 第23会計年度末 （2016年3月31日） | 61,416,279.26 | 6,424,142,811 | 220.97 | 23,113 | — |
| 第24会計年度末 （2017年3月31日） | 73,196,893.35 | 7,656,395,044 | 240.97 | 25,205 | — |
| 第25会計年度末 （2018年3月31日） | 89,654,915.18 | 9,377,904,128 | 261.77 | 27,381 | 9,431 |
| 第26会計年度末 （2019年3月31日） | 117,169,163.33 | 12,255,894,484 | 265.84 | 27,807 | 9,875 |
| 第27会計年度末 （2020年3月31日） | 86,710,192.70 | 9,069,886,156 | 241.43 | 25,254 | 8,749 |
| 2019年4月末日 | 117,828,757.58 | 12,324,888,043 | 272.06 | 28,457 | 10,082 |
| 5月末日 | 112,129,310.14 | 11,728,725,841 | 259.42 | 27,135 | 9,597 |
| 6月末日 | 123,063,698.11 | 12,872,462,822 | 272.35 | 28,488 | 10,049 |
| 7月末日 | 123,810,746.42 | 12,950,604,076 | 273.17 | 28,574 | 10,055 |
| 8月末日 | 121,681,551.57 | 12,727,890,294 | 268.56 | 28,091 | 9,865 |
| 9月末日 | 122,940,906.13 | 12,859,618,781 | 271.58 | 28,407 | 9,967 |
| 10月末日 | 120,745,537.95 | 12,629,983,270 | 277.18 | 28,993 | 10,151 |
| 11月末日 | 122,571,405.35 | 12,820,969,000 | 281.77 | 29,473 | 10,301 |
| 12月末日 | 116,928,217.33 | 12,230,691,533 | 289.28 | 30,259 | 10,547 |
| 2020年1月末日 | 97,643,231.32 | 10,213,481,996 | 287.14 | 30,035 | 10,450 |
| 2月末日 | 96,572,968.87 | 10,101,532,544 | 270.65 | 28,310 | 9,850 |
| 3月末日 | 86,710,192.70 | 9,069,886,156 | 241.43 | 25,254 | 8,749 |

（注）クラスBH円建て（acc）受益証券は、2017年7月12日に受益証券1口当たり10,000円で運用を開始しました。ただし、2018年1月11日および2018年7月19日に、それぞれ全投資家の買戻しにより投資家が0となり、その後、2018年1月31日および2018年8月17日に受益証券1口当たり10,000円で再度当初募集を行いました。

(2) 分配の推移

該当事項はありません。

Ⅲ. ファンドの経理状況

財務諸表

- a. ファンドの直近会計年度の日本語の財務書類は、ルクセンブルグの法令上の要件に準拠して作成された原文（英文）の財務書類を日本語に翻訳したものである。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第131条第5項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの原文の財務書類は、CSインベストメント・ファンズ・12および全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド（クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD、クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USDおよびクレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD）に関連する部分のみを記載している。ただし、「財務書類に対する注記」については、全文を記載している。
- c. ファンドの原文（英文）の財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラティブから監査証明に相当すると認められる証明を受けており、当該監査証明に相当すると認められる証明に係る監査報告書に相当するもの（訳文を含む。）が当該財務書類に添付されている。
- d. ファンドの原文（英文）の財務書類は、スイス・フランおよび米ドルで表示されている。日本語の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1スイス・フラン＝115.13円、1米ドル＝104.60円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

監査報告書

CSインベストメント・ファンズ・12

の受益者各位

監査意見

我々の意見では、添付の財務書類は、財務書類の作成および表示に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠し、CSインベストメント・ファンズ・12（以下「ファンド」という。）およびそのサブ・ファンドの2020年3月31日現在の財政状態ならびに同日に終了した年度の運用実績および純資産の変動について真実かつ公正に表示しているものと認める。

我々が行った監査

ファンドの財務書類は以下で構成される：

- ・ 2020年3月31日現在のファンドの結合純資産計算書および各サブ・ファンドの純資産計算書
- ・ 同日に終了した年度のファンドの結合運用計算書／純資産変動計算書および各サブ・ファンドの運用計算書／純資産変動計算書
- ・ 2020年3月31日現在の各サブ・ファンドの投資有価証券明細表
- ・ 重要な会計方針の要約を含む財務書類に対する注記

意見の根拠

我々は、監査人に関する2016年7月23日の法律（以下「2016年7月23日法」という。）およびルクセンブルグの金融監督委員会（以下「C S S F」という。）が採用した国際監査基準（以下「I S A s」という。）に準拠して監査を行った。2016年7月23日法およびルクセンブルグのC S S Fが採用したI S A sの下での我々の責任については、「財務書類の監査に関する承認された法定監査人の責任」の項において詳述されている。

我々は、我々が入手した監査証拠が監査意見表明のための基礎を得るのに十分かつ適切であると判断している。

我々は、財務書類の監査に関する倫理上の要件に従いつつ、ルクセンブルグのC S S Fが採用した国際会計士倫理基準審議会の職業会計士の倫理規程（以下「I E S B A規程」という。）に従ってファンドから独立した立場にある。我々は、これらの倫理上の要件の下で他の倫理的な義務も果たしている。

その他の情報

管理会社の取締役会は、その他の情報に関して責任を負う。その他の情報は、年次報告書に含まれる情報から構成されているが、財務書類およびそれに対する我々の監査報告書は含まれない。

財務書類に対する我々の意見は、その他の情報を対象としておらず、我々は、その他の情報に対していかなる形式の結論の保証も表明しない。

財務書類の監査に関する我々の責任は、上記に示したその他の情報を精読し、当該その他の情報が、財務書類または我々が監査で入手した知識と著しく矛盾していないか、もしくは重要な虚偽表示があると思われるかについて検討することである。我々が実施した調査に基づき、当該情報に重要な虚偽表示があるという結論に達した場合、我々はその事実を報告する義務がある。この点に関し、我々に報告すべき事項はない。

財務書類に関する管理会社の取締役会の責任

管理会社の取締役会は、財務書類の作成および表示に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して、当財務書類の作成および公正表示、ならびに不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、重要な虚偽表示がない財務書類を作成するために必要であると管理会社の取締役会が決定する内部統制に関して責任を負う。

財務書類の作成において、管理会社の取締役会は、ファンドおよび各サブ・ファンドが継続企業として存続する能力を評価し、それが適用される場合には、管理会社の取締役会がファンドの清算もしくはいずれかのサブ・ファンドの終了または運用の中止を意図している、もしくは現実的にそれ以外の選択肢がない場合を除き、継続企業の前提に関する事象を適宜開示し、継続企業の会計基準を使用する責任を負う。

財務書類の監査に関する「承認された法定監査人」の責任

我々の監査の目的は、不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、財務書類に全体として重要な虚偽表示がないかどうかにつき合理的な保証を得ること、および監査意見を含む監査報告書を発行することである。合理的な保証は高度な水準の保証ではあるが、2016年7月23日法およびルクセンブルグのCSSFが採用したISAsに準拠して行われる監査が、重要な虚偽表示を常に発見することを保証するものではない。虚偽表示は不正または誤謬により生じることがあり、重要とみなされるのは、単独または全体として、当該財務書類に基づく利用者の経済的意思決定に影響を及ぼすことが合理的に予想される場合である。

2016年7月23日法およびルクセンブルグのCSSFが採用したISAsに準拠した監査の一環として、監査全体を通じて、我々は専門的判断を下し、職業的懐疑心を保っている。また、以下も実行する。

- ・ 不正または誤謬のいずれに起因するかを問わず、財務書類の重要な虚偽表示のリスクを認識および評価し、それらのリスクに対応する監査手続を策定および実行し、我々の意見表明のための基礎として十分かつ適切な監査証拠を得る。不正による重要な虚偽表示は共謀、偽造、意図的な削除、不正表示または内部統制の無効化によることがあるため、誤謬による重要な虚偽表示に比べて、見逃すリスクはより高い。
- ・ ファンドの内部統制の有効性についての意見を表明するためではなく、状況に適した監査手続を策定するために、監査に関する内部統制についての知識を得る。
- ・ 使用される会計方針の適切性ならびに管理会社の取締役会が行った会計上の見積りおよび関連する開示の合理性を評価する。

- ・ 管理会社の取締役会が継続企業の前提の会計基準を採用した適切性および、入手した監査証拠に基づき、ファンドもしくはいずれかのサブ・ファンドが継続企業として存続する能力に重大な疑義を生じさせる可能性のある事象または状況に関連する重要な不確実性の有無について結論を下す。重要な不確実性が存在するという結論に達した場合、我々は、当報告書において、財務書類における関連する開示に対して注意喚起し、当該開示が不十分であった場合は、監査意見を修正する義務がある。我々の結論は、当報告書の日付までに入手した監査証拠に基づく。しかし、将来の事象または状況が、ファンドもしくはいずれかのサブ・ファンドが継続企業として存続しなくなる原因となることがある。
- ・ 開示を含む財務書類の全体的な表示、構成および内容について、また、財務書類が、公正表示を実現する方法で対象となる取引および事象を表しているかについて評価する。

我々は統治責任者に、特に、計画した監査の範囲および実施時期、ならびに我々が監査中に特定した内部統制における重大な不備を含む重大な監査所見に関して報告する。

ルクセンブルグ、2020年7月10日

プライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラティブ

代表して署名

サンドラ・パウリ



Audit report

To the Unitholders of
CS Investment Funds 12

Our opinion

In our opinion, the accompanying financial statements give a true and fair view of the financial position of CS Investment Funds 12 (the "Fund") and of each of its sub-funds as at 31 March 2020, and of the results of their operations and changes in their net assets for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements.

What we have audited

The Fund's financial statements comprise:

- the Combined Statement of Net Assets for the Fund and the Statement of Net Assets for each of the sub-funds as at 31 March 2020;
- the Combined Statement of Operations / Changes in Net Assets for the Fund and the Statement of Operations / Changes in Net Assets for each of the sub-funds for the year then ended;
- the Statement of Investments in Securities for each of the sub-funds as at 31 March 2020; and
- the notes to the financial statements, which include a summary of significant accounting policies.

Basis for opinion

We conducted our audit in accordance with the Law of 23 July 2016 on the audit profession (Law of 23 July 2016) and with International Standards on Auditing (ISAs) as adopted for Luxembourg by the "Commission de Surveillance du Secteur Financier" (CSSF). Our responsibilities under the Law of 23 July 2016 and ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF are further described in the "Responsibilities of the "Réviseur d'entreprises agréé" for the audit of the financial statements" section of our report.

We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion.

We are independent of the Fund in accordance with the International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants (IESBA Code) as adopted for Luxembourg by the CSSF together with the ethical requirements that are relevant to our audit of the financial statements. We have fulfilled our other ethical responsibilities under those ethical requirements.

Other information

The Board of Directors of the Management Company is responsible for the other information. The other information comprises the information stated in the annual report but does not include the financial statements and our audit report thereon.

Our opinion on the financial statements does not cover the other information and we do not express any form of assurance conclusion thereon.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T : +352 4948481, F : +352 4948482900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n°10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



In connection with our audit of the financial statements, our responsibility is to read the other information identified above and, in doing so, consider whether the other information is materially inconsistent with the financial statements or our knowledge obtained in the audit, or otherwise appears to be materially misstated. If, based on the work we have performed, we conclude that there is a material misstatement of this other information, we are required to report that fact. We have nothing to report in this regard.

Responsibilities of the Board of Directors of the Management Company for the financial statements

The Board of Directors of the Management Company is responsible for the preparation and fair presentation of the financial statements in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the financial statements, and for such internal control as the Board of Directors of the Management Company determines is necessary to enable the preparation of financial statements that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

In preparing the financial statements, the Board of Directors of the Management Company is responsible for assessing the Fund's and each of its sub-funds' ability to continue as a going concern, disclosing, as applicable, matters related to going concern and using the going concern basis of accounting unless the Board of Directors of the Management Company either intends to liquidate the Fund or close any of its sub-funds or to cease operations, or has no realistic alternative but to do so.

Responsibilities of the "Réviseur d'entreprises agréé" for the audit of the financial statements

The objectives of our audit are to obtain reasonable assurance about whether the financial statements as a whole are free from material misstatement, whether due to fraud or error, and to issue an audit report that includes our opinion. Reasonable assurance is a high level of assurance, but is not a guarantee that an audit conducted in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF will always detect a material misstatement when it exists. Misstatements can arise from fraud or error and are considered material if, individually or in the aggregate, they could reasonably be expected to influence the economic decisions of users taken on the basis of these financial statements.

As part of an audit in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF, we exercise professional judgment and maintain professional scepticism throughout the audit. We also:

- identify and assess the risks of material misstatement of the financial statements, whether due to fraud or error, design and perform audit procedures responsive to those risks, and obtain audit evidence that is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion. The risk of not detecting a material misstatement resulting from fraud is higher than for one resulting from error, as fraud may involve collusion, forgery, intentional omissions, misrepresentations, or the override of internal control;
- obtain an understanding of internal control relevant to the audit in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the Fund's internal control;
- evaluate the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates and related disclosures made by the Board of Directors of the Management Company;




- conclude on the appropriateness of the Board of Directors of the Management Company's use of the going concern basis of accounting and, based on the audit evidence obtained, whether a material uncertainty exists related to events or conditions that may cast significant doubt on the Fund's or any of its sub-funds' ability to continue as a going concern. If we conclude that a material uncertainty exists, we are required to draw attention in our audit report to the related disclosures in the financial statements or, if such disclosures are inadequate, to modify our opinion. Our conclusions are based on the audit evidence obtained up to the date of our audit report. However, future events or conditions may cause the Fund or any of its sub-funds to cease to continue as a going concern;
- evaluate the overall presentation, structure and content of the financial statements, including the disclosures, and whether the financial statements represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

We communicate with those charged with governance regarding, among other matters, the planned scope and timing of the audit and significant audit findings, including any significant deficiencies in internal control that we identify during our audit.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Represented by

Luxembourg, 10 July 2020

Electronically signed by
Sandra Paulis

A handwritten signature in black ink, appearing to read 'S. Paulis', enclosed within a rectangular box.

Sandra Paulis

(1) 貸借対照表

CSインベストメント・ファンズ・12
ー結合計算書

純資産計算書（スイス・フランで表示）

| | 2020年3月31日現在 | |
|-----------------|------------------|-------------|
| | (スイス・フラン) | (千円) |
| 資産 | | |
| 投資証券一時価 | 3,894,133,234.20 | 448,331,559 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | 142,752,417.55 | 16,435,086 |
| 未収収益 | 14,512,820.07 | 1,670,861 |
| 先物為替契約に係る未実現純利益 | 19,548,705.23 | 2,250,642 |
| | 4,070,947,177.05 | 468,688,148 |
| 負債 | | |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | 12,018,461.26 | 1,383,685 |
| 未払利息 | 11.54 | 1 |
| 未払費用引当金 | 5,526,855.96 | 636,307 |
| 先物為替契約に係る未実現純損失 | 77,615.02 | 8,936 |
| その他の負債 | 6,623.01 | 763 |
| | 17,629,566.79 | 2,029,692 |
| 純資産 | 4,053,317,610.26 | 466,658,456 |

注記は当財務書類の一部である。

(2) 損益計算書

CSインベストメント・ファンズ・12

－結合計算書

運用計算書／純資産変動計算書（スイス・フランで表示）

2019年4月1日から
2020年3月31日までの期間
(スイス・フラン) (千円)

| | | |
|-------------------------|------------------|--------------|
| 期首現在純資産 | 4,703,586,609.90 | 541,523,926 |
| 収益 | | |
| 投資証券に係る利息（純額） | 44,236,552.50 | 5,092,954 |
| 配当金（純額） | 36,193,538.05 | 4,166,962 |
| 銀行利息 | 1,029,400.05 | 118,515 |
| 証券貸付収益 | 518,210.00 | 59,662 |
| その他の収益 | 48,962.53 | 5,637 |
| | 82,026,663.13 | 9,443,730 |
| 費用 | | |
| 管理報酬 | 70,548,289.62 | 8,122,225 |
| 保管報酬 | 2,899,445.30 | 333,813 |
| 管理事務代行費用 | 2,784,565.74 | 320,587 |
| 印刷および公告費 | 103,458.07 | 11,911 |
| 利息および銀行手数料 | 213,719.14 | 24,605 |
| 監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 | 1,121,250.74 | 129,090 |
| 年次税 | 1,826,800.12 | 210,319 |
| | 79,497,528.73 | 9,152,550 |
| 純利益（損失） | 2,529,134.40 | 291,179 |
| 実現利益（損失） | | |
| 投資対象売却 | 415,047,199.28 | 47,784,384 |
| 金融先物契約 | 459,731.55 | 52,929 |
| 先物為替契約 | (36,247,466.23) | (4,173,171) |
| 外国為替 | 1,640,365.28 | 188,855 |
| | 380,899,829.88 | 43,852,997 |
| 実現純利益（損失） | 383,428,964.28 | 44,144,177 |
| 未実現純評価益（評価損）の変動 | | |
| 投資対象 | (719,099,169.91) | (82,789,887) |
| 先物為替契約 | 23,702,504.70 | 2,728,869 |
| | (695,396,665.21) | (80,061,018) |

| | | |
|---------------------|------------------|--------------|
| 運用の結果による純資産の純増加（減少） | (311,967,700.93) | (35,916,841) |
| 申込み／買戻し | | |
| 申込み | 594,838,379.35 | 68,483,743 |
| 買戻し | (836,172,647.78) | (96,268,557) |
| | (241,334,268.43) | (27,784,814) |
| 分配金 | (3,661,476.83) | (421,546) |
| 為替換算調整 | (93,305,553.45) | (10,742,268) |
| 期末現在純資産 | 4,053,317,610.26 | 466,658,456 |

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

| | Valoren | ISIN | 管理報酬 | 総費用比率 |
|-------------------|----------|--------------|-------|-------|
| クラスB米ドル (acc) | 672327 | LU0078041133 | 1.50% | 1.94% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | 28145643 | LU1230136977 | 0.60% | 1.03% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | 1057436 | LU0108835801 | 0.60% | 1.07% |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | 26362734 | LU1144411391 | 1.25% | 1.69% |
| クラスBH円建て (acc) | 36829019 | LU1614284856 | 1.50% | 1.98% |

ファンド・パフォーマンス

| | 年初来 | 設定来 | 2019年 | 2018年 | 2017年 |
|-------------------|---------|--------|--------|--------|--------|
| クラスB米ドル (acc) | −12.00% | / | 15.75% | −6.79% | 11.29% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | −11.79% | / | 16.79% | −6.01% | 12.16% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | −11.80% | / | 16.75% | −6.00% | 12.23% |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | −11.95% | / | 16.03% | −6.57% | 11.56% |
| クラスBH円建て (acc) | −12.51% | −8.03% | 12.60% | −9.20% | / |

注記

先物為替契約

| 買い | | 売り | | 満期日 | 評価額 |
|----------------------------|-------------|---------|--------------|------------|-------------|
| 取引相手方 | | | | (日ー月ー年) | (米ドル) |
| 日本円 | 714,664,300 | 米ドル | −6,534,910 | 15.04.2020 | 88,633.05 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 5,131,500 | 米ドル | −46,774 | 15.04.2020 | 784.87 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 719,795,800 | 米ドル | −6,571,665 | 15.05.2020 | 109,849.43 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 2,868,728 | 英ポンド | −2,210,000 | 15.05.2020 | 125,697.10 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 340,909 | 豪ドル | −510,000 | 15.05.2020 | 28,701.57 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 9,817,721 | ユーロ | −9,050,000 | 15.05.2020 | −129,764.18 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 921,254 | 日本円 | −101,750,000 | 15.05.2020 | −23,193.38 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 439,832 | スイス・フラン | −430,000 | 15.05.2020 | −5,605.72 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |

| | | | | | |
|----------------------------|-------------|--------|--------------|------------|-------------------|
| 米ドル | 1,027,486 | カナダ・ドル | －1,360,000 | 15.05.2020 | 71,560.07 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 英ポンド | 2,060,000 | 米ドル | －2,670,553 | 15.05.2020 | －113,808.82 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 556,078 | 日本円 | －58,015,300 | 15.04.2020 | 18,379.77 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 18,421,000 | 米ドル | －175,601 | 15.06.2020 | －4,397.14 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 1,218,842 | 日本円 | －129,088,300 | 15.04.2020 | 22,433.60 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 30,777,000 | 米ドル | －291,970 | 15.04.2020 | －6,727.32 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 101,750,000 | 米ドル | －950,179 | 15.05.2020 | －5,683.08 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| ユーロ | 2,600,000 | 米ドル | －2,863,505 | 15.05.2020 | －5,597.80 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 578,861 | 日本円 | －62,111,100 | 15.04.2020 | 3,210.18 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| スイス・フラン | 310,000 | 米ドル | －323,420 | 15.05.2020 | －2,280.76 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 380,060 | 日本円 | －41,778,700 | 15.04.2020 | －7,143.58 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 28,409,500 | 米ドル | －255,407 | 15.04.2020 | 7,893.68 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 51,944,900 | 米ドル | －481,290 | 15.04.2020 | 137.90 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 先物為替契約に係る未実現純利益 | | | | | 173,079.44 |

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

| | 2020年3月31日現在 | |
|-----------------|----------------|------------|
| | (米ドル) | (千円) |
| 資産 | | |
| 投資証券一時価 | 279,308,311.76 | 29,215,649 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | 7,786,728.47 | 814,492 |
| 未収収益 | 951,348.89 | 99,511 |
| 先物為替契約に係る未実現純利益 | 173,079.44 | 18,104 |
| | 288,219,468.56 | 30,147,756 |
| 負債 | | |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | 695,236.97 | 72,722 |
| 未払費用引当金 | 403,143.14 | 42,169 |
| | 1,098,380.11 | 114,891 |
| 純資産 | 287,121,088.45 | 30,032,866 |

| ファンドの推移 | 2020年3月31日現在 | 2019年3月31日現在 | 2018年3月31日現在 |
|------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産総額（米ドル） | 287,121,088.45 | 322,314,020.43 | 310,484,462.82 |

1口当たり純資産価格

| | | | |
|-------------------|----------|----------|-----------|
| クラスB米ドル (acc) | 263.06 | 278.37 | 273.13 |
| クラスEB—元本成長型 (米ドル) | 1,088.44 | 1,141.26 | 1,110.25 |
| クラスIB—元本成長型 (米ドル) | 1,183.80 | 1,241.64 | 1,208.05 |
| クラスUB—元本成長型 (米ドル) | 107.15 | 113.11 | 110.72 |
| クラスBH円建て (acc) | 9,197.00 | 9,994.00 | 10,076.00 |

| 発行済受益証券口数 | 期末現在 | 期首現在 | 発行口数 | 買戻口数 |
|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| クラスB米ドル (acc) | 699,546.663 | 762,776.516 | 154,219.062 | 217,448.915 |
| クラスEB—元本成長型 (米ドル) | 15,811.165 | 16,683.481 | 1,850.893 | 2,723.209 |
| クラスIB—元本成長型 (米ドル) | 25,773.024 | 15,684.033 | 10,088.991 | 0.000 |
| クラスUB—元本成長型 (米ドル) | 406,072.113 | 443,244.297 | 36,933.106 | 74,105.290 |
| クラスBH円建て (acc) | 139,262.432 | 236,255.480 | 27,556.708 | 124,549.756 |

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

運用計算書／純資産変動計算書 (米ドルで表示)

2019年4月1日から
2020年3月31日までの期間
(米ドル) (千円)

| | | |
|--------------------------|-----------------|-------------|
| 期首現在純資産 | 322,314,020.43 | 33,714,047 |
| 収益 | | |
| 投資証券に係る利息 (純額) | 3,373,642.52 | 352,883 |
| 配当金 (純額) | 2,679,976.88 | 280,326 |
| 銀行利息 | 88,748.93 | 9,283 |
| 証券貸付収益 | 38,997.28 | 4,079 |
| その他の収益 | 3,552.25 | 372 |
| | 6,184,917.86 | 646,942 |
| 費用 | | |
| 管理報酬 | 4,915,449.43 | 514,156 |
| 保管報酬 | 205,547.07 | 21,500 |
| 管理事務代行費用 | 197,325.38 | 20,640 |
| 印刷および公告費 | 21,350.93 | 2,233 |
| 利息および銀行手数料 | 5,951.22 | 622 |
| 監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 | 125,012.02 | 13,076 |
| 年次税 | 124,192.06 | 12,990 |
| | 5,594,828.11 | 585,219 |
| 純利益 (損失) | 590,089.75 | 61,723 |
| 実現利益 (損失) | | |
| 投資対象売却 | 40,531,895.91 | 4,239,636 |
| 金融先物契約 | 63,623.30 | 6,655 |
| 先物為替契約 | 213,714.67 | 22,355 |
| 外国為替 | 143,266.23 | 14,986 |
| | 40,952,500.11 | 4,283,632 |
| 実現純利益 (損失) | 41,542,589.86 | 4,345,355 |
| 未実現純評価益 (評価損) の変動 | | |
| 投資対象 | (58,185,787.64) | (6,086,233) |
| 先物為替契約 | 101,912.47 | 10,660 |
| | (58,083,875.17) | (6,075,573) |

| | | |
|---------------------|--------------------|---------------|
| 運用の結果による純資産の純増加（減少） | (16, 541, 285. 31) | (1, 730, 218) |
| <hr/> | | |
| 申込み／買戻し | | |
| 申込み | 66, 634, 498. 30 | 6, 969, 969 |
| 買戻し | (85, 286, 144. 97) | (8, 920, 931) |
| | (18, 651, 646. 67) | (1, 950, 962) |
| <hr/> | | |
| 期末現在純資産 | 287, 121, 088. 45 | 30, 032, 866 |
| <hr/> | | |

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

| | Valoren | ISIN | 管理報酬 | 総費用比率 |
|-------------------|----------|--------------|-------|-------|
| クラスB米ドル (acc) | 672380 | LU0078042453 | 1.70% | 2.15% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | 28146665 | LU1230137272 | 0.60% | 1.05% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | 28234316 | LU1230137512 | 0.60% | / |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | 26362879 | LU1144411631 | 1.40% | 1.86% |
| クラスBH円建て (acc) | 36829025 | LU1614285234 | 1.70% | 2.37% |

クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USDークラスIBは、2020年1月16日に運用を停止した。

ファンド・パフォーマンス

| | 年初来 | 設定来 | 2019年 | 2018年 | 2017年 |
|-------------------|---------|---------|--------|---------|--------|
| クラスB米ドル (acc) | -16.54% | / | 19.45% | -8.85% | 15.89% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | -16.31% | / | 20.76% | -7.93% | 16.90% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | / | / | 20.72% | / | / |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | -16.48% | / | 19.79% | -8.58% | 16.22% |
| クラスBH円建て (acc) | -17.05% | -12.51% | 16.43% | -14.64% | / |

注記

先物為替契約

| 買い | | 売り | | 満期日 | 評価額 |
|----------------------------|-----------|---------|------------|------------|------------|
| 取引相手方 | | | | (日ー月ー年) | (米ドル) |
| 日本円 | 6,915,700 | 米ドル | -63,237 | 15.04.2020 | 857.69 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 732,400 | 米ドル | -6,676 | 15.04.2020 | 112.02 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 7,648,100 | 米ドル | -69,826 | 15.05.2020 | 1,167.20 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 400,417 | カナダ・ドル | -530,000 | 15.05.2020 | 27,887.38 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 143,201 | スイス・フラン | -140,000 | 15.05.2020 | -1,825.13 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 1,258,404 | ユーロ | -1,160,000 | 15.05.2020 | -16,632.75 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |

| | | | | | |
|----------------------------|------------|------|-------------|------------|------------|
| 米ドル | 441,176 | 豪ドル | －660,000 | 15.05.2020 | 37,143.21 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 300,777 | 日本円 | －33,220,000 | 15.05.2020 | －7,572.33 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 493,265 | 英ポンド | －380,000 | 15.05.2020 | 21,613.08 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 英ポンド | 390,000 | 米ドル | －505,590 | 15.05.2020 | －21,546.33 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 45,841,100 | 米ドル | －436,165 | 15.04.2020 | －11,307.74 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 45,841,100 | 米ドル | －436,594 | 15.05.2020 | －11,072.90 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 53,489,200 | 米ドル | －509,895 | 15.06.2020 | －12,768.01 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 121,222 | 日本円 | －12,838,700 | 15.04.2020 | 2,231.17 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 5,786,000 | 米ドル | －54,890 | 15.04.2020 | －1,264.72 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| スイス・フラン | 150,000 | 米ドル | －156,494 | 15.05.2020 | －1,103.59 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 100,032 | 日本円 | －10,733,300 | 15.04.2020 | 554.74 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| ユーロ | 780,000 | 米ドル | －859,051 | 15.05.2020 | －1,679.34 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 33,220,000 | 米ドル | －310,221 | 15.05.2020 | －1,855.44 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 2,927,300 | 米ドル | －27,066 | 15.04.2020 | 64.32 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 56,840 | 日本円 | －6,248,200 | 15.04.2020 | －1,068.36 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 44,452 | 日本円 | －4,947,200 | 15.04.2020 | －1,397.67 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 8,490,700 | 米ドル | －76,333 | 15.04.2020 | 2,359.18 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 7,960,000 | 米ドル | －73,753 | 15.04.2020 | 21.13 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 先物為替契約に係る未実現純利益 | | | | | 2,916.81 |

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

| | 2020年3月31日現在 | |
|-----------------|---------------|-----------|
| | (米ドル) | (千円) |
| 資産 | | |
| 投資証券一時価 | 83,603,455.53 | 8,744,921 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | 3,370,643.36 | 352,569 |
| 未収収益 | 169,540.70 | 17,734 |
| 先物為替契約に係る未実現純利益 | 2,916.81 | 305 |
| | 87,146,556.40 | 9,115,530 |
| 負債 | | |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | 296,947.17 | 31,061 |
| 未払費用引当金 | 139,416.53 | 14,583 |
| | 436,363.70 | 45,644 |
| 純資産 | 86,710,192.70 | 9,069,886 |

| ファンドの推移 | 2020年3月31日現在 | 2019年3月31日現在 | 2018年3月31日現在 |
|------------|---------------|----------------|---------------|
| 純資産総額（米ドル） | 86,710,192.70 | 117,169,163.33 | 89,654,915.18 |

1口当たり純資産価格

| | | | |
|-------------------|----------|----------|----------|
| クラスB米ドル (acc) | 241.43 | 265.84 | 261.77 |
| クラスEB—元本成長型 (米ドル) | 1,075.41 | 1,170.99 | 1,141.17 |
| クラスIB—元本成長型 (米ドル) | / | 1,025.99 | / |
| クラスUB—元本成長型 (米ドル) | 107.24 | 117.73 | 115.60 |
| クラスBH円建て (acc) | 8,749.00 | 9,875.00 | 9,431.00 |

| 発行済受益証券口数 | 期末現在 | 期首現在 | 発行口数 | 買戻口数 |
|-------------------|-------------|-------------|------------|-------------|
| クラスB米ドル (acc) | 279,926.486 | 345,921.571 | 66,761.302 | 132,756.387 |
| クラスEB—元本成長型 (米ドル) | 6,868.650 | 6,493.055 | 1,358.682 | 983.087 |
| クラスIB—元本成長型 (米ドル) | 0.000 | 6,363.503 | 0.000 | 6,363.503 |
| クラスUB—元本成長型 (米ドル) | 96,546.555 | 93,993.918 | 17,486.185 | 14,933.548 |
| クラスBH円建て (acc) | 17,118.374 | 130.000 | 16,988.374 | 0.000 |

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD

運用計算書／純資産変動計算書（米ドルで表示）

| | 2019年4月1日から 2020年3月31日までの期間 (米ドル) | (千円) |
|-------------------------|---|------------------|
| 期首現在純資産 | 117,169,163.33 | 12,255,894 |
| 収益 | | |
| 投資証券に係る利息（純額） | 567,219.22 | 59,331 |
| 配当金（純額） | 1,354,432.58 | 141,674 |
| 銀行利息 | 30,452.69 | 3,185 |
| 証券貸付収益 | 12,911.38 | 1,351 |
| その他の収益 | 1,325.51 | 139 |
| | 1,966,341.38 | 205,679 |
| 費用 | | |
| 管理報酬 | 1,995,774.69 | 208,758 |
| 保管報酬 | 72,345.78 | 7,567 |
| 管理事務代行費用 | 69,452.36 | 7,265 |
| 印刷および公告費 | 10,894.50 | 1,140 |
| 利息および銀行手数料 | 3,850.56 | 403 |
| 監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 | 54,635.43 | 5,715 |
| 年次税 | 42,402.13 | 4,435 |
| | 2,249,355.45 | 235,283 |
| 純利益（損失） | (283,014.07) | (29,603) |
| 実現利益（損失） | | |
| 投資対象売却 | 23,189,502.59 | 2,425,622 |
| 金融先物契約 | (26,560.70) | (2,778) |
| 先物為替契約 | 141,334.58 | 14,784 |
| 外国為替 | (32,009.32) | (3,348) |
| | 23,272,267.15 | 2,434,279 |
| 実現純利益（損失） | 22,989,253.08 | 2,404,676 |

未実現純評価益（評価損）の変動

| | | |
|--------|-----------------|-------------|
| 投資対象 | (29,960,706.41) | (3,133,890) |
| 先物為替契約 | (8,699.29) | (910) |
| | (29,969,405.70) | (3,134,800) |

| | | |
|---------------------|----------------|-----------|
| 運用の結果による純資産の純増加（減少） | (6,980,152.62) | (730,124) |
|---------------------|----------------|-----------|

申込み／買戻し

| | | |
|-----|-----------------|-------------|
| 申込み | 23,815,603.43 | 2,491,112 |
| 買戻し | (47,294,421.44) | (4,946,996) |
| | (23,478,818.01) | (2,455,884) |

| | | |
|---------|---------------|-----------|
| 期末現在純資産 | 86,710,192.70 | 9,069,886 |
|---------|---------------|-----------|

注記は当財務書類の一部である。

テクニカル・データおよび注記

テクニカル・データ

| | Valoren | ISIN | 管理報酬 | 総費用比率 |
|-------------------|----------|--------------|-------|-------|
| クラスAー分配型 (米ドル) | 672336 | LU0078046876 | 1.30% | 1.76% |
| クラスB米ドル (acc) | 672337 | LU0078046959 | 1.30% | 1.76% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | 28145654 | LU1230137199 | 0.60% | 1.04% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | 28234308 | LU1230137439 | 0.60% | 1.10% |
| クラスUAー分配型 (米ドル) | 26362951 | LU1144412100 | 1.05% | 1.52% |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | 26364579 | LU1144412282 | 1.05% | 1.51% |
| クラスBH円建て (acc) | 36829010 | LU1614284344 | 1.30% | 1.82% |

ファンド・パフォーマンス

| | 年初来 | 設定来 | 2019年 | 2018年 | 2017年 |
|-------------------|--------|--------|--------|--------|-------|
| クラスAー分配型 (米ドル) | －8.00% | / | 12.25% | －4.83% | 7.32% |
| クラスB米ドル (acc) | －8.01% | / | 12.26% | －4.83% | 7.32% |
| クラスEBー元本成長型 (米ドル) | －7.84% | / | 13.05% | －4.17% | 8.06% |
| クラスIBー元本成長型 (米ドル) | －7.85% | / | 13.01% | －4.21% | 8.02% |
| クラスUAー分配型 (米ドル) | －7.95% | / | 12.52% | －4.60% | 7.57% |
| クラスUBー元本成長型 (米ドル) | －7.94% | / | 12.53% | －4.61% | 7.57% |
| クラスBH円建て (acc) | －8.48% | －6.05% | 9.14% | －7.29% | / |

分配金

| | 分配落ち日 (日－月－年) | 金額 |
|-----------------|------------------|------|
| クラスAー分配型 (米ドル) | 21.05.2019 | 1.30 |
| クラスUAー分配型 (米ドル) | 21.05.2019 | 1.20 |

注記

先物為替契約

| 買い | | 売り | | 満期日 (日－月－年) | 評価額 (米ドル) |
|----------------------------|-------------|-----|----------|----------------|--------------|
| 取引相手方 | | | | | |
| 日本円 | 84,547,500 | 米ドル | －773,105 | 15.04.2020 | 10,485.63 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 101,812,900 | 米ドル | －929,542 | 15.05.2020 | 15,537.86 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 17,265,400 | 米ドル | －157,376 | 15.04.2020 | 2,640.76 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |

| | | | | | |
|----------------------------|-------------|---------|-------------|------------|-------------|
| 米ドル | 721,068 | 日本円 | －79,640,000 | 15.05.2020 | －18,153.52 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 494,652 | 豪ドル | －740,000 | 15.05.2020 | 41,645.41 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 16,315,858 | ユーロ | －15,040,000 | 15.05.2020 | －215,652.30 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 460,290 | スイス・フラン | －450,000 | 15.05.2020 | －5,866.45 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 3,764,394 | 英ポンド | －2,900,000 | 15.05.2020 | 164,941.90 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 1,526,119 | カナダ・ドル | －2,020,000 | 15.05.2020 | 106,287.74 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 英ポンド | 2,700,000 | 米ドル | －3,500,240 | 15.05.2020 | －149,166.90 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 112,652,400 | 米ドル | －1,073,879 | 15.06.2020 | －26,890.41 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 10,839,500 | 米ドル | －103,236 | 15.05.2020 | －2,618.28 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 10,839,500 | 米ドル | －103,135 | 15.04.2020 | －2,673.81 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 567,091 | 日本円 | －60,061,000 | 15.04.2020 | 10,437.70 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| スイス・フラン | 230,000 | 米ドル | －239,957 | 15.05.2020 | －1,692.18 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| ユーロ | 2,560,000 | 米ドル | －2,819,451 | 15.05.2020 | －5,511.68 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 79,640,000 | 米ドル | －743,708 | 15.05.2020 | －4,448.15 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 69,814 | 日本円 | －7,550,700 | 15.04.2020 | －165.82 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 米ドル | 69,766 | 日本円 | －7,669,200 | 15.04.2020 | －1,311.32 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 6,958,500 | 米ドル | －62,558 | 15.04.2020 | 1,933.44 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 日本円 | 8,557,500 | 米ドル | －79,289 | 15.04.2020 | 22.72 |
| CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG | | | | | |
| 先物為替契約に係る未実現純損失 | | | | | －80,217.66 |

純資産計算書（米ドルで表示）およびファンドの推移

| | 2020年3月31日現在 | |
|-----------------|----------------|------------|
| | (米ドル) | (千円) |
| 資産 | | |
| 投資証券一時価 | 310,887,835.45 | 32,518,868 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | 11,451,513.86 | 1,197,828 |
| 未収収益 | 1,354,226.22 | 141,652 |
| | 323,693,575.53 | 33,858,348 |
| 負債 | | |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | 215,983.02 | 22,592 |
| 未払費用引当金 | 410,025.21 | 42,889 |
| 先渡為替契約に係る未実現純損失 | 80,217.66 | 8,391 |
| | 706,225.89 | 73,871 |
| 純資産 | 322,987,349.64 | 33,784,477 |

| ファンドの推移 | 2020年3月31日現在 | 2019年3月31日現在 | 2018年3月31日現在 |
|------------|----------------|----------------|----------------|
| 純資産総額（米ドル） | 322,987,349.64 | 339,693,928.62 | 334,853,152.06 |

1口当たり純資産価格

| | | | |
|------------------|----------|----------|----------|
| クラスAー分配型（米ドル） | 142.32 | 147.33 | 145.29 |
| クラスB米ドル（acc） | 260.56 | 267.37 | 261.57 |
| クラスEBー元本成長型（米ドル） | 1,086.57 | 1,106.98 | 1,075.64 |
| クラスIBー元本成長型（米ドル） | 1,080.46 | 1,101.16 | 1,070.35 |
| クラスUAー分配型（米ドル） | 102.17 | 105.78 | 104.30 |
| クラスUBー元本成長型（米ドル） | 106.27 | 108.77 | 106.17 |
| クラスBH円建て（acc） | 9,395.00 | 9,895.00 | 9,952.00 |

| 発行済受益証券口数 | 期末現在 | 期首現在 | 発行口数 | 買戻口数 |
|------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| クラスAー分配型（米ドル） | 127,678.938 | 134,336.372 | 31,380.913 | 38,038.347 |
| クラスB米ドル（acc） | 802,905.053 | 850,124.451 | 102,720.942 | 149,940.340 |
| クラスEBー元本成長型（米ドル） | 7,536.944 | 7,278.437 | 1,307.089 | 1,048.582 |
| クラスIBー元本成長型（米ドル） | 38,177.192 | 28,098.842 | 13,197.505 | 3,119.155 |
| クラスUAー分配型（米ドル） | 154,698.126 | 151,089.100 | 44,388.973 | 40,779.947 |
| クラスUBー元本成長型（米ドル） | 261,511.165 | 323,304.635 | 78,664.633 | 140,458.103 |
| クラスBH円建て（acc） | 29,610.678 | 27,454.657 | 13,985.072 | 11,829.051 |

注記は当財務書類の一部である。

CSインベストメント・ファンズ・12

ークレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

運用計算書／純資産変動計算書（米ドルで表示）

| | 2019年4月1日から 2020年3月31日までの期間 (米ドル) | (千円) |
|-------------------------|---|------------|
| 期首現在純資産 | 339,693,928.62 | 35,531,985 |
| 収益 | | |
| 投資証券に係る利息（純額） | 5,394,037.46 | 564,216 |
| 配当金（純額） | 1,726,614.01 | 180,604 |
| 銀行利息 | 82,918.55 | 8,673 |
| 証券貸付収益 | 43,983.72 | 4,601 |
| その他の収益 | 3,761.53 | 393 |
| | 7,251,315.27 | 758,488 |
| 費用 | | |
| 管理報酬 | 4,904,408.27 | 513,001 |
| 保管報酬 | 225,515.38 | 23,589 |
| 管理事務代行費用 | 216,711.07 | 22,668 |
| 印刷および公告費 | 25,217.09 | 2,638 |
| 利息および銀行手数料 | 4,103.98 | 429 |
| 監査、統制、弁護士、代理銀行およびその他の費用 | 130,872.11 | 13,689 |
| 年次税 | 142,274.01 | 14,882 |
| | 5,649,101.91 | 590,896 |
| 純利益（損失） | 1,602,213.36 | 167,592 |
| 実現利益（損失） | | |
| 投資対象売却 | 29,656,473.61 | 3,102,067 |
| 金融先物契約 | (11,197.23) | (1,171) |
| 先物為替契約 | 1,441,845.23 | 150,817 |
| 外国為替 | (48,451.07) | (5,068) |
| | 31,038,670.54 | 3,246,645 |
| 実現純利益（損失） | 32,640,883.90 | 3,414,236 |

未実現純評価益（評価損）の変動

| | | |
|--------|-----------------|-------------|
| 投資対象 | (41,704,795.38) | (4,362,322) |
| 先物為替契約 | (332,591.70) | (34,789) |
| | (42,037,387.08) | (4,397,111) |

| | | |
|---------------------|----------------|-----------|
| 運用の結果による純資産の純増加（減少） | (9,396,503.18) | (982,874) |
|---------------------|----------------|-----------|

申込み／買戻し

| | | |
|-----|-----------------|-------------|
| 申込み | 64,482,262.44 | 6,744,845 |
| 買戻し | (71,419,407.16) | (7,470,470) |
| | (6,937,144.72) | (725,625) |

| | | |
|-----|--------------|----------|
| 分配金 | (372,931.08) | (39,009) |
|-----|--------------|----------|

| | | |
|---------|----------------|------------|
| 期末現在純資産 | 322,987,349.64 | 33,784,477 |
|---------|----------------|------------|

注記は当財務書類の一部である。

注記（2020年3月31日現在）

一般事項

CSインベストメント・ファンズ・12（以下「ファンド」という。）は、サブ・ファンドを有するルクセンブルグのミューチュアル・インベストメント・ファンド（以下「アンブレラ・ファンド」という。）である。ファンドは、改正済みの2010年12月17日法パートIに基づく譲渡性のある証券を集团的投資の対象とする投資信託としてルクセンブルグにおいて登録されている。

2020年3月31日現在、ファンドは10本のサブ・ファンドを有する。

重要な会計方針の要約

a) 財務書類の表示

ファンドの財務書類は、投資信託に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して作成される。

b) 各サブ・ファンドの純資産価額の計算

各サブ・ファンドの受益証券の純資産価額は、それぞれのサブ・ファンドの参照通貨で計算され、管理会社が、ルクセンブルグにおいて銀行が、通常、全日営業を行っている各銀行営業日（以下「評価日」という。）にルクセンブルグにおいて決定するものとする。

各サブ・ファンドの純資産価額は、同日までに発生した収益／費用、および直近の入手可能な市場価格に基づく純資産の評価に基づいて、毎日決定される。

財務書類は、2020年3月31日現在の投資の市場価格に基づく2020年3月31日現在の純資産価額を反映している。

投資運用会社は、申込みまたは買戻しの結果として望ましい資産配分を維持するために取引を行う必要があり、これにより、サブ・ファンドおよびその受益者に追加費用が発生する可能性がある。このため、既存受益者の利益を保護するために、これらの元本の変動から、元本の変動純額が管理会社の取締役会により予め定められた閾値を超える場合、1口当たりの純資産価格の調整が適用される。この調整は、これらの取引の結果としてサブ・ファンドが負担する可能性がある見積税額および取引費用、ならびにサブ・ファンドが投資する資産の見積売買差額を反映している。適用されているスイングファクターの妥当性を検証するために、定期的な見直しが行われる。

統計情報に開示されている1口当たりの純資産価格は、公表されている1口当たりの純資産価格であるのに対し、純資産計算書に開示されている純資産総額は、期末のスイング調整を除いた純資産総額である。

ファンドは、部分的にスイングプライシングを適用する。計算される純資産価額は、各評価日において受領した申込みに関し、発行申込みにより純剰余金が生じている場合、受益証券1口当たり最大2%の引き上げ、または買戻申請により純剰余金が生じている場合、受益証券1口当たり最大2%の引下げが行われる。

2020年3月31日現在、年次報告書に含まれるサブ・ファンドに適用されたスイングプライシングはなかった。

c) 各サブ・ファンドの投資証券の評価

証券取引所に上場されている、または通常の取引が行われている証券は、入手可能な直近の売値で評価される。かかる価格が特定の取引日について入手できない場合、最終の仲値（最終買呼値と最終売呼値の仲値）またはその代わりとして最終買呼値を評価の基準とすることができる。

複数の証券取引所で取引されている証券の場合、評価は当該証券の主要市場である取引所を参照して行われる。

証券取引所での取引が顕著ではないが、証券ディーラー間の取引が規制されている（価格が市況を反映する）流通市場で取引されている証券の場合、評価は、当該流通市場を基準とすることができる。

規制された市場で取引されている証券は、証券取引所に上場されている証券と同じ方法で評価される。

証券取引所に上場されておらず、規制された市場でも取引されていない証券は、その入手可能な直近の市場価格で評価される。かかる価格が入手できない場合、管理会社は、管理会社が定める他の基準に従い、その価値が慎重かつ誠実に見積られた推定売値を基準として当該証券を評価する。

特定の状況または状況の変化により上記の規則に準拠した評価が不可能または不正確となった場合、管理会社は、当該サブ・ファンドの資産の適切な評価を得るために、他の一般に認められた監査可能な評価原則を用いることができる。

d) 銀行預金およびブローカー預金

銀行預金およびブローカー預金には、手許現金、追加証拠金、要求払預金および当座借越が含まれる。

e) 各サブ・ファンドの投資対象売却に係る実現純損益

証券の売却に係る実現損益は、平均取得原価に基づき計算される。

f) 為替換算

財務書類は、各サブ・ファンドの参照通貨で維持され、結合財務書類はスイス・フランで維持される。

銀行預金、その他の純資産および各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建てのポートフォリオ証券の価額は、評価日の実勢為替レートで参照通貨に換算される。

各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建ての収益および費用は、それらがサブ・ファンドに発生した日に適用される為替レートで参照通貨に換算される。

為替差損益は、運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

各サブ・ファンドの参照通貨以外の通貨建ての証券の取得原価は、取得日に有効な為替レートで参照通貨に換算される。

g) 各サブ・ファンドの投資証券取引

投資証券取引は、取引日ベースで計上される。

h) 各サブ・ファンドの金融先物契約の評価

期日未到来の金融先物契約は、当該日時点の実勢市場レートで評価日に評価し、その結果生じた未実現損益の変動は、運用計算書／純資産変動計算書に計上され、金融先物契約の未実現損益として純資産計算書に表示される。実現損益もまた、「金融先物契約の実現純損益」として運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

i) 各サブ・ファンドの先物為替契約の評価

期日未到来の先物為替契約は、当該日時点の実勢先物為替レートで評価日に評価し、その結果生じた未実現損益の変動は、運用計算書／純資産変動計算書に計上され、先物為替契約の未実現損益として純資産計算書に表示される。実現損益もまた、「先物為替契約の実現純損益」として運用計算書／純資産変動計算書に計上される。

j) 未払費用の割り当て

サブ・ファンドに直接割り当てられる未払費用は、当該サブ・ファンドに請求される。直接割り当てることができない未払費用は、各サブ・ファンドの純資産額に比例してサブ・ファンドの間で分割される。

k) 証券貸付

ファンドは、サブ・ファンドのポートフォリオに含まれる証券の貸付を行うことができる。ファンドは、公認の証券補償機関またはこの種の業務に特化した一流の金融機関が組織する証券貸付の標準化されたシステムの範囲内でのみ証券を貸付けることができる。証券貸付からの収益は、証券貸付からの総収益から、証券貸付の当事者になる取引相手方が保持する直接的および間接的な費用および手数料を差し引いたものを示している。

l) 収益の認識

配当収益は、源泉徴収税を控除した後、分配落ち日に計上される。利息収益は、源泉徴収税を控除し、比例配分ベースで発生する。

管理報酬

(サブ・ファンドごとの詳細を参照)

管理会社は、そのサービスに対する報酬および費用の払い戻しとして、管理報酬（サブ・ファンドごとの詳細を参照）を受け取る権利を有する。かかる報酬は、該当月における各受益証券クラスの平均日次純資産価額に基づき計算され、各月の月末に支払われる。さらに、管理報酬には前期に関連してこの期間に請求された管理報酬の調整額を含んでいる。

年次税

現行法および規則に基づき、ファンドは、ルクセンブルグにおいてその投資に基づき年率0.05%の年次税を課される。かかる年次税は、各四半期末に各サブ・ファンドの純資産に基づき計算され、四半期ごとに支払われる。機関投資家のみが取得できる受益証券クラスの場合、年間税率は0.01%である。

ルクセンブルグ法に基づくその他の投資信託に投資される純資産の部分は、当該税金を免除される。

総費用比率（TER）

（サブ・ファンドごとの詳細を参照）

TERは、ファンドの資産に継続的に請求されるすべての費用および手数料の合計を表しており、その平均資産に対する比率として適及的に行われる。

TERは、SFAMAガイドラインに従って計算される。

期末まで6か月以内に開始された受益証券について、TERは開示されていない。また報告年度中に償還された受益証券についても開示されていない。

サブ・ファンドが、ファンド・オブ・ファンズとして、その純資産の少なくとも10%を投資対象ファンドに投資する場合、ファンド・オブ・ファンズのTERの構成は以下のように計算される。

パフォーマンス関連の報酬を含む個々の投資対象ファンドの比例TERは、期末日時点のファンド・オブ・ファンズの総資産に占める割合に応じて加重され、ファンド・オブ・ファンズのTERから報告年度中に投資対象ファンドから受け取った適及手数料を差し引く。

証券ポートフォリオの構成の変動

報告年度中の証券ポートフォリオの構成の変動については、管理会社の登録事務所またはファンドが登録されている国の現地代理店において、受益者は無料で入手することができる。

為替レート

結合財務書類は、スイス・フランで維持される。このため、サブ・ファンドの財務書類は、2020年3月31日現在の為替レートでスイス・フランに換算される。

1 ユーロ=1.061650スイス・フラン

1 米ドル=0.967555スイス・フラン

ファンドのパフォーマンス

（サブ・ファンドごとの詳細を参照）

Y年のパフォーマンスは、Y年（それぞれY-1年）の最終営業日に計算された純資産価額に基づく。当該純資産価額は、Y年（それぞれY-1年）の最終営業日における投資の市場価格を反映している。年初来のパフォーマンスは、2020年1月1日から2020年3月31日までの期間が含まれる。

過去のパフォーマンスは、現在および将来のパフォーマンスの指標にならない。

パフォーマンス・データは、ファンド受益証券の購入または買戻しにかかる手数料および費用を考慮していない。

3年以上前に運用を開始した受益証券について、設定来のパフォーマンスは開示されない。
分配型受益証券のパフォーマンスには、分配金の再投資が含まれる。

パフォーマンスは、受益証券1口当たりのスイング済み純資産価格に基づき計算される。

証券貸付

サブ・ファンドは、以下のとおりチューリッヒのクレディ・スイス（スイス）リミテッドとの「証券貸付」システムに参加した。

| サブ・ファンド | 通貨 | 貸株時価 | 担保時価 |
|-------------------------------------|---------|---------------|---------------|
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR | ユーロ | 21,019,318.25 | 22,112,259.10 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF | スイス・フラン | 75,230,214.45 | 79,141,957.63 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD | 米ドル | 26,991,138.39 | 28,394,595.79 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR | ユーロ | 3,828,002.19 | 4,027,046.71 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF | スイス・フラン | 17,456,337.34 | 18,364,013.98 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD | 米ドル | 4,729,205.00 | 4,975,109.32 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・レディット・EUR | ユーロ | 18,418,207.00 | 19,375,897.95 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR | ユーロ | 25,557,313.26 | 26,886,216.10 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF | スイス・フラン | 80,617,658.34 | 84,809,532.27 |
| クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD | 米ドル | 36,169,680.17 | 38,050,393.93 |

証券貸付相手方がファンドに引き渡す担保は、以下で構成される十分に分散されたポートフォリオから成る。

- ・ 政府、政府機関、公法で規制されている団体または厳選されたOECD加盟国による企業（クレディ・スイスの関連会社を除く）が発行または保証する高格付けの債券
- ・ 国際機関による高格付けの債券
- ・ 受益証券が主要インデックスと流動性インデックスに組み入れられることを条件に、OECDにおいて特定の証券取引所に上場されている株式

担保の時価の決定は、担保の種類のボラティリティに適合した適切なヘアカットの適用を条件とする。

運用計算書／純資産変動計算書の「証券貸付収益」に記載されている収益は、貸付元本から受領した純額である。直接および間接的な運用費用および手数料は、その手数料から負担され、元本が負う債務リスクを含む。

2020年3月31日に終了した年度において、元本に対し支払われた手数料は以下のとおりある。

| サブ・ファンド | 通貨 | 証券貸付 総額 | 証券貸付の 取引相手方 による | 証券貸付 利益純額 |
|--------------------------------------|---------|------------|-----------------------|--------------|
| | | | 費用および 手数料 | |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR | ユーロ | 123,116.72 | 49,246.69 | 73,870.03 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF | スイス・フラン | 154,899.17 | 61,959.67 | 92,939.50 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD | 米ドル | 64,995.47 | 25,998.19 | 38,997.28 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR | ユーロ | 42,687.32 | 17,074.93 | 25,612.39 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF | スイス・フラン | 38,373.38 | 15,349.35 | 23,024.03 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD | 米ドル | 21,518.97 | 8,607.59 | 12,911.38 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・レデイト・EUR | ユーロ | 68,632.82 | 27,453.13 | 41,179.69 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR | ユーロ | 113,542.42 | 45,416.97 | 68,125.45 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF | スイス・フラン | 146,343.30 | 58,537.32 | 87,805.98 |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD | 米ドル | 73,306.20 | 29,322.48 | 43,983.72 |

取引費用

取引費用には、（年度中に発生した場合）ブローカー手数料、印紙税、地方税およびその他の海外手数料が含まれる。取引手数料は、証券の売買費用に含まれる。

2020年3月31日に終了した年度において、ファンドは以下のとおり、投資証券の売買および類似の取引（デリバティブ商品またはその他の適格資産を含む）に関連する取引費用を負担した。

| | | |
|--------------------------------------|------------|---------|
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・EUR | 192,775.89 | ユーロ |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・CHF | 324,870.77 | スイス・フラン |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD | 127,712.54 | 米ドル |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・EUR | 75,748.97 | ユーロ |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・CHF | 107,470.06 | スイス・フラン |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・グロース・USD | 72,429.99 | 米ドル |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・レデイト・EUR | 76,222.99 | ユーロ |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・EUR | 138,966.09 | ユーロ |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・CHF | 249,654.45 | スイス・フラン |
| クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD | 90,517.39 | 米ドル |

すべての取引費用が個別に特定できるわけではない。確定利付証券、先物為替契約およびその他のデリバティブ契約の一部について、取引費用は投資対象の売買価格に含まれる。これらの取引費用は、個別には特定できないが、各サブ・ファンドのパフォーマンスの範囲内で把握される。

グローバル・エクスポージャー

グローバル・エクスポージャーは、各サブ・ファンドのコミットメント・アプローチに基づき計算される。

金融デリバティブ商品

サブ・ファンドは、効率的なポートフォリオ運用を目的としてデリバティブ取引を行うことができる。デリバティブの詳細は、注記のページに表示される。保有するデリバティブの種類によっては、取引相手方エクスポージャーを軽減するために、異なる取引相手方からの担保を受け入れることがある。その他の種類のデリバティブについて、証拠金勘定を使用する場合がある。

2020年3月31日現在、取引相手方リスクを軽減するために、ファンドが受け入れた担保はなかった。

後続事象

クレディ・スイス・ファンド・マネジメント・エスエイの決定に従い、クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・レッドイト・EURは、2020年7月1日付でクレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・イールド・EURに合併される。

(3) 投資有価証券明細表等

CSインベストメント・ファンズ・12 (2020年3月31日現在、監査済年次報告書)

クレディ・スイス (Lux) ポートフォリオ・ファンド・バランス・USD

投資有価証券明細表

| | | | |
|--------------|-------|--------------------------|-------|
| 国別内訳 | | 中華人民共和国 | 0.03 |
| アメリカ合衆国 | 51.78 | イスラエル | 0.03 |
| ルクセンブルグ | 18.22 | エルサルバドル | 0.03 |
| ドイツ | 3.97 | ドミニカ共和国 | 0.03 |
| アイルランド | 3.15 | パキスタン | 0.03 |
| 日本 | 2.44 | モンゴル | 0.02 |
| フランス | 2.31 | コスタリカ | 0.02 |
| イギリス | 2.14 | ニュージーランド | 0.02 |
| カナダ | 1.97 | アルメニア | 0.02 |
| オランダ | 1.48 | ケニア | 0.02 |
| オーストラリア | 1.21 | セネガル | 0.02 |
| スイス | 1.07 | エクアドル | 0.02 |
| スペイン | 0.98 | パラグアイ | 0.02 |
| 国際機関 | 0.71 | クウェート | 0.02 |
| イタリア | 0.45 | コートジボワール | 0.02 |
| ケイマン諸島 | 0.35 | ジャマイカ | 0.02 |
| メキシコ | 0.31 | モロッコ | 0.02 |
| 香港 | 0.28 | ハンガリー | 0.01 |
| ベルギー | 0.27 | スロベニア | 0.01 |
| チリ | 0.24 | エチオピア | 0.01 |
| バミューダ | 0.21 | ナミビア | 0.01 |
| フィンランド | 0.20 | ウズベキスタン | 0.01 |
| シンガポール | 0.16 | ベラルーシ | 0.01 |
| フィリピン | 0.16 | リベリア | 0.01 |
| 韓国 | 0.15 | バハマ | 0.01 |
| コロンビア | 0.14 | チュニジア | 0.01 |
| トルコ | 0.12 | グアテマラ | 0.01 |
| アラブ首長国連邦 | 0.12 | アンゴラ | 0.01 |
| サウジアラビア | 0.12 | ジョージア | 0.01 |
| ヴァージン諸島 (英領) | 0.11 | イラク | 0.01 |
| ポーランド | 0.11 | タジキスタン | 0.01 |
| ウルグアイ | 0.11 | ボリビア | 0.01 |
| オーストリア | 0.10 | ヨルダン | 0.01 |
| カタール | 0.10 | トーゴ | 0.01 |
| ブラジル | 0.10 | アルゼンチン | 0.01 |
| ジャージー | 0.10 | ガボン | 0.01 |
| 南アフリカ | 0.08 | ベネズエラ | - |
| ノルウェー | 0.08 | 合計 | 97.28 |
| バーレーン | 0.08 | | |
| ボルトガル | 0.08 | 業種別内訳 | |
| インドネシア | 0.08 | 投資信託／ファンド | 19.04 |
| エジプト | 0.08 | 国および中央政府 | 18.62 |
| ペルー | 0.07 | 銀行・その他の金融機関 | 8.54 |
| パナマ | 0.07 | インターネット・ソフトウェア・ITサービス | 6.90 |
| インド | 0.06 | 金融・投資・その他の多角化企業 | 6.02 |
| カザフスタン | 0.06 | 医薬品・化粧品・医療品 | 5.02 |
| マレーシア | 0.06 | 不動産 | 2.86 |
| ロシア | 0.06 | 食品・清涼飲料 | 2.31 |
| スウェーデン | 0.05 | 国際機関 | 2.23 |
| オマーン | 0.05 | エネルギー・水道 | 1.91 |
| ナイジェリア | 0.05 | コンピューターハードウェア・ネットワーク | 1.83 |
| ガーナ | 0.05 | 電子・半導体 | 1.70 |
| ルーマニア | 0.04 | 石油 | 1.61 |
| ウクライナ | 0.04 | 通信 | 1.58 |
| アゼルバイジャン | 0.04 | 保険会社 | 1.44 |
| スリランカ | 0.04 | カントン (州) ・連邦国家・プロビンス (州) | 1.41 |
| ガーナ | 0.04 | | |

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| | |
|--------------------|-------|
| 機械工学・産業機器 | 1.31 |
| 各種消費財 | 1.30 |
| 交通・運輸 | 1.15 |
| 建築材・建設業 | 1.15 |
| 宿泊・仕出し・娯楽施設 | 1.10 |
| 小売り・百貨店 | 1.03 |
| バイオテクノロジー | 0.97 |
| 化学 | 0.85 |
| 電気機器・部品 | 0.80 |
| 繊維・衣服・革製品 | 0.65 |
| グラフィック出版・印刷メディア | 0.61 |
| 自動車 | 0.50 |
| 各種サービス | 0.49 |
| ヘルスケア・社会福祉 | 0.37 |
| 公共・非営利機関 | 0.33 |
| タバコ・アルコール飲料 | 0.29 |
| 林業・紙製品・林産品 | 0.27 |
| 鉱業・石炭・鉄鋼 | 0.22 |
| 航空・宇宙産業 | 0.18 |
| 貴金属・宝石 | 0.14 |
| 環境サービス・リサイクル | 0.12 |
| 包装業 | 0.10 |
| 写真・光学 | 0.07 |
| 各種貿易会社 | 0.07 |
| ゴム・タイヤ | 0.07 |
| 非鉄金属 | 0.05 |
| 抵当・資金貸出機関（MBS、ABS） | 0.03 |
| 分類不能／非分類機関 | 0.02 |
| 農業・漁業 | 0.01 |
| 各種資本財 | 0.01 |
| 合計 | 97.28 |

| 投資有価証券明細表 | | | |
|--|-----------|--------------|------------------|
| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| CHF ABB (reg. shares) | 3,078 | 54,105.21 | 0.02 |
| USD ABBVIE | 9,862 | 751,414.05 | 0.27 |
| USD ACADIA REALTY TRUST | 460 | 5,695.90 | 0.00 |
| USD ACCENTURE -A- | 4,356 | 711,177.49 | 0.26 |
| EUR ACCOR | 1,178 | 32,312.82 | 0.01 |
| JPY ACTIVIA PROPERTIES | 3 | 10,875.15 | 0.00 |
| USD ACUTY BRANDS | 296 | 25,336.13 | 0.01 |
| CHF ADECCO (reg. shares) | 482 | 18,993.50 | 0.01 |
| EUR ADIDAS (reg. shares) | 1,210 | 273,465.90 | 0.10 |
| EUR ADO PROPERTIES | 143 | 3,221.43 | 0.00 |
| USD ADOBE INC | 3,316 | 1,055,408.84 | 0.38 |
| USD ADVANCE AUTO PARTS | 454 | 42,372.79 | 0.01 |
| JPY ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT | 6 | 18,263.66 | 0.01 |
| EUR AEDIFICA | 120 | 12,479.48 | 0.00 |
| EUR AEGON | 12,003 | 30,475.47 | 0.01 |
| JPY AEON | 2,420 | 53,782.86 | 0.02 |
| JPY AEON FINANCIAL SERVICE | 417 | 4,470.46 | 0.00 |
| JPY AEON MALL | 577 | 7,280.30 | 0.00 |
| JPY AEON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8 | 7,361.76 | 0.00 |
| EUR AEROPORTS DE PARIS | 129 | 12,416.42 | 0.00 |
| USD AES | 4,611 | 62,702.94 | 0.02 |
| USD AGILENT TECHNOLOGIES | 2,087 | 149,497.00 | 0.05 |
| USD AGREE REALTY | 221 | 13,710.20 | 0.00 |
| EUR AIR LIQUIDE | 3,174 | 406,224.72 | 0.14 |
| JPY AJINOMOTO | 1,622 | 30,199.90 | 0.01 |
| EUR AKZO NOBEL NV | 1,624 | 106,902.98 | 0.04 |
| CHF ALCON INC | 597 | 30,462.80 | 0.01 |
| USD ALEXANDER' S INC | 12 | 3,175.60 | 0.00 |
| USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES | 1,413 | 193,630.03 | 0.07 |
| USD ALIGN TECHNOLOGY | 490 | 85,283.60 | 0.03 |
| USD ALLEGION | 608 | 55,977.46 | 0.02 |
| USD ALLIANT ENERGY | 1,614 | 77,957.34 | 0.03 |
| EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted) | 2,946 | 507,165.09 | 0.19 |
| CAD ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 666 | 20,949.86 | 0.01 |
| CHF ALLREAL HOLDING (reg. shares) | 69 | 12,701.63 | 0.00 |
| USD ALLSTATE | 2,132 | 195,611.29 | 0.07 |
| USD ALLY FINANCIAL | 2,492 | 35,963.81 | 0.01 |
| USD ALPHABET -A- | 2,107 | 2,447,875.38 | 0.86 |
| USD ALPHABET -C- | 2,059 | 2,393,672.41 | 0.84 |
| EUR ALSTRIA OFFICE REIT | 822 | 11,757.31 | 0.00 |
| EUR AMADEUS IT GROUP -A- | 2,893 | 137,134.93 | 0.05 |
| USD AMAZON.COM | 69 | 135,074.85 | 0.05 |
| USD AMERCO | 70 | 20,266.46 | 0.01 |
| USD AMERICAN ASSETS TRUST | 268 | 6,688.03 | 0.00 |
| USD AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 738 | 20,485.71 | 0.01 |
| USD AMERICAN EXPRESS | 5,920 | 506,807.29 | 0.19 |
| USD AMERICAN FINANCE TRUST INC | 575 | 3,594.35 | 0.00 |
| USD AMERICAN FINANCIAL GROUP | 476 | 33,336.28 | 0.01 |
| USD AMERICAN HOMES 4 RENT -A- | 1,402 | 32,525.12 | 0.01 |
| USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 5,728 | 138,909.34 | 0.05 |
| USD AMERICAN TOWER | 2,951 | 642,663.86 | 0.23 |
| USD AMERICAN WATER WORKS | 1,220 | 145,882.09 | 0.05 |
| USD AMERICOLD REALTY TRUST | 1,040 | 35,405.65 | 0.01 |
| USD AMERIPRISE FINANCIAL | 829 | 85,005.05 | 0.03 |
| USD AMERISOURCEBERGEN | 1,011 | 89,435.13 | 0.03 |
| USD AMGEN | 4,081 | 827,312.86 | 0.30 |
| AUD AMP | 11,183 | 9,137.84 | 0.00 |
| NZD AMP NZ OFFICE TRUST | 5,191 | 5,247.10 | 0.00 |
| JPY ANA HOLDINGS | 424 | 10,361.36 | 0.00 |
| EUR ANDRITZ | 468 | 14,668.78 | 0.01 |
| USD AON | 1,566 | 258,463.84 | 0.09 |
| AUD APA GROUP | 3,931 | 24,688.03 | 0.01 |
| USD APACHE | 2,266 | 9,470.91 | 0.00 |
| USD APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO -A- | 799 | 28,094.52 | 0.01 |
| USD APPLE | 737 | 187,327.25 | 0.07 |
| USD APPLE HOSPITALITY REIT | 1,134 | 10,396.50 | 0.00 |
| USD APPLIED MATERIALS | 6,188 | 283,533.25 | 0.10 |
| USD APTIV PLC | 1,672 | 82,306.35 | 0.03 |
| USD ARAMARK HOLDINGS | 1,812 | 36,176.48 | 0.01 |
| USD ARCH CAPITAL GROUP | 2,697 | 76,762.07 | 0.03 |
| USD ARCONIC (reg shares) | 2,529 | 40,615.98 | 0.01 |
| USD ARMADA HOFFLER PROPERTIES | 295 | 3,155.92 | 0.00 |
| EUR AROUNDTOWN PROPERTY HOLDINGS | 5,880 | 29,382.72 | 0.01 |
| USD ARTHUR J. GALLAGHER | 1,221 | 99,550.75 | 0.03 |
| CAD ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 668 | 3,743.82 | 0.00 |
| JPY ASahi GLASS | 667 | 16,431.90 | 0.01 |
| JPY ASahi KASEI | 4,661 | 33,021.65 | 0.01 |
| EUR ASCENCIO | 24 | 1,124.37 | 0.00 |
| SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 23,849 | 47,401.33 | 0.02 |
| HKD ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 1,017 | 9,523.07 | 0.00 |
| EUR ASML HOLDING | 3,080 | 819,261.32 | 0.30 |
| EUR ASSICURAZIONI GENERALI | 6,971 | 94,928.26 | 0.03 |
| GBP ASSOCIATED BRITISH FOODS | 1,859 | 41,825.61 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|--|-----------|--------------|------------------|
| GBP ASSURA | 11,540 | 11,947.81 | 0.00 | USD CELANESE -A- | 790 | 57,971.39 | 0.02 |
| USD ASSURANT | 398 | 41,381.31 | 0.01 | CHF CEMBRA MONEY (reg. shares) | 95 | 8,715.70 | 0.00 |
| JPY ASTELLAS PHARMA | 7,061 | 109,291.53 | 0.04 | USD CENTENE | 3,908 | 232,191.81 | 0.08 |
| AUD ASX | 646 | 30,458.83 | 0.01 | JPY CENTRAL JAPAN RAILWAY | 542 | 87,011.68 | 0.03 |
| EUR ATOS | 661 | 44,753.10 | 0.02 | USD CENTURYLINK | 6,267 | 59,283.80 | 0.02 |
| SEK ATRIUM LJUNGBERG AB | 223 | 3,478.44 | 0.00 | USD CERNER | 2,117 | 133,363.04 | 0.05 |
| USD AT&T | 1,432 | 41,736.04 | 0.01 | USD C.H. ROBINSON WORLDWIDE | 864 | 57,209.23 | 0.02 |
| NZD AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT | 3,236 | 9,572.61 | 0.00 | HKD CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,507 | 5,740.25 | 0.00 |
| AUD AURIZON HOLDINGS | 6,637 | 17,182.93 | 0.01 | USD CHARLES SCHWAB | 7,706 | 259,084.50 | 0.09 |
| AUD AUSNET SERVICES | 6,142 | 6,428.57 | 0.00 | AUD CHARTER HALL LONG WALE REIT | 2,166 | 5,819.11 | 0.00 |
| AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP | 9,564 | 99,275.10 | 0.03 | AUD CHARTER HALL RETAIL | 1,792 | 3,411.11 | 0.00 |
| USD AUTODESK | 1,471 | 229,570.31 | 0.08 | CAD CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES (units) | 1,201 | 7,553.41 | 0.00 |
| USD AVALONBAY COMMUNITIES | 755 | 111,129.81 | 0.04 | USD CHATHAM LODGING TRUST | 248 | 1,474.56 | 0.00 |
| USD AVERY DENNISON | 547 | 55,700.72 | 0.02 | USD CHENIERE ENERGY | 1,540 | 51,598.25 | 0.02 |
| GBP AVIVA | 20,444 | 68,066.25 | 0.02 | USD CHEVRON | 1,284 | 93,036.66 | 0.03 |
| EUR AXA | 14,204 | 246,060.98 | 0.09 | CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI | 0 | 8,660.98 | 0.00 |
| USD AXALTA COATING SYSTEMS | 1,281 | 22,120.38 | 0.01 | CAD CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,382 | 12,542.73 | 0.00 |
| USD BAKER HUGHES A GE CO | 4,436 | 46,581.13 | 0.02 | USD CHUBB N | 3,028 | 338,161.05 | 0.12 |
| USD BALL | 2,028 | 131,141.81 | 0.05 | JPY CHUGAI PHARMACEUTICAL | 835 | 96,626.74 | 0.03 |
| CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares) | 164 | 21,498.49 | 0.01 | JPY CHUO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 1,226 | 35,464.68 | 0.01 |
| EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA (reg. shares) | 44,745 | 143,140.37 | 0.05 | CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares) | 1,010 | 55,391.89 | 0.02 |
| EUR BANCO DE SABADELL (reg. shares) | 37,721 | 19,411.58 | 0.01 | USD CIGNA CORP | 2,493 | 441,733.32 | 0.16 |
| EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares) | 9,409 | 0.01 | 0.00 | USD CISCO SYSTEMS | 1,293 | 50,836.08 | 0.02 |
| USD BANK OF AMERICA | 1,732 | 36,769.88 | 0.01 | USD CITIGROUP | 434 | 18,286.36 | 0.01 |
| USD BANK OF NEW YORK MELLON | 5,607 | 188,860.45 | 0.07 | USD CITIZENS FINANCIAL GROUP | 2,850 | 53,616.86 | 0.02 |
| EUR BANKINTER (reg. shares) | 4,521 | 16,587.97 | 0.01 | USD CITRIX SYSTEMS | 872 | 123,465.02 | 0.04 |
| GBP BARRATT DEVELOPMENTS | 5,314 | 29,058.75 | 0.01 | SGD CITY DEVELOPMENTS | 3,792 | 19,279.41 | 0.01 |
| CHF BARRY CALLEBAUT (reg. shares) | 3 | 6,619.39 | 0.00 | EUR CITYCON OYJ | 370 | 2,285.41 | 0.00 |
| EUR BASF (reg. shares) | 6,761 | 320,085.55 | 0.11 | GBP CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 3,034 | 3,626.53 | 0.00 |
| USD BECTON DICKINSON | 1,804 | 414,465.67 | 0.14 | HKD CK ASSET HOLDINGS LTD | 13,041 | 71,423.89 | 0.02 |
| EUR BEFIMMO SICAFI | 105 | 5,027.67 | 0.00 | CHF CLARIANT (reg. shares) | 702 | 11,801.36 | 0.00 |
| EUR BEIERSDORF | 676 | 68,625.49 | 0.02 | USD CLOROX | 821 | 142,312.94 | 0.05 |
| AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 1,639 | 6,289.76 | 0.00 | HKD CLP HOLDINGS | 5,484 | 50,588.79 | 0.02 |
| JPY BENESSE HOLDING | 266 | 6,782.09 | 0.00 | USD CME GROUP -A- | 2,390 | 413,170.35 | 0.14 |
| GBP BERKELEY GROUP HOLDINGS | 623 | 27,934.67 | 0.01 | USD CMS ENERGY | 1,905 | 111,924.81 | 0.04 |
| USD BEST BUY | 1,564 | 89,151.18 | 0.03 | EUR CNH Industrial N.V. (reg. shares) | 6,810 | 38,976.65 | 0.01 |
| GBP BIG YELLOW GROUP | 748 | 9,317.73 | 0.00 | EUR CNP ASSURANCES | 1,103 | 10,794.45 | 0.00 |
| USD BIOGEN | 1,203 | 380,622.65 | 0.13 | USD COCA-COLA | 28,509 | 1,261,506.90 | 0.45 |
| USD BIOMARIN PHARMACEUTICAL | 1,207 | 101,969.88 | 0.04 | AUD COCA-COLA AMATIL | 1,689 | 9,137.44 | 0.00 |
| USD BLACKROCK | 772 | 339,863.85 | 0.12 | EUR COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 98 | 3,733.63 | 0.00 |
| AUD BLUESCOPE STEEL | 1,715 | 9,056.60 | 0.00 | USD COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PL | 1,432 | 53,742.27 | 0.02 |
| EUR BMW | 2,222 | 114,863.39 | 0.04 | GBP COCA-COLA HBC AG | 1,042 | 22,448.47 | 0.01 |
| EUR BMW (pref. shares) | 381 | 16,385.25 | 0.01 | AUD COCHLEAR | 193 | 22,111.18 | 0.01 |
| EUR BNP PARIBAS -A- | 597 | 18,022.40 | 0.01 | EUR COFINIMMO SICAFI | 126 | 16,509.89 | 0.01 |
| CAD BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 207 | 3,332.96 | 0.00 | USD COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 3,600 | 167,304.98 | 0.06 |
| HKD BOC HONG KONG | 12,341 | 34,152.53 | 0.01 | AUD COLES GROUP LTD | 3,778 | 35,059.09 | 0.01 |
| USD BOOKING HOLDINGS INC | 280 | 376,708.80 | 0.13 | USD COLGATE-PALMOLIVE | 5,434 | 360,630.54 | 0.13 |
| AUD BORAL | 3,907 | 4,901.98 | 0.00 | USD COLONY CAPITAL INC -A- | 2,617 | 4,579.09 | 0.00 |
| USD BORG WARNER | 1,322 | 32,207.40 | 0.01 | EUR COLRUYT | 370 | 20,011.00 | 0.01 |
| USD BOSTON PROPERTIES | 1,885 | 173,835.63 | 0.06 | USD COLUMBIA PROPERTY TRUST | 629 | 7,857.50 | 0.00 |
| EUR BOUYGUES | 1,502 | 44,038.88 | 0.02 | USD COMERICA | 1,098 | 32,227.86 | 0.01 |
| AUD BRAMBLES | 5,204 | 33,637.78 | 0.01 | JPY COMFORIA RESIDENTIAL REIT | 3 | 8,540.45 | 0.00 |
| USD BRANDYWINE REALTY TRUST | 956 | 10,054.52 | 0.00 | CAD COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 989 | 5,632.70 | 0.00 |
| JPY BRIDGESTONE | 2,132 | 65,613.85 | 0.02 | EUR COMMERZBANK | 6,716 | 24,381.57 | 0.01 |
| USD BRISTOL MYERS SQUIBB | 15,633 | 871,374.77 | 0.31 | AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 5,961 | 225,528.81 | 0.08 |
| GBP BRITISH LAND | 9,154 | 38,161.41 | 0.01 | GBP COMPASS GROUP PLC | 8,338 | 130,679.72 | 0.05 |
| USD BRIXMOR PROPERTY GROUP | 1,602 | 15,223.14 | 0.01 | AUD COMPUTERSHARE | 1,630 | 9,684.81 | 0.00 |
| USD BROOKFIELD PROPERTY REIT INC -A- | 355 | 3,010.36 | 0.00 | USD CONOCOPHILLIPS | 7,401 | 227,938.26 | 0.08 |
| GBP BT GROUP | 43,843 | 64,095.65 | 0.02 | USD CONSOLIDATED EDISON | 2,248 | 175,330.52 | 0.06 |
| USD BUNGE | 907 | 37,205.05 | 0.01 | USD COPART | 1,370 | 93,853.39 | 0.03 |
| AUD BUNNINGS WAREHOUSE PROPERTY TRUST | 2,386 | 4,891.73 | 0.00 | USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 605 | 13,383.38 | 0.00 |
| GBP BURBERRY GROUP | 2,148 | 35,272.81 | 0.01 | USD COSTCO WHOLESALE | 88 | 25,021.16 | 0.01 |
| USD CADENCE DESIGN SYSTEMS | 1,904 | 125,713.35 | 0.04 | USD COUSINS PROPERTIES INC | 786 | 23,016.39 | 0.01 |
| EUR CA-IMMOBILIEN ANLAGEN | 337 | 11,348.20 | 0.00 | EUR COVESTRO | 265 | 8,100.42 | 0.00 |
| EUR CAIXABANK | 24,083 | 44,922.80 | 0.02 | EUR COVIVIO FONCIERE DES REGIONS | 226 | 12,719.95 | 0.00 |
| USD CAMDEN PROPERTY TRUST | 1,166 | 92,364.73 | 0.03 | EUR CREDIT AGRICOLE | 7,743 | 56,838.93 | 0.02 |
| USD CAMPBELL SOUP | 1,085 | 50,068.74 | 0.02 | EUR CRH PLC | 5,307 | 144,707.84 | 0.05 |
| CAD CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 913 | 27,324.23 | 0.01 | GBP CRODA INTERNATIONAL PLC | 671 | 35,530.37 | 0.01 |
| SGD CAPITACOMMERCIAL TRUST (units) | 22,221 | 23,878.34 | 0.01 | CAD CROMBIE | 478 | 4,174.52 | 0.00 |
| GBP CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES | 3,594 | 7,393.15 | 0.00 | AUD CROMWELL PROPERTY GROUP | 11,718 | 5,737.39 | 0.00 |
| SGD CAPITALAND | 20,653 | 41,339.88 | 0.01 | CHF CS GROUP (reg. shares) | 5,013 | 41,451.27 | 0.01 |
| SGD CAPITAMALL TRUST | 20,220 | 25,420.02 | 0.01 | AUD CSL | 1,526 | 277,050.62 | 0.10 |
| USD CAPRI HOLDINGS LTD | 964 | 10,406.48 | 0.00 | USD CSX | 4,951 | 283,685.83 | 0.10 |
| USD CARDINAL HEALTH | 1,921 | 92,102.32 | 0.03 | USD CUBESMART | 1,047 | 28,040.95 | 0.01 |
| USD CARETRUST REIT | 515 | 7,621.50 | 0.00 | USD CUMMINS | 989 | 133,800.22 | 0.05 |
| USD CARMAX | 1,018 | 54,795.93 | 0.02 | GBP CUSTODIAN REIT | 1,929 | 2,368.17 | 0.00 |
| EUR CARMILA SA | 183 | 2,603.17 | 0.00 | JPY CYBERAGENT | 372 | 14,423.29 | 0.01 |
| EUR CARREFOUR | 4,069 | 64,360.89 | 0.02 | USD CYRUSONE | 614 | 37,930.08 | 0.01 |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON | 348 | 13,418.95 | 0.00 | JPY DAI NIPPON PRINTING | 897 | 19,119.08 | 0.01 |
| JPY CASIO COMPUTER | 714 | 10,028.44 | 0.00 | JPY DAICEL CORP | 918 | 6,710.72 | 0.00 |
| SEK CASTELLUM | 1,317 | 22,337.50 | 0.01 | JPY DAIFUKU | 376 | 23,873.81 | 0.01 |
| SEK CATENA AB | 122 | 3,560.16 | 0.00 | JPY DAIKIN INDUSTRIES | 945 | 115,286.26 | 0.04 |
| USD CATERPILLAR | 4,978 | 577,694.48 | 0.21 | JPY DAIWA HOUSE INDUSTRY | 2,091 | 51,873.19 | 0.02 |
| USD CBOE HOLDINGS | 726 | 64,760.99 | 0.02 | JPY DAIWA OFFICE INVESTMENT | 1 | 7,267.26 | 0.00 |
| USD CBRE GROUP | 2,117 | 79,827.33 | 0.03 | JPY DAIWAHOUSE RESIDENTIAL INVESTMENT | 10 | 23,400.94 | 0.01 |
| SGD CDL HOSPITALITY TRUST (stapled security) | 3,800 | 2,135.23 | 0.00 | EUR DANONE | 4,142 | 266,512.41 | 0.09 |
| | | | | USD DARDEN RESTAURANTS | 832 | 45,310.42 | 0.02 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|--------------|------------------|
| SGD DBS GROUP HOLDINGS | 6,031 | 78,662.52 | 0.03 | AUD FORTESCUE METALS GROUP | 4,620 | 28,279.25 | 0.01 |
| GBP DCC | 513 | 32,463.85 | 0.01 | USD FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 954 | 41,277.63 | 0.01 |
| USD DEERE & CO | 2,005 | 277,038.99 | 0.10 | HKD FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,509 | 6,029.15 | 0.00 |
| USD DELL TECHNOLOGIES INC | 1,061 | 41,977.24 | 0.01 | USD FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 367 | 6,857.85 | 0.00 |
| USD DELTA AIR LINES | 1,121 | 31,988.71 | 0.01 | USD FRANKLIN RESOURCES | 1,957 | 32,655.30 | 0.01 |
| JPY DENSO | 1,602 | 51,813.85 | 0.02 | USD FRANKLIN STREET PROPERTIES | 564 | 3,232.35 | 0.00 |
| USD DENTSPLY SIRONA | 1,559 | 60,530.45 | 0.02 | EUR FRAPORT | 267 | 10,824.02 | 0.00 |
| GBP DERWENT LONDON | 490 | 19,881.86 | 0.01 | SGD FRASERS CENTREPOINT TRUST | 3,422 | 5,384.31 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares) | 1,274 | 174,700.51 | 0.06 | SGD FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 8,030 | 4,990.93 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE EUROSHOP (reg. shares) | 254 | 2,915.47 | 0.00 | EUR FRESenius | 363 | 13,524.26 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE POST (reg. shares) | 6,635 | 180,379.48 | 0.06 | JPY FRONTIER REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 6,188.14 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares) | 1,590 | 20,605.31 | 0.01 | JPY FUJITSU | 733 | 66,277.73 | 0.02 |
| EUR DEUTSCHE WOHNEN (reg. shares) | 4,162 | 158,527.06 | 0.06 | JPY FUKUOKA REIT | 4 | 3,635.26 | 0.00 |
| USD DEVON ENERGY | 2,258 | 15,600.84 | 0.01 | EUR GALP ENERGIA -B- | 3,364 | 38,366.42 | 0.01 |
| USD DEXCOM | 619 | 166,556.02 | 0.06 | USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES | 1,097 | 30,399.55 | 0.01 |
| AUD DEXUS PROPERTY GROUP (stapled security) | 8,945 | 49,766.47 | 0.02 | USD GAP | 1,319 | 9,286.36 | 0.00 |
| USD DIAMONDRock HOSPITALITY | 1,122 | 5,698.72 | 0.00 | USD GARMIN (reg. shares) | 880 | 65,973.55 | 0.02 |
| USD DIGITAL REALTY | 1,417 | 196,861.73 | 0.07 | GBP GCP STUDENT LIVING | 2,229 | 3,676.10 | 0.00 |
| SEK DIOS FASTIGHETER | 407 | 2,722.75 | 0.00 | CHF GEBERIT | 55 | 24,240.20 | 0.01 |
| USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 2,055 | 73,313.92 | 0.03 | EUR GECINA | 560 | 74,127.64 | 0.03 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -A- | 961 | 18,677.32 | 0.01 | USD GENERAL MILLS | 4,048 | 213,620.06 | 0.07 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -C- | 2,485 | 43,582.50 | 0.02 | USD GENUINE PARTS | 951 | 64,056.27 | 0.02 |
| USD DOMINION RESOURCES | 5,474 | 395,194.26 | 0.14 | EUR GETLINK SE | 2,950 | 35,568.15 | 0.01 |
| USD DOMINO'S PIZZA | 254 | 82,267.52 | 0.03 | USD GETTY REALTY | 177 | 4,207.95 | 0.00 |
| USD DOUGLAS EMMETT | 896 | 27,340.65 | 0.01 | USD GILEAD SCIENCES | 8,433 | 630,485.46 | 0.23 |
| USD DOVER | 963 | 80,829.80 | 0.03 | CHF GIVAUDAN (reg. shares) | 21 | 65,837.54 | 0.02 |
| USD DOW INC | 1,307 | 38,202.40 | 0.01 | GBP GLAXOSMITHKLINE | 26,230 | 492,611.37 | 0.18 |
| CAD DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 591 | 3,897.55 | 0.00 | USD GLOBAL NET LEASE | 507 | 6,775.86 | 0.00 |
| CAD DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 273 | 4,472.63 | 0.00 | JPY GLOBAL ONE REAL ESTATE INVESTMENT | 5 | 3,932.23 | 0.00 |
| USD DTE ENERGY | 1,287 | 122,232.05 | 0.04 | JPY GLP J-REIT | 18 | 19,769.55 | 0.01 |
| CHF DUFREY | 43 | 1,349.68 | 0.00 | USD GOLDMAN SACHS GROUP | 568 | 87,820.82 | 0.03 |
| USD DUKE REALTY | 4,465 | 144,574.34 | 0.05 | AUD GOODMAN GROUP (stapled security) | 5,485 | 40,624.13 | 0.01 |
| USD E TRADE FINANCIAL | 1,481 | 50,841.40 | 0.02 | NZD GOODMAN PROPERTY TRUST | 5,384 | 6,846.98 | 0.00 |
| JPY EAST JAPAN RAILWAY | 1,129 | 85,493.14 | 0.03 | AUD GPT GROUP (stapled security) | 15,897 | 35,319.84 | 0.01 |
| USD EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 399 | 9,832.34 | 0.00 | GBP GRAINGER | 2,941 | 9,452.87 | 0.00 |
| USD EASTGROUP PROPERTIES | 207 | 21,634.39 | 0.01 | EUR GRAND CITY PROPERTIES | 538 | 11,320.36 | 0.00 |
| USD EAST-WEST BANCORP | 926 | 23,836.76 | 0.01 | CAD GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT (units) | 291 | 11,899.33 | 0.00 |
| GBP EASYJET | 829 | 5,871.95 | 0.00 | GBP GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 1,239 | 10,463.70 | 0.00 |
| USD EATON | 2,724 | 211,589.96 | 0.07 | CHF GURIT-HEBERLEIN | 3 | 3,009.12 | 0.00 |
| USD ECOLAB | 1,736 | 270,482.41 | 0.09 | EUR HAMBORNER REIT | 342 | 3,065.53 | 0.00 |
| USD EDISON INTERNATIONAL | 2,354 | 128,955.33 | 0.04 | GBP HAMMERSON | 3,717 | 3,566.61 | 0.00 |
| EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares) | 17,158 | 68,869.12 | 0.02 | HKD HANG LUNG PROPERTIES | 9,847 | 19,997.02 | 0.01 |
| USD EDWARDS LIFESCIENCES | 1,393 | 262,721.52 | 0.09 | HKD HANG SENG BANK | 2,551 | 43,612.62 | 0.02 |
| EUR EIFFAGE | 526 | 37,195.31 | 0.01 | USD HANNESBRANDS | 2,300 | 18,103.43 | 0.01 |
| JPY EISAI | 935 | 68,658.00 | 0.02 | USD HARLEY-DAVIDSON | 1,180 | 22,329.47 | 0.01 |
| USD ELECTRONIC ARTS | 1,960 | 196,376.80 | 0.07 | USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 2,376 | 83,733.66 | 0.03 |
| USD EMPIRE STATE REALTY TRUST -A- | 816 | 7,307.47 | 0.00 | AUD HARVEY NORMAN HOLDINGS | 1,875 | 3,384.88 | 0.00 |
| GBP EMPRIE STUDENT | 2,926 | 2,397.88 | 0.00 | USD HASBRO | 895 | 64,040.09 | 0.02 |
| CHF EMS-CHEMIE HOLDING | 9 | 5,526.23 | 0.00 | USD HCA HOLDINGS | 1,792 | 161,019.41 | 0.06 |
| EUR ENAGAS | 1,670 | 33,147.51 | 0.01 | USD HEALTHCARE REALTY TRUST | 710 | 19,838.01 | 0.01 |
| NOK ENTRIA ASA | 819 | 9,671.58 | 0.00 | USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA -A- | 1,163 | 28,227.82 | 0.01 |
| EUR E.ON (reg. shares) | 15,052 | 155,924.67 | 0.05 | USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 6,090 | 145,241.12 | 0.05 |
| USD EPR PROPERTIES | 421 | 10,185.99 | 0.00 | EUR HEIDELBERGCEMENT | 1,001 | 42,942.63 | 0.01 |
| USD EQUINIX | 568 | 354,803.77 | 0.12 | GBP HELICAL | 473 | 2,052.81 | 0.00 |
| USD EQUITABLE HOLDINGS INC | 3,002 | 43,384.05 | 0.02 | EUR HENKEL | 697 | 51,481.99 | 0.02 |
| USD EQUITY COMMONWEALTH | 651 | 20,636.66 | 0.01 | EUR HENKEL (pref. shares) | 1,196 | 96,065.90 | 0.03 |
| USD EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 938 | 53,910.09 | 0.02 | USD HENRY JACK & ASSOCIATES | 525 | 81,498.65 | 0.03 |
| USD EQUITY RESIDENTIAL | 1,985 | 122,510.41 | 0.04 | USD HENRY SCHEIN | 947 | 47,817.95 | 0.02 |
| USD ERIE INDEMNITY -A- | 179 | 26,570.93 | 0.01 | USD HESS | 1,933 | 64,361.21 | 0.02 |
| USD ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TR | 493 | 6,433.32 | 0.00 | USD HEWLETT-PACKARD | 8,562 | 83,136.02 | 0.03 |
| USD ESSEX PROPERTY TRUST | 355 | 78,190.89 | 0.03 | CHF HIAG IMMOBILIEN HOLDING (reg shares) | 13 | 1,265.50 | 0.00 |
| EUR ESSILORLUXOTTICA | 1,904 | 205,349.01 | 0.07 | EUR HIBERNIA REIT -144A- (reg. shares) | 3,319 | 3,867.76 | 0.00 |
| USD ESTEE LAUDER COMPANIES -A- | 1,456 | 232,010.87 | 0.08 | USD HIGHWOODS PROPERTIES | 551 | 19,522.90 | 0.01 |
| EUR EURAZEO | 253 | 11,413.29 | 0.00 | USD HILTON WORLDWIDE HOLDINGS (reg. shares) | 1,793 | 122,383.85 | 0.04 |
| EUR EUROCOMMERCIAL (cert. shares) | 239 | 2,319.17 | 0.00 | JPY HINO MOTORS | 1,053 | 5,669.45 | 0.00 |
| EUR EURONEXT NV | 188 | 14,012.08 | 0.00 | JPY HIROSE ELECTRIC | 124 | 12,813.81 | 0.00 |
| USD EVERSOURCE ENERGY | 2,192 | 171,409.47 | 0.06 | JPY HITACHI CHEMICAL | 382 | 16,240.28 | 0.01 |
| EUR EXOR HOLDING | 728 | 37,558.75 | 0.01 | JPY HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY | 396 | 8,020.92 | 0.00 |
| USD EXPEDIA | 895 | 50,345.01 | 0.02 | JPY HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES | 254 | 18,791.58 | 0.01 |
| USD EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON | 1,121 | 74,774.96 | 0.03 | JPY HITACHI METALS | 789 | 8,319.99 | 0.00 |
| USD EXTRA SPACE STORAGE | 682 | 65,261.03 | 0.02 | HKD HKEX | 4,039 | 121,838.37 | 0.04 |
| USD EXXON MOBIL | 1,293 | 49,103.18 | 0.02 | HKD HKT (stapled security) | 12,632 | 17,210.10 | 0.01 |
| SEK FABEGE AB | 1,289 | 16,565.66 | 0.01 | USD HOLLYFRONTIER | 939 | 23,014.16 | 0.01 |
| USD FACTSET RESEARCH SYSTEMS | 264 | 68,885.47 | 0.02 | USD HOLOGIC | 1,769 | 62,102.00 | 0.02 |
| JPY FAST RETAILING | 218 | 89,211.70 | 0.03 | USD HOME DEPOT | 7,962 | 1,486,551.69 | 0.53 |
| USD FASTENAL | 3,890 | 121,547.36 | 0.04 | JPY HONDA MOTOR | 6,163 | 138,716.25 | 0.05 |
| SEK FASTIGHETS BALDER -B- | 474 | 17,078.54 | 0.01 | HKD HONG KONG & CHINA GAS | 33,849 | 55,812.18 | 0.02 |
| EUR FAURECIA | 285 | 8,525.59 | 0.00 | USD HONGKONG LAND HOLDINGS | 5,616 | 21,061.13 | 0.01 |
| USD FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 883 | 65,916.63 | 0.02 | USD HORMEL FOODS | 1,913 | 89,205.92 | 0.03 |
| GBP FERGUSON | 1,196 | 74,956.23 | 0.03 | USD HOST HOTELS AND RESORTS | 8,496 | 93,798.04 | 0.03 |
| EUR FERROVIAL | 3,274 | 78,555.49 | 0.03 | USD HP | 9,969 | 173,062.03 | 0.06 |
| USD FIFTH THIRD BANCORP | 4,722 | 70,124.39 | 0.02 | CAD H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UNITS | 1,547 | 9,706.30 | 0.00 |
| USD FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST | 692 | 23,008.99 | 0.01 | USD HUDSON PACIFIC | 819 | 20,758.55 | 0.01 |
| USD FIRST REPUBLIC BANK | 1,103 | 90,751.09 | 0.03 | SEK HUFVUDSTADEN -A- | 534 | 7,316.98 | 0.00 |
| NZD FLETCHER BUILDING | 2,847 | 5,906.62 | 0.00 | JPY HULIC | 2,864 | 29,124.46 | 0.01 |
| USD FLOWSERVE | 835 | 19,936.43 | 0.01 | JPY HULIC REIT | 6 | 6,530.51 | 0.00 |
| CHF FLUGHAFEN ZUERICH | 15 | 1,640.74 | 0.00 | USD HUMANA | 884 | 277,585.27 | 0.10 |
| | | | | USD HUNTINGTON BANCSHARES | 6,625 | 54,393.48 | 0.02 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|--------------|------------------|
| HKD HYSAN DEVELOPMENT | 2,957 | 9,614.37 | 0.00 | USD KILROY REALTY | 563 | 35,891.01 | 0.01 |
| EUR IBERDROLA | 48,250 | 475,633.90 | 0.18 | USD KIMBERLY-CLARK | 2,287 | 292,425.27 | 0.10 |
| USD IBM | 7,021 | 778,807.89 | 0.28 | USD KIMCO REALTY | 2,234 | 21,597.96 | 0.01 |
| EUR ICADE | 156 | 12,313.36 | 0.00 | USD KINDER MORGAN | 13,494 | 187,836.55 | 0.07 |
| JPY ICHIGO REAL ESTATE INVESTMENT | 6 | 4,008.31 | 0.00 | GBP KINGFISHER | 11,014 | 19,652.26 | 0.01 |
| USD IDEX | 499 | 68,939.43 | 0.02 | EUR KINGSPAN GROUP | 1,033 | 55,206.81 | 0.02 |
| USD IDEXX LABORATORIES | 584 | 141,347.72 | 0.05 | USD KITE REALTY GROUP TRUST | 448 | 4,240.30 | 0.00 |
| CHF IDORSIA LTD | 99 | 2,566.04 | 0.00 | NZD KIWI PROPERTY | 7,482 | 4,169.40 | 0.00 |
| EUR IGD SIIQ (reg shares) | 320 | 1,315.78 | 0.00 | USD KKR & CO INC -A- | 3,331 | 78,186.35 | 0.03 |
| USD IHS MARKIT | 2,585 | 155,080.96 | 0.05 | EUR KLEPIERRE | 2,259 | 43,548.12 | 0.02 |
| USD ILLINOIS TOOL WORKS | 2,157 | 306,497.83 | 0.11 | SEK KLOVERN -B- | 2,496 | 19,542.83 | 0.00 |
| GBP IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 1,199 | 1,360.01 | 0.00 | JPY KOBAYASHI PHARMACEUTICAL | 181 | 16,782.42 | 0.01 |
| USD INDEPENDENCE REALTY TRUST | 507 | 4,525.95 | 0.00 | USD KOHL'S | 1,019 | 14,871.38 | 0.01 |
| EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX | 7,323 | 190,104.42 | 0.07 | EUR KOJAMO OYJ | 880 | 16,683.15 | 0.01 |
| JPY INDUSTRIAL & INFRASTRUCTURE FUND INVESTMENT | 8 | 10,795.08 | 0.00 | JPY KOMATSU | 3,449 | 56,825.61 | 0.02 |
| USD INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIE | 349 | 6,122.30 | 0.00 | JPY KONAMI | 343 | 10,542.66 | 0.00 |
| EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares) | 9,434 | 139,019.26 | 0.05 | EUR KONE -B- | 192 | 10,857.40 | 0.00 |
| GBP INFORMA | 6,534 | 35,858.23 | 0.01 | JPY KONICA MINOLTA | 1,670 | 6,791.87 | 0.00 |
| EUR ING GROUP | 28,645 | 150,288.42 | 0.05 | EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | 8,411 | 196,433.48 | 0.07 |
| EUR INGENICO GROUP | 406 | 43,210.57 | 0.02 | EUR KONINKLIJKE DSM | 1,217 | 138,202.44 | 0.05 |
| EUR INMOBILIARIA COLONIAL SA | 1,588 | 15,047.58 | 0.01 | EUR KONINKLIJKE KPN | 23,963 | 57,214.73 | 0.02 |
| USD INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTI | 88 | 6,649.91 | 0.00 | EUR KONINKLIJKE VOPAK | 471 | 24,523.15 | 0.01 |
| JPY INPEX | 3,779 | 21,309.79 | 0.01 | JPY KUBOTA | 3,873 | 49,568.79 | 0.02 |
| AUD INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 7,705 | 29,237.21 | 0.01 | CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL | 58 | 8,019.52 | 0.00 |
| USD INTEL | 30,304 | 1,640,040.10 | 0.58 | SEK KUNGSLEDEN | 921 | 6,970.33 | 0.00 |
| USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE | 3,713 | 299,794.10 | 0.10 | JPY KURARAY | 1,174 | 11,875.27 | 0.00 |
| GBP INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 903 | 39,347.04 | 0.01 | JPY KURITA WATER INDUSTRIES | 365 | 8,448.36 | 0.00 |
| USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | 691 | 70,586.72 | 0.02 | JPY KYOCERA | 1,197 | 71,078.19 | 0.02 |
| USD INTERNATIONAL PAPER | 2,466 | 76,770.87 | 0.03 | JPY KYUSHU RAILWAY COMPANY | 597 | 17,133.32 | 0.01 |
| CAD INTERRENT REAL ESTATE INVESTME | 615 | 5,746.85 | 0.00 | USD LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 660 | 83,476.15 | 0.03 |
| GBP INTERTEK GROUP | 842 | 49,363.61 | 0.02 | CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares) | 1,172 | 42,828.36 | 0.01 |
| EUR INTERVEST OFFICES | 111 | 2,892.40 | 0.00 | USD LAM RESEARCH | 974 | 233,642.57 | 0.08 |
| EUR INTESA SANPAOLO | 94,365 | 154,111.64 | 0.05 | GBP LAND SECURITIES GROUP PLC | 3,483 | 24,046.93 | 0.01 |
| GBP INTU PROPERTIES PLC | 4,336 | 239.45 | 0.00 | CHF LANDIS+GYR GROUP AG | 73 | 5,012.54 | 0.00 |
| USD INTUIT | 1,735 | 399,107.53 | 0.14 | EUR LAR ESPANA | 292 | 1,289.08 | 0.00 |
| USD INVESCO | 2,882 | 26,169.79 | 0.01 | JPY LASALLE LOGIPORT | 7 | 8,987.75 | 0.00 |
| USD INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 65 | 3,567.45 | 0.00 | JPY LAWSON | 186 | 10,206.46 | 0.00 |
| JPY INVINCIBLE INVESTMENT | 24 | 5,318.02 | 0.00 | EUR LEASINVEST REAL ESTATE | 11 | 1,106.40 | 0.00 |
| USD INVITATION HOMES (reg. shares) | 2,900 | 61,982.33 | 0.02 | EUR LEG IMMOBILIEN (reg. shares) | 338 | 38,038.30 | 0.01 |
| USD IQVIA HOLDINGS INC | 1,080 | 116,523.16 | 0.04 | GBP LEGAL & GENERAL GROUP | 31,132 | 74,832.13 | 0.03 |
| EUR IRISH RESIDENT | 2,120 | 2,838.46 | 0.00 | EUR LEGRAND | 372 | 23,840.87 | 0.01 |
| USD IRON MOUNTAIN REIT | 1,833 | 43,621.50 | 0.02 | AUD LENDLEASE GROUP | 1,881 | 11,856.00 | 0.00 |
| GBP ITV | 18,910 | 15,479.99 | 0.01 | USD LENNOX INTERNATIONAL | 227 | 41,271.70 | 0.01 |
| GBP J. SAINSBURY | 9,237 | 24,098.32 | 0.01 | USD LEXINGTON REALITY TRUST | 1,297 | 12,876.53 | 0.00 |
| JPY JAPAN EXCELLENT | 6 | 7,151.42 | 0.00 | USD LIBERTY BROADB c -C- | 723 | 80,032.76 | 0.03 |
| JPY JAPAN HOTEL REIT INVESTMENT | 22 | 6,296.12 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -A- | 920 | 15,189.58 | 0.01 |
| JPY JAPAN LOGISTICS | 4 | 9,263.11 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -C- | 2,921 | 45,884.19 | 0.02 |
| JPY JAPAN PRIME REALTY INVESTMENT | 4 | 12,328.87 | 0.00 | USD LIFE STORAGE | 255 | 24,135.39 | 0.01 |
| JPY JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT | 6 | 36,876.87 | 0.01 | USD LINCOLN NATIONAL | 1,278 | 33,637.10 | 0.01 |
| JPY JAPAN RENTAL HOUSING INVESTMENTS | 7 | 6,171.21 | 0.00 | USD LINDE PLC | 3,589 | 620,904.82 | 0.23 |
| JPY JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT | 22 | 25,449.91 | 0.01 | CHF LINDT & SPRUENGLI | 3 | 21,140.11 | 0.01 |
| SGD JARDINE CYCLE & CARRIAGE | 333 | 4,596.62 | 0.00 | USD LKQ | 2,077 | 42,595.18 | 0.01 |
| USD JAZZ PHARMACEUTICALS | 362 | 36,056.35 | 0.01 | USD LOEWS | 1,737 | 60,508.44 | 0.02 |
| USD JBG SMITH PROPERTIES | 663 | 21,119.11 | 0.01 | CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares) | 306 | 13,244.41 | 0.00 |
| EUR JC DECAUX | 547 | 9,901.72 | 0.00 | GBP LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 1,653 | 149,219.33 | 0.05 |
| EUR JERONIMO MARTINS | 1,689 | 30,470.08 | 0.01 | GBP LONDONMETRIC PROPERTY | 3,975 | 8,669.29 | 0.00 |
| JPY JFE HOLDINGS | 1,812 | 11,797.40 | 0.00 | CHF LONZA GROUP (reg. shares) | 132 | 54,891.78 | 0.02 |
| USD JOHNSON & JOHNSON | 17,544 | 2,300,608.61 | 0.81 | EUR L'OREAL | 1,884 | 493,930.85 | 0.18 |
| USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 5,107 | 137,688.99 | 0.05 | USD LOWE'S COMPANIES | 5,146 | 442,803.93 | 0.16 |
| GBP JOHNSON MATTHEY | 1,010 | 22,521.07 | 0.01 | USD LTC PROPERTIES | 213 | 6,578.48 | 0.00 |
| USD JONES LANG LASALLE | 338 | 34,117.26 | 0.01 | USD LULULEMON ATHLETICA | 753 | 142,703.24 | 0.05 |
| USD JP MORGAN CHASE | 1,284 | 115,596.06 | 0.04 | EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 138 | 51,082.63 | 0.02 |
| CHF JULIUS BAER GRUPPE | 242 | 8,262.71 | 0.00 | GBP LXI REIT PLC | 2,518 | 3,397.18 | 0.00 |
| JPY KAJIMA | 1,656 | 17,011.79 | 0.01 | USD MACERICH | 759 | 4,274.84 | 0.00 |
| JPY KANSAI PAINT | 660 | 12,575.07 | 0.00 | USD MACK-CALI REALTY | 490 | 7,456.74 | 0.00 |
| USD KANSAS CITY SOUTHERN INDUSTRIES | 676 | 85,917.14 | 0.03 | AUD MACQUARIE GROUP | 1,129 | 59,234.40 | 0.02 |
| JPY KAO | 1,809 | 147,938.82 | 0.05 | USD MANPOWER | 348 | 18,463.04 | 0.01 |
| JPY KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES | 529 | 7,688.89 | 0.00 | USD MANULIFE US REAL ESTATE INVEST | 6,889 | 4,994.40 | 0.00 |
| EUR KBC GROUP | 1,678 | 77,353.91 | 0.03 | SGD MAPLETREE COMMERCIAL TRUST REIT (reg. shares) | 10,572 | 13,588.11 | 0.00 |
| JPY KDDI | 6,674 | 197,223.64 | 0.07 | SGD MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 7,427 | 12,675.37 | 0.00 |
| JPY KEIO CORP | 381 | 22,527.33 | 0.01 | SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 12,328 | 13,680.17 | 0.00 |
| USD KELLOGG | 1,669 | 100,094.29 | 0.03 | USD MARATHON OIL | 5,116 | 16,830.13 | 0.01 |
| JPY KENEDIX OFFICE INVESTMENT | 2 | 9,636.16 | 0.00 | USD MARATHON PETROLEUM (when issued) | 4,346 | 102,662.56 | 0.04 |
| JPY KENEDIX RESIDENTIAL INVESTMENT CORPORATION | 4 | 6,840.49 | 0.00 | GBP MARKS & SPENCER | 10,178 | 12,524.97 | 0.00 |
| JPY KENEDIYX RETAIL REIT | 2 | 3,516.98 | 0.00 | USD MARSH & MCLENNAN | 3,379 | 292,144.08 | 0.10 |
| USD KENNEDY-WILSON HOLDINGS | 678 | 9,098.68 | 0.00 | JPY MARUI | 704 | 11,834.36 | 0.00 |
| SGD KEPPPEL | 4,846 | 18,004.65 | 0.01 | USD MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 4,009 | 90,713.79 | 0.03 |
| SGD KEPPPEL DC REIT TRUST (reg. -S-) | 5,865 | 9,432.91 | 0.00 | USD MASCO | 1,848 | 63,877.02 | 0.02 |
| SGD KEPPPEL REIT | 9,587 | 6,396.50 | 0.00 | USD MASTERCARD | 6,154 | 1,486,538.71 | 0.53 |
| EUR KERING | 509 | 265,541.30 | 0.09 | USD MC CORMICK (non voting) | 845 | 119,356.44 | 0.04 |
| EUR KERRY GROUP -A- | 1,147 | 132,443.87 | 0.05 | USD MCDONALD'S | 5,734 | 948,072.89 | 0.34 |
| USD KEYCORP | 6,586 | 68,291.98 | 0.02 | JPY MCUBS MIDCITY INVESTMENT | 8 | 5,700.41 | 0.00 |
| JPY KEYENCE | 690 | 222,681.76 | 0.08 | USD MEDICAL PROPERTIES TRUST | 2,783 | 48,122.65 | 0.02 |
| USD KEYSIGHT TECHNOLOGIES. | 1,225 | 102,467.63 | 0.04 | EUR MEDIOBANCA | 2,556 | 14,098.66 | 0.00 |
| JPY KIKKOMAN | 537 | 22,907.40 | 0.01 | USD MEDTRONIC | 263 | 23,740.84 | 0.01 |
| CAD KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 459 | 5,086.80 | 0.00 | GBP MEGGITT | 4,055 | 14,597.81 | 0.01 |
| | | | | USD MERCADOLIBRE | 303 | 148,032.66 | 0.05 |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|--------------|------------------|
| EUR MERCIALYS | 301 | 2,183.94 | 0.00 | CHF NOVARTIS (reg. shares) | 4,455 | 367,667.97 | 0.13 |
| EUR MERCK | 867 | 89,034.00 | 0.03 | EUR NSI NV | 86 | 3,395.45 | 0.00 |
| USD MERCK & CO | 18,267 | 1,405,451.13 | 0.50 | JPY NSK | 1,317 | 8,464.67 | 0.00 |
| NZD MERIDIAN ENERGY | 4,280 | 10,250.22 | 0.00 | JPY NTT DOCOMO | 5,043 | 157,759.72 | 0.05 |
| EUR MERLIN PROPERTIES | 1,617 | 12,189.96 | 0.00 | USD NUCOR | 2,024 | 72,922.00 | 0.03 |
| EUR METRO AG | 1,157 | 9,987.67 | 0.00 | USD NVIDIA | 3,878 | 1,022,226.61 | 0.37 |
| EUR METSO | 706 | 16,814.14 | 0.01 | USD NVR | 24 | 61,600.24 | 0.02 |
| USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 159 | 109,759.47 | 0.04 | SEK NYFOSA AB | 778 | 3,932.87 | 0.00 |
| EUR MICHELIN (reg. shares) | 1,147 | 102,029.74 | 0.04 | JPY OBAYASHI | 2,390 | 20,502.83 | 0.01 |
| USD MICROSOFT | 49,412 | 7,792,744.09 | 2.72 | USD OCCIDENTAL PETROLEUM | 5,849 | 67,730.78 | 0.02 |
| USD MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 616 | 63,471.19 | 0.02 | JPY ODAKYU ELECTRIC RAILWAY | 1,094 | 24,038.51 | 0.01 |
| AUD MIRVAC GROUP | 32,042 | 40,987.66 | 0.01 | USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 258 | 7,029.30 | 0.00 |
| JPY MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 4,728 | 28,154.36 | 0.01 | USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 1,221 | 32,396.27 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI ELECTRIC | 6,809 | 84,205.93 | 0.03 | USD OMNICOM GROUP | 1,449 | 79,524.24 | 0.03 |
| JPY MITSUBISHI ESTATE | 9,987 | 147,551.32 | 0.05 | JPY OMRON | 710 | 37,012.63 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI MATERIALS | 414 | 8,494.39 | 0.00 | EUR OMV | 988 | 27,283.69 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE | 1,479 | 7,286.87 | 0.00 | USD ONEOK (new) | 2,705 | 58,990.31 | 0.02 |
| JPY MITSUI CHEMICALS | 680 | 12,921.82 | 0.00 | JPY ONO PHARMACEUTICAL | 1,402 | 32,291.85 | 0.01 |
| JPY MITSUI FUDOSAN | 7,853 | 136,064.53 | 0.05 | USD ORACLE | 476 | 22,991.38 | 0.01 |
| JPY MITUI FUDOSAN LOGISTICS PARK | 2 | 8,340.28 | 0.00 | EUR ORANGE | 13,392 | 163,627.36 | 0.06 |
| JPY MIZUHO FINANCIAL GROUP | 90,178 | 103,247.00 | 0.04 | AUD ORICA | 1,364 | 12,811.37 | 0.00 |
| CHF MOBIMO HOLDING | 32 | 8,838.14 | 0.00 | JPY ORIENTAL LAND | 743 | 95,057.21 | 0.03 |
| USD MOHAWK INDUSTRIES | 363 | 27,663.29 | 0.01 | AUD ORIGIN ENERGY | 5,871 | 15,739.04 | 0.01 |
| GBP MONDI | 2,534 | 43,398.58 | 0.02 | EUR ORION CORPORATION (new) -B- | 704 | 28,791.87 | 0.01 |
| USD MONMOUTH REAL ESTATE -A- | 509 | 6,136.60 | 0.00 | JPY ORIX | 4,941 | 59,521.49 | 0.02 |
| EUR MONTEA SCA | 61 | 5,676.00 | 0.00 | JPY ORIX JREIT | 13 | 16,737.46 | 0.01 |
| USD MOODY'S | 1,139 | 240,828.46 | 0.08 | JPY OSAKA GAS | 1,386 | 26,130.55 | 0.01 |
| JPY MORI HILLS REIT INVESTMENT CORP | 8 | 10,012.47 | 0.00 | JPY OTSUKA | 384 | 16,451.88 | 0.01 |
| JPY MORI TRUST SOGO REIT | 5 | 5,839.01 | 0.00 | SGD OVERSEA-CHINESE BANKING (reg. shares) | 11,109 | 67,413.45 | 0.02 |
| GBP MORRISON (W.M.) SUPERMARKETS | 12,527 | 27,649.81 | 0.01 | USD OWENS CORNING | 770 | 29,888.48 | 0.01 |
| USD MOSAIC | 2,191 | 23,710.10 | 0.01 | USD PACCAR | 2,342 | 143,149.60 | 0.05 |
| USD MOTOROLA SOLUTIONS | 1,157 | 153,803.44 | 0.05 | JPY PANASONIC | 8,242 | 62,987.97 | 0.02 |
| USD M&T BANK | 824 | 85,272.78 | 0.03 | SEK PANDOX -B- | 438 | 3,627.30 | 0.00 |
| HKD MTR | 5,115 | 26,428.97 | 0.01 | USD PARAMOUNT GROUP | 1,055 | 9,285.88 | 0.00 |
| EUR MTU AERO ENGINES | 446 | 65,330.72 | 0.02 | CHF PARGESA HOLDING | 41 | 2,746.74 | 0.00 |
| EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS- GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted) | 969 | 195,683.89 | 0.07 | USD PARK HOTELS & RESORTS | 1,288 | 10,188.57 | 0.00 |
| JPY MURATA MANUFACTURING | 2,149 | 108,911.01 | 0.04 | USD PARKER-HANNIFIN | 847 | 109,892.35 | 0.04 |
| JPY NABTESCO | 417 | 9,636.51 | 0.00 | JPY PARK24 | 431 | 6,354.16 | 0.00 |
| JPY NAGOYA RAILROAD | 695 | 19,502.00 | 0.01 | CHF PARTNERS GROUP | 49 | 33,790.66 | 0.01 |
| USD NASDAQ OMX GROUP | 741 | 70,337.09 | 0.02 | USD PAYPAL HOLDINGS | 217 | 20,782.71 | 0.01 |
| AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK | 9,728 | 99,308.12 | 0.03 | HKD PCCW | 14,123 | 7,780.56 | 0.00 |
| GBP NATIONAL GRID PLC | 18,298 | 214,770.11 | 0.07 | GBP PEARSON | 4,082 | 27,968.88 | 0.01 |
| USD NATIONAL HEALTH INVESTORS | 229 | 11,338.21 | 0.00 | USD PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 711 | 7,739.79 | 0.00 |
| USD NATIONAL OILWELL VARCO | 2,455 | 24,135.00 | 0.01 | USD PENTAIR | 1,106 | 32,913.74 | 0.01 |
| USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 927 | 29,846.80 | 0.01 | USD PEOPLES UNITED FINANCIAL | 3,247 | 35,877.41 | 0.01 |
| USD NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 321 | 9,486.86 | 0.00 | USD PEPSICO | 9,621 | 1,155,476.11 | 0.41 |
| EUR NATIXIS | 6,361 | 20,709.77 | 0.01 | EUR PERNOD-RICARD | 220 | 31,201.54 | 0.01 |
| EUR NATURGY ENERGY GROUP | 1,985 | 35,100.03 | 0.01 | USD PERRIGO CO PLC | 825 | 39,680.02 | 0.01 |
| JPY NEC | 919 | 33,596.81 | 0.01 | USD PHILLIPS 66 | 2,945 | 158,017.91 | 0.06 |
| EUR NESTE OYJ | 3,283 | 111,136.83 | 0.04 | GBP PHOENIX SPREE DEUTSCHLAND LTD | 417 | 1,387.08 | 0.00 |
| CHF NESTLE (reg. shares) | 5,884 | 604,767.58 | 0.22 | USD PHYSICIANS REALTY TRUST | 1,016 | 14,157.58 | 0.00 |
| HKD NEW WORLD DEVELOPMENT | 27,728 | 29,835.50 | 0.01 | USD PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST -A- | 671 | 11,857.24 | 0.00 |
| AUD NEWCREST MINING | 2,562 | 36,138.07 | 0.01 | USD PINNACLE WEST CAPITAL | 736 | 55,787.91 | 0.02 |
| USD NEWELL BRANDS | 2,568 | 34,099.69 | 0.01 | USD PIONEER NATURAL RESOURCES | 1,119 | 78,489.67 | 0.03 |
| USD NEWMONT MINING | 5,456 | 247,051.60 | 0.09 | USD PNC FINANCIAL SERVICES | 2,930 | 280,436.07 | 0.10 |
| GBP NEWRIVER REIT | 1,471 | 1,088.56 | 0.00 | USD PPG INDUSTRIES | 1,610 | 134,623.89 | 0.05 |
| GBP NEXT | 695 | 35,110.73 | 0.01 | JPY PREMIER INVESTMENT | 6 | 6,857.77 | 0.00 |
| JPY NGK INSULATORS | 966 | 12,674.41 | 0.00 | GBP PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 5,862 | 11,674.13 | 0.00 |
| JPY NGK SPARK PLUG | 581 | 8,185.38 | 0.00 | USD PRINCIPAL FINANCIAL | 1,972 | 61,786.86 | 0.02 |
| USD NIELSEN HOLDINGS PLC | 2,263 | 28,376.99 | 0.01 | USD PROCTER & GAMBLE | 17,984 | 1,978,195.98 | 0.70 |
| USD NIKE -B- | 9,614 | 795,440.37 | 0.29 | USD PROGRESSIVE | 3,898 | 287,833.27 | 0.10 |
| JPY NIKON | 1,183 | 10,939.61 | 0.00 | USD PROLOGIS | 8,898 | 715,153.76 | 0.26 |
| JPY NINTENDO | 428 | 164,890.83 | 0.06 | GBP PRUDENTIAL | 13,630 | 175,013.29 | 0.06 |
| JPY NIPPON ACCOMMODATIONS FUND | 2 | 11,868.23 | 0.00 | USD PRUDENTIAL FINANCIAL | 2,691 | 140,290.60 | 0.05 |
| JPY NIPPON BUILDING FUND | 6 | 41,197.40 | 0.01 | CHF PS BUSINESS PARKS | 108 | 14,603.05 | 0.01 |
| JPY NIPPON EXPRESS | 293 | 14,360.17 | 0.01 | JPY PSP SWISS PROPERTY (reg. shares) | 192 | 23,912.58 | 0.01 |
| JPY NIPPON PROLOGIS REIT | 18 | 43,980.44 | 0.02 | USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 3,327 | 149,414.31 | 0.05 |
| JPY NIPPON REIT INVESTMENT | 2 | 6,266.72 | 0.00 | USD PUBLIC STORAGE | 804 | 159,604.85 | 0.06 |
| JPY NIPPON YUSEN | 568 | 6,770.56 | 0.00 | EUR PUMA | 325 | 19,426.99 | 0.01 |
| USD NISOURCE | 2,391 | 59,699.58 | 0.02 | USD PVH | 478 | 17,999.60 | 0.01 |
| JPY NISSIN FOOD HOLDINGS | 235 | 19,574.62 | 0.01 | EUR QIAGEN (reg. shares) | 1,521 | 61,090.14 | 0.02 |
| JPY NITORI HOLDINGS | 299 | 40,350.83 | 0.01 | USD QTS REALTY TRUST -A- | 309 | 17,903.08 | 0.01 |
| JPY NITTO DENKO | 583 | 26,054.80 | 0.01 | USD QUEST DIAGNOSTICS | 916 | 73,581.63 | 0.03 |
| GBP NMC HEALTH | 654 | 7,607.36 | 0.00 | JPY RAKUTEN | 3,172 | 24,094.00 | 0.01 |
| EUR NN GROUP | 2,079 | 56,121.72 | 0.02 | AUD RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 539 | 18,898.24 | 0.01 |
| USD NOBLE ENERGY | 3,053 | 18,440.08 | 0.01 | EUR RANDSTAD HOLDING | 306 | 10,799.92 | 0.00 |
| EUR NOKIAN TYRES | 838 | 20,296.95 | 0.01 | USD RAYMOND JAMES FINANCIAL | 816 | 51,543.55 | 0.02 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS | 1,017 | 16,528.13 | 0.01 | GBP RDI REIT PLC | 1,241 | 1,001.66 | 0.00 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND | 22 | 27,575.21 | 0.01 | USD REALTY INCOME | 1,767 | 88,109.28 | 0.03 |
| JPY NOMURA RESEARCH INSTITUTE | 1,250 | 26,483.88 | 0.01 | GBP RECKITT BENCKISER GROUP | 3,729 | 284,333.88 | 0.10 |
| USD NORDSTROM | 637 | 9,774.01 | 0.00 | EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA | 425 | 17,988.71 | 0.01 |
| USD NORFOLK SOUTHERN | 1,750 | 255,500.78 | 0.09 | JPY RECRUIT HOLDINGS | 5,125 | 132,744.39 | 0.05 |
| CAD NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 257 | 5,918.13 | 0.00 | EUR RED ELECTRICA CORPORACION | 2,908 | 52,225.57 | 0.02 |
| USD NORTHERN TRUST | 1,317 | 99,411.64 | 0.03 | USD REGENCY CENTERS | 903 | 34,716.48 | 0.01 |
| CAD NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 554 | 3,761.11 | 0.00 | GBP REGIONAL REIT | 1,817 | 1,847.31 | 0.00 |
| USD NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 1,376 | 15,083.83 | 0.01 | USD REGIONS FINANCIAL | 6,492 | 58,237.50 | 0.02 |
| | | | | USD REINSURANCE GROUP AMERICA | 401 | 33,718.18 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| GBP RELX | 10,197 | 218,997.05 | 0.08 | JPY SOHO SECURITY SERVICES | 264 | 12,852.30 | 0.00 |
| GBP RENTOKIL INITIAL | 9,653 | 46,416.05 | 0.02 | EUR SOLVAY | 497 | 36,224.16 | 0.01 |
| EUR REPSOL | 10,904 | 99,688.59 | 0.03 | JPY SOMPO HOLDINGS | 1,243 | 38,478.91 | 0.01 |
| USD RESMED | 939 | 138,251.50 | 0.05 | CHF SONOVA HOLDING (reg. shares) | 108 | 19,395.75 | 0.01 |
| JPY RESONA HOLDINGS | 7,720 | 23,255.26 | 0.01 | JPY SONY | 4,810 | 286,073.84 | 0.10 |
| EUR RETAIL ESTATES | 50 | 2,592.03 | 0.00 | USD SOUTHERN | 6,963 | 376,974.96 | 0.13 |
| USD RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT | 643 | 5,328.79 | 0.00 | USD SOUTHWEST AIRLINES | 918 | 32,684.40 | 0.01 |
| USD RETAIL PROPERTIES OF AMERICA -A- | 1,171 | 6,052.34 | 0.00 | USD S&P GLOBAL | 1,629 | 399,255.23 | 0.14 |
| USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY | 611 | 25,061.77 | 0.01 | GBP SPIRAX-SARCO ENGINEERING | 384 | 38,901.28 | 0.01 |
| JPY R-INVESCO OFFICE REIT | 42 | 5,589.38 | 0.00 | USD SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 535 | 13,977.67 | 0.00 |
| CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,713 | 19,407.97 | 0.01 | GBP SSE | 5,431 | 87,890.06 | 0.03 |
| USD RLJ LODGING TRUST | 941 | 7,264.19 | 0.00 | EUR ST GOBAIN | 3,304 | 80,345.99 | 0.03 |
| USD ROBERT HALF INTERNATIONAL | 748 | 28,236.63 | 0.01 | CHF STADLER RAIL AG | 118 | 5,442.21 | 0.00 |
| CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares) | 1,423 | 461,725.14 | 0.17 | USD STAG INDUSTRIAL | 805 | 18,132.62 | 0.01 |
| USD ROCKWELL AUTOMATION | 761 | 114,802.28 | 0.04 | GBP STANDARD CHARTERED | 14,229 | 78,677.65 | 0.03 |
| USD ROPER TECHNOLOGIES | 700 | 218,278.13 | 0.08 | GBP STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 12,524 | 34,770.21 | 0.01 |
| USD ROSS STORES | 2,385 | 207,422.05 | 0.07 | GBP STANDARD LIFE INVESTMENTS PROPERTY | 2,008 | 2,106.50 | 0.00 |
| USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 1,137 | 36,582.43 | 0.01 | USD INCOME FUND | | | |
| EUR ROYAL DUTCH SHELL -A- | 402 | 7,195.13 | 0.00 | USD STANLEY BLACK & DECKER | 1,002 | 100,184.75 | 0.03 |
| EUR ROYAL PHILIPS | 6,076 | 246,123.16 | 0.09 | JPY STANLEY ELECTRIC | 489 | 9,651.68 | 0.00 |
| USD RPT REALTY | 429 | 2,588.70 | 0.00 | USD STARBUCKS | 8,134 | 534,721.75 | 0.20 |
| GBP RSA INSURANCE GROUP | 5,384 | 28,066.05 | 0.01 | USD STATE STREET | 2,493 | 132,800.27 | 0.05 |
| EUR RWE -A- | 3,915 | 102,924.89 | 0.04 | USD STERIS PLC | 579 | 81,109.63 | 0.03 |
| NZD RYMAN HEALTHCARE | 1,336 | 8,155.51 | 0.00 | EUR STMICROELECTRONICS | 738 | 16,097.97 | 0.01 |
| USD RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 261 | 9,373.64 | 0.00 | AUD STOCKLAND TRUST | 19,511 | 30,211.68 | 0.01 |
| USD SABRA HEALTH CARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,081 | 11,801.19 | 0.00 | EUR STORA ENSO -R- | 5,050 | 51,232.16 | 0.02 |
| | | | | USD STORE CAPITAL | 1,162 | 21,048.63 | 0.01 |
| GBP SAFESTORE HOLDINGS | 1,000 | 7,941.00 | 0.00 | CHF STRAUMANN HOLDING (reg. shares) | 11 | 8,328.24 | 0.00 |
| EUR SAFRAN | 186 | 16,339.88 | 0.01 | JPY SUMITOMO CHEMICAL | 5,512 | 16,389.50 | 0.01 |
| USD SALESFORCE.COM | 5,716 | 823,012.99 | 0.30 | JPY SUMITOMO METAL MINING | 861 | 17,682.13 | 0.01 |
| SEK SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORD -B- | 4,547 | 8,720.53 | 0.00 | JPY SUMITOMO REALTY & DEVELOPMENT | 1,916 | 46,762.82 | 0.02 |
| EUR SANOFI | 429 | 37,680.01 | 0.01 | JPY SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES | 631 | 5,954.75 | 0.00 |
| JPY SANTEN PHARMACEUTICAL | 1,327 | 22,834.94 | 0.01 | USD SUMMIT HOTEL PROPERTIES | 560 | 2,361.31 | 0.00 |
| EUR SAP SE | 6,721 | 758,154.60 | 0.27 | CAD SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 573 | 3,569.48 | 0.00 |
| EUR SARTORIUS (pref. shares) | 239 | 58,169.09 | 0.02 | USD SUN COMMUNITIES | 490 | 61,220.90 | 0.02 |
| USD SAUL CENTERS | 64 | 2,089.35 | 0.00 | HKD SUN HUNG KAI PROPERTIES | 12,295 | 162,115.64 | 0.06 |
| USD SBA COMMUNICATIONS -A- (reg. shares) | 756 | 204,107.72 | 0.07 | USD SUNSTONE HOTEL INVESTORS | 1,206 | 10,505.66 | 0.00 |
| AUD SCENTRE GROUP | 25,430 | 24,358.03 | 0.01 | SGD SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,937 | 8,724.16 | 0.00 |
| CHF SCHINDLER HOLDING | 22 | 4,562.10 | 0.00 | JPY SUNTORY BEVERAGE & FOOD | 511 | 19,347.17 | 0.01 |
| CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.) | 44 | 9,666.58 | 0.00 | USD SVB FINANCIAL GROUP | 358 | 54,134.63 | 0.02 |
| USD SCHLUMBERGER | 9,259 | 124,900.50 | 0.04 | HKD SWIRE PACIFIC -A- | 1,642 | 10,583.31 | 0.00 |
| EUR SCHNEIDER ELECTRIC | 3,710 | 319,897.13 | 0.11 | HKD SWIRE PROPERTIES | 8,997 | 25,303.65 | 0.01 |
| GBP SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LIMITED | 2,540 | 1,223.77 | 0.00 | CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares) | 76 | 26,007.17 | 0.01 |
| | | | | CHF SWISS PRIME SITE | 530 | 51,855.55 | 0.02 |
| GBP SCHRODERS | 649 | 19,984.75 | 0.01 | CHF SWISS REINSURANCE | 640 | 49,348.74 | 0.02 |
| CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES | 4 | 4,157.20 | 0.00 | CHF SWISSCOM (reg. shares) | 56 | 30,036.97 | 0.01 |
| JPY SECOM | 781 | 64,904.55 | 0.02 | AUD SYDNEY AIRPORT (stapled security) | 3,689 | 12,621.93 | 0.00 |
| AUD SEEK | 1,114 | 10,114.49 | 0.00 | EUR SYMRISE | 864 | 80,571.41 | 0.03 |
| JPY SEGA SAMMY HOLDINGS | 642 | 7,821.37 | 0.00 | JPY SYSMEX | 624 | 45,319.65 | 0.02 |
| GBP SEGRO PLC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,035 | 104,536.72 | 0.04 | USD T ROWE PRICE GROUP | 1,572 | 153,548.71 | 0.05 |
| JPY SEKISUI CHEMICAL | 1,340 | 17,784.38 | 0.01 | EUR TAG IMMOBILIEN | 617 | 12,213.47 | 0.00 |
| JPY SEKISUI HOUSE | 2,292 | 37,880.11 | 0.01 | JPY TAISEI | 749 | 22,934.76 | 0.01 |
| JPY SEKISUI HOUSE REIT | 19 | 12,422.35 | 0.00 | JPY TAKEDA PHARMACEUTICAL | 5,659 | 173,405.20 | 0.06 |
| USD SEMPRA ENERGY | 1,896 | 214,234.55 | 0.07 | USD TANGER FACTORY OUTLET CENTERS | 497 | 2,486.15 | 0.00 |
| USD SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING P | 1,025 | 29,657.71 | 0.01 | USD TAPESTRY INC | 2,019 | 26,149.79 | 0.01 |
| USD SERITAGE GROWTH PROPERTIES -A- | 177 | 1,609.99 | 0.00 | USD TARGA RESOURCES | 1,490 | 10,295.51 | 0.00 |
| USD SERVICE PROPERTIES TRUST | 883 | 4,770.05 | 0.00 | GBP TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 2,198 | 2,916.60 | 0.00 |
| EUR SES | 2,445 | 14,345.09 | 0.00 | USD TAUBMAN CENTERS | 322 | 13,504.00 | 0.00 |
| JPY SEVEN & I HOLDINGS | 2,846 | 94,259.09 | 0.03 | GBP TAYLOR WIMPEY | 17,119 | 24,942.13 | 0.01 |
| CHF SFS GROUP (reg. shares) | 17 | 1,275.05 | 0.00 | USD TD AMERITRADE HOLDING | 1,770 | 61,335.14 | 0.02 |
| GBP SHAFTESBURY | 1,088 | 8,330.18 | 0.00 | JPY T&D HOLDINGS | 2,057 | 16,847.92 | 0.01 |
| JPY SHARP | 786 | 8,265.90 | 0.00 | USD TE CONNECTIVITY (reg. shares) | 2,274 | 143,226.08 | 0.05 |
| USD SHERWIN-WILLIAMS | 545 | 250,409.89 | 0.09 | USD TECHNIPFMC (reg. shares) | 3,430 | 23,118.81 | 0.01 |
| JPY SHIMADZU | 824 | 21,703.90 | 0.01 | HKD TECHTRONIC INDUSTRIES | 4,570 | 29,657.72 | 0.01 |
| JPY SHIMIZU | 2,187 | 17,121.53 | 0.01 | JPY TEIJIN | 655 | 11,098.37 | 0.00 |
| JPY SHIN-ETSU CHEMICAL | 1,340 | 133,234.21 | 0.05 | SEK TELEFON LM ERICSSON -B- | 2,088 | 17,081.92 | 0.01 |
| JPY SHISEIDO | 1,490 | 88,102.64 | 0.03 | EUR TELEFONICA | 31,358 | 143,598.37 | 0.05 |
| AUD SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GROUP | 4,559 | 6,334.54 | 0.00 | EUR TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) | 5,733 | 14,211.38 | 0.00 |
| JPY SHOWA DENKO | 500 | 10,363.95 | 0.00 | EUR TELEPERFORMANCE | 394 | 82,002.95 | 0.03 |
| EUR SIEMENS (reg. shares) | 5,333 | 453,362.49 | 0.17 | AUD TELSTRA | 13,870 | 26,061.01 | 0.01 |
| USD SIGNATURE BANK | 380 | 30,543.98 | 0.01 | CHF TEMENOS GROUP | 71 | 9,281.62 | 0.00 |
| CHF SIKA NOM. | 244 | 40,306.23 | 0.01 | EUR TENARIS | 3,166 | 19,381.58 | 0.01 |
| USD SIMON PROPERTY GROUP | 1,668 | 91,525.41 | 0.03 | USD TERRENO REALTY GROUP | 359 | 18,581.41 | 0.01 |
| SGD SINGAPORE AIRLINES | 1,797 | 7,242.58 | 0.00 | GBP TESCO | 51,269 | 145,453.00 | 0.05 |
| SGD SINGAPORE EXCHANGE | 2,683 | 17,314.85 | 0.01 | USD TESLA MOTORS | 902 | 472,427.34 | 0.17 |
| SGD SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 5,390 | 6,928.15 | 0.00 | USD TEXAS INSTRUMENTS | 6,248 | 624,363.35 | 0.23 |
| SGD SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 27,215 | 48,549.79 | 0.02 | HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 10,064 | 85,307.71 | 0.03 |
| HKD SINO LAND | 16,008 | 20,322.65 | 0.01 | CHF THE SWATCH GROUP | 46 | 9,206.15 | 0.00 |
| GBP SIRIUS REAL ESTATE LTD | 4,557 | 3,723.34 | 0.00 | CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares) | 56 | 2,221.53 | 0.00 |
| USD SITE CENTERS CORP | 831 | 4,327.35 | 0.00 | USD TIFFANY & CO | 733 | 94,932.22 | 0.03 |
| USD SL GREEN REALTY | 432 | 18,612.51 | 0.01 | USD TJX COS | 8,081 | 386,369.16 | 0.13 |
| CAD SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 696 | 9,215.65 | 0.00 | EUR TLG IMMOBILIEN | 64 | 1,024.14 | 0.00 |
| GBP SMITH & NEPHEW | 4,565 | 81,199.03 | 0.03 | JPY TOBU RAILWAY | 710 | 24,784.66 | 0.01 |
| EUR SNAM | 12,851 | 59,278.95 | 0.02 | JPY TOHO | 420 | 12,851.15 | 0.00 |
| USD SNAP-ON | 360 | 39,138.10 | 0.01 | JPY TOKYO ELECTRON | 588 | 110,864.02 | 0.04 |
| CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares) | 18 | 42,560.31 | 0.01 | JPY TOKYO GAS | 1,393 | 32,974.74 | 0.01 |
| CHF SOFTWAREONE HOLDING AG | 344 | 6,765.15 | 0.00 | JPY TOKYO TATEMONO | 964 | 10,240.73 | 0.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|--|-----------|-------------|----------------------|
| JPY TOKYU | 1,847 | 29,087.37 | 0.01 | GBP WHITBREAD | 698 | 26,217.14 | 0.01 |
| JPY TOKYU REIT | 4 | 5,651.36 | 0.00 | EUR WIENERBERGER | 504 | 7,958.46 | 0.00 |
| JPY TORAY INDUSTRIES | 5,129 | 22,282.34 | 0.01 | SEK WILHBORGS FASTIGHETER AB | 648 | 9,050.99 | 0.00 |
| EUR TOTAL | 16,099 | 625,155.60 | 0.23 | USD WILLIAMS COMPANIES | 8,222 | 116,346.38 | 0.04 |
| JPY TOTO | 520 | 17,318.60 | 0.01 | USD WILLIS TOWERS WATSON | 869 | 147,551.23 | 0.05 |
| JPY TOYO SUISAN KAISHA | 331 | 15,981.34 | 0.01 | EUR WOLTERS KLUWER | 1,832 | 129,041.97 | 0.04 |
| JPY TOYODA GOSEI | 245 | 4,208.43 | 0.00 | AUD WOODSIDE PETROLEUM | 3,179 | 35,433.86 | 0.01 |
| USD TRACTOR SUPPLY | 782 | 66,077.93 | 0.02 | GBP WORKSPACE GROUP | 647 | 6,093.11 | 0.00 |
| USD TRANE TECHNOLOGIES PLC | 1,605 | 132,526.61 | 0.05 | AUD WORLEYPARSONS | 1,125 | 4,236.08 | 0.00 |
| USD TRANSDIGM GROUP | 317 | 101,468.97 | 0.04 | USD W. P. CAREY | 928 | 53,869.55 | 0.02 |
| AUD TRANSURBAN GROUP | 9,221 | 67,951.64 | 0.02 | GBP WPP 2012 | 6,587 | 45,033.90 | 0.02 |
| USD TRAVELERS COMPANIES | 2,753 | 273,542.84 | 0.10 | USD WW GRAINGER | 300 | 74,500.23 | 0.03 |
| USD TRIMBLE NAVIGATION | 1,634 | 51,998.77 | 0.02 | USD XCEL ENERGY | 3,500 | 211,020.32 | 0.07 |
| USD TRIPADVISOR | 616 | 10,712.79 | 0.00 | USD XENIA HOTELS & RESORTS | 610 | 6,279.85 | 0.00 |
| GBP TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING RE | 1,545 | 1,743.38 | 0.00 | EUR XIOR STUDENT HOUSING NV | 74 | 3,237.02 | 0.00 |
| GBP TRITAX BIG BOX REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8,342 | 11,605.32 | 0.00 | USD XYLEM | 1,177 | 76,684.15 | 0.03 |
| GBP TRITAX EUROBOX PLC | 2,063 | 2,393.88 | 0.00 | JPY YAKULT HONSHA | 445 | 26,337.31 | 0.01 |
| USD TRUIST FINANCIAL CORP | 8,976 | 276,811.05 | 0.10 | JPY YAMADA DENKI | 2,324 | 9,276.86 | 0.00 |
| CHF UBS GROUP | 6,553 | 61,263.66 | 0.02 | JPY YAMAHA | 532 | 20,759.53 | 0.01 |
| EUR UCB | 848 | 73,519.97 | 0.03 | JPY YAMAHA MOTOR | 1,036 | 12,539.01 | 0.00 |
| USD UDR | 3,583 | 130,938.68 | 0.05 | JPY YASKAWA ELECTRIC | 889 | 24,493.99 | 0.01 |
| USD ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE | 366 | 64,311.58 | 0.02 | JPY YOKOGAWA ELECTRIC | 848 | 10,231.80 | 0.00 |
| EUR UMICORE SA | 1,326 | 46,345.43 | 0.02 | USD ZIONS BANCORP | 1,130 | 30,228.48 | 0.01 |
| USD UNDER ARMOUR -A- | 1,197 | 11,024.55 | 0.00 | USD ZOETIS -A- | 3,176 | 373,751.75 | 0.13 |
| USD UNDER ARMOUR (when issued) | 1,240 | 9,993.94 | 0.00 | CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares) | 314 | 111,276.74 | 0.04 |
| EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA | 1,587 | 89,800.56 | 0.03 | GBP 3I GROUP | 5,079 | 49,889.69 | 0.02 |
| JPY UNI-CHARM | 1,489 | 55,875.42 | 0.02 | USD 3M | 4,800 | 655,186.37 | 0.24 |
| EUR UNICREDIT (reg. shares) | 1,228 | 9,626.47 | 0.00 | 株式 (およびエクイティ型証券) | | | 112,986,240.51 39.36 |
| EUR UNILEVER | 9,842 | 483,867.76 | 0.18 | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている | | | |
| GBP UNILEVER | 5,823 | 294,274.48 | 0.10 | 証券：株式 (およびエクイティ型証券) | | | 112,986,240.51 39.36 |
| USD UNION PACIFIC | 4,796 | 676,456.05 | 0.25 | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券 | | | |
| GBP UNITE GROUP | 1,417 | 14,085.07 | 0.00 | 債券 | | | |
| USD UNITED PARCEL SERVICE -B- | 4,673 | 436,556.57 | 0.15 | USD ABB FINANCE (USA) T. 2 2.875%/12- | 235,168 | 236,908.47 | 0.08 |
| USD UNITED RENTALS | 493 | 50,691.00 | 0.02 | 08.05.2022 | | | |
| JPY UNITED URBAN INVESTMENT | 15 | 14,491.50 | 0.01 | USD ABBOTT LABORATORIES 3.75%/16-30.11.2026 | 54,693 | 60,999.01 | 0.02 |
| USD UNITEDHEALTH GROUP | 665 | 165,857.50 | 0.06 | USD ABBVIE 3.6%/15-14.05.2025 | 94,067 | 98,564.65 | 0.03 |
| USD UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 69 | 6,990.79 | 0.00 | CHF ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024 | 546 | 538.02 | 0.00 |
| SGD UOL GROUP | 3,935 | 18,155.46 | 0.01 | USD ABQ FINANCE 3.5%/17-22.02.2022 | 34,046 | 32,371.07 | 0.01 |
| EUR UPM-KYMMENE | 3,582 | 98,601.74 | 0.03 | USD ABU DHABI CRUDE OIL 4.6%/17-02.11.2047 | 58,363 | 58,080.73 | 0.02 |
| USD URBAN EDGE PROPERTIES (when issued) | 634 | 5,586.02 | 0.00 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 2.5%/19-30.09.2029 | 83,980 | 81,653.37 | 0.03 |
| USD URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 160 | 2,255.85 | 0.00 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 3.125%/17- | 58,363 | 59,431.24 | 0.02 |
| USD US BANCORP | 9,924 | 341,884.38 | 0.12 | 11.10.2027 | | | |
| JPY USS CO | 811 | 11,159.99 | 0.00 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 3.125%/19- | 49,934 | 46,346.57 | 0.02 |
| USD VAIL RESORTS | 257 | 37,918.29 | 0.01 | 30.09.2049 | | | |
| EUR VALEO | 1,616 | 27,037.04 | 0.04 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 4.125%/17- | 29,181 | 31,538.58 | 0.01 |
| USD VALERO ENERGY | 2,717 | 123,257.28 | 0.01 | 11.10.2047 | | | |
| USD VARIAN MEDICAL SYSTEMS | 595 | 61,090.12 | 0.02 | USD ACE INA HOLDINGS 3.35%/15-03.05.2026 | 201,573 | 213,151.10 | 0.07 |
| EUR VASTNED RETAIL N.V. | 84 | 1,409.85 | 0.00 | CHF ACHMEA BANK 0.5%/17-27.10.2023 | 200 | 201.62 | 0.00 |
| USD VENTAS | 2,020 | 54,146.23 | 0.02 | USD ADECOAGRO SA 6%/17-21.09.2027 | 34,046 | 26,733.77 | 0.01 |
| EUR VERBUND -A- | 428 | 15,505.68 | 0.01 | USD AEROPUERTOS ARGENTINA 2000 (reg. -S-) | 13,694 | 6,955.68 | 0.00 |
| USD VEREIT | 5,809 | 28,404.27 | 0.01 | 6.875%/-01.02.2027 | | | |
| USD VERIZON COMMUNICATIONS | 28,848 | 1,550,021.98 | 0.55 | USD AFRICA FINANCE CORP 3.75%/19-30.10.2029 | 50,690 | 45,616.79 | 0.02 |
| USD VERTEX PHARMACEUTICALS | 1,714 | 407,795.85 | 0.14 | EUR AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/17- | 66,506 | 74,558.36 | 0.03 |
| USD VF | 2,304 | 124,600.19 | 0.04 | 24.01.2024 | | | |
| USD VICI PROPERTIES INC | 2,504 | 41,670.49 | 0.01 | USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3%/18- | 134,382 | 145,297.68 | 0.05 |
| AUD VICINITY CENTRES | 15,093 | 9,560.95 | 0.00 | 20.09.2023 | | | |
| CHF VIFOR PHARMA AG | 139 | 19,239.33 | 0.01 | EUR AGENCE FRANCAISE DEVELOP 0.25%/19- | 6,651 | 7,350.02 | 0.00 |
| EUR VINCI | 331 | 27,345.01 | 0.01 | 29.06.2029 | | | |
| USD VISA -A- | 12,240 | 1,972,060.10 | 0.70 | USD AGUA Y SANEAMIENTOS ARG 6.625%/18- | 37,829 | 12,153.59 | 0.00 |
| USD VMWARE | 539 | 65,240.69 | 0.02 | 01.02.2023 | | | |
| EUR VOESTALPINE | 1,352 | 27,502.46 | 0.01 | USD AI CANDELARIA SPAIN 7.5%/18-15.12.2028 | 37,829 | 28,175.53 | 0.01 |
| EUR VONOVIA (reg. shares) | 2,653 | 130,565.00 | 0.05 | USD AJECORP (reg. -S-) 6.5%/12-14.05.2022 | 45,394 | 35,699.50 | 0.01 |
| USD VORNADO REALTY TRUST | 934 | 33,825.81 | 0.01 | CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025 | 909 | 947.46 | 0.00 |
| USD VOYA FINANCIAL | 922 | 37,402.12 | 0.01 | CHF AKADEMISKA HUS 0.3%/17-08.10.2029 | 227 | 233.34 | 0.00 |
| EUR VW (pref. shares) | 90 | 10,530.51 | 0.00 | USD AKCB FINANCE LTD 4.75%/18-09.10.2023 | 45,394 | 43,543.20 | 0.02 |
| USD WABCO | 329 | 44,428.05 | 0.02 | USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875%/19- | 62,039 | 57,454.92 | 0.02 |
| EUR WAERTSILAE -B- | 2,975 | 21,838.31 | 0.01 | 22.10.2029 | | | |
| USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 1,289 | 58,953.05 | 0.02 | USD ALTERNATIFBANK 8.75%/16-16.04.2026 | 15,131 | 13,812.60 | 0.00 |
| SEK WALLENSTAM BYGGNADS -B- | 797 | 9,085.19 | 0.00 | USD ALTRIA GROUP INC 3.8%/19-14.02.2024 | 201,573 | 204,549.99 | 0.07 |
| USD WALT DISNEY | 13,185 | 1,273,667.25 | 0.45 | USD ALTRIA GROUP 2.85%/12-09.08.2022 | 201,573 | 202,514.11 | 0.07 |
| USD WASHINGTON REAL ESTAT INVESTMENT TRUST | 449 | 10,709.47 | 0.00 | USD AMAZON.COM INC 3.15%/18-22.08.2027 | 127,528 | 140,536.26 | 0.05 |
| USD WASTE MANAGEMENT | 2,826 | 261,602.31 | 0.09 | USD AMERICAN EXPRESS CO 2.5%/17-01.08.2022 | 295,640 | 298,977.82 | 0.10 |
| USD WATERS | 421 | 76,678.57 | 0.03 | USD AMERICAN EXPRESS CO 3%/17-30.10.2024 | 134,382 | 138,511.39 | 0.05 |
| USD WEC ENERGY GROUP | 2,119 | 186,707.91 | 0.07 | USD AMERICAN EXPRESS CREDIT 2.7%/17- | 113,284 | 114,335.17 | 0.04 |
| USD WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 669 | 9,658.37 | 0.00 | 03.03.2022 | | | |
| USD WELLTOWER | 5,007 | 229,217.50 | 0.08 | USD AMERICAN HONDA FINANCE S. -A- 3.375%/18- | 100,786 | 101,207.67 | 0.04 |
| EUR WENDEL | 174 | 13,907.26 | 0.00 | 10.12.2021 | | | |
| EUR WERELDHAVE | 197 | 1,442.64 | 0.00 | USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 134,382 | 138,922.60 | 0.05 |
| EUR WERELDHAVE BELGIUM | 12 | 656.99 | 0.00 | 4.875%/12-01.06.2022 | | | |
| AUD WESFARMERS | 3,825 | 80,239.20 | 0.03 | USD AMGEN INC 3.2%/17-02.11.2027 | 134,382 | 140,375.27 | 0.05 |
| JPY WEST JAPAN RAILWAY | 604 | 41,356.25 | 0.01 | CHF AMGEN 0.41%/16-08.03.2023 | 909 | 939.94 | 0.00 |
| USD WESTERN UNION | 2,948 | 53,453.87 | 0.02 | USD ANDRADE GUTIER INT SA 11%/18-20.08.2021 | 57 | 57.41 | 0.00 |
| AUD WESTPAC BANKING | 12,007 | 121,259.88 | 0.04 | USD ANDRADE GUTIERREZ INTERNATIONAL SA | 75,809 | 54,717.14 | 0.02 |
| USD WEYERHAEUSER | 5,035 | 85,338.57 | 0.03 | 9.5%/19-25.11.2024 | | | |
| HKD WHARF REAL ESTATE INVESTMENT C | 4,984 | 20,513.33 | 0.01 | EUR ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/17- | 38,795 | 37,735.87 | 0.01 |
| USD WHIRLPOOL | 406 | 34,800.61 | 0.01 | 18.09.2025 | | | |
| | | | | USD ANHEUSER BUSCH INBEV WORLDWIDE | 41,255 | 41,447.47 | 0.01 |
| | | | | 2.5%/12-15.07.2022 | | | |
| | | | | USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE 3.3%/16- | 133,307 | 137,180.68 | 0.05 |
| | | | | 01.02.2026 | | | |
| | | | | USD ANTHEM INC 3.65%/17-01.12.2027 | 147,820 | 152,646.35 | 0.05 |
| | | | | CHF ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL | 455 | 458.92 | 0.00 |
| | | | | 0.25%/16-25.10.2023 | | | |
| | | | | EUR ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL | 53,648 | 59,692.24 | 0.02 |
| | | | | 0.625%/15-27.01.2022 | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| USD APICORP SUKUK LTD 3.141%/17-01.11.2022 | 22,697 | 22,702.64 | 0.01 | USD BERKSHIRE HATHAWAY 3.125%/16-15.03.2026 | 443,460 | 475,668.58 | 0.17 |
| USD APPLE INC 2.75%/17-13.01.2025 | 134,382 | 142,217.65 | 0.05 | CHF BFCM 0.55%/15-08.12.2023 | 236 | 240.72 | 0.00 |
| USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027 | 201,573 | 218,079.55 | 0.08 | USD BIZ FINANCE (reg. -S-) 9.625%/15-27.04.2022 | 87,544 | 33,571.64 | 0.01 |
| CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024 | 728 | 759.47 | 0.00 | USD BIZ FINANCE (reg. -S-) 9.75%/15-22.01.2025 | 58,363 | 55,312.59 | 0.02 |
| USD APPLE 2.4%/13-03.05.2023 | 134,382 | 139,444.00 | 0.05 | USD BLUESTAR FIN HOLDINGS FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL | 37,829 | 38,556.85 | 0.01 |
| USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023 | 2,000,000 | 2,092,060.00 | 0.72 | CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027 | 364 | 357.18 | 0.00 |
| USD APPLE 3.45%/14-06.05.2024 | 36,149 | 39,124.84 | 0.01 | CHF BNG BANK 1.125%/13-19.04.2023 | 1,091 | 1,174.17 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT (reg. -S-) S. -2- 6.125%/17-31.01.2022 | 29,181 | 28,087.01 | 0.01 | CHF BNG 1.25%/14-30.04.2024 | 909 | 993.98 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT 5.577%/18-21.02.2023 | 116,725 | 108,065.40 | 0.04 | CHF BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027 | 182 | 153.40 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT 8.7002%/19-01.03.2049 | 87,544 | 72,538.03 | 0.03 | CHF BNP PARIBAS (subordinated) 1.75%/15-05.06.2025 | 273 | 276.34 | 0.00 |
| USD ARAGVI FINANCE INTL 12%/19-09.04.2024 | 26,480 | 22,300.71 | 0.01 | USD BNP PARIBAS T. -100- 2.375%/15-21.05.2020 | 201,573 | 201,611.06 | 0.07 |
| USD ARDSHININVESTBANK CJSC 6.5%/20-28.01.2025 | 45,394 | 39,934.34 | 0.01 | CHF BNP PARIBAS 1.875%/12-12.09.2022 | 273 | 281.70 | 0.00 |
| CHF AROUNDTOWN SA 1.72%/19-05.03.2026 | 364 | 368.46 | 0.00 | CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LONDON BRANCH) | 455 | 438.25 | 0.00 |
| CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025 | 364 | 351.54 | 0.00 | CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING 0.25%/15-24.06.2022 | 909 | 921.14 | 0.00 |
| CHF ASB FINANCE 0.2%/17-02.08.2024 | 685 | 667.78 | 0.00 | USD BOLIVIA GOVERNMENT 4.5%/17-20.03.2028 | 29,181 | 23,885.49 | 0.01 |
| USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.5%/17-02.11.2027 | 456,898 | 512,507.34 | 0.18 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 0.6%/19-31.10.2029 | 15,518 | 16,997.49 | 0.01 |
| USD ASTRAZENECA PLC 3.125%/17-12.06.2027 | 201,573 | 211,173.67 | 0.07 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.4%/18-30.04.2028 | 22,169 | 26,030.59 | 0.01 |
| CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024 | 728 | 759.09 | 0.00 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.4%/18-30.07.2028 | 27,711 | 32,550.40 | 0.01 |
| USD AT&T 3.4%/15-15.05.2025 | 129,678 | 134,620.52 | 0.05 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.45%/17-31.10.2027 | 21,060 | 24,731.60 | 0.01 |
| USD AT&T 3.6%/16-17.02.2023 | 137,607 | 141,641.64 | 0.05 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.45%/19-30.04.2029 | 34,140 | 40,292.01 | 0.01 |
| USD AT&T 4.125%/16-17.02.2026 | 134,382 | 142,348.00 | 0.05 | USD BOS FUNDING 4.23%/17-07.03.2022 | 37,829 | 37,920.57 | 0.01 |
| USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP T. -10- 2.7%/15-16.11.2020 | 134,382 | 134,557.88 | 0.05 | USD BOSTON PROPERTIES LP 4.5%/18-01.12.2028 | 100,786 | 110,713.84 | 0.04 |
| EUR AUSTRIA S. 1 1.65%/14-21.10.2024 | 46,333 | 55,517.29 | 0.02 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 2.112%/18-16.09.2021 | 67,191 | 66,214.64 | 0.02 |
| EUR AUSTRIA 0.75%/16-20.10.2026 | 33,253 | 38,824.77 | 0.01 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 2.75%/18-10.05.2023 | 130,754 | 130,716.92 | 0.05 |
| EUR AUSTRIA -144A- (reg. -S-) 1.2%/15-20.10.2025 | 46,333 | 55,139.56 | 0.02 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 3.796%/18-21.09.2025 | 40,852 | 42,449.80 | 0.01 |
| USD BAHRAIN (reg. -S-) 6%/14-19.09.2044 | 43,772 | 33,707.92 | 0.01 | EUR BP CAPITAL MARKET 1.117%/16-25.01.2024 | 665 | 724.24 | 0.00 |
| EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1%/16-20.01.2021 | 22,169 | 24,405.70 | 0.01 | USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.279%/17-19.09.2027 | 268,764 | 269,827.98 | 0.09 |
| CHF BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024 | 513 | 466.51 | 0.00 | CHF BP CAPITAL MARKETS 0.75%/14-27.09.2021 | 218 | 224.46 | 0.00 |
| USD BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR FIX-TO-FLOATER (reg. -S-) 3.8%/16-11.08.2026 | 29,181 | 26,374.07 | 0.01 | CHF BP CAPITAL MARKETS 1.75%/14-28.02.2024 | 218 | 227.39 | 0.00 |
| USD BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCIAL (reg. -S-) 5.75%/13-26.09.2023 | 58,363 | 57,611.50 | 0.02 | EUR BPCE 1.125%/17-18.01.2023 | 33,253 | 35,873.33 | 0.01 |
| EUR BANCO SANTANDER (reg. -S-) 1.375%/17-09.02.2022 | 44,338 | 48,249.49 | 0.02 | CHF BPCE 1.5%/14-30.04.2021 | 1,091 | 1,104.46 | 0.00 |
| CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027 | 546 | 487.26 | 0.00 | USD BRASKEM IDESA SAPI 7.45%/19-15.11.2029 | 15,131 | 10,439.80 | 0.00 |
| USD BANCO SANTANDER SA 3.8%/17-23.02.2028 | 161,258 | 158,315.25 | 0.06 | USD BRAZIL 8.25%/04-20.01.2034 | 128,398 | 162,353.85 | 0.06 |
| USD BANCO SANTANDER SA 4.379%/18-12.04.2028 | 215,011 | 220,338.92 | 0.08 | EUR BRD 3.25%/11-04.07.2021 | 55,422 | 63,815.23 | 0.02 |
| USD BANCOLOMBIA SA 3%/20-29.01.2025 | 15,131 | 13,492.12 | 0.00 | EUR BRD 4.75%/98-04.07.2028 | 22,169 | 35,240.40 | 0.01 |
| USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/18-20.12.2023 | 215,683 | 219,821.81 | 0.08 | EUR BRD 5.625%/98-04.01.2028 | 16,627 | 27,239.77 | 0.01 |
| USD BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/19-22.10.2025 | 900,000 | 898,524.00 | 0.31 | USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO -144A- 2.9%/19-26.07.2024 | 95,411 | 99,275.26 | 0.03 |
| USD BANK OF AMERICA CORP S. -N- FIX-TO-FRN FRN/19-07.02.2030 | 134,382 | 144,713.12 | 0.05 | CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027 | 1,023,000 | 760,495.11 | 0.26 |
| USD BANK OF AMERICA S. -L- 2.503%/16-21.10.2022 | 295,640 | 295,737.61 | 0.10 | USD BROADCOM CRP / CAYMAN FI 3%/18-15.01.2022 | 116,106 | 114,982.00 | 0.04 |
| USD BANK OF AMERICA 3.3%/13-11.01.2023 | 153,195 | 158,544.88 | 0.06 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/19-15.08.2029 | 15,518 | 17,840.34 | 0.01 |
| EUR BANK OF IRELAND GROUP 1.375%/18-29.08.2023 | 33,253 | 34,687.14 | 0.01 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/18-15.08.2028 | 28,819 | 33,815.41 | 0.01 |
| USD BANK OF MONTREAL S. -E- 2.5%/19-28.06.2024 | 134,382 | 135,111.53 | 0.05 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-15.02.2029 | 66,506 | 78,155.25 | 0.03 |
| CHF BANK OF MONTREAL 0.05%/18-30.12.2022 | 364 | 365.45 | 0.00 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5%/17-15.08.2027 | 83,133 | 98,800.53 | 0.03 |
| CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.2%/18-19.11.2025 | 273 | 282.83 | 0.00 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5%/18-15.02.2028 | 44,338 | 52,900.38 | 0.02 |
| CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.3%/15-16.09.2022 | 418 | 421.78 | 0.00 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-01.08.2027 | 18,843 | 21,854.52 | 0.01 |
| USD BANK OF NOVA SCOTIA 3.4%/19-11.02.2024 | 134,382 | 140,152.20 | 0.05 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2%/18-01.02.2028 | 66,506 | 77,005.91 | 0.03 |
| USD BANK OF NY MELLON CORP 2.95%/18-29.01.2023 | 335,955 | 343,493.42 | 0.12 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8%/18-01.12.2028 | 16,627 | 20,338.43 | 0.01 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/19-12.06.2026 | 364 | 357.18 | 0.00 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 3%/19-01.08.2029 | 33,253 | 41,381.78 | 0.01 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025 | 346 | 341.28 | 0.00 | CHF CADES 2.375%/11-19.04.2023 | 455 | 504.04 | 0.00 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027 | 637 | 646.44 | 0.00 | CHF CADES 3%/09-21.04.2021 | 364 | 387.82 | 0.00 |
| USD BANQUE FED CRED MUTUEL 2.2%/17-20.07.2020 | 134,382 | 134,238.05 | 0.05 | EUR CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 4%/12-15.12.2025 | 22,169 | 30,108.14 | 0.01 |
| CHF BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029 | 364 | 347.78 | 0.00 | CHF CAISSE DES DEPOTS ET CON 0.3%/17-12.11.2027 | 546 | 564.81 | 0.00 |
| EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.375%/17-13.01.2022 | 44,338 | 48,055.38 | 0.02 | USD CANADA GOVERNMENT 2%/17-15.11.2022 | 470,336 | 487,917.62 | 0.17 |
| CHF BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG 0.55%/16-11.10.2022 | 364 | 374.28 | 0.00 | USD CANADA GOVERNMENT 2.625%/19-25.01.2022 | 431,366 | 448,150.15 | 0.16 |
| USD BANQUE OUEST AFRICAINE D 4.7%/19-22.10.2031 | 40,855 | 36,455.27 | 0.01 | CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025 | 546 | 561.99 | 0.00 |
| EUR BARCLAYS BANK 1.875%/16-08.12.2023 | 44,338 | 47,278.94 | 0.02 | CHF CANADIAN IMPERIAL BANK 0.15%/18-31.07.2023 | 327 | 330.59 | 0.00 |
| USD BARCLAYS BANK 3.2%/16-10.08.2021 | 134,382 | 133,392.79 | 0.05 | USD CANADIAN IMPERIAL BANK 2.55%/17-16.06.2022 | 268,764 | 271,104.61 | 0.09 |
| EUR BASF SE 0.875%/17-15.11.2027 | 44,338 | 47,867.11 | 0.02 | USD CAPITAL ONE FINANCIAL 3.2%/15-05.02.2025 | 87,079 | 87,340.67 | 0.03 |
| CHF BAT HOLDINGS 1.375%/14-08.09.2026 | 455 | 457.98 | 0.00 | USD CAPITAL ONE NA 2.65%/17-08.08.2022 | 282,202 | 279,185.13 | 0.10 |
| CHF BATELCO INTERNATIONAL FINANCE 0.625%/14-08.09.2021 | 773 | 795.75 | 0.00 | USD CARDINAL HEALTH INC 2.616%/17-15.06.2022 | 147,820 | 148,532.52 | 0.05 |
| EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033 | 170,000 | 211,343.19 | 0.07 | USD CBQ FINANCE LTD 5%/18-24.05.2023 | 22,697 | 22,892.61 | 0.01 |
| EUR BELGIUM KINGDOM -144A- 0.8%/18-22.06.2028 | 33,253 | 39,069.96 | 0.01 | USD CBS 2.9%/16-15.01.2027 | 48,646 | 46,699.40 | 0.02 |
| EUR BELGIUM KINGDOM -144A- 0.9%/19-22.06.2029 | 11,084 | 13,186.17 | 0.00 | USD CELGENE 3.875%/15-15.08.2025 | 79,285 | 89,933.30 | 0.03 |
| EUR BELGIUM OLO S. 64 4.5%/11-28.03.2026 | 33,253 | 46,789.89 | 0.02 | USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 4.2%/19-29.01.2030 | 15,131 | 12,882.02 | 0.00 |
| EUR BELGIUM OLO S. -81- (reg. -S-) -144A- 0.8%/17-22.06.2027 | 55,422 | 64,745.04 | 0.02 | USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 5.15%/19-29.01.2050 | 23,454 | 18,611.97 | 0.01 |
| EUR BELGIUM OLO S. -82- (reg. -S-) 0.5%/17-22.10.2024 | 44,338 | 50,350.17 | 0.02 | CHF CENTRAL AMERICAN BANK 0.2%/19-25.03.2024 | 236 | 240.72 | 0.00 |
| EUR BELGIUM OLO -114A- (reg. -S-) S. 76 1%/16-22.06.2026 | 22,169 | 26,071.94 | 0.01 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|--|-----------|--------------|------------------|
| USD CENTRAL BK TUNISIA (reg. -S-) 5.75%/15-30.01.2025 | 29,181 | 23,258.09 | 0.01 | USD CVS HEALTH CORP 4.3%/18-25.03.2028 | 201,573 | 213,925.14 | 0.07 |
| USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE (reg. -S-) 6.75%/16-08.11.2021 | 30,263 | 26,189.83 | 0.01 | USD CYDSA SAB DE CV 6.25%/17-04.10.2027 | 45,394 | 33,715.31 | 0.01 |
| USD CENTRAL CHN REAL ESTATE 6.875%/20-10.02.2021 | 15,131 | 14,248.99 | 0.00 | EUR DAIMLER 1.4%/16-12.01.2024 | 22,169 | 24,008.47 | 0.01 |
| CHF CFF 3%/07-07.06.2022 | 546 | 601.18 | 0.00 | CHF DANSKE BANK A/S 0.625%/19-24.11.2022 | 109 | 108.11 | 0.00 |
| USD CHARLES SCHWAB CORP 3.85%/18-21.05.2025 | 42,465 | 45,579.02 | 0.02 | CHF DANSKE BANK (subordinated) 3.125%/13-18.12.2025 | 346 | 322.30 | 0.00 |
| USD CHEVRON CORPORATION 3.191%/13-24.06.2023 | 55,634 | 58,057.50 | 0.02 | CHF DEUT PFANDBRIEFBANK AG 0.125%/19-05.06.2023 | 273 | 272.11 | 0.00 |
| USD CHEVRON 2.954%/16-16.05.2026 | 100,786 | 106,079.68 | 0.04 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.1%/19-19.06.2029 | 437 | 432.00 | 0.00 |
| USD CHINA SCE GRP HLDGS LTD 7.25%/19-19.04.2023 | 37,829 | 32,849.26 | 0.01 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.45%/17-08.11.2030 | 364 | 374.28 | 0.00 |
| USD CHINA SCE PROPERTY HLDGS 5.875%/17-10.03.2022 | 30,263 | 27,350.42 | 0.01 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028 | 455 | 469.73 | 0.00 |
| USD CISCO SYSTEMS 2.2%/16-28.02.2021 | 268,764 | 269,876.36 | 0.09 | CHF DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/14-26.08.2024 | 327 | 361.22 | 0.00 |
| USD CITIBANK NA 3.4%/18-23.07.2021 | 85,736 | 87,204.27 | 0.03 | CHF DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023 | 455 | 430.26 | 0.00 |
| CHF CITIGROUP INC 0.5%/17-22.11.2024 | 637 | 634.93 | 0.00 | EUR DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL 4.338 | 48,681.99 | 0.02 | |
| CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028 | 655 | 597.24 | 0.00 | CHF DIAMOND 1 FINANCE CORP / DIAMOND 2 FINANCE CORP -144A- 4.42%/16-15.06.2021 | 124,975 | 126,233.61 | 0.04 |
| CHF CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026 | 455 | 447.65 | 0.00 | CHF DIB SUKUK LTD S. -5- 3.664%/17-14.02.2022 | 34,046 | 34,015.14 | 0.01 |
| USD CITIGROUP INC 2.7%/17-27.10.2022 | 295,640 | 297,402.06 | 0.10 | USD DIGICEL GROUP TWO LTD 9.125%/19-01.04.2024 | 23,022 | 2,465.45 | 0.00 |
| EUR CITIGROUP S. 2.125%/14-10.09.2026 | 55,422 | 61,345.67 | 0.02 | USD DISCOVERY BANK 3.45%/16-27.07.2026 | 134,382 | 131,551.76 | 0.05 |
| USD CITIGROUP 2.9%/16-08.12.2021 | 295,640 | 298,303.77 | 0.10 | USD DISCOVERY COMMUNICATIONS 2.95%/17-20.03.2023 | 147,820 | 147,465.26 | 0.05 |
| USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125%/17-19.07.2027 | 34,046 | 35,582.61 | 0.01 | EUR DNB BOLIGKREDITT 2.75%/12-21.03.2022 | 22,169 | 25,741.85 | 0.01 |
| USD CNOOC CURTIS FUNDING NO 1 (reg. -S-) 4.5%/13-03.10.2023 | 99,216 | 106,413.62 | 0.04 | USD DOMINICAN REPUBLIC (reg. -S-) 5.5%/15-27.01.2025 | 43,772 | 41,668.29 | 0.01 |
| CHF COCA-COLA (reg. -S-) 0.25%/15-22.12.2022 | 1,455 | 1,514.43 | 0.00 | USD DOMINICAN REPUBLIC (reg. -S-) 7.45%/14-30.04.2044 | 29,181 | 28,308.21 | 0.01 |
| EUR COCA-COLA 1.125%/14-22.09.2022 | 44,338 | 49,079.94 | 0.02 | USD DOMINICAN REPUBLIC 6%/18-19.07.2028 | 43,772 | 41,156.59 | 0.01 |
| USD COCA-COLA 2.55%/16-01.06.2026 | 134,382 | 140,356.46 | 0.05 | USD DOWDUPONT INC 4.205%/18-15.11.2023 | 67,191 | 70,724.49 | 0.02 |
| USD COCA-COLA 2.875%/15-27.10.2025 | 80,629 | 86,202.99 | 0.03 | USD DOWDUPONT INC 4.725%/18-15.11.2028 | 161,258 | 176,685.78 | 0.06 |
| USD CODELCO INC 3%/19-30.09.2029 | 34,802 | 32,121.88 | 0.01 | USD DTEK FINANCE PLC 10.75%/16-31.12.2024 | 15,131 | 7,561.49 | 0.00 |
| USD CODELCO INC 3.625%/17-01.08.2027 | 268,764 | 263,512.04 | 0.09 | USD DUBAI 5.25%/13-30.01.2043 | 29,181 | 27,126.95 | 0.01 |
| USD COLOMBIA 4.5%/15-28.01.2026 | 178,154 | 180,778.01 | 0.06 | USD DUKE ENERGY 1.8%/16-01.09.2021 | 134,382 | 133,200.62 | 0.05 |
| USD COLOMBIA 5%/15-15.06.2045 | 58,363 | 59,895.23 | 0.02 | USD EADS FINANCE (reg. -S-) 2.7%/13-17.04.2023 | 134,382 | 135,091.38 | 0.05 |
| USD COLOMBIA 6.125%/09-18.01.2041 | 58,363 | 66,647.20 | 0.02 | USD EATON 2.75%/13-02.11.2022 | 167,977 | 169,699.07 | 0.06 |
| USD COLOMBIA 7.375%/06-18.09.2037 | 29,181 | 36,455.63 | 0.01 | CHF EBN 0.5%/14-22.09.2022 | 760 | 788.14 | 0.00 |
| USD COMCAST CORP 4.15%/18-15.10.2028 | 82,645 | 93,404.36 | 0.03 | USD ECOPETROL 7.375%/13-18.09.2043 | 60,526 | 61,430.09 | 0.02 |
| USD COMCAST 3.125%/12-15.07.2022 | 169,456 | 174,657.78 | 0.06 | USD ECUADOR (reg. -S-) 10.75%/16-28.03.2022 | 29,181 | 9,280.24 | 0.00 |
| USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD (reg. -S-) 5.75%/12-140242 | 58,363 | 56,211.38 | 0.02 | USD EDF (reg. -S-) 2.35%/15-13.10.2020 | 201,573 | 201,409.49 | 0.07 |
| USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD (reg. -S-) 4.875%/13-15.01.2024 | 116,725 | 112,439.24 | 0.04 | CHF EDF 0.3%/16-14.10.2024 | 455 | 460.80 | 0.00 |
| CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026 | 455 | 455.87 | 0.00 | CHF EDF 0.65%/16-13.10.2028 | 182 | 184.70 | 0.00 |
| USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA NEW YORK BRANCH 2.4%/15-02.11.2020 | 134,382 | 134,271.65 | 0.05 | EUR EDF 4.625%/09-11.09.2024 | 22,169 | 28,276.00 | 0.01 |
| CHF COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.5%/14-07.02.2022 | 591 | 604.85 | 0.00 | EUR EDP FINANCE BV 1.5%/17-22.11.2027 | 55,422 | 60,650.59 | 0.02 |
| CHF COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.2024 | 909 | 990.22 | 0.00 | CHF EIB 1.125%/12-26.04.2023 | 1,364 | 1,467.71 | 0.00 |
| USD CONOCOPHILLIPS 4.95%/16-15.03.2026 | 201,573 | 214,683.05 | 0.07 | USD EL SALVADOR (reg. -S-) 7.65%/05-15.06.2035 | 40,854 | 34,733.93 | 0.01 |
| EUR COOPERATIEVE RABOBANK 1.25%/16-23.03.2026 | 44,338 | 49,148.05 | 0.02 | CHF ELEMENTIA (reg. -S-) 5.5%/14-15.01.2025 | 34,046 | 27,403.79 | 0.01 |
| CHF COOPERATIVE RABOBANK 2%/10-16.09.2021 | 273 | 286.21 | 0.00 | CHF EL LILLY & CO 0.15%/16-24.05.2024 | 593 | 603.65 | 0.00 |
| CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026 | 182 | 208.57 | 0.00 | USD ELI LILLY & CO 3.375%/19-15.03.2029 | 100,786 | 111,727.75 | 0.04 |
| USD CORPORACION FINANCIERA DE DESARROLLO SA COFIDE (reg. -S-) 4.75%/15-15.07.2025 | 29,181 | 28,339.14 | 0.01 | USD EMIRATE OF KUWAIT (reg. -S-) 3.5%/17-20.03.2027 | 58,363 | 60,979.02 | 0.02 |
| CHF CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024 | 327 | 345.48 | 0.00 | USD EMPRESA ELECTRICA COCHRA 5.5%/19-14.05.2027 | 18,914 | 17,090.61 | 0.01 |
| USD COSAN LTD 5.5%/19-20.09.2029 | 37,829 | 30,254.60 | 0.01 | USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO (reg. -S-) 3.75%/16-05.08.2026 | 116,725 | 108,898.82 | 0.04 |
| USD COSTA RICA (reg. -S-) 4.25%/12-26.01.2023 | 46,690 | 41,837.60 | 0.01 | EUR ENEL FINANCE INTERNATIONAL (reg. -S-) S. 78 1.966%/15-27.01.2025 | 66,506 | 75,502.64 | 0.03 |
| USD COSTA RICA (reg. -S-) 7.158%/15-12.03.2045 | 43,772 | 35,203.17 | 0.01 | CHF ENEL FINANCE INTERNATIONAL 0.55%/17-03.09.2024 | 546 | 555.50 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE CIB FINANCIAL SOLUTIONS 0.1275%/20-27.07.2028 | 331 | 273.54 | 0.00 | EUR ENI SPA 1%/17-14.03.2025 | 56,530 | 61,129.81 | 0.02 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027 | 455 | 468.56 | 0.00 | USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD 6.35%/18-10.08.2028 | 29,181 | 24,842.63 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.45%/19-24.01.2029 | 364 | 379.73 | 0.00 | USD ETHIOPIA (reg. -S-) 6.625%/14-11.12.2024 | 35,018 | 31,531.93 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029 | 455 | 464.09 | 0.00 | CHF EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026 | 364 | 443.65 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.1%/16-26.01.2026 | 455 | 468.09 | 0.00 | CHF EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025 | 327 | 391.16 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026 | 909 | 942.76 | 0.00 | USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025 | 1,000,000 | 1,038,960.00 | 0.36 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 0.2%/18-30.10.2023 | 364 | 372.40 | 0.00 | USD EUROPEAN BK RECON & DEV 2.75%/18-07.03.2023 | 162,602 | 172,730.51 | 0.06 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 0.55%/15-01.09.2022 | 546 | 548.74 | 0.00 | EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.625%/19-22.01.2029 | 22,169 | 25,772.75 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/19-07.11.2025 | 364 | 363.94 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029 | 1,000,000 | 1,057,220.00 | 0.37 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 2.125%/14-30.10.2024 | 273 | 302.14 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.5%/18-15.03.2023 | 134,382 | 141,880.35 | 0.05 |
| CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.25%/19-10.10.2029 | 455 | 432.37 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.625%/19-15.03.2024 | 335,148 | 361,199.39 | 0.13 |
| CHF CREDIT AGRICOLE 0.625%/15-15.09.2023 | 91 | 91.64 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025 | 1,000,000 | 1,111,380.00 | 0.39 |
| CHF CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025 | 455 | 465.27 | 0.00 | EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.5%/09-15.10.2025 | 11,084 | 15,372.60 | 0.01 |
| EUR CREDIT AGRICOLE 1.875%/16-20.12.2026 | 2,217 | 2,411.72 | 0.00 | USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY (reg -S-) S. -2- 5.375%/16-24.10.2023 | 58,363 | 50,881.12 | 0.02 |
| CHF CREDIT SUISSE AG LONDON 0.55%/16-15.04.2024 | 909 | 914.56 | 0.00 | USD EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.75%/18-15.03.2023 | 87,348 | 92,758.54 | 0.03 |
| USD CREDIT SUISSE GROUP FUNDING (GUERNSEY) 4.55%/16-17.04.2026 | 134,382 | 138,870.19 | 0.05 | CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025 | 455 | 441.77 | 0.00 |
| CHF CREDIT SUISSE LONDON 1%/14-24.09.2021 | 582 | 598.85 | 0.00 | CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.253%/18-06.03.2023 | 182 | 186.11 | 0.00 |
| USD CREDIVALORES SA 9.75%/17-27.07.2022 | 30,263 | 26,349.02 | 0.01 | USD EXPORT-IMPORT BANK KOREA 3%/17-01.11.2022 | 41,658 | 43,324.29 | 0.02 |
| CHF CRH 1.375%/13-15.03.2023 | 364 | 392.33 | 0.00 | USD EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 2.875%/16-26.04.2026 | 58,363 | 61,800.77 | 0.02 |
| CHF CS GROUP FUNDING 1%/15-14.04.2023 | 1,182 | 1,234.14 | 0.00 | | | | |
| USD CSN ISLANDS XI CORP 6.75%/20-28.01.2028 | 30,263 | 19,533.81 | 0.01 | | | | |
| USD CVS HEALTH CORP 3.35%/18-09.03.2021 | 167,171 | 168,294.40 | 0.06 | | | | |
| USD CVS HEALTH CORP 3.7%/18-09.03.2023 | 207,754 | 215,339.44 | 0.07 | | | | |
| USD CVS HEALTH CORP 4.1%/18-25.03.2025 | 43,674 | 45,973.54 | 0.02 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量/ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量/ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|--------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE (reg. -S-) 6.95%/12-10.07.2042 | 35,018 | 36,848.99 | 0.01 | CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625%/15-30.12.2021 | 91 | 94.04 | 0.00 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 6.375%/18-24.10.2048 | 14,591 | 14,487.50 | 0.01 | USD MONGOLIA (reg. -S-) T. 2 5.125%/12-05.12.2022 | 17,509 | 15,757.38 | 0.01 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 4.75%/17-19.04.2027 | 43,772 | 42,317.86 | 0.01 | USD MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/19-23.01.2030 | 134,382 | 148,915.24 | 0.05 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 5.75%/17-29.04.2047 | 29,181 | 29,183.65 | 0.01 | EUR MORGAN STANLEY 1.75%/15-30.01.2025 | 66,506 | 72,282.29 | 0.03 |
| USD KENYA (reg. -S-) 6.875%/14-24.06.2024 | 43,772 | 41,455.56 | 0.01 | USD MORGAN STANLEY 2.75%/17-19.05.2022 | 295,640 | 298,711.75 | 0.10 |
| EUR KFW 0.625%/17-22.02.2027 | 11,084 | 12,796.49 | 0.00 | USD MORGAN STANLEY 3.125%/18-23.01.2023 | 268,764 | 274,722.17 | 0.10 |
| USD KFW 1.5%/16-15.06.2021 | 87,079 | 88,150.51 | 0.03 | USD MOROCCO (reg. -S-) 4.25%/12-11.12.2022 | 29,181 | 28,968.87 | 0.01 |
| USD KFW 1.75%/19-14.09.2029 | 3,500,000 | 3,726,939.99 | 1.29 | USD MOROCCO (reg. -S-) 5.5%/12-11.12.2042 | 29,181 | 30,908.85 | 0.01 |
| USD KFW 2%/17-29.09.2022 | 2,000,000 | 2,071,600.00 | 0.71 | USD MPLX 4.125%/17-01.03.2027 | 134,382 | 115,278.12 | 0.04 |
| CHF KFW 2.5%/05-25.08.2025 | 637 | 754.35 | 0.00 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.25%/19-26.02.2029 | 437 | 459.74 | 0.00 |
| USD KINDER MORGAN 4.3%/14-01.06.2025 | 134,382 | 136,984.82 | 0.05 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.3%/17-20.12.2024 | 437 | 425.00 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA (reg. -S-) 6.125%/13-01.08.2023 | 58,363 | 55,415.90 | 0.02 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.5%/18-14.06.2028 | 546 | 587.37 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 7%/16-12.10.2028 | 116,725 | 106,842.12 | 0.04 | CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027 | 455 | 515.79 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF JORDAN (reg. -S-) 5.75%/16-31.01.2027 | 35,018 | 30,839.28 | 0.01 | CHF NA DEVELOPMENT BANK 0.3%/18-24.07.2026 | 200 | 209.58 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 4.5%/16-26.10.2046 | 58,363 | 59,570.15 | 0.02 | USD NAMIBIA (reg. -S-) 5.5%/11-03.11.2021 | 35,018 | 33,609.17 | 0.01 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA (reg. -S-) 3.25%/16-26.10.2026 | 29,181 | 29,276.44 | 0.01 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19-21.06.2027 | 1,364 | 1,332.36 | 0.00 |
| USD KOC HOLDING AS 6.5%/19-11.03.2025 | 16,645 | 15,387.77 | 0.01 | USD NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH T. -17- 2.5%/16-12.07.2026 | 46,227 | 46,561.58 | 0.02 |
| USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025 | 200,000 | 213,096.00 | 0.07 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025 | 546 | 530.12 | 0.00 |
| AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023 | 19,000 | 12,896.47 | 0.00 | EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.875%/12-13.01.2023 | 29,484 | 34,115.02 | 0.01 |
| CHF KOMMUNEKREDIT 0.625%/15-09.07.2027 | 364 | 393.27 | 0.00 | USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.7%/18-04.11.2021 | 84,795 | 86,950.43 | 0.03 |
| USD KOREA EAST-WEST POWER CO 3.875%/18-19.07.2023 | 15,131 | 16,166.60 | 0.01 | CHF NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0%/19-11.07.2025 | 504 | 522.55 | 0.00 |
| USD KOREA GAS CORPORATION (reg. -S-) T. -11- 2.25%/16-18.07.2026 | 22,697 | 22,883.76 | 0.01 | EUR NETHERLANDS (reg. -S-) 1.75%/13-15.07.2023 | 85,128 | 100,873.77 | 0.04 |
| CHF KOREA GAS CORPORATION 0%/19-28.11.2023 | 191 | 193.14 | 0.00 | EUR NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026 | 22,169 | 25,800.96 | 0.01 |
| CHF KOREA NATIONAL OIL CORP 0.373%/18-01.06.2023 | 127 | 130.14 | 0.00 | EUR NETHERLANDS 2%/14-15.07.2024 | 33,253 | 40,599.50 | 0.01 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) T. 7 3.25%/14-10.07.2024 | 51,447 | 54,335.20 | 0.02 | CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.25%/19-18.10.2027 | 455 | 444.12 | 0.00 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) 2.625%/16-14.04.2026 | 201,573 | 208,676.18 | 0.07 | USD NEXTERA ENERGY CAPITAL 3.55%/17-01.05.2027 | 147,820 | 151,681.08 | 0.05 |
| USD KOREA RESOURCES CORP 4%/18-18.04.2023 | 37,829 | 39,798.01 | 0.01 | USD NISOURCE INC 3.49%/17-15.05.2027 | 147,820 | 149,846.64 | 0.05 |
| CHF KOREA WESTERN POWER CO LTD 0.125%/19-27.02.2024 | 302 | 306.91 | 0.00 | CHF NORDEA BANK 0.25%/15-27.11.2023 | 909 | 923.96 | 0.00 |
| USD KOREA WESTERN POWER CO 3.75%/18-07.06.2023 | 37,829 | 40,404.40 | 0.01 | CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025 | 346 | 341.82 | 0.00 |
| USD KSA SUKUK LTD S. -1- 2.894%/17-20.04.2022 | 58,363 | 58,519.04 | 0.02 | CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025 | 909 | 946.05 | 0.00 |
| EUR LAND NORDRHEIN-WESTFALEN 0.5%/17-16.02.2027 | 55,422 | 62,982.72 | 0.02 | USD NOVARTIS CAPITAL 3%/15-20.11.2025 | 335,955 | 359,810.74 | 0.13 |
| USD LCPR SR SECURED FIN DAC 6.75%/19-15.10.2027 | 15,131 | 15,099.23 | 0.01 | USD NOVARTIS CAPITAL 3.4%/14-06.05.2024 | 174,696 | 187,094.60 | 0.07 |
| CHF LGT BANK 1.5%/14-10.05.2021 | 1,091 | 1,144.84 | 0.00 | EUR NOVARTIS FINANCE (reg. -S-) 0.125%/16-20.09.2023 | 22,169 | 23,953.01 | 0.01 |
| EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC 1.5%/17-12.09.2027 | 44,338 | 45,914.32 | 0.02 | EUR NWB (reg. -S-) S. -1418- 0.5%/15-27.10.2022 | 46,333 | 51,872.67 | 0.02 |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05%/18-16.08.2023 | 134,382 | 138,846.01 | 0.05 | EUR OBRIGACOEES DO TESOURO -144A- 1.95%/19-15.06.2029 | 6,651 | 8,067.94 | 0.00 |
| USD LONGFOR HOLDINGS LTD 3.95%/19-16.09.2029 | 35,559 | 33,392.32 | 0.01 | EUR OBRIGACOEES DO TESOURO -144A- 2.125%/18-17.10.2028 | 15,518 | 19,029.19 | 0.01 |
| USD LOWE'S COS INC 3.65%/19-05.04.2029 | 87,348 | 89,701.36 | 0.03 | CHF OEKB 1%/12-28.09.2021 | 182 | 191.00 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023 | 291 | 277.02 | 0.00 | CHF OEKB 2.625%/06-22.11.2024 | 455 | 530.83 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 3%/12-29.11.2022 | 364 | 380.11 | 0.00 | CHF OEKB 3%/07-14.06.2022 | 364 | 401.92 | 0.00 |
| USD MAF GLOBAL SECURITIES (subordinated) FIX-TO-FLOATERS 6.375%/18-PERPETUAL | 37,829 | 28,798.57 | 0.01 | USD OIL & NATURAL GAS CORPORATION LTD 3.375%/19-05.12.2029 | 64,309 | 52,381.37 | 0.02 |
| USD MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK 3.043%/15-22.04.2025 | 87,544 | 91,943.02 | 0.03 | USD OIL INDIA LTD 5.125%/19-04.02.2029 | 18,914 | 16,690.38 | 0.01 |
| USD MAR SUKUK LTD 3.025%/19-13.11.2024 | 60,526 | 57,702.91 | 0.02 | USD OMAN (reg. -S-) 5.375%/17-08.03.2027 | 43,772 | 31,464.60 | 0.01 |
| CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024 | 273 | 273.38 | 0.00 | USD OMAN (reg. -S-) 6.5%/17-08.03.2047 | 29,181 | 19,034.97 | 0.01 |
| USD MCDONALD'S 3.7%/15-30.01.2026 | 134,382 | 141,401.95 | 0.05 | USD OMAN SOVEREIGN SUKUK 5.932%/18-31.10.2025 | 29,181 | 26,061.83 | 0.01 |
| USD MEDTRONIC 3.15%/15-15.03.2022 | 201,573 | 208,936.21 | 0.07 | CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.25%/17-28.06.2029 | 364 | 374.28 | 0.00 |
| USD MENDOZA PROVINCE 8.375%/16-19.05.2024 | 15,131 | 6,754.53 | 0.00 | USD ONTARIO (PROVINCE OF) 3.05%/19-29.01.2024 | 418,196 | 451,488.89 | 0.16 |
| USD MERCK & CO 2.35%/15-10.02.2022 | 127,260 | 130,676.52 | 0.05 | AUD ONTARIO 6.25%/10-29.09.2020 | 285,000 | 179,116.68 | 0.06 |
| USD MERCK & CO 3.875%/10-15.01.2021 | 162,736 | 164,537.90 | 0.06 | CHF OP CORPORATE BANK 1%/14-14.07.2021 | 909 | 936.65 | 0.00 |
| CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027 | 637 | 618.48 | 0.00 | USD ORACLE 1.9%/16-15.09.2021 | 84,661 | 84,949.25 | 0.03 |
| USD METINVEST BV 7.75%/18-23.04.2023 | 15,131 | 10,681.30 | 0.00 | USD ORACLE 2.65%/16-15.07.2026 | 138,413 | 141,421.02 | 0.05 |
| USD METINVEST B.V. 7.75%/19-17.10.2029 | 24,210 | 16,947.23 | 0.01 | USD PAKISTAN (reg. -S-) 8.25%/14-15.04.2024 | 99,216 | 88,290.74 | 0.03 |
| USD METINVEST BV 8.5%/18-23.04.2026 | 75,657 | 53,200.70 | 0.02 | USD PANAMA 7.125%/05-29.01.2026 | 145,907 | 176,314.95 | 0.06 |
| USD METRO (reg. -S-) 5%/17-25.01.2047 | 29,181 | 29,114.20 | 0.01 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 5%/16-15.04.2026 | 40,854 | 41,733.83 | 0.01 |
| USD MHP LUX SA 6.95%/18-03.04.2026 | 30,263 | 24,283.87 | 0.01 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 6.1%/14-11.08.2044 | 29,181 | 30,705.16 | 0.01 |
| EUR MICROSOFT 2.125%/13-06.12.2021 | 46,333 | 52,081.62 | 0.02 | USD PEPISCO INC 3%/17-15.10.2027 | 235,168 | 250,237.80 | 0.09 |
| USD MICROSOFT 3.125%/15-03.11.2025 | 85,064 | 93,064.80 | 0.02 | USD PERU 5.625%/10-18.11.2050 | 58,363 | 85,616.22 | 0.03 |
| USD MICROSOFT 3.3%/17-06.02.2027 | 201,573 | 223,548.22 | 0.08 | USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR S. -8- 3.375%/19-05.02.2030 | 58,363 | 53,997.10 | 0.02 |
| USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR (reg. -S-) 6%/15-15.03.2025 | 30,263 | 28,169.03 | 0.01 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5.75%/18-01.02.2029 | 37,829 | 35,687.93 | 0.01 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.25%/19-25.03.2029 | 17,401 | 15,890.76 | 0.01 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 7.375%/17-17.01.2027 | 45,394 | 46,513.35 | 0.02 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.625%/18-15.10.2026 | 22,697 | 21,455.88 | 0.01 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA (reg. -S-) 9%/11-17.11.2021 | 58,363 | 4,043.36 | 0.00 |
| USD MINEJESA CAPITAL BV 4.625%/17-10.08.2030 | 56,743 | 51,068.68 | 0.02 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA 5.5%/07-12.04.2037 | 175,088 | 11,977.76 | 0.00 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.407%/19-07.03.2024 | 134,382 | 138,536.93 | 0.05 | USD PETROLEOS DEL PERU SA 5.625%/17-19.06.2047 | 102,135 | 92,452.23 | 0.03 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.455%/18-02.03.2023 | 81,973 | 83,935.35 | 0.03 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.5%/11-02.06.2041 | 29,181 | 18,615.05 | 0.01 |
| USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.85%/16-01.03.2026 | 83,048 | 87,269.31 | 0.03 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.875%/16-04.02.2026 | 58,363 | 44,191.01 | 0.02 |
| USD MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018%/18-05.03.2028 | 268,764 | 288,775.82 | 0.10 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.5%/18-13.03.2027 | 29,181 | 21,577.25 | 0.01 |
| EUR MOLSON COORS BREWING 1.25%/16-15.07.2024 | 44,338 | 47,900.19 | 0.02 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.95%/20-28.01.2060 | 15,131 | 10,068.62 | 0.00 |
| CHF MONDELEZ INTERNATIONAL (reg. -S-) 0.65%/16-26.07.2022 | 1,000 | 1,032.90 | 0.00 | USD PETROLEOS VENEZUELA (REG-.S.) 6%/14-16.05.2024 | 58,363 | 4,092.97 | 0.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率(%) |
|--|-----------|----------------|--------------|
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： 投資信託 | | | |
| 投資信託受益証券（クローズド・エンド型） | | | |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 2,594 | 2,395.94 | 0.00 |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST LIMITED | 1,187 | 1,096.06 | 0.00 |
| GBP F&C UK REAL ESTATE INVESTMENT | 1,172 | 1,005.45 | 0.00 |
| GBP PICTON PROPERTY INCOME | 2,736 | 3,019.38 | 0.00 |
| GBP UK COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 3,139 | 2,919.21 | 0.00 |
| 投資信託受益証券（クローズド・エンド型） | | 10,436.04 | 0.00 |
| 投資信託受益証券（オープン・エンド型） | | | |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAP - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD | 60,471 | 5,883,223.59 | 2.05 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD | 8,237 | 7,264,364.43 | 2.53 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD | 19,375 | 16,383,768.16 | 5.70 |
| JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY | 1,618 | 1,453,104.71 | 0.51 |
| CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD | 4,556 | 2,486,555.68 | 0.87 |
| EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR | 344 | 754,510.59 | 0.26 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD | 2,074 | 3,340,722.88 | 1.16 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD | 4,050 | 4,538,258.86 | 1.58 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND -EB- USD | 930 | 1,453,454.21 | 0.51 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND -EB- | 13,625 | 1,286,063.75 | 0.45 |
| USD CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD | 19,739 | 9,251,268.82 | 3.22 |
| 投資信託受益証券（オープン・エンド型） | | 54,095,295.68 | 18.84 |
| 証券取引所または他の組織された市場に 上場されている証券：投資信託 | | | |
| | | 54,105,731.72 | 18.84 |
| 証券取引所に上場されていない証券： 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| USD DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 1,280 | 4,646.37 | 0.00 |
| CAD FIRST CAPITAL REALTY INC | 716 | 6,856.79 | 0.00 |
| EUR WAREHOUSES DE PAUW N.V. | 645 | 18,529.32 | 0.01 |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | 30,032.48 | 0.01 |
| 証券取引所に上場されていない証券： 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| | | 30,032.48 | 0.01 |
| ポートフォリオ合計 | | 279,308,311.76 | 97.28 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | | 7,786,728.47 | 2.71 |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | | -695,236.97 | -0.24 |
| その他の純資産 | | 721,285.19 | 0.25 |
| 純資産総額 | | 287,121,088.45 | 100.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンズ・グロース・USD

投資有価証券明細表

| | | | |
|-------------|-------|-----------------------|-------|
| 国別内訳 | | ジャマイカ | 0.02 |
| アメリカ合衆国 | 46.85 | ケニア | 0.02 |
| ルクセンブルグ | 20.86 | ガーナ | 0.02 |
| ドイツ | 5.40 | イスラエル | 0.02 |
| アイルランド | 4.10 | リベリア | 0.02 |
| 日本 | 3.06 | 中華人民共和国 | 0.02 |
| フランス | 2.26 | スリランカ | 0.02 |
| イギリス | 2.09 | アルメニア | 0.02 |
| オーストラリア | 1.58 | ルーマニア | 0.02 |
| オランダ | 1.54 | アゼルバイジャン | 0.02 |
| スイス | 1.37 | パキスタン | 0.02 |
| ノルウェー | 1.23 | エルサルバドル | 0.02 |
| スペイン | 0.80 | モロッコ | 0.02 |
| カナダ | 0.72 | セネガル | 0.01 |
| 香港 | 0.43 | ベラルーシ | 0.01 |
| ケイマン諸島 | 0.37 | タジキスタン | 0.01 |
| バミューダ | 0.28 | イラク | 0.01 |
| シンガポール | 0.24 | コートジボワール | 0.01 |
| ベルギー | 0.21 | ヨルダン | 0.01 |
| フィンランド | 0.21 | モンゴル | 0.01 |
| イタリア | 0.21 | ジョージア | 0.01 |
| メキシコ | 0.15 | グアテマラ | 0.01 |
| ジャージー | 0.13 | ガーンジー | 0.01 |
| 国際機関 | 0.13 | エチオピア | 0.01 |
| チリ | 0.10 | クウェート | 0.01 |
| アラブ首長国連邦 | 0.10 | アルゼンチン | 0.01 |
| ヴァージン諸島（英領） | 0.10 | トーゴ | 0.01 |
| 韓国 | 0.09 | ナミビア | 0.01 |
| コロンビア | 0.09 | バハマ | 0.01 |
| トルコ | 0.09 | アンゴラ | - |
| サウジアラビア | 0.09 | ベネズエラ | - |
| インド | 0.07 | エクアドル | - |
| ポルトガル | 0.07 | 合計 | 96.42 |
| ブラジル | 0.06 | | |
| インドネシア | 0.06 | 業種別内訳 | |
| フィリピン | 0.06 | 投資信託／ファンド | 21.83 |
| バーレーン | 0.05 | インターネット・ソフトウェア・ITサービス | 10.13 |
| カタール | 0.05 | 銀行・その他の金融機関 | 9.09 |
| オーストリア | 0.05 | 医薬品・化粧品・医療品 | 6.35 |
| ベルー | 0.05 | 金融・投資・その他の多角化企業 | 4.93 |
| ウルグアイ | 0.05 | 国および中央政府 | 3.82 |
| ポーランド | 0.05 | 不動産 | 3.44 |
| パナマ | 0.05 | 食品・清涼飲料 | 3.04 |
| マレーシア | 0.04 | コンピューターハードウェア・ネットワーク | 2.67 |
| スウェーデン | 0.04 | 電子・半導体 | 2.44 |
| カザフスタン | 0.04 | エネルギー・水道 | 2.36 |
| エジプト | 0.04 | 保険会社 | 2.03 |
| ナイジェリア | 0.04 | 機械工学・産業機器 | 1.96 |
| パラグアイ | 0.03 | 国際機関 | 1.92 |
| ドミニカ共和国 | 0.03 | 各種消費財 | 1.88 |
| ニュージーランド | 0.03 | 通信 | 1.65 |
| ロシア | 0.03 | 建築材・建設業 | 1.61 |
| 南アフリカ | 0.03 | 交通・運輸 | 1.59 |
| ウクライナ | 0.03 | 石油 | 1.54 |
| オマーン | 0.03 | 宿泊・仕出し・娯楽施設 | 1.48 |
| コスタリカ | 0.02 | バイオテクノロジー | 1.34 |
| ウズベキスタン | 0.02 | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| | |
|-----------------------|-------|
| 小売り・百貨店 | 1.32 |
| 電気機器・部品 | 1.15 |
| 化学 | 1.12 |
| 繊維・衣服・革製品 | 0.98 |
| 自動車 | 0.66 |
| カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州） | 0.63 |
| グラフィック出版・印刷メディア | 0.57 |
| 各種サービス | 0.55 |
| 公共・非営利機関 | 0.47 |
| ヘルスケア・社会福祉 | 0.35 |
| 林業・紙製品・林産品 | 0.33 |
| 貴金属・宝石 | 0.20 |
| 鉱業・石炭・鉄鋼 | 0.19 |
| 包装業 | 0.14 |
| 環境サービス・リサイクル | 0.14 |
| 航空・宇宙産業 | 0.12 |
| 写真・光学 | 0.11 |
| ゴム・タイヤ | 0.09 |
| タバコ・アルコール飲料 | 0.07 |
| 非鉄金属 | 0.06 |
| 各種貿易会社 | 0.03 |
| 農業・漁業 | 0.01 |
| 抵当・資金貸出機関（MBS、ABS） | 0.01 |
| 各種資本財 | 0.01 |
| 分類不能／非分類機関 | 0.01 |
| 合計 | 96.42 |

投資有価証券明細表

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|--------------|------------------|
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| CHF ABB (reg. shares) | 1,080 | 18,977.46 | 0.02 |
| USD ABBVIE | 4,537 | 345,696.21 | 0.41 |
| USD ACADIA REALTY TRUST | 145 | 1,793.96 | 0.00 |
| USD ACCENTURE -A- | 2,012 | 328,490.58 | 0.39 |
| EUR ACCOR | 503 | 13,801.34 | 0.02 |
| JPY ACTIVIA PROPERTIES | 1 | 3,530.71 | 0.00 |
| USD ACUTY BRANDS | 136 | 11,656.16 | 0.01 |
| CHF ADECCO (reg. shares) | 203 | 8,003.88 | 0.01 |
| EUR ADIDAS (reg. shares) | 517 | 116,801.79 | 0.13 |
| EUR ADO PROPERTIES | 45 | 1,023.25 | 0.00 |
| USD ADOBE INC | 1,532 | 487,437.54 | 0.57 |
| USD ADVANCE AUTO PARTS | 209 | 19,494.06 | 0.02 |
| JPY ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT | 2 | 5,929.45 | 0.01 |
| EUR AEDIFICA | 38 | 3,963.95 | 0.00 |
| EUR AEGON | 5,127 | 13,016.57 | 0.02 |
| JPY AEON | 1,054 | 23,425.36 | 0.03 |
| JPY AEON FINANCIAL SERVICE | 182 | 1,947.13 | 0.00 |
| JPY AEON MALL | 187 | 2,363.61 | 0.00 |
| JPY AEON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2 | 2,390.06 | 0.00 |
| EUR AEROPORTS DE PARIS | 63 | 6,050.32 | 0.01 |
| USD AES | 2,121 | 28,847.17 | 0.03 |
| USD AGILENT TECHNOLOGIES | 960 | 68,777.72 | 0.08 |
| USD AGREE REALTY | 70 | 4,318.10 | 0.00 |
| EUR AIR LIQUIDE | 1,356 | 173,505.27 | 0.20 |
| JPY AJINOMOTO | 706 | 13,153.70 | 0.02 |
| EUR AKZO NOBEL NV | 709 | 46,713.74 | 0.05 |
| CHF ALCON INC | 195 | 9,937.92 | 0.01 |
| USD ALEXANDER'S INC | 4 | 1,000.17 | 0.00 |
| USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES | 554 | 75,994.37 | 0.09 |
| USD ALIGN TECHNOLOGY | 226 | 39,235.65 | 0.05 |
| USD ALLEGION | 280 | 25,753.04 | 0.03 |
| USD ALLIANT ENERGY | 743 | 35,865.12 | 0.04 |
| EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted) | 1,267 | 218,169.15 | 0.26 |
| CAD ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 210 | 6,598.27 | 0.01 |
| CHF ALLREAL HOLDING (reg. shares) | 22 | 4,034.51 | 0.00 |
| USD ALLSTATE | 981 | 89,993.10 | 0.10 |
| USD ALLY FINANCIAL | 1,147 | 16,545.54 | 0.02 |
| USD ALPHABET -A- 976 1,134,121.91 1.32 | | | |
| USD ALPHABET -C- | 947 | 1,101,235.04 | 1.28 |
| EUR ALSTRIA OFFICE REIT | 261 | 3,734.56 | 0.00 |
| EUR AMADEUS IT GROUP -A- | 1,236 | 58,572.59 | 0.07 |
| USD AMAZON.COM | 36 | 70,805.14 | 0.08 |
| USD AMERCO | 32 | 9,323.81 | 0.01 |
| USD AMERICAN ASSETS TRUST | 84 | 2,106.43 | 0.00 |
| USD AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 233 | 6,452.09 | 0.01 |
| USD AMERICAN EXPRESS | 2,805 | 240,160.83 | 0.29 |
| USD AMERICAN FINANCE TRUST INC | 181 | 1,132.06 | 0.00 |
| USD AMERICAN FINANCIAL GROUP | 219 | 15,336.72 | 0.02 |
| USD AMERICAN HOMES 4 RENT -A- | 442 | 10,243.97 | 0.01 |
| USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 2,635 | 63,906.75 | 0.07 |
| USD AMERICAN TOWER | 1,358 | 295,664.50 | 0.35 |
| USD AMERICAN WATER WORKS | 561 | 67,114.64 | 0.08 |
| USD AMERICOLD REALTY TRUST | 328 | 11,151.20 | 0.01 |
| USD AMERIPRISE FINANCIAL | 382 | 39,107.50 | 0.05 |
| USD AMERISOURCEBERGEN | 465 | 41,145.61 | 0.05 |
| USD AMGEN | 1,885 | 382,175.52 | 0.45 |
| AUD AMP | 6,203 | 5,068.50 | 0.01 |
| NZD AMP NZ OFFICE TRUST | 1,685 | 1,703.52 | 0.00 |
| JPY ANA HOLDINGS | 185 | 4,512.94 | 0.01 |
| EUR ANDRITZ | 200 | 6,265.28 | 0.01 |
| USD AON | 720 | 118,909.10 | 0.14 |
| AUD APA GROUP | 2,181 | 13,693.75 | 0.02 |
| USD APACHE | 1,042 | 4,357.20 | 0.01 |
| USD APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO -A- | 252 | 8,848.53 | 0.01 |
| USD APPLE | 386 | 98,195.43 | 0.11 |
| USD APPLE HOSPITALITY REIT | 357 | 3,274.43 | 0.00 |
| USD APPLIED MATERIALS | 2,847 | 130,442.56 | 0.15 |
| USD APTIV PLC | 769 | 37,865.93 | 0.04 |
| USD ARAMARK HOLDINGS | 833 | 16,643.38 | 0.02 |
| USD ARCH CAPITAL GROUP | 1,241 | 35,315.22 | 0.04 |
| USD ARCONIC (reg shares) | 1,164 | 18,685.82 | 0.02 |
| USD ARMADA HOFFLER PROPERTIES | 93 | 993.97 | 0.00 |
| EUR AROUNDTOWN PROPERTY HOLDINGS | 1,868 | 9,333.04 | 0.01 |
| USD ARTHUR J. GALLAGHER | 562 | 45,799.40 | 0.05 |
| CAD ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 210 | 1,179.14 | 0.00 |
| JPY ASAHI GLASS | 291 | 7,156.98 | 0.01 |
| JPY ASAHI KASEI | 2,030 | 14,382.72 | 0.02 |
| EUR ASCENCIO | 8 | 357.14 | 0.00 |
| SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,957 | 19,790.12 | 0.02 |
| HKD ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 564 | 5,282.18 | 0.01 |
| EUR ASML HOLDING | 1,329 | 353,510.79 | 0.42 |
| EUR ASSICURAZIONI GENERALI | 2,978 | 40,545.43 | 0.05 |
| GBP ASSOCIATED BRITISH FOODS | 761 | 17,117.17 | 0.02 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| GBP ASSURA | 3,665 | 3,795.07 | 0.00 | USD CELANESE -A- | 363 | 26,670.37 | 0.03 |
| USD ASSURANT | 183 | 19,037.92 | 0.02 | CHF CEMBRA MONEY (reg. shares) | 48 | 4,388.73 | 0.01 |
| JPY ASTELLAS PHARMA | 3,075 | 47,602.40 | 0.05 | USD CENTENE | 1,798 | 106,822.37 | 0.12 |
| AUD ASX | 358 | 16,894.64 | 0.02 | JPY CENTRAL JAPAN RAILWAY | 236 | 37,898.31 | 0.04 |
| EUR ATOS | 282 | 19,114.79 | 0.02 | USD CENTURYLINK | 2,883 | 27,274.16 | 0.03 |
| SEK ATRIUM LJUNGBERG AB | 71 | 1,104.88 | 0.00 | USD CERNER | 974 | 61,355.12 | 0.07 |
| USD AT&T | 751 | 21,877.69 | 0.03 | USD C.H. ROBINSON WORLDWIDE | 398 | 26,319.73 | 0.03 |
| NZD AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT | 1,795 | 5,309.65 | 0.01 | HKD CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,086 | 1,863.62 | 0.00 |
| AUD AURIZON HOLDINGS | 3,681 | 9,530.88 | 0.01 | USD CHARLES SCHWAB | 3,545 | 119,194.64 | 0.14 |
| AUD AUSNET SERVICES | 3,407 | 3,565.75 | 0.00 | AUD CHARTER HALL LONG WALE REIT | 703 | 1,889.22 | 0.00 |
| AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP | 5,305 | 55,065.06 | 0.06 | AUD CHARTER HALL RETAIL | 582 | 1,107.45 | 0.00 |
| USD AUTODESK | 677 | 105,616.32 | 0.12 | CAD CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES (units) | 378 | 2,378.99 | 0.00 |
| USD AVALONBAY COMMUNITIES | 238 | 35,000.95 | 0.04 | USD CHATHAM LODGING TRUST | 78 | 464.42 | 0.00 |
| USD AVERY DENNISON | 252 | 25,625.72 | 0.03 | USD CHENIERE ENERGY | 709 | 23,738.33 | 0.03 |
| GBP AVIVA | 8,367 | 27,856.18 | 0.03 | USD CHEVRON | 673 | 48,769.06 | 0.06 |
| EUR AXA | 6,141 | 106,380.35 | 0.12 | CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI | 0 | 2,318.87 | 0.00 |
| USD AXALTA COATING SYSTEMS | 589 | 10,176.72 | 0.01 | CAD CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE | 435 | 3,950.40 | 0.00 |
| USD BAKER HUGHES A GE CO | 2,041 | 21,430.16 | 0.02 | INVESTMENT TRUST | | | |
| USD BALL | 933 | 60,333.22 | 0.07 | USD CHUBB N | 1,393 | 155,574.67 | 0.18 |
| CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares) | 70 | 9,187.20 | 0.01 | JPY CHUGAI PHARMACEUTICAL | 363 | 42,086.20 | 0.05 |
| EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA (reg. shares) | 19,111 | 61,137.61 | 0.07 | JPY CHUO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 534 | 15,446.79 | 0.02 |
| EUR BANCO DE SABADELL (reg. shares) | 16,111 | 8,291.01 | 0.01 | CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares) | 375 | 20,591.40 | 0.02 |
| EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares) | 4,019 | 0.00 | 0.00 | USD CIGNA CORP | 1,147 | 203,224.22 | 0.23 |
| USD BANK OF AMERICA | 908 | 19,274.48 | 0.02 | USD CISCO SYSTEMS | 678 | 26,647.86 | 0.03 |
| USD BANK OF NEW YORK MELLON | 2,580 | 86,887.30 | 0.10 | USD CITIGROUP | 228 | 9,585.56 | 0.01 |
| EUR BANKINTER (reg. shares) | 1,931 | 7,085.00 | 0.01 | USD CITIZENS FINANCIAL GROUP | 1,311 | 24,667.02 | 0.03 |
| GBP BARRATT DEVELOPMENTS | 2,175 | 11,892.32 | 0.01 | USD CITRIX SYSTEMS | 401 | 56,801.42 | 0.07 |
| CHF BARRY CALLEBAUT (reg. shares) | 1 | 1,772.26 | 0.00 | SGD CITY DEVELOPMENTS | 1,580 | 8,035.93 | 0.01 |
| EUR BASF (reg. shares) | 2,924 | 138,420.76 | 0.16 | EUR CITYCON OYJ | 118 | 725.93 | 0.00 |
| USD BECTON DICKINSON | 830 | 190,679.44 | 0.22 | GBP CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 964 | 1,151.92 | 0.00 |
| EUR BEFIMMO SICAFI | 33 | 1,596.97 | 0.00 | HKD CK ASSET HOLDINGS LTD | 4,234 | 23,188.35 | 0.03 |
| EUR BEIERSDORF | 289 | 29,311.08 | 0.03 | CHF CLARIANT (reg. shares) | 303 | 5,095.42 | 0.01 |
| AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 909 | 3,488.75 | 0.00 | USD CLOROX | 378 | 65,472.61 | 0.08 |
| JPY BENESSE HOLDING | 116 | 2,953.97 | 0.00 | HKD CLP HOLDINGS | 3,042 | 28,060.16 | 0.03 |
| GBP BERKELEY GROUP HOLDINGS | 255 | 11,432.29 | 0.01 | USD CME GROUP -A- | 1,099 | 190,083.51 | 0.22 |
| USD BEST BUY | 720 | 41,014.97 | 0.05 | USD CMS ENERGY | 876 | 51,492.23 | 0.06 |
| GBP BIG YELLOW GROUP | 238 | 2,959.66 | 0.00 | EUR CNH Industrial N.V. (reg. shares) | 2,909 | 16,647.57 | 0.02 |
| USD BIOGEN | 553 | 175,109.59 | 0.20 | EUR CNP ASSURANCES | 471 | 4,610.49 | 0.01 |
| USD BIOMARIN PHARMACEUTICAL | 555 | 46,912.35 | 0.05 | USD COCA-COLA | 13,204 | 584,262.65 | 0.68 |
| USD BLACKROCK | 355 | 156,358.06 | 0.18 | AUD COCA-COLA AMATIL | 937 | 5,068.28 | 0.01 |
| AUD BLUESCOPE STEEL | 951 | 5,023.44 | 0.01 | EUR COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 42 | 1,594.70 | 0.00 |
| EUR BMW | 949 | 49,060.05 | 0.06 | USD COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PL | 612 | 22,954.21 | 0.03 |
| EUR BMW (pref. shares) | 163 | 6,998.41 | 0.01 | GBP COCA-COLA HBC AG | 427 | 9,187.06 | 0.01 |
| EUR BNP PARIBAS -A- | 291 | 8,782.03 | 0.01 | AUD COCHLEAR | 107 | 12,264.44 | 0.01 |
| CAD BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 65 | 1,049.74 | 0.00 | EUR COFINIMMO SICAFI | 40 | 5,244.15 | 0.01 |
| HKD BOC HONG KONG | 6,845 | 18,943.43 | 0.02 | USD COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 1,656 | 76,970.48 | 0.09 |
| USD BOOKING HOLDINGS INC | 129 | 173,308.98 | 0.20 | AUD COLES GROUP LTD | 2,096 | 19,446.28 | 0.02 |
| AUD BORAL | 2,167 | 2,718.99 | 0.00 | USD COLGATE-PALMOLIVE | 2,500 | 165,912.00 | 0.19 |
| USD BORG WARNER | 608 | 14,817.36 | 0.02 | USD COLONY CAPITAL INC -A- | 824 | 1,442.21 | 0.00 |
| USD BOSTON PROPERTIES | 745 | 68,755.18 | 0.08 | EUR COLRUYT | 158 | 8,547.03 | 0.01 |
| EUR BOUYGUES | 642 | 18,809.73 | 0.02 | USD COLUMBIA PROPERTY TRUST | 198 | 2,474.76 | 0.00 |
| AUD BRAMBLES | 2,887 | 18,657.91 | 0.02 | USD COMERICA | 505 | 14,826.78 | 0.02 |
| USD BRANDYWINE REALTY TRUST | 301 | 3,166.73 | 0.00 | JPY COMFORIA RESIDENTIAL REIT | 1 | 2,772.73 | 0.00 |
| JPY BRIDGESTONE | 928 | 28,578.40 | 0.03 | CAD COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 311 | 1,774.05 | 0.00 |
| USD BRISTOL MYERS SQUIBB | 7,192 | 400,885.44 | 0.47 | EUR COMMERZBANK | 2,869 | 10,413.77 | 0.01 |
| GBP BRITISH LAND | 3,330 | 13,881.74 | 0.02 | AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 3,306 | 125,094.38 | 0.14 |
| USD BRIXMOR PROPERTY GROUP | 505 | 4,794.61 | 0.01 | GBP COMPASS GROUP PLC | 3,412 | 53,480.81 | 0.06 |
| USD BROOKFIELD PROPERTY REIT INC -A- | 112 | 948.13 | 0.00 | AUD COMPUTERSHARE | 904 | 5,371.89 | 0.01 |
| GBP BT GROUP | 17,943 | 26,231.21 | 0.03 | USD CONOCOPHILLIPS | 3,405 | 104,865.48 | 0.12 |
| USD BUNGE | 417 | 17,116.59 | 0.02 | USD CONSOLIDATED EDISON | 1,034 | 80,662.71 | 0.09 |
| AUD BUNNINGS WAREHOUSE PROPERTY TRUST | 775 | 1,588.14 | 0.00 | USD COPART | 630 | 43,178.27 | 0.05 |
| GBP BURBERRY GROUP | 879 | 14,435.43 | 0.02 | USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 190 | 4,215.17 | 0.00 |
| USD CADENCE DESIGN SYSTEMS | 876 | 57,835.79 | 0.07 | USD COSTCO WHOLESALE | 46 | 13,115.89 | 0.02 |
| EUR CA-IMMOBILIEN ANLAGEN | 107 | 3,604.61 | 0.00 | USD COUSINS PROPERTIES INC | 248 | 7,249.14 | 0.01 |
| EUR CAIXABANK | 10,286 | 19,187.27 | 0.02 | EUR COVESTRO | 129 | 3,947.20 | 0.00 |
| USD CAMDEN PROPERTY TRUST | 463 | 36,694.54 | 0.04 | EUR COVIVIO FONCIERE DES REGIONS | 72 | 4,040.33 | 0.00 |
| USD CAMPBELL SOUP | 499 | 23,034.67 | 0.03 | EUR CREDIT AGRICOLE | 3,307 | 24,276.85 | 0.03 |
| CAD CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 288 | 8,605.92 | 0.01 | EUR CRH PLC | 2,267 | 61,807.10 | 0.07 |
| SGD CAPITACOMMERCIAL TRUST (units) | 9,283 | 9,974.82 | 0.01 | GBP CRODA INTERNATIONAL PLC | 275 | 14,540.84 | 0.02 |
| GBP CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES | 1,142 | 2,348.34 | 0.00 | CAD CROMBIE | 151 | 1,314.79 | 0.00 |
| SGD CAPITALAND | 8,673 | 17,360.14 | 0.02 | AUD CROMWELL PROPERTY GROUP | 3,804 | 1,862.69 | 0.00 |
| SGD CAPITAMALL TRUST | 8,543 | 10,739.56 | 0.01 | CHF CS GROUP (reg. shares) | 1,873 | 15,482.76 | 0.02 |
| USD CAPRI HOLDINGS LTD | 444 | 4,787.62 | 0.01 | AUD CSL | 846 | 153,672.06 | 0.18 |
| USD CARDINAL HEALTH | 884 | 42,372.67 | 0.05 | USD CSX | 2,278 | 130,512.75 | 0.15 |
| USD CARETRUST REIT | 162 | 2,400.43 | 0.00 | USD CUBESMART | 330 | 8,831.65 | 0.01 |
| USD CARMAX | 468 | 25,209.46 | 0.03 | USD CUMMINS | 455 | 61,556.25 | 0.07 |
| EUR CARMILA SA | 58 | 826.86 | 0.00 | GBP CUSTODIAN REIT | 613 | 752.22 | 0.00 |
| EUR CARREFOUR | 1,738 | 27,489.60 | 0.03 | JPY CYBERAGENT | 162 | 6,282.13 | 0.01 |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON | 149 | 5,731.46 | 0.01 | USD CYRUSONE | 193 | 11,946.29 | 0.01 |
| JPY CASIO COMPUTER | 311 | 4,367.93 | 0.01 | JPY DAI NIPPON PRINTING | 391 | 8,327.40 | 0.01 |
| SEK CASTELLUM | 418 | 7,095.22 | 0.01 | JPY DAICEL CORP | 400 | 2,922.88 | 0.00 |
| SEK CATENA AB | 39 | 1,130.84 | 0.00 | JPY DAIFUKU | 164 | 10,398.34 | 0.01 |
| USD CATERPILLAR | 2,373 | 275,364.02 | 0.33 | JPY DAIKIN INDUSTRIES | 412 | 50,213.43 | 0.06 |
| USD CBOE HOLDINGS | 334 | 29,794.00 | 0.03 | JPY DAIWA HOUSE INDUSTRY | 911 | 22,593.59 | 0.03 |
| USD CBRE GROUP | 974 | 36,725.43 | 0.04 | JPY DAIWA OFFICE INVESTMENT | 0 | 2,359.38 | 0.00 |
| SGD CDL HOSPITALITY TRUST (stapled security) | 1,234 | 693.22 | 0.00 | JPY DAIWAHSE RESIDENTIAL INVESTMENT | 3 | 7,597.31 | 0.01 |
| | | | | EUR DANONE | 1,769 | 113,831.84 | 0.13 |
| | | | | USD DARDEN RESTAURANTS | 383 | 20,845.55 | 0.02 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| SGD DBS GROUP HOLDINGS | 3,345 | 43,631.85 | 0.05 | AUD FORTESCUE METALS GROUP | 2,563 | 15,685.69 | 0.02 |
| GBP DCC | 210 | 13,285.86 | 0.02 | USD FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 439 | 18,990.22 | 0.02 |
| USD DEERE & CO | 923 | 127,454.80 | 0.15 | HKD FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,113 | 1,957.41 | 0.00 |
| USD DELL TECHNOLOGIES INC | 488 | 19,312.09 | 0.02 | USD FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 115 | 2,159.92 | 0.00 |
| USD DELTA AIR LINES | 516 | 14,716.76 | 0.02 | USD FRANKLIN RESOURCES | 900 | 15,023.43 | 0.02 |
| JPY DENSO | 698 | 22,567.75 | 0.03 | USD FRANKLIN STREET PROPERTIES | 178 | 1,018.05 | 0.00 |
| USD DENTSPLY SIRONA | 717 | 27,847.69 | 0.03 | EUR FRAPORT | 114 | 4,623.12 | 0.01 |
| GBP DERWENT LONDON | 156 | 6,315.21 | 0.01 | SGD FRASERS CENTREPOINT TRUST | 1,111 | 1,748.06 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares) | 544 | 74,617.47 | 0.09 | SGD FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 2,607 | 1,620.35 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE EUROSHOP (reg. shares) | 81 | 926.06 | 0.00 | EUR FRESINIUS | 177 | 6,590.15 | 0.01 |
| EUR DEUTSCHE POST (reg. shares) | 2,834 | 77,043.05 | 0.09 | JPY FRONTIER REAL ESTATE INVESTMENT | 1 | 2,009.03 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares) | 775 | 10,040.64 | 0.01 | JPY FUJITSU | 319 | 28,867.55 | 0.03 |
| EUR DEUTSCHE WOHNEN (reg. shares) | 1,587 | 60,428.11 | 0.07 | JPY FUKUOKA REIT | 1 | 1,180.22 | 0.00 |
| USD DEVON ENERGY | 1,039 | 7,177.34 | 0.01 | EUR GALP ENERGIA -B- | 1,437 | 16,386.93 | 0.02 |
| USD DEXCOM | 285 | 76,625.91 | 0.09 | USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES | 346 | 9,574.51 | 0.01 |
| AUD DEXUS PROPERTY GROUP (stapled security) | 3,745 | 20,837.42 | 0.02 | USD GAP | 607 | 2,222.29 | 0.00 |
| USD DIAMONDROCK HOSPITALITY | 353 | 1,794.84 | 0.00 | USD GARMIN (reg. shares) | 405 | 30,351.85 | 0.04 |
| USD DIGITAL REALTY | 446 | 62,002.69 | 0.07 | GBP GCP STUDENT LIVING | 708 | 1,167.66 | 0.00 |
| SEK DIOS FASTIGHETER | 129 | 864.85 | 0.00 | CHF GEBERIT | 18 | 8,046.58 | 0.01 |
| USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 946 | 33,728.87 | 0.04 | EUR GECINA | 211 | 27,993.11 | 0.03 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -A- | 442 | 8,592.70 | 0.01 | USD GENERAL MILLS | 1,862 | 98,278.23 | 0.01 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -C- | 1,143 | 20,050.61 | 0.02 | USD GENUINE PARTS | 438 | 29,469.78 | 0.03 |
| USD DOMINION RESOURCES | 2,519 | 181,813.42 | 0.21 | EUR GETLINK SE | 1,260 | 15,191.74 | 0.02 |
| USD DOMINO'S PIZZA | 117 | 37,848.07 | 0.04 | USD GETTY REALTY | 56 | 1,325.32 | 0.00 |
| USD DOUGLAS EMMETT | 282 | 8,611.09 | 0.01 | USD GILEAD SCIENCES | 3,880 | 290,061.69 | 0.34 |
| USD DOVER | 443 | 37,186.63 | 0.04 | CHF GIVAUDAN (reg. shares) | 8 | 25,850.42 | 0.03 |
| USD DOW INC | 685 | 20,025.39 | 0.02 | GBP GLAXOSMITHKLINE | 10,735 | 201,601.70 | 0.23 |
| CAD DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 186 | 1,227.55 | 0.00 | USD GLOBAL NET LEASE | 160 | 2,134.09 | 0.00 |
| CAD DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 86 | 1,408.68 | 0.00 | JPY GLOBAL ONE REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 1,276.63 | 0.00 |
| USD DTE ENERGY | 592 | 56,234.19 | 0.06 | JPY GLP J-REIT | 6 | 6,418.35 | 0.01 |
| CHF DUFREY | 12 | 361.36 | 0.00 | USD GOLDMAN SACHS GROUP | 298 | 46,034.96 | 0.05 |
| USD DUKE REALTY | 1,765 | 57,147.66 | 0.07 | AUD GOODMAN GROUP (stapled security) | 3,043 | 22,533.04 | 0.03 |
| USD E TRADE FINANCIAL | 682 | 23,390.14 | 0.03 | NZD GOODMAN PROPERTY TRUST | 1,748 | 2,222.93 | 0.00 |
| JPY EAST JAPAN RAILWAY | 492 | 37,236.91 | 0.04 | AUD GPT GROUP (stapled security) | 6,655 | 14,786.39 | 0.02 |
| USD EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 126 | 3,096.75 | 0.00 | GBP GRAINGER | 934 | 3,002.58 | 0.00 |
| USD EASTGROUP PROPERTIES | 65 | 6,813.87 | 0.01 | EUR GRAND CITY PROPERTIES | 171 | 3,595.77 | 0.00 |
| USD EAST-WEST BANCORP | 426 | 10,966.36 | 0.01 | CAD GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT (units) | 92 | 3,747.76 | 0.00 |
| GBP EASYJET | 339 | 2,403.10 | 0.00 | GBP GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 393 | 3,323.66 | 0.00 |
| USD EATON | 1,253 | 97,344.26 | 0.11 | CHF GURIT-HEBERLEIN | 1 | 1,515.22 | 0.00 |
| USD ECOLAB | 799 | 124,438.38 | 0.14 | EUR HAMBORNER REIT | 109 | 973.73 | 0.00 |
| USD EDISON INTERNATIONAL | 1,083 | 59,327.30 | 0.07 | GBP HAMMERSON | 1,181 | 1,132.89 | 0.00 |
| EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares) | 7,329 | 29,415.14 | 0.03 | HKD HANG LUNG PROPERTIES | 3,197 | 6,492.20 | 0.01 |
| USD EDWARDS LIFESCIENCES | 641 | 120,867.89 | 0.14 | HKD HANG SENG BANK | 1,415 | 24,190.67 | 0.03 |
| EUR EIFFAGE | 224 | 15,886.73 | 0.02 | USD HANNESBRANDS | 1,058 | 8,328.68 | 0.01 |
| JPY EISAI | 407 | 29,904.29 | 0.03 | USD HARLEY-DAVIDSON | 543 | 10,272.92 | 0.01 |
| USD ELECTRONIC ARTS | 902 | 90,345.28 | 0.10 | USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 1,093 | 38,522.58 | 0.04 |
| USD EMPIRE STATE REALTY TRUST -A- | 257 | 2,301.53 | 0.00 | AUD HARVEY NORMAN HOLDINGS | 1,040 | 1,877.50 | 0.00 |
| GBP EMPRIE STUDENT | 929 | 761.66 | 0.00 | USD HASBRO | 412 | 29,462.34 | 0.03 |
| CHF EMS-CHEMIE HOLDING | 2 | 1,479.58 | 0.00 | USD HCA HOLDINGS | 824 | 74,078.73 | 0.09 |
| EUR ENAGAS | 713 | 14,157.85 | 0.02 | USD HEALTHCARE REALTY TRUST | 224 | 6,248.09 | 0.01 |
| NOK ENTRA ASA | 260 | 3,072.05 | 0.00 | USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA -A- | 366 | 8,890.51 | 0.01 |
| EUR E.ON (reg. shares) | 6,429 | 66,598.00 | 0.08 | USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 2,403 | 57,313.48 | 0.07 |
| USD EPR PROPERTIES | 132 | 3,208.13 | 0.00 | EUR HEIDELBERGCEMENT | 428 | 18,341.51 | 0.02 |
| USD EQUINIX | 261 | 163,231.33 | 0.19 | GBP HELICAL | 150 | 652.05 | 0.00 |
| USD EQUITABLE HOLDINGS INC | 1,381 | 19,959.31 | 0.02 | EUR HENKEL | 298 | 21,988.81 | 0.03 |
| USD EQUITY COMMONWEALTH | 205 | 6,499.63 | 0.01 | EUR HENKEL (pref. shares) | 511 | 41,031.33 | 0.05 |
| USD EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 295 | 16,979.28 | 0.02 | USD HENRY JACK & ASSOCIATES | 242 | 37,494.34 | 0.04 |
| USD EQUITY RESIDENTIAL | 625 | 38,585.33 | 0.04 | USD HENRY SCHEIN | 435 | 21,999.17 | 0.03 |
| USD ERIE INDEMNITY -A- | 82 | 12,224.25 | 0.01 | USD HESS | 889 | 29,610.08 | 0.03 |
| USD ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TR | 155 | 2,026.21 | 0.00 | USD HEWLETT-PACKARD | 3,939 | 38,247.63 | 0.04 |
| USD ESSEX PROPERTY TRUST | 112 | 24,626.65 | 0.03 | CHF HIAG IMMOBILIEN HOLDING (reg shares) | 4 | 401.97 | 0.00 |
| EUR ESSILORLUXOTTICA | 813 | 87,707.95 | 0.10 | EUR HIBERNIA REIT -144A- (reg. shares) | 1,054 | 1,228.54 | 0.00 |
| USD ESTEE LAUDER COMPANIES -A- | 670 | 106,739.12 | 0.12 | USD HIGHWOODS PROPERTIES | 174 | 6,148.85 | 0.01 |
| EUR EURAZEO | 108 | 4,874.80 | 0.01 | USD HILTON WORLDWIDE HOLDINGS (reg. shares) | 825 | 56,304.02 | 0.06 |
| EUR EUROCOMMERCIAL (cert. shares) | 76 | 736.65 | 0.00 | JPY HINO MOTORS | 459 | 2,469.35 | 0.00 |
| EUR EURONEXT NV | 92 | 6,827.86 | 0.01 | JPY HIROSE ELECTRIC | 54 | 5,581.11 | 0.01 |
| USD EVERSOURCE ENERGY | 1,008 | 78,858.79 | 0.09 | JPY HITACHI CHEMICAL | 166 | 7,073.52 | 0.01 |
| EUR EXOR HOLDING | 311 | 16,041.96 | 0.02 | JPY HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY | 172 | 3,493.54 | 0.00 |
| USD EXPEDIA | 412 | 23,161.77 | 0.03 | JPY HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES | 111 | 8,184.75 | 0.01 |
| USD EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON | 516 | 34,401.03 | 0.04 | JPY HITACHI METALS | 343 | 3,623.81 | 0.00 |
| USD EXTRA SPACE STORAGE | 215 | 20,554.32 | 0.02 | HKD HKEX | 2,240 | 67,580.26 | 0.08 |
| USD EXXON MOBIL | 678 | 25,739.49 | 0.03 | HKD HKT (stapled security) | 7,007 | 9,545.95 | 0.01 |
| SEK FABEGE AB | 410 | 5,261.87 | 0.01 | USD HOLLYFRONTIER | 432 | 10,587.91 | 0.01 |
| USD FACTSET RESEARCH SYSTEMS | 122 | 31,691.51 | 0.04 | USD HOLOGIC | 814 | 28,570.70 | 0.03 |
| JPY FAST RETAILING | 95 | 38,856.54 | 0.04 | USD HOME DEPOT | 3,706 | 692,033.77 | 0.81 |
| USD FASTENAL | 1,789 | 55,919.19 | 0.06 | JPY HONDA MOTOR | 2,684 | 60,418.47 | 0.07 |
| SEK FASTIGHETS BALDER -B- | 151 | 5,424.78 | 0.01 | HKD HONG KONG & CHINA GAS | 18,775 | 30,957.42 | 0.04 |
| EUR FAURECIA | 139 | 4,154.38 | 0.00 | USD HONGKONG LAND HOLDINGS | 1,823 | 6,837.67 | 0.01 |
| USD FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 348 | 25,941.62 | 0.03 | USD HORMEL FOODS | 880 | 41,040.15 | 0.05 |
| GBP FERGUSON | 489 | 30,675.91 | 0.04 | USD HOST HOTELS AND RESORTS | 3,350 | 36,981.80 | 0.04 |
| EUR FERROVIAL | 1,398 | 33,552.34 | 0.04 | USD HP | 4,586 | 79,619.07 | 0.09 |
| USD FIFTH THIRD BANCORP | 2,172 | 32,261.49 | 0.04 | CAD H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UNITS | 487 | 3,057.05 | 0.00 |
| USD FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST | 218 | 7,246.81 | 0.01 | USD HUDSON PACIFIC | 258 | 6,538.02 | 0.01 |
| USD FIRST REPUBLIC BANK | 507 | 41,751.03 | 0.05 | SEK HUFVUDSTADEN -A- | 170 | 2,324.14 | 0.00 |
| NZD FLETCHER BUILDING | 1,579 | 3,276.24 | 0.00 | JPY HULIC | 1,054 | 10,718.61 | 0.01 |
| USD FLOWSERVE | 384 | 9,171.97 | 0.01 | JPY HULIC REIT | 2 | 2,120.18 | 0.00 |
| CHF FLUGHAFEN ZUERICH | 7 | 826.19 | 0.00 | USD HUMANA | 407 | 127,706.12 | 0.15 |
| | | | | USD HUNTINGTON BANCSHARES | 3,048 | 25,024.31 | 0.03 |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| HKD HYSAN DEVELOPMENT | 960 | 3,121.38 | 0.00 | USD KILROY REALTY | 177 | 11,304.07 | 0.01 |
| EUR IBERDROLA | 21,028 | 207,286.87 | 0.25 | USD KIMBERLY-CLARK | 1,052 | 134,533.42 | 0.16 |
| USD IBM | 3,301 | 366,217.58 | 0.43 | USD KIMCO REALTY | 703 | 6,802.40 | 0.01 |
| EUR ICADE | 49 | 3,911.18 | 0.00 | USD KINDER MORGAN | 6,208 | 86,416.25 | 0.10 |
| JPY ICHIGO REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 1,301.33 | 0.00 | GBP KINGFISHER | 4,507 | 8,042.71 | 0.01 |
| USD IDEX | 230 | 31,716.33 | 0.04 | EUR KINGSPAN GROUP | 441 | 23,579.74 | 0.03 |
| USD IDEXX LABORATORIES | 268 | 65,028.56 | 0.07 | USD KITE REALTY GROUP TRUST | 141 | 1,335.51 | 0.00 |
| CHF IDORSIA LTD | 50 | 1,292.11 | 0.00 | NZD KIWI PROPERTY | 2,429 | 1,353.63 | 0.00 |
| EUR IGD SIIQ (reg shares) | 102 | 417.94 | 0.00 | USD KKR & CO INC -A- | 1,533 | 35,970.48 | 0.04 |
| USD IHS MARKIT | 1,189 | 71,346.68 | 0.08 | EUR KLEPIERRE | 863 | 16,633.74 | 0.02 |
| USD ILLINOIS TOOL WORKS | 992 | 141,007.66 | 0.16 | SEK KLOVERN -B- | 793 | 1,182.83 | 0.00 |
| GBP IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 381 | 431.99 | 0.00 | JPY KOBAYASHI PHARMACEUTICAL | 79 | 7,309.66 | 0.01 |
| USD INDEPENDENCE REALTY TRUST | 160 | 1,425.47 | 0.00 | USD KOHL'S | 469 | 6,841.74 | 0.01 |
| EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX | 3,128 | 81,196.73 | 0.09 | EUR KOJAMO OYJ | 279 | 5,299.19 | 0.01 |
| JPY INDUSTRIAL & INFRASTRUCTURE FUND INVESTMENT | 3 | 3,504.71 | 0.00 | JPY KOMATSU | 1,502 | 24,750.64 | 0.03 |
| USD INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIE | 110 | 1,928.25 | 0.00 | JPY KONAMI | 150 | 4,591.86 | 0.01 |
| EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares) | 4,092 | 60,299.93 | 0.07 | EUR KONE -B- | 93 | 5,290.64 | 0.01 |
| GBP INFORMA | 2,674 | 14,675.02 | 0.02 | JPY KONICA MINOLTA | 727 | 2,958.23 | 0.00 |
| EUR ING GROUP | 12,385 | 64,979.01 | 0.07 | EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | 3,654 | 85,338.83 | 0.10 |
| EUR INGENICO GROUP | 174 | 18,455.95 | 0.02 | EUR KONINKLIJKE DSM | 520 | 59,028.54 | 0.07 |
| EUR INMOBILIARIA COLONIAL SA | 504 | 4,779.67 | 0.01 | EUR KONINKLIJKE KPN | 10,235 | 24,437.36 | 0.03 |
| USD INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTI | 28 | 2,094.43 | 0.00 | EUR KONINKLIJKE VOPAK | 201 | 10,474.24 | 0.01 |
| JPY INPEX | 1,646 | 9,281.57 | 0.01 | JPY KUBOTA | 1,687 | 21,589.90 | 0.02 |
| AUD INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 4,274 | 16,217.04 | 0.02 | CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL | 16 | 2,147.13 | 0.00 |
| USD INTEL | 14,024 | 758,990.69 | 0.89 | SEK KUNGSLEDEN | 292 | 2,214.04 | 0.00 |
| USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE | 1,708 | 137,923.54 | 0.16 | JPY KURARAY | 511 | 5,172.33 | 0.01 |
| GBP INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 369 | 16,102.82 | 0.02 | JPY KURITA WATER INDUSTRIES | 159 | 3,679.72 | 0.00 |
| USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | 318 | 32,474.19 | 0.04 | JPY KYOCERA | 522 | 30,958.41 | 0.04 |
| USD INTERNATIONAL PAPER | 1,135 | 35,319.27 | 0.04 | JPY KYUSHU RAILWAY COMPANY | 260 | 7,462.49 | 0.01 |
| CAD INTERRENT REAL ESTATE INVESTME | 194 | 1,810.00 | 0.00 | USD LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 304 | 38,404.11 | 0.04 |
| GBP INTERTEK GROUP | 345 | 20,202.11 | 0.02 | CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares) | 464 | 16,967.09 | 0.02 |
| EUR INTERVEST OFFICES | 35 | 918.73 | 0.00 | USD LAM RESEARCH | 448 | 107,489.81 | 0.12 |
| EUR INTESA SANPAOLO | 40,305 | 65,823.62 | 0.08 | GBP LAND SECURITIES GROUP PLC | 1,106 | 7,638.20 | 0.01 |
| GBP INTU PROPERTIES PLC | 1,377 | 76.06 | 0.00 | CHF LANDIS+GYR GROUP AG | 37 | 2,524.03 | 0.00 |
| USD INTUIT | 798 | 183,613.76 | 0.21 | EUR LAR ESPANA | 93 | 409.46 | 0.00 |
| USD INVESCO | 1,326 | 12,039.69 | 0.01 | JPY LASALLE LOGIPORT | 2 | 2,917.95 | 0.00 |
| USD INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 20 | 1,123.59 | 0.00 | JPY LAWSON | 81 | 4,445.47 | 0.01 |
| JPY INVINCIBLE INVESTMENT | 8 | 1,726.54 | 0.00 | EUR LEASINVEST REAL ESTATE | 4 | 351.43 | 0.00 |
| USD INVITATION HOMES (reg. shares) | 914 | 19,521.68 | 0.02 | EUR LEG IMMOBILIEN (reg. shares) | 107 | 12,082.37 | 0.01 |
| USD IQVIA HOLDINGS INC | 497 | 53,607.75 | 0.06 | GBP LEGAL & GENERAL GROUP | 12,741 | 30,625.12 | 0.04 |
| EUR IRISH RESIDENT | 674 | 901.60 | 0.00 | EUR LEGRAND | 181 | 11,617.27 | 0.01 |
| USD IRON MOUNTAIN REIT | 843 | 20,068.54 | 0.02 | AUD LENDLEASE GROUP | 1,043 | 6,076.18 | 0.01 |
| GBP ITV | 7,739 | 6,335.20 | 0.01 | USD LENNOX INTERNATIONAL | 104 | 18,987.49 | 0.02 |
| GBP J. SAINSBURY | 3,780 | 9,862.26 | 0.01 | USD LEXINGTON REALITY TRUST | 408 | 4,055.53 | 0.00 |
| JPY JAPAN EXCELLENT | 2 | 2,321.77 | 0.00 | USD LIBERTY BROADB c -C- | 333 | 36,819.94 | 0.04 |
| JPY JAPAN HOTEL REIT INVESTMENT | 7 | 2,044.09 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -A- | 423 | 6,988.13 | 0.01 |
| JPY JAPAN LOGISTICS | 1 | 3,007.35 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -C- | 1,344 | 21,109.52 | 0.02 |
| JPY JAPAN PRIME REALTY INVESTMENT | 1 | 4,002.67 | 0.00 | USD LIFE STORAGE | 80 | 7,601.57 | 0.01 |
| JPY JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 11,972.38 | 0.01 | USD LINCOLN NATIONAL | 588 | 15,475.11 | 0.02 |
| JPY JAPAN RENTAL HOUSING INVESTMENTS | 2 | 2,003.53 | 0.00 | USD LINDE PLC | 1,651 | 285,654.02 | 0.34 |
| JPY JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT | 8 | 9,487.51 | 0.01 | CHF LINDT & SPRUENGLI | 1 | 8,128.95 | 0.01 |
| SGD JARDINE CYCLE & CARRIAGE | 185 | 2,549.62 | 0.00 | USD LKQ | 955 | 19,596.37 | 0.02 |
| USD JAZZ PHARMACEUTICALS | 166 | 16,588.12 | 0.02 | USD LOEWS | 799 | 27,837.75 | 0.03 |
| USD JBG SMITH PROPERTIES | 209 | 6,651.58 | 0.01 | CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares) | 154 | 6,669.14 | 0.01 |
| EUR JC DECAUX | 234 | 4,229.19 | 0.00 | GBP LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 677 | 61,068.16 | 0.07 |
| EUR JERONIMO MARTINS | 721 | 13,014.27 | 0.02 | GBP LONDONMETRIC PROPERTY | 1,263 | 2,753.69 | 0.00 |
| JPY JFE HOLDINGS | 789 | 5,138.41 | 0.01 | CHF LONZA GROUP (reg. shares) | 47 | 19,735.24 | 0.02 |
| USD JOHNSON & JOHNSON | 8,072 | 1,058,420.02 | 1.23 | EUR L'OREAL | 817 | 214,116.41 | 0.26 |
| USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 2,350 | 63,345.32 | 0.07 | USD LOWE'S COMPANIES | 2,367 | 203,716.76 | 0.24 |
| GBP JOHNSON MATTHEY | 413 | 9,216.77 | 0.01 | USD LTC PROPERTIES | 67 | 2,071.93 | 0.00 |
| USD JONES LANG LASALLE | 155 | 15,696.02 | 0.02 | USD LULULEMON ATHLETICA | 346 | 65,652.18 | 0.08 |
| USD JP MORGAN CHASE | 673 | 60,594.52 | 0.07 | EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 67 | 24,891.74 | 0.03 |
| CHF JULIUS BAER GRUPPE | 65 | 2,212.24 | 0.00 | GBP LXI REIT PLC | 800 | 1,079.07 | 0.00 |
| JPY KAJIMA | 721 | 7,409.56 | 0.01 | USD MACERICH | 239 | 1,346.38 | 0.00 |
| JPY KANSAI PAINT | 287 | 5,477.13 | 0.01 | USD MACK-CALI REALTY | 154 | 2,348.54 | 0.00 |
| USD KANSAS CITY SOUTHERN INDUSTRIES | 311 | 39,527.11 | 0.05 | AUD MACQUARIE GROUP | 626 | 32,855.63 | 0.04 |
| JPY KAO | 788 | 64,435.40 | 0.07 | USD MANPOWER | 160 | 8,494.12 | 0.01 |
| JPY KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES | 230 | 3,348.93 | 0.00 | USD MANULIFE US REAL ESTATE INVEST | 2,237 | 1,621.47 | 0.00 |
| EUR KBC GROUP | 717 | 33,039.13 | 0.04 | SGD MAPLETREE COMMERCIAL TRUST REIT (reg. shares) | 3,432 | 4,411.49 | 0.01 |
| JPY KDDI | 2,907 | 85,901.61 | 0.10 | SGD MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 2,411 | 4,115.16 | 0.00 |
| JPY KEIO CORP | 166 | 9,811.88 | 0.01 | SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 4,002 | 4,441.38 | 0.01 |
| USD KELLOGG | 768 | 46,049.47 | 0.05 | USD MARATHON OIL | 2,353 | 7,742.89 | 0.01 |
| JPY KENEDIX OFFICE INVESTMENT | 1 | 3,128.46 | 0.00 | USD MARATHON PETROLEUM (when issued) | 2,000 | 47,231.03 | 0.05 |
| JPY KENEDIX RESIDENTIAL INVESTMENT CORPORATION | 1 | 2,220.82 | 0.00 | GBP MARKS & SPENCER | 4,166 | 5,125.86 | 0.01 |
| JPY KENEDIYX RETAIL REIT | 1 | 1,141.82 | 0.00 | USD MARSH & MCLENNAN | 1,555 | 134,404.06 | 0.16 |
| USD KENNEDY-WILSON HOLDINGS | 214 | 2,865.68 | 0.00 | JPY MARUI | 307 | 5,154.51 | 0.01 |
| SGD KEPPPEL | 2,688 | 9,986.66 | 0.01 | USD MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 1,844 | 41,733.87 | 0.05 |
| SGD KEPPPEL DC REIT TRUST (reg. -S-) | 1,904 | 3,062.47 | 0.00 | USD MASCO | 850 | 29,387.32 | 0.03 |
| SGD KEPPPEL REIT | 3,112 | 2,076.68 | 0.00 | USD MASTERCARD | 2,843 | 686,760.26 | 0.80 |
| EUR KERING | 217 | 113,417.07 | 0.13 | USD MC CORMICK (non voting) | 389 | 54,911.23 | 0.06 |
| EUR KERRY GROUP -A- | 495 | 57,141.82 | 0.07 | USD MCDONALD'S | 2,683 | 443,615.60 | 0.52 |
| USD KEYCORP | 3,030 | 31,418.47 | 0.04 | JPY MCUBS MIDCITY INVESTMENT | 3 | 1,850.68 | 0.00 |
| JPY KEYENCE | 301 | 96,990.01 | 0.11 | USD MEDICAL PROPERTIES TRUST | 877 | 15,156.50 | 0.02 |
| USD KEYSIGHT TECHNOLOGIES. | 563 | 47,141.35 | 0.05 | EUR MEDIABANCA | 1,245 | 6,870.05 | 0.01 |
| JPY KIKKOMAN | 234 | 9,977.42 | 0.01 | USD MEDTRONIC | 138 | 12,444.76 | 0.01 |
| CAD KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 145 | 1,602.11 | 0.00 | GBP MEGGITT | 1,660 | 5,974.17 | 0.01 |
| | | | | USD MERCADOLIBRE | 139 | 68,104.03 | 0.08 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| EUR MERCIALYS | 96 | 693.70 | 0.00 | CHF NOVARTIS (reg. shares) | 1,695 | 139,894.19 | 0.16 |
| EUR MERCK | 370 | 38,027.89 | 0.04 | EUR NSI NV | 27 | 1,078.52 | 0.00 |
| USD MERCK & CO | 8,486 | 652,951.30 | 0.76 | JPY NSK | 574 | 3,686.82 | 0.00 |
| NZD MERIDIAN ENERGY | 2,374 | 5,685.50 | 0.01 | JPY NTT DOCOMO | 2,197 | 68,712.93 | 0.08 |
| EUR MERLIN PROPERTIES | 514 | 3,871.98 | 0.00 | USD NUCOR | 931 | 33,548.56 | 0.04 |
| EUR METRO AG | 494 | 4,265.90 | 0.00 | USD NVIDIA | 1,784 | 470,286.47 | 0.55 |
| EUR METSO | 301 | 7,181.60 | 0.01 | USD NVR | 11 | 28,339.86 | 0.03 |
| USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 73 | 50,496.04 | 0.06 | SEK NYFOSA AB | 247 | 1,249.23 | 0.00 |
| EUR MICHELIN (reg. shares) | 490 | 43,578.58 | 0.05 | JPY OBAYASHI | 1,041 | 8,930.10 | 0.01 |
| USD MICROSOFT | 22,804 | 3,596,394.54 | 4.16 | USD OCCIDENTAL PETROLEUM | 2,691 | 31,160.28 | 0.04 |
| USD MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 194 | 19,990.60 | 0.02 | JPY ODAKYU ELECTRIC RAILWAY | 477 | 10,470.08 | 0.01 |
| AUD MIRVAC GROUP | 13,419 | 17,165.88 | 0.02 | USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 81 | 2,213.92 | 0.00 |
| JPY MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 2,059 | 12,262.75 | 0.01 | USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 384 | 10,203.38 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI ELECTRIC | 2,966 | 36,676.26 | 0.04 | USD OMNICOM GROUP | 666 | 36,585.99 | 0.04 |
| JPY MITSUBISHI ESTATE | 3,732 | 55,139.34 | 0.06 | JPY OMRON | 309 | 16,121.01 | 0.02 |
| JPY MITSUBISHI MATERIALS | 180 | 3,699.77 | 0.00 | EUR OMV | 422 | 11,653.31 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE | 644 | 3,173.83 | 0.00 | USD ONEOK (new) | 1,244 | 27,139.13 | 0.03 |
| JPY MITSUI CHEMICALS | 296 | 5,628.16 | 0.01 | JPY ONO PHARMACEUTICAL | 611 | 14,064.86 | 0.02 |
| JPY MITSUI FUDOSAN | 2,915 | 50,510.89 | 0.06 | USD ORACLE | 249 | 12,051.89 | 0.01 |
| JPY MITUI FUDOSAN LOGISTICS PARK | 1 | 2,707.74 | 0.00 | EUR ORANGE | 5,720 | 69,887.94 | 0.08 |
| JPY MIZUHO FINANCIAL GROUP | 39,278 | 44,969.68 | 0.05 | AUD ORICA | 756 | 7,106.10 | 0.01 |
| CHF MOBIMO HOLDING | 10 | 2,807.32 | 0.00 | JPY ORIENTAL LAND | 323 | 41,402.58 | 0.05 |
| USD MOHAWK INDUSTRIES | 167 | 12,726.80 | 0.01 | AUD ORIGIN ENERGY | 3,257 | 8,730.00 | 0.01 |
| GBP MONDI | 1,037 | 17,760.91 | 0.02 | EUR ORION CORPORATION (new) -B- | 301 | 12,297.48 | 0.01 |
| USD MONMOUTH REAL ESTATE -A- | 160 | 1,932.76 | 0.00 | JPY ORIX | 2,152 | 25,924.84 | 0.03 |
| EUR MONTEA SCA | 19 | 1,802.91 | 0.00 | JPY ORIX JREIT | 4 | 5,433.95 | 0.01 |
| USD MOODY'S | 524 | 110,795.75 | 0.13 | JPY OSAKA GAS | 603 | 11,381.28 | 0.01 |
| JPY MORI HILLS REIT INVESTMENT CORP | 2 | 3,250.63 | 0.00 | JPY OTSUKA | 167 | 7,165.69 | 0.01 |
| JPY MORI TRUST SOGO REIT | 2 | 1,895.68 | 0.00 | SGD OVERSEA-CHINESE BANKING (reg. shares) | 6,162 | 37,392.32 | 0.04 |
| GBP MORRISON (W.M.) SUPERMARKETS | 5,127 | 11,315.71 | 0.01 | USD OWENS CORNING | 354 | 13,750.52 | 0.02 |
| USD MOSAIC | 1,008 | 10,908.09 | 0.01 | USD PACCAR | 1,077 | 65,857.53 | 0.08 |
| USD MOTOROLA SOLUTIONS | 532 | 70,758.95 | 0.08 | JPY PANASONIC | 3,590 | 27,434.68 | 0.03 |
| USD M&T BANK | 379 | 39,230.67 | 0.05 | SEK PANDOX -B- | 139 | 1,152.16 | 0.00 |
| HKD MTR | 2,837 | 14,659.40 | 0.02 | USD PARAMOUNT GROUP | 332 | 2,924.64 | 0.00 |
| EUR MTU AERO ENGINES | 197 | 28,755.61 | 0.03 | CHF PARGESA HOLDING | 11 | 735.41 | 0.00 |
| EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS- GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted) | 414 | 83,579.81 | 0.10 | USD PARK HOTELS & RESORTS | 406 | 3,208.95 | 0.00 |
| JPY MURATA MANUFACTURING | 936 | 47,436.66 | 0.05 | USD PARKER-HANNIFIN | 390 | 50,557.17 | 0.06 |
| JPY NABTESCO | 182 | 4,197.23 | 0.00 | JPY PARK24 | 188 | 2,767.58 | 0.00 |
| JPY NAGOYA RAILROAD | 303 | 8,494.18 | 0.01 | CHF PARTNERS GROUP | 20 | 13,709.67 | 0.02 |
| USD NASDAQ OMX GROUP | 341 | 32,359.34 | 0.04 | USD PAYPAL HOLDINGS | 114 | 10,894.13 | 0.01 |
| AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK | 5,396 | 55,083.38 | 0.06 | HKD PCCW | 7,834 | 4,315.65 | 0.00 |
| GBP NATIONAL GRID PLC | 7,488 | 87,894.88 | 0.10 | GBP PEARSON | 1,670 | 11,446.29 | 0.01 |
| USD NATIONAL HEALTH INVESTORS | 72 | 3,571.03 | 0.00 | USD PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 224 | 2,437.69 | 0.00 |
| USD NATIONAL OILWELL VARCO | 1,130 | 11,103.57 | 0.01 | USD PENTAIR | 509 | 15,142.33 | 0.02 |
| USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 292 | 9,400.41 | 0.01 | USD PEOPLES UNITED FINANCIAL | 1,494 | 16,505.79 | 0.02 |
| USD NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 101 | 2,987.94 | 0.00 | USD PEPSICO | 4,447 | 534,079.47 | 0.63 |
| EUR NATIXIS | 2,717 | 8,845.48 | 0.01 | EUR PERNOD-RICARD | 107 | 15,204.01 | 0.02 |
| EUR NATURGY ENERGY GROUP | 848 | 14,991.80 | 0.02 | USD PERRIGO CO PLC | 380 | 18,255.22 | 0.02 |
| JPY NEC | 400 | 14,633.24 | 0.02 | USD PHILLIPS 66 | 1,355 | 72,697.86 | 0.08 |
| EUR NESTE OYJ | 1,429 | 48,373.07 | 0.06 | GBP PHOENIX SPREE DEUTSCHLAND LTD | 132 | 440.59 | 0.00 |
| CHF NESTLE (reg. shares) | 2,203 | 226,472.97 | 0.27 | USD PHYSICIANS REALTY TRUST | 320 | 4,459.01 | 0.01 |
| HKD NEW WORLD DEVELOPMENT | 9,002 | 9,686.34 | 0.01 | USD PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST -A- | 211 | 3,734.50 | 0.00 |
| AUD NEWCREST MINING | 1,421 | 20,044.76 | 0.02 | USD PINNACLE WEST CAPITAL | 339 | 25,665.84 | 0.03 |
| USD NEWELL BRANDS | 1,181 | 15,687.93 | 0.02 | USD PIONEER NATURAL RESOURCES | 515 | 36,110.03 | 0.04 |
| USD NEWMONT MINING | 2,510 | 113,658.77 | 0.13 | USD PNC FINANCIAL SERVICES | 1,348 | 129,017.66 | 0.15 |
| GBP NEWRIVER REIT | 467 | 345.77 | 0.00 | USD PPG INDUSTRIES | 741 | 61,935.18 | 0.07 |
| GBP NEXT | 285 | 14,369.10 | 0.02 | JPY PREMIER INVESTMENT | 2 | 2,226.43 | 0.00 |
| JPY NGK INSULATORS | 421 | 5,520.39 | 0.01 | GBP PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 1,862 | 3,708.13 | 0.00 |
| JPY NGK SPARK PLUG | 253 | 3,565.18 | 0.00 | USD PRINCIPAL FINANCIAL | 907 | 28,425.72 | 0.03 |
| USD NIELSEN HOLDINGS PLC | 1,041 | 13,055.14 | 0.02 | USD PROCTER & GAMBLE | 8,361 | 919,702.15 | 1.07 |
| USD NIKE -B- | 4,506 | 372,788.52 | 0.44 | USD PROGRESSIVE | 1,793 | 132,420.82 | 0.15 |
| JPY NIKON | 515 | 4,764.79 | 0.01 | USD PROLOGIS | 3,516 | 282,557.08 | 0.34 |
| JPY NINTENDO | 186 | 71,818.92 | 0.08 | GBP PRUDENTIAL | 5,578 | 71,624.37 | 0.08 |
| JPY NIPPON ACCOMMODATIONS FUND | 1 | 3,853.12 | 0.00 | USD PRUDENTIAL FINANCIAL | 1,238 | 64,542.22 | 0.07 |
| JPY NIPPON BUILDING FUND | 2 | 13,375.08 | 0.02 | USD PS BUSINESS PARKS | 34 | 4,599.31 | 0.01 |
| JPY NIPPON EXPRESS | 128 | 6,254.64 | 0.01 | CHF PSP SWISS PROPERTY (reg. shares) | 61 | 7,595.52 | 0.01 |
| JPY NIPPON PROLOGIS REIT | 6 | 16,283.26 | 0.02 | USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 1,531 | 68,739.68 | 0.08 |
| JPY NIPPON REIT INVESTMENT | 1 | 2,034.54 | 0.00 | USD PUBLIC STORAGE | 253 | 50,268.43 | 0.06 |
| JPY NIPPON YUSEN | 248 | 2,948.95 | 0.00 | EUR PUMA | 159 | 9,466.46 | 0.01 |
| USD NISOURCE | 1,100 | 27,465.44 | 0.03 | USD PVH | 220 | 8,280.91 | 0.01 |
| JPY NISSIN FOOD HOLDINGS | 102 | 8,525.81 | 0.01 | EUR QIAGEN (reg. shares) | 650 | 26,092.60 | 0.03 |
| JPY NITORI HOLDINGS | 130 | 17,574.98 | 0.02 | USD QTS REALTY TRUST -A- | 97 | 5,638.68 | 0.01 |
| JPY NITTO DENKO | 254 | 11,348.28 | 0.01 | USD QUEST DIAGNOSTICS | 422 | 33,852.03 | 0.04 |
| GBP NMC HEALTH | 268 | 3,113.32 | 0.00 | JPY RAKUTEN | 1,382 | 10,494.25 | 0.01 |
| EUR NN GROUP | 888 | 23,970.51 | 0.03 | AUD RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 299 | 10,482.31 | 0.01 |
| USD NOBLE ENERGY | 1,405 | 8,483.56 | 0.01 | EUR RANDSTAD HOLDING | 149 | 5,262.62 | 0.01 |
| EUR NOKIAN TYRES | 358 | 8,669.16 | 0.01 | USD RAYMOND JAMES FINANCIAL | 375 | 23,713.17 | 0.03 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS | 382 | 6,202.46 | 0.01 | GBP RDI REIT PLC | 394 | 318.16 | 0.00 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND | 7 | 8,952.52 | 0.01 | USD REALTY INCOME | 557 | 27,750.50 | 0.03 |
| JPY NOMURA RESEARCH INSTITUTE | 544 | 11,535.17 | 0.01 | GBP RECKITT BENCKISER GROUP | 1,526 | 116,363.93 | 0.13 |
| USD NORDSTROM | 293 | 4,496.64 | 0.01 | EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA | 207 | 8,765.61 | 0.01 |
| USD NORFOLK SOUTHERN | 805 | 117,545.92 | 0.14 | JPY RECRUIT HOLDINGS | 2,232 | 57,817.39 | 0.07 |
| CAD NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 81 | 1,863.95 | 0.00 | EUR RED ELECTRICA CORPORACION | 1,242 | 22,306.40 | 0.03 |
| USD NORTHERN TRUST | 606 | 45,735.41 | 0.05 | USD REGENCY CENTERS | 285 | 10,934.15 | 0.01 |
| CAD NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 175 | 1,184.58 | 0.00 | GBP REGIONAL REIT | 577 | 586.77 | 0.00 |
| USD NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 633 | 6,939.48 | 0.01 | USD REGIONS FINANCIAL | 2,987 | 26,792.79 | 0.03 |
| | | | | USD REINSURANCE GROUP AMERICA | 184 | 15,512.41 | 0.02 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| GBP RELX | 4,173 | 89,624.76 | 0.10 | JPY SOHO SECURITY SERVICES | 115 | 5,597.88 | 0.01 |
| GBP RENTOKIL INITIAL | 3,950 | 18,995.82 | 0.02 | EUR SOLVAY | 212 | 15,471.93 | 0.02 |
| EUR REPSOL | 4,742 | 43,349.91 | 0.05 | JPY SOMPO HOLDINGS | 541 | 16,759.66 | 0.02 |
| USD RESMED | 432 | 63,604.11 | 0.07 | CHF SONOVA HOLDING (reg. shares) | 40 | 7,250.36 | 0.01 |
| JPY RESONA HOLDINGS | 3,362 | 10,128.93 | 0.01 | JPY SONY | 2,095 | 124,600.70 | 0.14 |
| EUR RETAIL ESTATES | 16 | 823.32 | 0.00 | USD SOUTHERN | 3,203 | 173,431.43 | 0.20 |
| USD RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT | 202 | 1,678.33 | 0.00 | USD SOUTHWEST AIRLINES | 422 | 15,036.81 | 0.02 |
| USD RETAIL PROPERTIES OF AMERICA -A- | 369 | 1,906.22 | 0.00 | USD S&P GLOBAL | 750 | 183,681.71 | 0.21 |
| USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY | 192 | 7,893.34 | 0.01 | GBP SPIRAX-SARCO ENGINEERING | 157 | 15,920.39 | 0.02 |
| JPY R-INVESCO OFFICE REIT | 14 | 1,814.64 | 0.00 | USD SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 168 | 4,402.35 | 0.01 |
| CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 539 | 6,112.65 | 0.01 | GBP SSE | 2,223 | 35,969.10 | 0.04 |
| USD RLJ LODGING TRUST | 296 | 2,287.90 | 0.00 | EUR ST GOBAIN | 1,411 | 34,317.10 | 0.04 |
| USD ROBERT HALF INTERNATIONAL | 344 | 12,990.57 | 0.01 | CHF STADLER RAIL AG | 59 | 2,740.39 | 0.00 |
| CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares) | 537 | 174,308.42 | 0.20 | USD STAG INDUSTRIAL | 254 | 5,710.97 | 0.01 |
| USD ROCKWELL AUTOMATION | 350 | 52,816.04 | 0.06 | GBP STANDARD CHARTERED | 5,823 | 32,190.72 | 0.04 |
| USD ROPER TECHNOLOGIES | 322 | 100,421.23 | 0.12 | GBP STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 5,125 | 14,229.74 | 0.02 |
| USD ROSS STORES | 1,097 | 95,426.77 | 0.11 | GBP STANDARD LIFE INVESTMENTS PROPERTY | 638 | 669.10 | 0.00 |
| USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 523 | 16,830.14 | 0.02 | INCOME FUND | | | |
| EUR ROYAL DUTCH SHELL -A- | 196 | 3,506.07 | 0.00 | USD STANLEY BLACK & DECKER | 461 | 46,091.08 | 0.05 |
| EUR ROYAL PHILIPS | 2,595 | 105,123.26 | 0.12 | JPY STANLEY ELECTRIC | 213 | 4,203.83 | 0.00 |
| USD RPT REALTY | 135 | 815.33 | 0.00 | USD STARBUCKS | 3,757 | 247,017.10 | 0.29 |
| GBP RSA INSURANCE GROUP | 2,203 | 11,486.06 | 0.01 | USD STATE STREET | 1,147 | 61,096.21 | 0.07 |
| EUR RWE -A- | 1,672 | 43,960.92 | 0.05 | USD STERIS PLC | 267 | 37,315.37 | 0.04 |
| NZD RYMAN HEALTHCARE | 741 | 4,523.63 | 0.01 | EUR STMICROELECTRONICS | 360 | 7,844.28 | 0.01 |
| USD RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 82 | 2,952.28 | 0.00 | AUD STOCKLAND TRUST | 8,163 | 12,639.51 | 0.01 |
| USD SABRA HEALTH CARE REAL ESTATE | 340 | 3,716.85 | 0.00 | EUR STORA ENSO -R- | 2,226 | 22,581.70 | 0.03 |
| INVESTMENT TRUST | | | | USD STORE CAPITAL | 366 | 6,629.38 | 0.01 |
| GBP SAFESTORE HOLDINGS | 318 | 2,522.35 | 0.00 | CHF STRAUMANN HOLDING (reg. shares) | 3 | 2,229.79 | 0.00 |
| EUR SAFRAN | 91 | 7,962.16 | 0.01 | JPY SUMITOMO CHEMICAL | 2,401 | 7,138.52 | 0.01 |
| USD SALESFORCE.COM | 2,640 | 380,128.70 | 0.45 | JPY SUMITOMO METAL MINING | 375 | 7,701.53 | 0.01 |
| SEK SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORD -B- | 1,444 | 2,769.96 | 0.00 | JPY SUMITOMO REALTY & DEVELOPMENT | 622 | 15,181.94 | 0.02 |
| EUR SANOFI | 209 | 18,360.86 | 0.02 | JPY SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES | 275 | 2,593.62 | 0.00 |
| JPY SANTEN PHARMACEUTICAL | 578 | 9,945.86 | 0.01 | USD SUMMIT HOTEL PROPERTIES | 176 | 743.71 | 0.00 |
| EUR SAP SE | 2,879 | 324,696.52 | 0.38 | CAD SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 180 | 1,124.23 | 0.00 |
| EUR SARTORIUS (pref. shares) | 102 | 24,844.98 | 0.03 | USD SUN COMMUNITIES | 154 | 19,281.86 | 0.02 |
| USD SAUL CENTERS | 20 | 658.05 | 0.00 | HKD SUN HUNG KAI PROPERTIES | 5,230 | 68,957.18 | 0.08 |
| USD SBA COMMUNICATIONS -A- (reg. shares) | 348 | 93,901.98 | 0.11 | USD SUNSTONE HOTEL INVESTORS | 380 | 3,308.82 | 0.00 |
| AUD SCENTRE GROUP | 8,256 | 7,908.04 | 0.01 | SGD SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,226 | 2,832.37 | 0.00 |
| CHF SCHINDLER HOLDING | 6 | 1,221.45 | 0.00 | JPY SUNTORY BEVERAGE & FOOD | 223 | 8,426.74 | 0.01 |
| CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.) | 12 | 2,588.11 | 0.00 | USD SVB FINANCIAL GROUP | 165 | 24,905.23 | 0.03 |
| USD SCHLUMBERGER | 4,260 | 57,461.83 | 0.07 | HKD SWIRE PACIFIC -A- | 911 | 5,870.26 | 0.01 |
| EUR SCHNEIDER ELECTRIC | 1,585 | 136,633.34 | 0.16 | HKD SWIRE PROPERTIES | 3,817 | 10,734.74 | 0.01 |
| GBP SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 807 | 388.71 | 0.00 | CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares) | 30 | 10,178.43 | 0.01 |
| LIMITED | | | | CHF SWISS PRIME SITE | 179 | 17,535.99 | 0.02 |
| GBP SCHRODERS | 266 | 8,178.78 | 0.01 | CHF SWISS REINSURANCE | 247 | 19,058.21 | 0.02 |
| CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES | 2 | 2,093.33 | 0.00 | CHF SWISSCOM (reg. shares) | 22 | 11,572.02 | 0.01 |
| JPY SECOM | 340 | 28,269.46 | 0.03 | AUD SYDNEY AIRPORT (stapled security) | 2,046 | 7,001.02 | 0.01 |
| AUD SEEK | 618 | 5,610.22 | 0.01 | EUR SYMRISE | 369 | 34,413.38 | 0.04 |
| JPY SEGA SAMMY HOLDINGS | 280 | 3,406.63 | 0.00 | JPY SYSMEX | 272 | 19,739.17 | 0.02 |
| GBP SEGRO PLC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,028 | 38,157.44 | 0.04 | USD T ROWE PRICE GROUP | 723 | 70,641.75 | 0.08 |
| JPY SEKISUI CHEMICAL | 584 | 7,746.06 | 0.01 | EUR TAG IMMOBILIEN | 196 | 3,879.45 | 0.00 |
| JPY SEKISUI HOUSE | 998 | 16,498.85 | 0.02 | JPY TAISEI | 326 | 9,989.33 | 0.01 |
| JPY SEKISUI HOUSE REIT | 6 | 4,033.02 | 0.00 | JPY TAKEDA PHARMACEUTICAL | 2,465 | 75,527.39 | 0.09 |
| USD SEMPRA ENERGY | 872 | 98,560.93 | 0.11 | USD TANGER FACTORY OUTLET CENTERS | 157 | 783.03 | 0.00 |
| USD SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING P | 472 | 13,644.35 | 0.02 | USD TAPESTRY INC | 929 | 12,030.49 | 0.01 |
| USD SERITAGE GROWTH PROPERTIES -A- | 56 | 507.08 | 0.00 | USD TARGA RESOURCES | 685 | 4,736.56 | 0.01 |
| USD SERVICE PROPERTIES TRUST | 278 | 1,502.35 | 0.00 | GBP TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 698 | 926.42 | 0.00 |
| EUR SES | 1,044 | 6,127.02 | 0.01 | USD TAUBMAN CENTERS | 102 | 4,253.16 | 0.00 |
| JPY SEVEN & I HOLDINGS | 1,239 | 41,054.96 | 0.05 | GBP TAYLOR WIMPEY | 7,006 | 10,207.59 | 0.01 |
| CHF SFS GROUP (reg. shares) | 9 | 642.04 | 0.00 | USD TD AMERITRADE HOLDING | 814 | 28,217.90 | 0.03 |
| GBP SHAFTESBURY | 346 | 2,645.97 | 0.00 | JPY T&D HOLDINGS | 896 | 7,338.18 | 0.01 |
| JPY SHARP | 342 | 3,600.25 | 0.00 | USD TE CONNECTIVITY (reg. shares) | 1,046 | 65,892.72 | 0.08 |
| USD SHERWIN-WILLIAMS | 251 | 115,203.79 | 0.13 | USD TECHNIPFMC (reg. shares) | 1,578 | 10,636.06 | 0.01 |
| JPY SHIMADZU | 359 | 9,453.23 | 0.01 | HKD TECHTRONIC INDUSTRIES | 2,535 | 16,450.29 | 0.02 |
| JPY SHIMIZU | 953 | 7,457.36 | 0.01 | JPY TEIJIN | 285 | 4,833.94 | 0.01 |
| JPY SHIN-ETSU CHEMICAL | 584 | 58,030.74 | 0.07 | SEK TELEFON LM ERICSSON -B- | 1,017 | 8,323.75 | 0.01 |
| JPY SHISEIDO | 649 | 38,373.49 | 0.04 | EUR TELEFONICA | 13,393 | 61,333.23 | 0.07 |
| AUD SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY | 1,480 | 2,056.56 | 0.00 | EUR TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING | 2,449 | 6,069.91 | 0.01 |
| GROUP | | | | (reg. shares) | | | |
| JPY SHOWA DENKO | 218 | 4,514.07 | 0.01 | EUR TELEPERFORMANCE | 168 | 35,024.81 | 0.04 |
| EUR SIEMENS (reg. shares) | 2,290 | 194,671.38 | 0.22 | AUD TELSTRA | 7,693 | 14,455.30 | 0.02 |
| USD SIGNATURE BANK | 175 | 14,052.09 | 0.02 | CHF TEMENOS GROUP | 19 | 2,485.04 | 0.00 |
| CHF SIKA NOM. | 90 | 14,916.00 | 0.02 | EUR TENARIS | 1,352 | 8,278.19 | 0.01 |
| USD SIMON PROPERTY GROUP | 525 | 28,826.43 | 0.03 | USD TERRENO REALTY GROUP | 113 | 5,852.32 | 0.01 |
| SGD SINGAPORE AIRLINES | 996 | 4,017.25 | 0.00 | GBP TESCO | 20,982 | 59,526.79 | 0.07 |
| SGD SINGAPORE EXCHANGE | 1,488 | 9,604.05 | 0.01 | USD TESLA MOTORS | 415 | 217,345.34 | 0.26 |
| SGD SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 2,990 | 3,842.85 | 0.00 | USD TEXAS INSTRUMENTS | 2,874 | 287,245.15 | 0.34 |
| SGD SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 15,096 | 26,929.18 | 0.03 | HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,267 | 27,695.85 | 0.03 |
| HKD SINO LAND | 5,197 | 6,597.91 | 0.01 | CHF THE SWATCH GROUP | 16 | 3,171.68 | 0.00 |
| GBP SIRIUS REAL ESTATE LTD | 1,447 | 1,182.67 | 0.00 | CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares) | 15 | 594.79 | 0.00 |
| USD SITE CENTERS CORP | 262 | 1,362.92 | 0.00 | USD TIFFANY & CO | 337 | 43,674.60 | 0.05 |
| USD SL GREEN REALTY | 136 | 5,862.11 | 0.01 | USD TJX COS | 3,718 | 177,753.33 | 0.20 |
| CAD SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 219 | 2,902.52 | 0.00 | EUR TLG IMMOBILIEN | 20 | 325.31 | 0.00 |
| GBP SMITH & NEPHEW | 1,868 | 33,230.78 | 0.04 | JPY TOBU RAILWAY | 309 | 10,795.06 | 0.01 |
| EUR SNAM | 5,489 | 25,319.02 | 0.03 | JPY TOHO | 183 | 5,597.37 | 0.01 |
| USD SNAP-ON | 165 | 18,005.91 | 0.02 | JPY TOKYO ELECTRON | 256 | 48,287.30 | 0.06 |
| CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE | 8 | 17,850.35 | 0.02 | JPY TOKYO GAS | 607 | 14,362.29 | 0.02 |
| HOLDING (reg. shares) | | | | JPY TOKYO TATEMONO | 313 | 3,324.74 | 0.00 |
| CHF SOFTWAREONE HOLDING AG | 173 | 3,406.55 | 0.00 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|--|-----------|---------------|------------------|
| JPY TOKYU | 805 | 12,669.13 | 0.01 | GBP WHITBREAD | 286 | 10,729.39 | 0.01 |
| JPY TOKYU REIT | 1 | 1,834.76 | 0.00 | EUR WIENERBERGER | 246 | 3,878.03 | 0.00 |
| JPY TORAY INDUSTRIES | 2,234 | 9,705.17 | 0.01 | SEK WILHBORGS FASTIGHETER AB | 206 | 2,874.93 | 0.00 |
| EUR TOTAL | 6,876 | 267,014.26 | 0.32 | USD WILLIAMS COMPANIES | 3,783 | 53,526.42 | 0.06 |
| JPY TOTO | 227 | 7,543.19 | 0.01 | USD WILLIS TOWERS WATSON | 400 | 67,882.55 | 0.08 |
| JPY TOYO SUISAN KAISHA | 144 | 6,960.74 | 0.01 | EUR WOLTERS KLUWER | 783 | 55,115.95 | 0.06 |
| JPY TOYODA GOSEI | 107 | 1,833.00 | 0.00 | AUD WOODSIDE PETROLEUM | 1,763 | 19,654.15 | 0.02 |
| USD TRACTOR SUPPLY | 360 | 30,399.87 | 0.04 | GBP WORKSPACE GROUP | 206 | 1,935.40 | 0.00 |
| USD TRANE TECHNOLOGIES PLC | 738 | 60,970.31 | 0.07 | AUD WORLEYPARSONS | 624 | 2,349.63 | 0.00 |
| USD TRANSDIGM GROUP | 146 | 46,681.91 | 0.05 | USD W. P. CAREY | 292 | 16,966.51 | 0.02 |
| AUD TRANSURBAN GROUP | 5,115 | 37,690.83 | 0.04 | GBP WPP 2012 | 2,696 | 18,430.17 | 0.02 |
| USD TRAVELERS COMPANIES | 1,334 | 132,526.31 | 0.15 | USD WW GRAINGER | 138 | 34,274.64 | 0.04 |
| USD TRIMBLE NAVIGATION | 752 | 23,922.60 | 0.03 | USD XCEL ENERGY | 1,610 | 97,082.19 | 0.11 |
| USD TRIPADVISOR | 283 | 4,928.53 | 0.01 | USD XENIA HOTELS & RESORTS | 192 | 1,977.87 | 0.00 |
| GBP TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING RE | 491 | 553.76 | 0.00 | EUR XIOR STUDENT HOUSING NV | 23 | 1,028.20 | 0.00 |
| GBP TRITAX BIG BOX REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,650 | 3,686.28 | 0.00 | USD XYLEM | 542 | 35,279.38 | 0.04 |
| GBP TRITAX EUROBOX PLC | 655 | 760.38 | 0.00 | JPY YAKULT HONSHA | 194 | 11,471.33 | 0.01 |
| USD TRUIST FINANCIAL CORP | 4,129 | 127,349.94 | 0.15 | JPY YAMADA DENKI | 1,012 | 4,040.58 | 0.00 |
| CHF UBS GROUP | 2,315 | 21,643.90 | 0.02 | JPY YAMAHA | 232 | 9,041.90 | 0.01 |
| EUR UCB | 362 | 31,401.59 | 0.04 | JPY YAMAHA MOTOR | 451 | 5,461.42 | 0.01 |
| USD UDR | 1,420 | 51,897.53 | 0.06 | JPY YASKAWA ELECTRIC | 387 | 10,668.46 | 0.01 |
| USD ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE | 168 | 29,587.24 | 0.03 | JPY YOKOGAWA ELECTRIC | 369 | 4,456.50 | 0.01 |
| EUR UMICORE SA | 566 | 19,794.90 | 0.02 | USD ZIONS BANCORP | 520 | 13,906.94 | 0.02 |
| USD UNDER ARMOUR -A- | 551 | 5,071.96 | 0.01 | USD ZOETIS -A- | 1,461 | 171,948.56 | 0.20 |
| USD UNDER ARMOUR (when issued) | 570 | 4,597.82 | 0.01 | CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares) | 120 | 42,483.91 | 0.05 |
| EUR UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBA | 606 | 34,276.60 | 0.04 | GBP 3I GROUP | 2,079 | 20,417.41 | 0.02 |
| JPY UNI-CHARM | 649 | 24,336.78 | 0.03 | USD 3M | 2,270 | 309,835.83 | 0.37 |
| EUR UNICREDIT (reg. shares) | 598 | 4,690.83 | 0.01 | 株式 (およびエクイティ型証券) | | 50,611,735.50 | 58.37 |
| EUR UNILEVER | 4,204 | 206,667.90 | 0.25 | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている | | | |
| GBP UNILEVER | 2,383 | 120,432.12 | 0.14 | 証券：株式 (およびエクイティ型証券) | | 50,611,735.50 | 58.37 |
| USD UNION PACIFIC | 2,216 | 312,547.78 | 0.37 | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券：債券 | | | |
| GBP UNITE GROUP | 450 | 4,473.94 | 0.01 | 債券 | | | |
| USD UNITED PARCEL SERVICE -B- | 2,150 | 200,842.60 | 0.23 | USD ABB FINANCE (USA) T. 2 2.875%/12- | 11,665 | 11,751.57 | 0.01 |
| USD UNITED RENTALS | 227 | 23,320.95 | 0.03 | 08.05.2022 | | | |
| JPY UNITED URBAN INVESTMENT | 5 | 4,704.79 | 0.01 | USD ABBOTT LABORATORIES 3.75%/16-30.11.2026 | 2,713 | 3,025.79 | 0.00 |
| USD UNITEDHEALTH GROUP | 349 | 86,941.16 | 0.10 | USD ABBVIE 3.6%/15-14.05.2025 | 4,666 | 4,889.18 | 0.01 |
| USD UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 22 | 2,201.79 | 0.00 | CHF ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024 | 80 | 78.91 | 0.00 |
| SGD UOL GROUP | 1,633 | 7,534.82 | 0.01 | USD ABQ FINANCE 3.5%/17-22.02.2022 | 11,427 | 10,864.77 | 0.01 |
| EUR UPM-KYMMENE | 1,530 | 42,114.43 | 0.05 | USD ABU DHABI CRUDE OIL 4.6%/17-02.11.2047 | 9,799 | 9,752.16 | 0.01 |
| USD URBAN EDGE PROPERTIES (when issued) | 200 | 1,759.35 | 0.00 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 2.5%/19-30.09.2029 | 28,186 | 27,405.49 | 0.03 |
| USD URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 50 | 710.49 | 0.00 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 3.125%/17-11.10.2027 | 9,799 | 9,978.92 | 0.01 |
| USD US BANCORP | 4,566 | 157,287.63 | 0.18 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 3.125%/19-30.09.2049 | 16,759 | 15,555.39 | 0.02 |
| JPY USS CO | 353 | 4,860.78 | 0.01 | USD ABU DHABI GOVT INT' L 4.125%/17-11.10.2047 | 4,900 | 5,295.55 | 0.01 |
| USD VAIL RESORTS | 118 | 17,444.72 | 0.02 | USD ACE INA HOLDINGS 3.35%/15-03.05.2026 | 9,999 | 10,573.11 | 0.01 |
| EUR VALEO | 690 | 11,547.97 | 0.01 | CHF ACHMEA BANK 0.5%/17-27.10.2023 | 29 | 29.57 | 0.00 |
| USD VALERO ENERGY | 1,250 | 56,705.85 | 0.07 | USD ADECOAGRO SA 6%/17-21.09.2027 | 11,427 | 8,972.71 | 0.01 |
| USD VARIAN MEDICAL SYSTEMS | 274 | 28,105.17 | 0.03 | USD AEROPUERTOS ARGENTINA 2000 (reg. -S-) | 4,596 | 2,334.55 | 0.00 |
| EUR VASTNED RETAIL N.V. | 27 | 447.82 | 0.00 | 6.875%/-01.02.2027 | | | |
| USD VENTAS | 636 | 17,053.65 | 0.02 | USD AFRICA FINANCE CORP 3.75%/19-30.10.2029 | 17,013 | 15,310.46 | 0.02 |
| EUR VERBUND -A- | 209 | 7,555.67 | 0.01 | EUR AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/17- | 4,127 | 4,626.61 | 0.01 |
| USD VEREIT | 1,829 | 8,946.08 | 0.01 | 24.01.2024 | | | |
| USD VERIZON COMMUNICATIONS | 13,354 | 717,512.81 | 0.84 | USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3%/18- | 6,666 | 7,207.32 | 0.01 |
| USD VERTEX PHARMACEUTICALS | 788 | 187,610.91 | 0.22 | 20.09.2023 | | | |
| USD VF | 1,060 | 57,323.68 | 0.07 | EUR AGENCE FRANCAISE DEVELOP 0.25%/19- | 413 | 456.10 | 0.00 |
| USD VICI PROPERTIES INC | 789 | 13,124.35 | 0.02 | 29.06.2029 | | | |
| AUD VICINITY CENTRES | 4,900 | 3,104.04 | 0.00 | USD AGUA Y SANEAMIENTOS ARG 6.625%/18- | 12,697 | 4,079.13 | 0.00 |
| CHF VIFOR PHARMA AG | 58 | 8,083.36 | 0.01 | 01.02.2023 | | | |
| EUR VINCI | 161 | 13,324.78 | 0.02 | USD AI CANDELARIA SPAIN 7.5%/18-15.12.2028 | 12,697 | 9,456.61 | 0.01 |
| USD VISA -A- | 5,686 | 916,048.75 | 1.07 | USD AJECORP (reg. -S-) 6.5%/12-14.05.2022 | 15,236 | 11,981.90 | 0.01 |
| USD VMWARE | 248 | 30,014.69 | 0.03 | CHF AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025 | 133 | 138.97 | 0.00 |
| EUR VOESTALPINE | 612 | 12,449.51 | 0.01 | CHF AKADEMISKA HUS 0.3%/17-08.10.2029 | 33 | 34.22 | 0.00 |
| EUR VONOVIA (reg. shares) | 843 | 41,472.28 | 0.05 | USD AKCB FINANCE LTD 4.75%/18-09.10.2023 | 15,236 | 14,614.49 | 0.02 |
| USD VORNADO REALTY TRUST | 294 | 10,653.63 | 0.01 | USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875%/19- | 20,822 | 19,283.71 | 0.02 |
| USD VOYA FINANCIAL | 424 | 17,207.25 | 0.02 | 22.10.2029 | | | |
| EUR VW (pref. shares) | 44 | 5,131.35 | 0.01 | USD ALTERNATIFBANK 8.75%/16-16.04.2026 | 5,079 | 4,635.95 | 0.01 |
| USD WABCO | 151 | 20,439.61 | 0.02 | USD ALTRIA GROUP INC 3.8%/19-14.02.2024 | 9,999 | 10,146.46 | 0.01 |
| EUR WAERTSILAE -B- | 1,271 | 9,327.50 | 0.01 | USD ALTRIA GROUP 2.85%/12-09.08.2022 | 9,999 | 10,045.48 | 0.01 |
| USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 675 | 30,902.71 | 0.04 | USD AMAZON.COM INC 3.15%/18-22.08.2027 | 6,326 | 6,971.14 | 0.01 |
| SEK WALLENSTAM BYGGNADS -B- | 253 | 2,885.79 | 0.00 | USD AMERICAN EXPRESS CO 2.5%/17-01.08.2022 | 14,665 | 14,830.45 | 0.02 |
| USD WALT DISNEY | 6,140 | 593,146.22 | 0.69 | USD AMERICAN EXPRESS CO 3%/17-30.10.2024 | 6,666 | 6,870.70 | 0.01 |
| USD WASHINGTON REAL ESTAT INVESTMENT TRUST | 141 | 3,373.01 | 0.00 | USD AMERICAN EXPRESS CREDIT 2.7%/17- | 5,619 | 5,671.46 | 0.01 |
| USD WASTE MANAGEMENT | 1,300 | 120,352.99 | 0.14 | 03.03.2022 | | | |
| USD WATERS | 194 | 35,276.81 | 0.04 | USD AMERICAN HONDA FINANCE S. -A- 3.375%/18- | 4,999 | 5,020.29 | 0.01 |
| USD WEC ENERGY GROUP | 975 | 85,897.00 | 0.10 | 10.12.2021 | | | |
| USD WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 211 | 3,041.96 | 0.00 | USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 6,666 | 6,891.09 | 0.01 |
| USD WELLTOWER | 1,980 | 90,646.31 | 0.10 | 4.875%/12-01.06.2022 | | | |
| EUR WENDEL | 74 | 5,940.02 | 0.01 | USD AMGEN INC 3.2%/17-02.11.2027 | 6,666 | 6,963.15 | 0.01 |
| EUR WERELDHAVE | 63 | 458.24 | 0.00 | CHF AMGEN 0.41%/16-08.03.2023 | 133 | 137.86 | 0.00 |
| EUR WERELDHAVE BELGIUM | 4 | 208.69 | 0.00 | USD ANDRADE GUTIER INT SA 11%/18-20.08.2021 | 19 | 19.27 | 0.00 |
| AUD WESFARMERS | 2,122 | 44,506.39 | 0.05 | USD ANDRADE GUTIERREZ INTERNATIONAL SA | 25,444 | 18,364.83 | 0.02 |
| JPY WEST JAPAN RAILWAY | 263 | 18,012.89 | 0.02 | 9.5%/19-25.11.2024 | | | |
| USD WESTERN UNION | 1,356 | 24,592.04 | 0.03 | EUR ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/17- | 2,407 | 2,341.65 | 0.00 |
| AUD WESTPAC BANKING | 6,660 | 67,259.39 | 0.08 | 18.09.2025 | | | |
| AUD WEYERHAEUSER | 2,316 | 39,260.94 | 0.05 | USD ANHEUSER BUSCH INBEV WORLDWIDE | 2,046 | 2,055.95 | 0.00 |
| HKD WHARF REAL ESTATE INVESTMENT C | 1,618 | 6,659.82 | 0.01 | 2.5%/12-15.07.2022 | | | |
| USD WHIRLPOOL | 187 | 16,010.40 | 0.02 | USD ANHEUSER-BUSCH INBEV FINANCE 3.3%/16- | 6,613 | 6,804.69 | 0.01 |
| | | | | 01.02.2026 | | | |
| | | | | USD ANTHEM INC 3.65%/17-01.12.2027 | 7,332 | 7,571.84 | 0.01 |
| | | | | CHF ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL | 67 | 67.31 | 0.00 |
| | | | | 0.25%/16-25.10.2023 | | | |
| | | | | EUR ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL | 3,329 | 3,704.12 | 0.00 |
| | | | | 0.625%/15-27.01.2022 | | | |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| USD APICORP SUKUK LTD 3.141%/17-01.11.2022 | 7,618 | 7,619.73 | 0.01 | CHF BFCM 0.55%/15-08.12.2023 | 35 | 35.31 | 0.00 |
| USD APPLE INC 2.75%/17-13.01.2025 | 6,666 | 7,054.54 | 0.01 | USD BIZ FINANCE (reg. -S-) 9.625%/15-27.04.2022 | 14,699 | 5,636.91 | 0.01 |
| USD APPLE INC 3%/17-20.06.2027 | 9,999 | 10,817.58 | 0.01 | USD BIZ FINANCE (reg. -S-) 9.75%/15-22.01.2025 | 9,799 | 9,287.37 | 0.01 |
| CHF APPLE 0.375%/15-25.11.2024 | 107 | 111.39 | 0.00 | USD BLUESTAR FIN HOLDINGS FIX-T0-FRN FRN/18-PERPETUAL | 12,697 | 12,940.91 | 0.01 |
| USD APPLE 2.4%/13-03.05.2023 | 6,666 | 6,916.96 | 0.01 | CHF BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027 | 53 | 52.39 | 0.00 |
| USD APPLE 2.85%/16-23.02.2023 | 1,250,000 | 1,307,537.51 | 1.51 | CHF BNG BANK 1.125%/13-19.04.2023 | 160 | 172.22 | 0.00 |
| USD APPLE 3.45%/14-06.05.2024 | 1,793 | 1,940.74 | 0.00 | CHF BNG 1.25%/14-30.04.2024 | 133 | 145.79 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT (reg. -S-) S. -2- 6.125%/17-31.01.2022 | 4,900 | 4,716.01 | 0.01 | CHF BNP PARIBAS SA 0.3%/19-15.10.2027 | 27 | 22.50 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT 5.577%/18-21.02.2023 | 19,599 | 18,144.94 | 0.02 | CHF BNP PARIBAS (subordinated) 1.75%/15-05.06.2025 | 40 | 40.53 | 0.00 |
| USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT 8.7002%/19-01.03.2049 | 14,699 | 12,179.64 | 0.01 | USD BNP PARIBAS T. -100- 2.375%/15-21.05.2020 | 9,999 | 10,000.68 | 0.01 |
| USD ARAGVI FINANCE INTL 12%/19-09.04.2024 | 8,888 | 7,484.83 | 0.01 | CHF BNP PARIBAS 1.875%/12-12.09.2022 | 40 | 41.32 | 0.00 |
| USD ARDSHININVESTBANK CJSC 6.5%/20-28.01.2025 | 15,236 | 13,403.25 | 0.02 | CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD (LONDON BRANCH) | 67 | 64.28 | 0.00 |
| CHF AROUNDTOWN SA 1.72%/19-05.03.2026 | 53 | 54.04 | 0.00 | CHF BNZ INTERNATIONAL FUNDING 0.25%/15-24.06.2022 | 133 | 135.11 | 0.00 |
| CHF ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025 | 53 | 51.56 | 0.00 | USD BOLIVIA GOVERNMENT 4.5%/17-20.03.2028 | 4,900 | 4,010.54 | 0.00 |
| CHF ASB FINANCE 0.2%/17-02.08.2024 | 100 | 97.95 | 0.00 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 0.6%/19-31.10.2029 | 963 | 1,054.76 | 0.00 |
| USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.5%/17-02.11.2027 | 22,664 | 25,422.33 | 0.03 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.4%/18-30.04.2028 | 1,376 | 1,615.29 | 0.00 |
| USD ASTRAZENECA PLC 3.125%/17-12.06.2027 | 9,999 | 10,475.02 | 0.01 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.4%/18-30.07.2028 | 1,720 | 2,019.87 | 0.00 |
| CHF AT&T 1.875%/14-04.12.2024 | 107 | 111.34 | 0.00 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.45%/17-31.10.2027 | 1,307 | 1,534.68 | 0.00 |
| USD AT&T 3.4%/15-15.05.2025 | 6,433 | 6,677.69 | 0.01 | EUR BONOS Y OBLIG DEL ESTADO -144A- 1.45%/19-30.04.2029 | 2,119 | 2,500.26 | 0.00 |
| USD AT&T 3.6%/16-17.02.2023 | 6,826 | 7,025.97 | 0.01 | USD BOS FUNDING 4.23%/17-07.03.2022 | 12,697 | 12,727.36 | 0.01 |
| USD AT&T 4.125%/16-17.02.2026 | 6,666 | 7,061.01 | 0.01 | USD BOSTON PROPERTIES LP 4.5%/18-01.12.2028 | 4,999 | 5,491.83 | 0.01 |
| USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP T. -10- 2.7%/15-16.11.2020 | 6,666 | 6,674.59 | 0.01 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 2.112%/18-16.09.2021 | 3,333 | 3,284.50 | 0.00 |
| EUR AUSTRIA S. 1.65%/14-21.10.2024 | 2,875 | 3,445.05 | 0.00 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 2.75%/18-10.05.2023 | 6,486 | 6,484.06 | 0.01 |
| EUR AUSTRIA 0.75%/16-20.10.2026 | 2,063 | 2,409.22 | 0.00 | USD BP CAP MARKETS AMERICA 3.796%/18-21.09.2025 | 2,026 | 2,105.67 | 0.00 |
| EUR AUSTRIA -144A- (reg. -S-) 1.2%/15-20.10.2025 | 2,875 | 3,421.61 | 0.00 | EUR BP CAPITAL MARKET 1.117%/16-25.01.2024 | 41 | 44.94 | 0.00 |
| USD BAHRAIN (reg. -S-) 6%/14-19.09.2044 | 7,350 | 5,659.80 | 0.01 | USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.279%/17-19.09.2027 | 13,332 | 13,384.50 | 0.02 |
| EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1%/16-20.01.2021 | 1,376 | 1,514.46 | 0.00 | CHF BP CAPITAL MARKETS 0.75%/14-27.09.2021 | 32 | 32.92 | 0.00 |
| CHF BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024 | 75 | 68.42 | 0.00 | CHF BP CAPITAL MARKETS 1.75%/14-28.02.2024 | 32 | 33.35 | 0.00 |
| USD BANCO NACIONAL DE COMERCIO EXTERIOR FIX-T0-FLOATER (reg. -S-) 3.8%/16-11.08.2026 | 4,900 | 4,428.39 | 0.01 | EUR BPCE 1.125%/17-18.01.2023 | 2,063 | 2,226.07 | 0.00 |
| USD BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCIAL (reg. -S-) 5.75%/13-26.09.2023 | 9,799 | 9,673.37 | 0.01 | CHF BPCE 1.5%/14-30.04.2021 | 160 | 162.00 | 0.00 |
| EUR BANCO SANTANDER (reg. -S-) 1.375%/17-09.02.2022 | 2,751 | 2,994.05 | 0.00 | USD BRASKEM IDESA SAPI 7.45%/19-15.11.2029 | 5,079 | 3,503.93 | 0.00 |
| CHF BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027 | 80 | 71.47 | 0.00 | USD BRAZIL 8.25%/04-20.01.2034 | 21,559 | 27,260.35 | 0.03 |
| USD BANCO SANTANDER SA 3.8%/17-23.02.2028 | 7,999 | 7,853.04 | 0.01 | EUR BRD 3.25%/11-04.07.2021 | 3,439 | 3,959.96 | 0.00 |
| USD BANCO SANTANDER SA 4.379%/18-12.04.2028 | 10,665 | 10,929.66 | 0.01 | EUR BRD 4.75%/98-04.07.2028 | 1,376 | 2,186.79 | 0.00 |
| USD BANCOLOMBIA SA 3%/20-29.01.2025 | 5,079 | 4,528.39 | 0.01 | EUR BRD 5.625%/98-04.01.2028 | 1,032 | 1,690.33 | 0.00 |
| USD BANK OF AMERICA CORP FIX-T0-FRN FRN/18- 20.12.2023 | 10,699 | 10,904.01 | 0.01 | USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO -144A- 2.9%/19- 26.07.2024 | 4,733 | 4,924.43 | 0.01 |
| USD BANK OF AMERICA CORP S. -N- FIX-T0-FRN FRN/19-07.02.2030 | 6,666 | 7,178.33 | 0.01 | CAD BRITISH COLUMBIA PROV OF 2.55%/17-18.06.2027 | 27,000 | 20,071.72 | 0.02 |
| USD BANK OF AMERICA S. -L- 2.503%/16-21.10.2022 | 14,665 | 14,669.72 | 0.02 | USD BROADCOM CRP / CAYMAN FI 3%/18-15.01.2022 | 5,759 | 5,703.55 | 0.01 |
| USD BANK OF AMERICA 3.3%/13-11.01.2023 | 7,599 | 7,864.43 | 0.01 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/19-15.08.2029 | 963 | 1,107.06 | 0.00 |
| EUR BANK OF IRELAND GROUP 1.375%/18-29.08.2023 | 2,063 | 2,152.46 | 0.00 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/18-15.08.2028 | 1,788 | 2,098.37 | 0.00 |
| USD BANK OF MONTREAL S. -E- 2.5%/19-28.06.2024 | 6,666 | 6,702.05 | 0.01 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.25%/19-15.02.2029 | 4,127 | 4,849.81 | 0.01 |
| CHF BANK OF MONTREAL 0.05%/18-30.12.2022 | 53 | 53.60 | 0.00 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5%/17-15.08.2027 | 5,159 | 6,130.93 | 0.01 |
| CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.2%/18-19.11.2025 | 40 | 41.48 | 0.00 | EUR BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5%/18-15.02.2028 | 2,751 | 3,282.66 | 0.00 |
| CHF BANK OF NOVA SCOTIA 0.3%/15-16.09.2022 | 61 | 61.86 | 0.00 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.05%/17-01.08.2027 | 1,169 | 1,356.15 | 0.00 |
| USD BANK OF NOVA SCOTIA 3.4%/19-11.02.2024 | 6,666 | 6,952.09 | 0.01 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2%/18-01.02.2028 | 4,127 | 4,778.49 | 0.01 |
| USD BANK OF NY MELLON CORP 2.95%/18-29.01.2023 | 16,665 | 17,038.59 | 0.02 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 2.8%/18-01.12.2028 | 1,032 | 1,262.07 | 0.00 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.2%/19-12.06.2026 | 53 | 52.39 | 0.00 | EUR BUONI POLIENNALI DEL TES 3%/19-01.08.2029 | 2,063 | 2,567.89 | 0.00 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025 | 51 | 50.06 | 0.00 | CHF CADES 2.375%/11-19.04.2023 | 67 | 73.93 | 0.00 |
| CHF BANQUE FED CRED MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027 | 93 | 94.82 | 0.00 | CHF CADES 3%/09-21.04.2021 | 53 | 56.88 | 0.00 |
| USD BANQUE FED CRED MUTUEL 2.2%/17-20.07.2020 | 6,666 | 6,658.72 | 0.01 | EUR CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 4%/12-15.12.2025 | 1,376 | 1,868.32 | 0.00 |
| CHF BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-24.10.2029 | 53 | 51.01 | 0.00 | CHF CAISSE DES DEPOTS ET CON 0.3%/17-12.11.2027 | 80 | 82.84 | 0.00 |
| EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.375%/17-13.01.2022 | 2,751 | 2,982.01 | 0.00 | USD CANADA GOVERNMENT 2%/17-15.11.2022 | 23,330 | 24,202.59 | 0.03 |
| CHF BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG 0.55%/16-11.10.2022 | 53 | 54.90 | 0.00 | USD CANADA GOVERNMENT 2.625%/19-25.01.2022 | 21,397 | 22,229.97 | 0.03 |
| USD BANQUE OUEST AFRICAINE D 4.7%/19-22.10.2031 | 13,712 | 12,235.56 | 0.01 | CHF CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025 | 80 | 82.43 | 0.00 |
| EUR BARCLAYS BANK 1.875%/16-08.12.2023 | 2,751 | 2,933.83 | 0.00 | CHF CANADIAN IMPERIAL BANK 0.15%/18-31.07.2023 | 48 | 48.49 | 0.00 |
| USD BARCLAYS BANK 3.2%/16-10.08.2021 | 6,666 | 6,616.79 | 0.01 | USD CANADIAN IMPERIAL BANK 2.55%/17-16.06.2022 | 13,332 | 13,447.83 | 0.02 |
| EUR BASF SE 0.875%/17-15.11.2027 | 2,751 | 2,970.33 | 0.00 | USD CAPITAL ONE FINANCIAL 3.2%/15-05.02.2025 | 4,319 | 4,332.43 | 0.00 |
| CHF BAT HOLDINGS 1.375%/14-08.09.2026 | 67 | 67.17 | 0.00 | USD CAPITAL ONE NA 2.65%/17-08.08.2022 | 13,998 | 13,848.65 | 0.02 |
| CHF BATELCO INTERNATIONAL FINANCE 0.625%/14-08.09.2021 | 113 | 116.72 | 0.00 | USD CARDINAL HEALTH INC 2.616%/17-15.06.2022 | 7,332 | 7,367.78 | 0.01 |
| EUR BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033 | 40,000 | 49,727.81 | 0.06 | USD CBQ FINANCE LTD 5%/18-24.05.2023 | 7,618 | 7,683.49 | 0.01 |
| EUR BELGIUM KINGDOM -144A- 0.8%/18-22.06.2028 | 2,063 | 2,424.43 | 0.00 | USD CBS 2.9%/16-15.01.2027 | 2,413 | 2,316.47 | 0.00 |
| EUR BELGIUM KINGDOM -144A- 0.9%/19-22.06.2029 | 688 | 818.25 | 0.00 | USD CELGENE 3.875%/15-15.08.2025 | 3,933 | 4,461.04 | 0.01 |
| EUR BELGIUM OLO S. 64 4.5%/11-28.03.2026 | 2,063 | 2,903.48 | 0.00 | USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 4.2%/19-29.01.2030 | 5,079 | 4,323.62 | 0.00 |
| EUR BELGIUM OLO S. -81- (reg. -S-) -144A- 0.8%/17-22.06.2027 | 3,439 | 4,017.66 | 0.00 | USD CELULOSA ARAUCO CONSTITU 5.15%/19-29.01.2050 | 7,872 | 6,246.77 | 0.01 |
| EUR BELGIUM OLO S. -82- (reg. -S-) 0.5%/17-22.10.2024 | 2,751 | 3,124.41 | 0.00 | CHF CENTRAL AMERICAN BANK 0.2%/19-25.03.2024 | 35 | 35.31 | 0.00 |
| EUR BELGIUM OLO -114A- (reg. -S-) S. 76 1%/16-22.06.2026 | 1,376 | 1,617.86 | 0.00 | USD CENTRAL BK TUNISIA (reg. -S-) 5.75%/15-30.01.2025 | 4,900 | 3,905.20 | 0.00 |
| USD BERKSHIRE HATHAWAY 3.125%/16-15.03.2026 | 21,997 | 23,594.99 | 0.03 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|--|-----------|--------------|------------------|
| USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE (reg. -S-) 6.75%/16-08.11.2021 | 10,157 | 8,790.15 | 0.01 | USD CYDSA SAB DE CV 6.25%/17-04.10.2027 | 15,236 | 11,315.94 | 0.01 |
| USD CENTRAL CHN REAL ESTATE 6.875%/20-10.02.2021 | 5,079 | 4,782.42 | 0.01 | EUR DAIMLER 1.4%/16-12.01.2024 | 1,376 | 1,489.81 | 0.00 |
| CHF CFF 3%/07-07.06.2022 | 80 | 88.18 | 0.00 | CHF DANSKE BANK A/S 0.625%/19-24.11.2022 | 16 | 15.86 | 0.00 |
| USD CHARLES SCHWAB CORP 3.85%/18-21.05.2025 | 2,106 | 2,260.89 | 0.00 | CHF DANSKE BANK (subordinated) 3.125%/13-18.12.2025 | 51 | 47.27 | 0.00 |
| USD CHEVRON CORPORATION 3.191%/13-24.06.2023 | 2,760 | 2,879.87 | 0.00 | CHF DEUT PFANDBRIEFBANK AG 0.125%/19-05.06.2023 | 40 | 39.91 | 0.00 |
| USD CHEVRON 2.954%/16-16.05.2026 | 4,999 | 5,261.96 | 0.01 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.1%/19-19.06.2029 | 64 | 63.36 | 0.00 |
| USD CHINA SCE GRP HLDGS LTD 7.25%/19-19.04.2023 | 12,697 | 11,025.27 | 0.01 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.45%/17-08.11.2030 | 53 | 54.90 | 0.00 |
| USD CHINA SCE PROPERTY HLDGS 5.875%/17-10.03.2022 | 10,157 | 9,179.68 | 0.01 | CHF DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 0.5%/18-18.07.2028 | 67 | 68.90 | 0.00 |
| USD CISCO SYSTEMS 2.2%/16-28.02.2021 | 13,332 | 13,386.90 | 0.02 | CHF DEUTSCHE BAHN FINANCE 1.5%/14-26.08.2024 | 48 | 52.98 | 0.00 |
| USD CITIBANK NA 3.4%/18-23.07.2021 | 4,253 | 4,325.67 | 0.00 | CHF DEUTSCHE BANK 0.625%/15-19.12.2023 | 67 | 63.11 | 0.00 |
| CHF CITIGROUP INC 0.5%/17-22.11.2024 | 93 | 93.13 | 0.00 | EUR DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE 0.875%/17-30.10.2024 | 2,751 | 3,020.89 | 0.00 |
| CHF CITIGROUP INC 0.5%/19-01.11.2028 | 96 | 87.60 | 0.00 | CHF DH SWITZERLAND FINANCE 0.5%/15-08.12.2023 | 67 | 67.21 | 0.00 |
| CHF CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026 | 67 | 65.66 | 0.00 | CHF DH SWITZERLAND FINANCE 1.125%/15-08.12.2028 | 21 | 21.85 | 0.00 |
| USD CITIGROUP INC 2.7%/17-27.10.2022 | 14,665 | 14,752.28 | 0.02 | USD DIAMOND 1 FINANCE CORP / DIAMOND 2 FINANCE CORP -144A- 4.42%/16-15.06.2021 | 6,199 | 6,261.67 | 0.01 |
| EUR CITIGROUP S. 2.125%/14-10.09.2026 | 3,439 | 3,806.72 | 0.00 | USD DIB SUKUK LTD S. -5- 3.664%/17-14.02.2022 | 11,427 | 11,416.57 | 0.01 |
| USD CITIGROUP 2.9%/16-08.12.2021 | 14,665 | 14,797.01 | 0.02 | USD DIGICEL GROUP TWO LTD 9.125%/19-01.04.2024 | 7,727 | 827.48 | 0.00 |
| USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125%/17-19.07.2027 | 11,427 | 11,942.66 | 0.01 | USD DISCOVERY BANK 3.45%/16-27.07.2026 | 6,666 | 6,525.47 | 0.01 |
| USD CNOOC CURTIS FUNDING NO 1 (reg. -S-) 4.5%/13-03.10.2023 | 16,659 | 17,867.59 | 0.02 | USD DISCOVERY COMMUNICATIONS 2.95%/17-20.03.2023 | 7,332 | 7,314.84 | 0.01 |
| CHF COCA-COLA (reg. -S-) 0.25%/15-22.12.2022 | 213 | 222.13 | 0.00 | EUR DNB BOLIGKREDITT 2.75%/12-21.03.2022 | 1,376 | 1,597.37 | 0.00 |
| EUR COCA-COLA 1.125%/14-22.09.2022 | 2,751 | 3,045.59 | 0.00 | USD DOMINICAN REPUBLIC (reg. -S-) 5.5%/15-27.01.2025 | 7,350 | 6,996.40 | 0.01 |
| USD COCA-COLA 2.55%/16-01.06.2026 | 6,666 | 6,962.22 | 0.01 | USD DOMINICAN REPUBLIC (reg. -S-) 7.45%/14-30.04.2044 | 4,900 | 4,753.15 | 0.01 |
| USD COCA-COLA 2.875%/15-27.10.2025 | 4,000 | 4,276.00 | 0.00 | USD DOMINICAN REPUBLIC 6%/18-19.07.2028 | 7,350 | 6,910.48 | 0.01 |
| USD CODELCO INC 3%/19-30.09.2029 | 11,681 | 10,781.13 | 0.01 | USD DOWDUPONT INC 4.205%/18-15.11.2023 | 3,333 | 3,508.21 | 0.00 |
| USD CODELCO INC 3.625%/17-01.08.2027 | 13,332 | 13,071.21 | 0.02 | USD DOWDUPONT INC 4.725%/18-15.11.2028 | 7,999 | 8,764.29 | 0.01 |
| USD COLOMBIA 4.5%/15-28.01.2026 | 14,015 | 14,221.92 | 0.02 | USD DTEK FINANCE PLC 10.75%/16-31.12.2024 | 5,079 | 2,537.88 | 0.00 |
| USD COLOMBIA 5%/15-15.06.2045 | 9,799 | 10,056.83 | 0.01 | USD DUBAI 5.25%/13-30.01.2043 | 4,900 | 4,554.81 | 0.01 |
| USD COLOMBIA 6.125%/09-18.01.2041 | 9,799 | 11,190.53 | 0.01 | USD DUKE ENERGY 1.8%/16-01.09.2021 | 6,666 | 6,607.26 | 0.01 |
| USD COLOMBIA 7.375%/06-18.09.2037 | 4,900 | 6,121.16 | 0.01 | USD EADS FINANCE (reg. -S-) 2.7%/13-17.04.2023 | 6,666 | 6,701.05 | 0.01 |
| USD COMCAST CORP 4.15%/18-15.10.2028 | 4,100 | 4,633.21 | 0.01 | USD EATON 2.75%/13-02.11.2022 | 8,332 | 8,417.72 | 0.01 |
| USD COMCAST 3.125%/15-07.2022 | 8,406 | 8,663.70 | 0.01 | CHF EBN 0.5%/14-22.09.2022 | 112 | 115.60 | 0.00 |
| USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD (reg. -S-) 5.75%/12-140242 | 9,799 | 9,438.29 | 0.01 | USD ECOPETROL 7.375%/13-18.09.2043 | 20,314 | 20,617.91 | 0.02 |
| USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD (reg. -S-) 4.875%/13-15.01.2024 | 19,599 | 18,879.34 | 0.02 | USD ECUADOR (reg. -S-) 10.75%/16-28.03.2022 | 4,900 | 1,558.22 | 0.00 |
| CHF COMMONWEALTH BANK AUST 0.4%/17-25.09.2026 | 67 | 66.86 | 0.00 | USD EDF (reg. -S-) 2.35%/15-13.10.2020 | 9,999 | 9,990.68 | 0.01 |
| USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA NEW YORK BRANCH 2.4%/15-02.11.2020 | 6,666 | 6,660.39 | 0.01 | CHF EDF 0.3%/16-14.10.2024 | 67 | 67.59 | 0.00 |
| CHF COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.5%/14-07.02.2022 | 87 | 88.72 | 0.00 | CHF EDF 0.65%/16-13.10.2028 | 27 | 27.09 | 0.00 |
| CHF COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 1.5%/14-19.02.2024 | 133 | 145.24 | 0.00 | EUR EDF 4.625%/09-11.09.2024 | 1,376 | 1,754.63 | 0.00 |
| USD CONOCOPHILLIPS 4.95%/16-15.03.2026 | 9,999 | 10,649.10 | 0.01 | EUR EDP FINANCE BV 1.5%/17-22.11.2027 | 3,439 | 3,763.59 | 0.00 |
| EUR COOPERATIVE RABOBANK 1.25%/16-23.03.2026 | 2,751 | 3,049.81 | 0.00 | CHF EIB 1.125%/12-26.04.2023 | 200 | 215.27 | 0.00 |
| CHF COOPERATIVE RABOBANK 2%/10-16.09.2021 | 40 | 41.98 | 0.00 | USD EL SALVADOR (reg. -S-) 7.65%/05-15.06.2035 | 6,860 | 5,832.07 | 0.01 |
| CHF COOPERATIVE RABOBANK 3.125%/06-15.09.2026 | 27 | 30.59 | 0.00 | USD ELEMENTIA (reg. -S-) 5.5%/14-15.01.2025 | 11,427 | 9,197.59 | 0.01 |
| USD CORPORACION FINANCIERA DE DESARROLLO SA COFIDE (reg. -S-) 4.75%/15-15.07.2025 | 4,900 | 4,758.34 | 0.01 | CHF ELI LILLY & CO 0.15%/16-24.05.2024 | 87 | 88.54 | 0.00 |
| CHF CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024 | 48 | 50.67 | 0.00 | USD ELI LILLY & CO 3.375%/19-15.03.2029 | 4,999 | 5,542.13 | 0.01 |
| USD COSAN LTD 5.5%/19-20.09.2029 | 12,697 | 10,154.41 | 0.01 | USD EMIRATE OF KUWAIT (reg. -S-) 3.5%/17-20.03.2027 | 9,799 | 10,238.81 | 0.01 |
| USD COSTA RICA (reg. -S-) 4.25%/12-26.01.2023 | 7,840 | 7,024.83 | 0.01 | USD EMPRESA ELECTRICA COCHRA 5.5%/19-14.05.2027 | 6,348 | 5,736.15 | 0.01 |
| USD COSTA RICA (reg. -S-) 7.158%/15-12.03.2045 | 7,350 | 5,910.86 | 0.01 | USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO (reg. -S-) 3.75%/16-05.08.2026 | 19,599 | 18,284.88 | 0.02 |
| CHF CREDIT AGRICOLE CIB FINANCIAL SOLUTIONS 0.1275%/20-27.07.2028 | 49 | 40.12 | 0.00 | EUR ENEL FINANCE INTERNATIONAL (reg. -S-) S. 78 1.966%/15-27.01.2025 | 4,127 | 4,685.21 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.25%/17-27.07.2027 | 67 | 68.73 | 0.00 | CHF ENEL FINANCE INTERNATIONAL 0.55%/17-03.09.2024 | 80 | 81.48 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOA 0.45%/19-24.01.2029 | 53 | 55.70 | 0.00 | EUR ENI SPA 1%/17-14.03.2025 | 3,508 | 3,793.32 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/19-24.10.2029 | 67 | 68.07 | 0.00 | USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD 6.35%/18-10.08.2028 | 4,900 | 4,171.25 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.1%/16-26.01.2026 | 67 | 68.66 | 0.00 | USD ETHIOPIA (reg. -S-) 6.625%/14-11.12.2024 | 5,880 | 5,294.43 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE HOME LOAN 0.25%/15-18.06.2026 | 133 | 138.28 | 0.00 | CHF EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026 | 53 | 65.07 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 0.2%/18-30.10.2023 | 53 | 54.62 | 0.00 | CHF EUROHYPO 3.125%/06-14.07.2025 | 48 | 57.37 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 0.55%/15-01.09.2022 | 80 | 80.48 | 0.00 | USD EUROPEAN BK RECON & DEV 1.5%/20-13.02.2025 | 350,000 | 363,636.01 | 0.42 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 1%/19-07.11.2025 | 53 | 53.38 | 0.00 | USD EUROPEAN BK RECON & DEV 2.75%/18-07.03.2023 | 8,066 | 8,568.10 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE LONDON 2.125%/14-30.10.2024 | 40 | 44.32 | 0.00 | EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.625%/19-22.01.2029 | 1,376 | 1,599.29 | 0.00 |
| CHF CREDIT AGRICOLE SA 0.25%/19-10.10.2029 | 67 | 63.42 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.5%/18-15.03.2023 | 6,666 | 7,037.81 | 0.01 |
| CHF CREDIT AGRICOLE 0.625%/15-15.09.2023 | 13 | 13.44 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.625%/19-15.03.2024 | 16,625 | 17,916.88 | 0.02 |
| CHF CREDIT AGRICOLE 1%/15-27.01.2025 | 67 | 68.24 | 0.00 | USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025 | 1,000,000 | 1,111,380.01 | 1.28 |
| EUR CREDIT AGRICOLE 1.875%/16-20.12.2026 | 138 | 149.66 | 0.00 | EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.5%/09-15.10.2025 | 688 | 953.92 | 0.00 |
| CHF CREDIT SUISSE AG LONDON 0.55%/16-15.04.2024 | 133 | 134.14 | 0.00 | USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY (reg -S-) S. -2- 5.375%/16-24.10.2023 | 9,799 | 8,543.30 | 0.01 |
| USD CREDIT SUISSE GROUP FUNDING (GUERNSEY) 4.55%/16-17.04.2026 | 6,666 | 6,888.49 | 0.01 | USD EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.75%/18-15.03.2023 | 4,333 | 4,601.18 | 0.01 |
| CHF CREDIT SUISSE LONDON 1%/14-24.09.2021 | 85 | 87.84 | 0.00 | CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.17%/17-18.07.2025 | 67 | 64.80 | 0.00 |
| USD CREDIVALORES SA 9.75%/17-27.07.2022 | 10,157 | 8,843.57 | 0.01 | CHF EXPORT-IMPORT BANK KOREA 0.253%/18-06.03.2023 | 27 | 27.30 | 0.00 |
| CHF CRH 1.375%/13-15.03.2023 | 53 | 57.54 | 0.00 | USD EXPORT-IMPORT BANK KOREA 3%/17-01.11.2022 | 2,066 | 2,149.05 | 0.00 |
| CHF CS GROUP FUNDING 1%/15-14.04.2023 | 173 | 181.02 | 0.00 | USD EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 2.875%/16-26.04.2026 | 9,799 | 10,376.78 | 0.01 |
| USD CSN ISLANDS XI CORP 6.75%/20-28.01.2028 | 10,157 | 6,556.17 | 0.01 | USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA (REG. -S-) 3.375%/16-05.08.2026 | 4,900 | 4,728.11 | 0.01 |
| USD CVS HEALTH CORP 3.35%/18-09.03.2021 | 8,292 | 8,348.05 | 0.01 | USD EXPRESS SCRIPTS HOLDING 3.4%/16-01.03.2027 | 6,999 | 6,721.84 | 0.01 |
| USD CVS HEALTH CORP 3.7%/18-09.03.2023 | 10,305 | 10,681.66 | 0.01 | | | | |
| USD CVS HEALTH CORP 4.1%/18-25.03.2025 | 2,166 | 2,280.46 | 0.00 | | | | |
| USD CVS HEALTH CORP 4.3%/18-25.03.2028 | 9,999 | 10,611.51 | 0.01 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| USD EXXON MOBIL 2.709%/15-06.03.2025 | 1,866 | 1,949.12 | 0.00 | CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029 | 69 | 65.38 | 0.00 |
| USD EZDAN SUKUK CO LTD S. -2- 4.875%/17-05.04.2022 | 7,618 | 5,958.65 | 0.01 | CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/20-27.03.2030 | 59 | 51.30 | 0.00 |
| EUR FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 1.5%/14-15.05.2024 | 6,672 | 7,993.97 | 0.01 | CHF HYPO VORARLBERG BANK AG 0.45%/18-05.03.2024 | 67 | 66.86 | 0.00 |
| USD FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL 5.625%/16-21.02.2047 | 4,900 | 5,042.72 | 0.01 | CHF HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 0.26%/20-11.02.2025 | 58 | 57.40 | 0.00 |
| USD FIDEIOMISO F/1401 (reg. -S-) 5.25%/14-15.12.2024 | 7,618 | 7,272.66 | 0.01 | EUR IBM CORP 0.95%/17-23.05.2025 | 3,439 | 3,776.94 | 0.00 |
| USD FIFTH THIRD BANCORP 3.65%/19-25.01.2024 | 4,999 | 5,174.07 | 0.01 | USD IBM 3.375%/13-01.08.2023 | 4,266 | 4,479.80 | 0.01 |
| USD FINANCIERA INDEPENDENCIA 8%/17-19.07.2024 | 5,079 | 3,505.40 | 0.00 | USD IBM 3.625%/14-12.02.2024 | 1,800 | 1,922.90 | 0.00 |
| EUR FINLAND 4%/09-04.07.2025 | 1,376 | 1,859.80 | 0.00 | CHF IBRD 0%/86-26.11.2021 | 27 | 27.70 | 0.00 |
| EUR FINNISH GOVERNMENT -144A- 0.5%/17-15.09.2027 | 2,063 | 2,379.26 | 0.00 | USD IBRD 1.875%/15-07.10.2022 | 28,330 | 29,246.35 | 0.03 |
| EUR FINNISH GOVERNMENT -144A- 0.5%/18-15.09.2028 | 5,503 | 6,359.85 | 0.01 | EUR IMPERIAL BRANDS FINANCE (reg. -S-) 1.375%/17-27.01.2025 | 2,751 | 2,951.64 | 0.00 |
| USD FIRST QUANTUM MINERALS L 7.25%/17-01.04.2023 | 5,079 | 4,282.58 | 0.00 | USD INDIAN RAILWAY FINANCE 3.249%/20-13.02.2030 | 5,079 | 4,622.75 | 0.01 |
| USD FOMENTO ECONOMICO MEX 3.5%/20-16.01.2050 | 11,427 | 10,644.80 | 0.01 | USD INDONESIA (reg. -S-) 7.75%/08-17.01.2038 | 9,799 | 13,538.88 | 0.02 |
| EUR FRANCE (GOVT OF) 0%/19-25.11.2029 | 688 | 756.27 | 0.00 | USD INDONESIA (reg. -S-) 8.5%/05-12.10.2035 | 4,900 | 7,040.45 | 0.01 |
| EUR FRANCE (GOVT OF) 0.5%/19-25.05.2029 | 1,692 | 1,952.50 | 0.00 | USD INDONESIA S. -22- (reg. -S-) 5.25%/16-08.01.2047 | 9,799 | 10,854.02 | 0.01 |
| EUR FRANCE (GOVT OF) 0.75%/17-25.05.2028 | 1,651 | 1,942.21 | 0.00 | USD INDUSTRIAS PENOLES SAB D 4.15%/19-12.09.2029 | 10,157 | 8,893.75 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 0%/16-25.05.2022 | 11,693 | 12,991.60 | 0.01 | USD ING GROEP NV 4.1%/18-02.10.2023 | 6,666 | 6,817.37 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 0.5%/15-25.05.2025 | 8,612 | 9,870.49 | 0.01 | EUR ING GROUP 0.75%/17-09.03.2022 | 3,439 | 3,700.49 | 0.00 |
| EUR FRANCE OAT 0.5%/15-25.05.2026 | 2,063 | 2,371.13 | 0.00 | USD INKIA ENERGY LTD 5.875%/17-09.11.2027 | 10,157 | 8,798.78 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 1%/14-25.11.2025 | 5,172 | 6,093.81 | 0.01 | USD INTEL 2.7%/12-15.12.2022 | 6,666 | 6,930.89 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 1.75%/13-25.05.2023 | 4,127 | 4,854.21 | 0.01 | USD INTER-AMERICAN DEVELOP BK 1.75%/17-14.09.2022 | 12,952 | 13,326.84 | 0.02 |
| EUR FRANCE OAT 1.75%/13-25.11.2024 | 4,127 | 4,984.08 | 0.01 | USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK IADB S.-510- T. -60- 1.75%/15-14.04.2022 | 19,998 | 20,494.70 | 0.02 |
| EUR FRANCE OAT 1.75%/17-25.06.2039 | 30,000 | 40,576.74 | 0.05 | USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE 3.75%/15-01.12.2025 | 9,999 | 10,547.32 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 2.25%/11-25.10.2022 | 5,172 | 6,089.56 | 0.01 | USD INTERCORP FIN SER INC 4.125%/17-19.10.2027 | 15,236 | 13,926.14 | 0.02 |
| EUR FRANCE OAT 2.75%/12-25.10.2027 | 963 | 1,292.25 | 0.00 | USD INTERCORP PERU LTD 3.875%/19-15.08.2029 | 6,348 | 5,576.62 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 3%/11-25.04.2022 | 2,751 | 3,244.92 | 0.00 | USD INTERNATIONAL PAPER 3%/16-15.02.2027 | 8,332 | 8,503.38 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 3.5%/10-25.04.2026 | 2,063 | 2,785.70 | 0.00 | CHF INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024 | 59 | 55.84 | 0.00 |
| EUR FRANCE OAT 4.25%/07-25.10.2023 | 2,421 | 3,111.26 | 0.00 | USD INTL BK RECON & DEVELOP 2.75%/18-23.07.2021 | 6,666 | 6,859.30 | 0.01 |
| EUR FRANCE OAT 5.5%/98-25.04.2029 | 1,816 | 3,005.10 | 0.00 | USD INTL FINANCE CORP 2%/17-24.10.2022 | 8,566 | 8,881.18 | 0.01 |
| USD GAZ CAPITAL (reg. -S-) S. 12.7.288%/07-16.08.2037 | 12,697 | 16,228.17 | 0.02 | USD IRAQ (reg. -S-) STEP UP 06-15.01.2028 | 8,820 | 6,703.38 | 0.01 |
| CHF GDF SUEZ 1.625%/12-09.10.2024 | 53 | 56.77 | 0.00 | EUR IRELAND TREASURY BOND 1%/16-15.05.2026 | 1,376 | 1,613.40 | 0.00 |
| USD GEOPARK LTD 6.5%/17-21.09.2024 | 10,157 | 5,764.11 | 0.01 | EUR IRISH TSY 2022 0%/17-18.10.2022 | 5,503 | 6,099.02 | 0.01 |
| EUR GERMANY 0%/16-15.08.2026 | 4,127 | 4,712.61 | 0.01 | EUR IRISH TSY 2028 0.9%/18-15.05.2028 | 688 | 810.79 | 0.00 |
| EUR GERMANY 0.25%/17-15.02.2027 | 1,995 | 2,323.66 | 0.00 | USD ISRAEL 2.875%/16-16.03.2026 | 14,699 | 15,301.03 | 0.02 |
| EUR GERMANY 0.50%/16-15.02.2026 | 1,376 | 1,613.01 | 0.00 | EUR ITALY BTP 0.95%/16-10.03.2023 | 2,339 | 2,596.45 | 0.00 |
| EUR GERMANY 0.5%/15-15.02.2025 | 1,376 | 1,597.89 | 0.00 | EUR ITALY BTP 1.25%/16-01.12.2026 | 1,754 | 1,941.60 | 0.00 |
| EUR GERMANY 1%/14-15.08.2024 | 2,875 | 3,391.51 | 0.00 | EUR ITALY BTP 1.45%/15-15.09.2022 | 2,339 | 2,624.80 | 0.00 |
| EUR GERMANY 1%/15-15.08.2025 | 2,407 | 2,880.96 | 0.00 | EUR ITALY BTP 1.5%/15-01.06.2025 | 949 | 1,069.21 | 0.00 |
| EUR GERMANY 1.5%/13-15.02.2023 | 4,829 | 5,639.79 | 0.01 | EUR ITALY BTP 1.6%/16-01.06.2026 | 2,063 | 2,333.12 | 0.00 |
| EUR GERMANY 1.5%/13-15.05.2023 | 4,127 | 4,845.74 | 0.01 | EUR ITALY BTP 1.85%/17-15.05.2024 | 2,339 | 2,677.17 | 0.00 |
| USD GHANA (reg. -S-) 8.125%/14-18.01.2026 | 2,450 | 1,923.40 | 0.00 | EUR ITALY BTP 2%/15-01.12.2025 | 1,754 | 2,027.40 | 0.00 |
| USD GILEAD SCIENCES 4.4%/11-01.12.2021 | 3,333 | 3,468.74 | 0.00 | EUR ITALY BTP 2.2%/17-01.06.2027 | 963 | 1,128.98 | 0.00 |
| USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 3%/19-01.06.2024 | 6,666 | 6,973.75 | 0.01 | EUR ITALY BTP 3.75%/10-01.03.2021 | 4,127 | 4,676.11 | 0.01 |
| CHF GLENCORE FINANCE 1.25%/14-01.12.2020 | 80 | 81.68 | 0.00 | EUR ITALY BTP 3.75%/14-01.09.2024 | 963 | 1,186.88 | 0.00 |
| EUR GLOBAL SWITCH HOLDINGS L 2.25%/17-31.05.2027 | 2,063 | 2,305.50 | 0.00 | EUR ITALY BTP 4.5%/13-01.03.2024 | 1,128 | 1,415.15 | 0.00 |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP INC FIX-TO-FRN FRN/18-01.05.2029 | 6,666 | 7,037.48 | 0.01 | EUR ITALY BTP 4.5%/13-01.05.2023 | 1,169 | 1,435.89 | 0.00 |
| CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.5%/17-04.12.2024 | 141 | 138.83 | 0.00 | EUR ITALY Btp 4.75%/08-01.08.2023 | 2,339 | 2,916.05 | 0.00 |
| CHF GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025 | 67 | 65.14 | 0.00 | EUR ITALY BTP 4.75%/11-01.09.2021 | 3,508 | 4,091.55 | 0.00 |
| EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.375%/17-15.05.2024 | 2,751 | 2,963.96 | 0.00 | EUR ITALY BTP 4.75%/13-01.09.2028 | 1,142 | 1,588.71 | 0.00 |
| EUR GOLDMAN SACHS GROUP 2%/15-27.07.2023 | 1,376 | 1,511.96 | 0.00 | EUR ITALY BTP 5.5%/12-01.09.2022 | 1,788 | 2,196.13 | 0.00 |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP 3%/17-26.04.2022 | 19,924 | 20,047.57 | 0.02 | EUR ITALY BTP 5.5%/12-01.11.2022 | 1,032 | 1,276.64 | 0.00 |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP 4%/14-03.03.2024 | 6,119 | 6,414.26 | 0.01 | EUR ITALY BTP 5%/98-01.03.2025 | 1,376 | 1,802.57 | 0.00 |
| USD GOLDMAN SACHS GROUP 5.75%/12-24.01.2022 | 9,832 | 10,449.96 | 0.01 | EUR ITALY 1.35%/15-15.04.2022 | 853 | 952.60 | 0.00 |
| USD GREENLAND GLB INVST 6.75%/19-26.09.2023 | 20,314 | 17,857.18 | 0.02 | EUR ITALY 2.5%/14-01.12.2024 | 990 | 1,165.25 | 0.00 |
| USD GRUPO BIMBO SAB DE CV 4%/19-06.09.2049 | 5,079 | 4,277.45 | 0.00 | EUR ITALY 3.75%/06-01.08.2021 | 1,554 | 1,784.63 | 0.00 |
| USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.65%/20-10.03.2027 | 10,157 | 8,863.69 | 0.01 | USD IVORY COAST (reg. -S-) 6.375%/15-03.03.2028 | 12,249 | 11,243.20 | 0.01 |
| USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.949%/19-18.02.2026 | 21,330 | 19,438.36 | 0.02 | CHF JACKSON NATL LIFE GLOBAL 0.375%/17-18.07.2025 | 107 | 108.14 | 0.00 |
| USD GTLK EUROPE DAC 5.95%/19-17.04.2025 | 8,380 | 7,991.71 | 0.01 | USD JAMAICA 7.625%/14-09.07.2025 | 4,900 | 5,240.23 | 0.01 |
| USD GUATEMALA (reg. -S-) 4.875%/13-13.02.2028 | 5,880 | 5,749.46 | 0.01 | USD JAMAICA 8%/07-15.03.2039 | 4,900 | 5,343.57 | 0.01 |
| USD GULF INTERNATIONAL BANK 3.5%/17-25.03.2022 | 7,618 | 7,487.26 | 0.01 | USD JOHN DEERE CAPITAL S. -F- 2.8%/16-06.03.2023 | 6,666 | 6,837.03 | 0.01 |
| USD HEWLETT-PACKARD ENTERPRISE 4.4%/16-15.10.2022 | 6,666 | 6,829.76 | 0.01 | USD JOHNSON & JOHNSON 2.9%/17-15.01.2028 | 6,666 | 7,325.31 | 0.01 |
| CHF HOLCIM OVERSEAS FINANCE 3.375%/11-10.06.2021 | 69 | 73.79 | 0.00 | CHF JP MORGAN CHASE 0.5%/15-04.12.2023 | 180 | 183.15 | 0.00 |
| USD HOME DEPOT INC 3.9%/18-06.12.2028 | 6,106 | 6,797.60 | 0.01 | EUR JP MORGAN CHASE 1.375%/14-16.09.2021 | 2,063 | 2,264.56 | 0.00 |
| USD HOME DEPOT 3.75%/13-15.02.2024 | 13,998 | 14,787.10 | 0.02 | EUR JP MORGAN CHASE 2.75%/13-01.02.2023 | 4,127 | 4,675.65 | 0.01 |
| EUR HONEYWELL INTERNATIONAL 1.3%/16-22.02.2023 | 2,063 | 2,297.32 | 0.00 | EUR JP MORGAN CHASE 4.4%/10-22.07.2020 | 13,332 | 13,396.24 | 0.02 |
| USD HSBC HOLDINGS PLC FRN/18-19.06.2029 | 4,313 | 4,554.80 | 0.01 | USD JPMORGAN CHASE & CO 3.2%/13-25.01.2023 | 4,273 | 4,406.59 | 0.01 |
| USD HSBC HOLDINGS 3.4%/16-08.03.2021 | 8,286 | 8,329.16 | 0.01 | USD JPMORGAN CHASE FIX-TO-FLOATER 17-01.05.2028 | 4,000 | 4,165.53 | 0.00 |
| USD HSBC USA 2.75%/15-07.08.2020 | 6,666 | 6,680.59 | 0.01 | USD JPMORGAN CHASE 2.972%/16-15.01.2023 | 14,665 | 14,847.02 | 0.02 |
| USD HUARONG FINANCE II 5.5%/15-16.01.2025 | 10,157 | 10,736.27 | 0.01 | USD JPMORGAN CHASE 4.35%/11-15.08.2021 | 4,066 | 4,182.86 | 0.00 |
| USD HUARONG FINANCE 2017 CO 4.75%/17-27.04.2027 | 21,584 | 22,331.30 | 0.03 | USD JPN BANK FOR INT'L COOP 2.25%/16-04.11.2026 | 5,333 | 5,721.54 | 0.01 |
| EUR HUNGARY 1.75%/17-10.10.2027 | 1,376 | 1,626.40 | 0.00 | USD JSL EUROPE 7.75%/17-26.07.2024 | 12,697 | 9,442.39 | 0.01 |
| CHF HYPO NOE GRUPPE BANK 0.2%/17-31.03.2022 | 133 | 131.66 | 0.00 | USD KAZAKHSTAN (reg. -S-) S. -4- 6.5%/15-21.07.2045 | 4,900 | 6,404.66 | 0.01 |
| CHF HYPO NOE LB NOE WIEN AG 0.1%/19-27.11.2024 | 67 | 65.66 | 0.00 | USD KAZAKHSTAN (reg. -S-) 3.875%/14-14.10.2024 | 7,350 | 7,470.67 | 0.01 |
| | | | | USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE (reg. -S-) 6.95%/12-10.07.2042 | 5,880 | 6,187.20 | 0.01 |
| | | | | USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 6.375%/18-24.10.2048 | 2,450 | 2,432.55 | 0.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|--------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 4.75%/17-19.04.2027 | 7,350 | 7,105.47 | 0.01 | USD MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/19-23.01.2030 | 6,666 | 7,386.77 | 0.01 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 5.75%/17-29.04.2047 | 4,900 | 4,900.14 | 0.01 | EUR MORGAN STANLEY 1.75%/15-30.01.2025 | 4,127 | 4,485.38 | 0.01 |
| USD KENYA (reg. -S-) 6.875%/14-24.06.2024 | 7,350 | 6,960.68 | 0.01 | USD MORGAN STANLEY 2.75%/17-19.05.2022 | 14,665 | 14,817.25 | 0.02 |
| EUR KFW 0.01%/19-05.05.2027 | 50,000 | 55,291.52 | 0.06 | USD MORGAN STANLEY 3.125%/18-23.01.2023 | 13,332 | 13,627.27 | 0.02 |
| EUR KFW 0.625%/17-22.02.2027 | 688 | 794.07 | 0.00 | USD MOROCCO (reg. -S-) 4.25%/12-11.12.2022 | 4,900 | 4,864.08 | 0.01 |
| USD KFW 1.5%/16-15.06.2021 | 4,319 | 4,372.60 | 0.01 | USD MOROCCO (reg. -S-) 5.5%/12-11.12.2042 | 4,900 | 5,189.81 | 0.01 |
| USD KFW 1.75%/19-14.09.2029 | 1,250,000 | 1,331,050.01 | 1.54 | USD MPLX 4.125%/17-01.03.2027 | 6,666 | 5,718.24 | 0.01 |
| USD KFW 2%/17-29.09.2022 | 1,300,000 | 1,346,540.01 | 1.56 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.25%/19-26.02.2029 | 64 | 67.43 | 0.00 |
| CHF KFW 2.5%/05-25.08.2025 | 93 | 110.64 | 0.00 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.3%/17-20.12.2024 | 64 | 62.34 | 0.00 |
| USD KINDER MORGAN 4.3%/14-01.06.2025 | 6,666 | 6,794.97 | 0.01 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.5%/18-14.06.2028 | 80 | 86.15 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF BAHRAIN (reg. -S-) 6.125%/13-01.08.2023 | 9,799 | 9,304.72 | 0.01 | CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12-08.06.2027 | 67 | 75.65 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF BAHRAIN 7%/16-12.10.2028 | 19,599 | 17,939.54 | 0.02 | CHF NA DEVELOPMENT BANK 0.3%/18-24.07.2026 | 29 | 30.74 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF JORDAN (reg. -S-) 5.75%/16-31.01.2027 | 5,880 | 5,178.13 | 0.01 | USD NAMIBIA (reg. -S-) 5.5%/11-03.11.2021 | 5,880 | 5,643.22 | 0.01 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 4.5%/16-26.10.2046 | 9,799 | 10,002.25 | 0.01 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19-21.06.2027 | 200 | 195.42 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDIA ARABIA (reg. -S-) 3.25%/16-26.10.2026 | 4,900 | 4,915.72 | 0.01 | USD NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH T. -17- 2.5%/16-12.07.2026 | 2,293 | 2,309.63 | 0.00 |
| USD KOC HOLDING AS 6.5%/19-11.03.2025 | 5,586 | 5,164.63 | 0.01 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17-31.10.2025 | 80 | 77.76 | 0.00 |
| USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025 | 1,000,000 | 1,065,480.01 | 1.23 | EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.875%/12-13.01.2023 | 1,830 | 2,116.96 | 0.00 |
| AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023 | 2,000 | 1,357.52 | 0.00 | USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.7%/18-04.11.2021 | 4,206 | 4,313.07 | 0.00 |
| CHF KOMMUNEKREDIT 0.625%/15-09.07.2027 | 53 | 57.68 | 0.00 | CHF NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0%/19-11.07.2025 | 74 | 76.64 | 0.00 |
| USD KOREA EAST-WEST POWER CO 3.875%/18-19.07.2023 | 5,079 | 5,426.03 | 0.01 | EUR NETHERLANDS (reg. -S-) 1.75%/13-15.07.2023 | 5,283 | 6,259.58 | 0.01 |
| USD KOREA GAS CORPORATION (reg. -S-) T. -11- 2.25%/16-18.07.2026 | 7,618 | 7,680.52 | 0.01 | EUR NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026 | 1,376 | 1,601.04 | 0.00 |
| CHF KOREA GAS CORPORATION 0%/19-28.11.2023 | 28 | 28.33 | 0.00 | EUR NETHERLANDS 2%/14-15.07.2024 | 2,063 | 2,519.34 | 0.00 |
| CHF KOREA NATIONAL OIL CORP 0.373%/18-01.06.2023 | 19 | 19.09 | 0.00 | CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.25%/19-18.10.2027 | 67 | 65.14 | 0.00 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) T. 7 3.25%/14-10.07.2024 | 17,267 | 18,236.63 | 0.02 | USD NEXTERA ENERGY CAPITAL 3.55%/17-01.05.2027 | 7,332 | 7,523.96 | 0.01 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) 2.625%/16-14.04.2026 | 9,999 | 10,351.14 | 0.01 | USD NISOURCE INC 3.49%/17-15.05.2027 | 7,332 | 7,432.97 | 0.01 |
| USD KOREA RESOURCES CORP 4%/18-18.04.2023 | 12,697 | 13,357.49 | 0.02 | CHF NORDEA BANK 0.25%/15-27.11.2023 | 133 | 135.52 | 0.00 |
| CHF KOREA WESTERN POWER CO LTD 0.125%/19-27.02.2024 | 44 | 45.02 | 0.00 | CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025 | 51 | 50.14 | 0.00 |
| USD KOREA WESTERN POWER CO 3.75%/18-07.06.2023 | 12,697 | 13,561.01 | 0.02 | CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025 | 133 | 138.76 | 0.00 |
| USD KSA SUKUK LTD S. -1- 2.894%/17-20.04.2022 | 9,799 | 9,825.76 | 0.01 | USD NOVARTIS CAPITAL 3%/15-20.11.2025 | 16,665 | 17,847.99 | 0.02 |
| EUR LAND NORDRHEIN-WESTFALEN 0.5%/17-16.02.2027 | 3,439 | 3,908.30 | 0.00 | USD NOVARTIS CAPITAL 3.4%/14-06.05.2024 | 8,666 | 9,280.61 | 0.01 |
| USD LCPR SR SECURED FIN DAC 6.75%/19-15.10.2027 | 5,079 | 5,067.79 | 0.01 | EUR NOVARTIS FINANCE (reg. -S-) 0.125%/16-20.09.2023 | 1,376 | 1,486.37 | 0.00 |
| CHF LGT BANK 1.5%/14-10.05.2021 | 160 | 167.92 | 0.00 | EUR NWB (reg. -S-) S. -1418- 0.5%/15-27.10.2022 | 2,875 | 3,218.88 | 0.00 |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 1.25%/17-12.09.2027 | 2,751 | 2,849.15 | 0.00 | EUR OBRIGACOE DO TESOURO -144A- 1.95%/19-15.06.2029 | 413 | 500.64 | 0.00 |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05%/18-16.08.2023 | 6,666 | 6,887.29 | 0.01 | EUR OBRIGACOE DO TESOURO -144A- 2.125%/18-17.10.2028 | 963 | 1,180.83 | 0.00 |
| USD LONGFOR HOLDINGS LTD 3.95%/19-16.09.2029 | 11,935 | 11,207.53 | 0.01 | CHF OEKB 1%/12-28.09.2021 | 27 | 28.01 | 0.00 |
| USD LOWE'S COS INC 3.65%/19-05.04.2029 | 4,333 | 4,449.53 | 0.01 | CHF OEKB 2.625%/06-22.11.2024 | 67 | 77.86 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023 | 43 | 40.63 | 0.00 | CHF OEKB 3%/07-14.06.2022 | 53 | 58.95 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 3%/12-29.11.2022 | 53 | 55.75 | 0.00 | USD OIL & NATURAL GAS CORPORATION LTD 3.375%/19-05.12.2029 | 21,584 | 17,580.87 | 0.02 |
| USD MAF GLOBAL SECURITIES (subordinated) FIX-TO-FLOATERS 6.375%/18-PERPETUAL | 12,697 | 9,665.72 | 0.01 | USD OIL INDIA LTD 5.125%/19-04.02.2029 | 6,348 | 5,601.83 | 0.01 |
| USD MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK 3.043%/15-22.04.2025 | 14,699 | 15,437.88 | 0.02 | USD OMAN (reg. -S-) 5.375%/17-08.03.2027 | 7,350 | 5,283.13 | 0.01 |
| USD MAR SUKUK LTD 3.025%/19-13.11.2024 | 20,314 | 19,366.95 | 0.02 | USD OMAN (reg. -S-) 6.5%/17-08.03.2047 | 4,900 | 3,196.11 | 0.00 |
| CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024 | 40 | 40.10 | 0.00 | USD OMAN SOVEREIGN SUKUK 5.932%/18-31.10.2025 | 4,900 | 4,375.96 | 0.01 |
| USD MCDONALD'S 3.7%/15-30.01.2026 | 6,666 | 7,014.08 | 0.01 | CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.25%/17-28.06.2029 | 53 | 54.90 | 0.00 |
| USD MEDTRONIC 3.15%/15-15.03.2022 | 9,999 | 10,364.04 | 0.01 | USD ONTARIO (PROVINCE OF) 3.05%/19-29.01.2024 | 20,744 | 22,395.58 | 0.03 |
| USD MENDOZA PROVINCE 8.375%/16-19.05.2024 | 5,079 | 2,267.04 | 0.00 | AUD ONTARIO 6.25%/10-29.09.2020 | 150,000 | 94,271.94 | 0.11 |
| USD MERCK & CO 2.35%/15-10.02.2022 | 6,313 | 6,482.06 | 0.01 | CHF OP CORPORATE BANK 1%/14-14.07.2021 | 133 | 137.38 | 0.00 |
| USD MERCK & CO 3.875%/10-15.01.2021 | 8,072 | 8,161.71 | 0.01 | USD ORACLE 1.9%/16-15.09.2021 | 4,199 | 4,213.81 | 0.00 |
| CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027 | 93 | 90.71 | 0.00 | USD ORACLE 2.65%/16-15.07.2026 | 6,866 | 7,015.03 | 0.01 |
| USD METINVEST BV 7.75%/18-23.04.2023 | 5,079 | 3,584.99 | 0.00 | USD PAKISTAN (reg. -S-) 8.25%/14-15.04.2024 | 16,659 | 14,824.64 | 0.02 |
| USD METINVEST B.V. 7.75%/19-17.10.2029 | 8,126 | 5,688.04 | 0.01 | USD PANAMA 7.125%/05-29.01.2026 | 24,499 | 29,604.52 | 0.03 |
| USD METINVEST BV 8.5%/18-23.04.2026 | 25,393 | 17,855.86 | 0.02 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 5%/16-15.04.2026 | 6,860 | 7,007.40 | 0.01 |
| USD METRO (reg. -S-) 5%/17-25.01.2047 | 4,900 | 4,888.48 | 0.01 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 6.1%/14-11.08.2044 | 4,900 | 5,155.61 | 0.01 |
| USD MHP LUX SA 6.95%/18-03.04.2026 | 10,157 | 8,150.45 | 0.01 | USD PEPSICO INC 3%/17-15.10.2027 | 11,665 | 12,412.75 | 0.01 |
| EUR MICROSOFT 2.125%/13-06.12.2021 | 2,875 | 3,231.85 | 0.00 | USD PERU 5.625%/10-18.11.2050 | 9,799 | 14,375.56 | 0.02 |
| USD MICROSOFT 3.125%/15-03.11.2025 | 4,219 | 4,616.37 | 0.01 | USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR S. -8- 3.375%/19-05.02.2030 | 9,799 | 9,066.49 | 0.01 |
| USD MICROSOFT 3.3%/17-06.02.2027 | 9,999 | 11,088.85 | 0.01 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5.75%/18-01.02.2029 | 12,697 | 11,978.01 | 0.01 |
| USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR (reg. -S-) 6%/15-15.03.2025 | 10,157 | 9,454.43 | 0.01 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 7.375%/17-17.01.2027 | 15,236 | 15,611.37 | 0.02 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.25%/19-25.03.2029 | 5,840 | 5,333.45 | 0.01 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA (reg. -S-) 9%/11-17.11.2021 | 9,799 | 678.91 | 0.00 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.625%/18-15.10.2026 | 7,618 | 7,201.28 | 0.01 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA 5.5%/07-12.04.2037 | 29,398 | 2,011.15 | 0.00 |
| USD MINEJESA CAPITAL BV 4.625%/17-10.08.2030 | 19,045 | 17,140.28 | 0.02 | USD PETROLEOS DEL PERU SA 5.625%/17-19.06.2047 | 17,149 | 15,523.38 | 0.02 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.407%/19-07.03.2024 | 6,666 | 6,871.96 | 0.01 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.5%/11-02.06.2041 | 4,900 | 3,125.60 | 0.00 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.455%/18-02.03.2023 | 4,066 | 4,163.52 | 0.00 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.875%/16-04.02.2026 | 9,799 | 7,419.98 | 0.01 |
| USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.85%/16-01.03.2026 | 4,119 | 4,328.89 | 0.00 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.5%/18-13.03.2027 | 4,900 | 3,622.97 | 0.00 |
| USD MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018%/18-05.03.2028 | 13,332 | 14,324.39 | 0.02 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.95%/20-28.01.2060 | 5,079 | 3,379.35 | 0.00 |
| EUR MOLSON COORS BREWING 1.25%/16-15.07.2024 | 2,751 | 2,972.38 | 0.00 | USD PETROLEOS VENEZUELA (REG-.S.) 6%/14-16.05.2024 | 9,799 | 687.24 | 0.00 |
| CHF MONDELEZ INTERNATIONAL (reg. -S-) 0.65%/16-26.07.2022 | 147 | 151.50 | 0.00 | USD PETRONAS CAPITAL (REG.-S-) 3.5%/15-18.03.2025 | 2,450 | 2,505.68 | 0.00 |
| CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625%/15-30.12.2021 | 13 | 13.79 | 0.00 | USD PETRONAS CAPITAL (reg. -S-) 4.5%/15-18.03.2045 | 4,900 | 5,080.30 | 0.01 |
| USD MONGOLIA (reg. -S-) T. 2 5.125%/12-05.12.2022 | 2,940 | 2,645.78 | 0.00 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| USD PETROPAVLOVSK 2016 8.125%/17-14.11.2022 | 22,854 | 21,979.79 | 0.03 | USD ROMANIA (reg. -S-) 4.375%/13-22.08.2023 | 8,820 | 9,155.22 | 0.01 |
| USD PFIZER 3%/13-15.06.2023 | 6,279 | 6,577.44 | 0.01 | USD ROMANIA (reg. -S-) 6.125%/14-22.01.2044 | 4,900 | 5,627.36 | 0.01 |
| CHF PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1.625%/14-16.05.2024 | 40 | 42.17 | 0.00 | EUR ROMANIA 2.375%/17-19.04.2027 | 1,376 | 1,529.43 | 0.00 |
| EUR PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 1.875%/14-03.03.2021 | 1,830 | 2,021.32 | 0.00 | USD ROYAL BANK OF CANADA S. -G- 2.75%/17-01.02.2022 | 4,666 | 4,751.02 | 0.01 |
| CHF PHILIP MORRIS INTERNATIONAL 2%/11-06.12.2021 | 53 | 56.17 | 0.00 | USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP 4.8%/16-05.04.2026 | 6,666 | 7,176.73 | 0.01 |
| USD PHILIP MORRIS INTL INC 2.375%/17-17.08.2022 | 4,459 | 4,492.95 | 0.01 | USD RUSSIAN FEDERATION (reg. -S-) 5.625%/12-04.04.2042 | 23,519 | 28,642.82 | 0.03 |
| USD PHILIP MORRIS INTL INC 2.5%/17-02.11.2022 | 1,886 | 1,892.44 | 0.00 | USD SANOFI 3.625%/18-19.06.2028 | 6,666 | 7,488.15 | 0.01 |
| USD PHILIPPINES 5%/12-13.01.2037 | 2,450 | 2,917.33 | 0.00 | CHF SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 0.15%/19-10.12.2024 | 59 | 58.20 | 0.00 |
| CHF PKO BANK POLSKI SA 0.3%/17-02.11.2021 | 53 | 53.77 | 0.00 | USD SANTANDER HOLDINGS USA 4.45%/18-03.12.2021 | 6,259 | 6,298.48 | 0.01 |
| USD PNC BANK NA 2.45%/15-05.11.2020 | 6,666 | 6,676.32 | 0.01 | EUR SANTANDER UK GROUP HOLDINGS 1.125%/16-08.09.2023 | 1,376 | 1,455.73 | 0.00 |
| CHF POLAND 1%/14-17.09.2021 | 75 | 77.71 | 0.00 | USD SANTANDER UK 2.875%/16-05.08.2021 | 7,332 | 7,242.47 | 0.01 |
| USD POLAND 5%/11-23.03.2022 | 3,486 | 3,722.75 | 0.00 | USD SASOL FINANCING USA LLC 6.5%/18-27.09.2028 | 10,157 | 4,266.03 | 0.00 |
| USD POLYUS FINANCE PLC CV 1%/18-26.01.2021 | 10,157 | 15,592.33 | 0.02 | USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 2.875%/19-16.04.2024 | 9,799 | 9,548.24 | 0.01 |
| EUR PORTUGAL 2.2%/15-17.10.2022 | 2,751 | 3,195.08 | 0.00 | USD SAUDI ARABIAN OIL COMPANY 3.5%/19-16.04.2029 | 20,314 | 20,101.31 | 0.02 |
| EUR PORTUGAL 2.875%/15-15.10.2025 | 688 | 857.10 | 0.00 | USD SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.75%/20-03.02.2032 | 27,285 | 25,507.02 | 0.03 |
| EUR PORTUGAL 5.65%/13-15.02.2024 | 688 | 915.59 | 0.00 | USD SCF CAPITAL (reg. -S-) 5.375%/16-16.06.2023 | 19,599 | 19,712.86 | 0.02 |
| USD POWER FINANCE CORP LTD 3.75%/17-06.12.2027 | 12,697 | 11,058.28 | 0.01 | USD SCHLUMBERGER INVESTMENT 3.65%/13-01.12.2023 | 13,332 | 13,203.59 | 0.02 |
| USD POWER FINANCE CORP LTD 3.9%/19-16.09.2029 | 6,348 | 5,426.11 | 0.01 | USD SHARJAH SUKUK PROGRAM 3.854%/19-03.04.2026 | 5,256 | 5,200.06 | 0.01 |
| USD POWER SECTOR ASSETS AND LIABILITIES MANAGEMENT (reg. -S-) 7.39%/09-02.12.2024 | 12,249 | 14,263.29 | 0.02 | EUR SHELL INTERNATIONAL FINANCE 1.25%/15-15.03.2022 | 3,095 | 3,411.88 | 0.00 |
| EUR PROCTER & GAMBLE CO/THE 0.5%/17-25.10.2024 | 2,751 | 2,999.91 | 0.00 | USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45%/17-01.06.2027 | 6,666 | 6,835.03 | 0.01 |
| USD PROCTER & GAMBLE 2.3%/12-06.02.2022 | 2,466 | 2,537.27 | 0.00 | USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ (reg. -S-) 3.25%/15-27.05.2025 | 9,999 | 10,441.03 | 0.01 |
| USD PROVINCE OF ALBERTA 2.2%/17-26.07.2022 | 2,153 | 2,222.44 | 0.00 | EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ 1.75%/13-12.03.2021 | 1,376 | 1,528.50 | 0.00 |
| USD PROVINCE OF ALBERTA 2.95%/19-23.01.2024 | 21,144 | 22,716.15 | 0.03 | USD SILKNET JSC 11%/19-02.04.2024 | 10,157 | 10,169.90 | 0.01 |
| CAD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCCD-32 3.3%/13-18.12.2023 | 340,000 | 256,569.84 | 0.30 | USD SINO OCEAN LAND IV 4.75%/19-05.08.2029 | 10,157 | 9,341.89 | 0.01 |
| USD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA S. BCUSG-9 2.25%/16-02.06.2026 | 6,666 | 7,120.67 | 0.01 | USD SINOPEC GROUP (reg. -S-) 3.25%/15-28.04.2025 | 12,249 | 12,837.46 | 0.01 |
| USD PROVINCE OF BUENOS AIRES (reg. -S-) 7.875%/16-15.06.2027 | 5,079 | 1,306.42 | 0.00 | USD SIRIUS INTERNATIONAL GRP 4.6%/16-01.11.2026 | 5,079 | 5,014.41 | 0.01 |
| USD PROVINCE OF ONTARIO 3.2%/14-160524 | 13,332 | 14,574.23 | 0.02 | EUR SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN 0.75%/15-16.06.2022 | 1,830 | 2,051.85 | 0.00 |
| USD PROVINCE OF QUEBEC S. -QO- 2.875%/14-16.10.2024 | 9,999 | 10,866.38 | 0.01 | CHF SLOVAKIA 2.125%/13-16.10.2023 | 29 | 32.60 | 0.00 |
| CHF PROVINCE OF QUEBEC 1.5%/14-05.02.2024 | 53 | 58.15 | 0.00 | CHF SNCF MOBILITES 2.625%/06-13.12.2021 | 133 | 143.65 | 0.00 |
| USD PROVINCE OF QUEBEC 2.75%/17-12.04.2027 | 22,664 | 25,040.22 | 0.03 | CHF SOCIETE GENERALE LTD 0.25%/20-25.02.2027 | 27 | 22.89 | 0.00 |
| USD PROVINCIA DE CORDOBA 7.125%/17-01.08.2027 | 5,079 | 2,284.10 | 0.00 | CHF SOCIETE GENERALE SA 0.25%/19-08.10.2026 | 69 | 60.22 | 0.00 |
| USD PT PERTAMINA (PERSERO) 4.7%/19-30.07.2049 | 5,079 | 4,670.33 | 0.01 | CHF SOCIETE GENERALE 0.875%/19-28.02.2024 | 27 | 26.39 | 0.00 |
| USD QIB SUKUK LTD S. -4- 3.251%/17-23.05.2022 | 16,505 | 16,484.99 | 0.02 | EUR SOCIETE GENERALE 1.125%/18-23.01.2025 | 4,127 | 4,330.73 | 0.00 |
| USD QIB SENIOR SUKUK LTD 4.264%/19-05.03.2024 | 5,586 | 5,546.52 | 0.01 | USD SOUTH AFRICA 4.665%/12-17.01.2024 | 4,900 | 4,613.60 | 0.01 |
| USD QNB FINANCE LTD 3.5%/19-28.03.2024 | 13,966 | 13,835.85 | 0.02 | USD SOUTHERN CO 2.95%/16-01.07.2023 | 7,332 | 7,391.76 | 0.01 |
| USD QUALCOMM INC 3.25%/17-20.05.2027 | 16,665 | 17,586.19 | 0.02 | USD SOUTHERN CO 3.25%/16-01.07.2026 | 7,332 | 7,387.80 | 0.01 |
| CHF QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024 | 56 | 59.61 | 0.00 | USD SOUTHERN COPPER 5.875%/15-23.04.2045 | 5,079 | 5,356.71 | 0.01 |
| CHF QUEBEC 1.125%/13-22.02.2023 | 87 | 92.39 | 0.00 | USD SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC (reg. -S-) 6.875%/16-24.03.2026 | 3,920 | 3,998.98 | 0.00 |
| CHF RCI BANQUE SA 0.55%/18-30.05.2023 | 67 | 63.76 | 0.00 | EUR SPAIN 0.4% 17-30.04.2022 | 6,878 | 7,640.68 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF ANGOLA (reg. -S-) 9.5%/15-12.11.2025 | 9,799 | 3,963.99 | 0.00 | EUR SPAIN 0.75%/16-30.07.2021 | 1,376 | 1,530.70 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF ANGOLA 8.25%/18-09.05.2028 | 5,880 | 2,313.07 | 0.00 | EUR SPAIN 1.3%/16-31.10.2026 | 1,857 | 2,159.63 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF ARMENIA 3.95%/19-26.09.2029 | 14,878 | 13,253.56 | 0.02 | EUR SPAIN 1.5%/17-30.04.2027 | 1,857 | 2,186.29 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN 3.5%/17-01.09.2032 | 4,900 | 4,107.07 | 0.00 | EUR SPAIN 1.6%/14-30.04.2025 | 2,063 | 2,422.60 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF BELARUS 7.625%/17-29.06.2027 | 4,900 | 4,879.90 | 0.01 | EUR SPAIN 1.95%/16-30.04.2026 | 2,063 | 2,488.87 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF CHILE 3.24%/18-06.02.2028 | 6,666 | 7,028.61 | 0.01 | EUR SPAIN 2.15%/15-31.10.2025 | 3,233 | 3,920.87 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF CHILE 3.5%/19-25.01.2050 | 9,799 | 10,153.55 | 0.01 | EUR SPAIN 2.75%/14-31.10.2024 | 2,105 | 2,580.08 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF ECUADOR 7.875%/18-23.01.2028 | 14,699 | 4,072.72 | 0.00 | EUR SPAIN 3.8%/14-30.04.2024 | 2,187 | 2,757.98 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF ECUADOR 9.5%/19-27.03.2030 | 9,799 | 2,853.42 | 0.00 | EUR SPAIN 4.4%/13-31.10.2023 | 2,187 | 2,771.38 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF EL SALVADOR 7.1246%/19-20.01.2050 | 9,799 | 7,573.83 | 0.01 | EUR SPAIN 5.15%/13-31.10.2028 | 1,238 | 1,883.40 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF GABON 6.625%/20-06.02.2031 | 4,900 | 3,011.97 | 0.00 | EUR SPAIN 5.5%/11-30.04.2021 | 2,063 | 2,404.23 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF GHANA S. -2018-1- 7.625%/18-16.05.2029 | 14,699 | 10,512.16 | 0.01 | EUR SPAIN 5.85%/11-31.01.2022 | 2,132 | 2,600.75 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF GHANA 6.375%/20-11.02.2027 | 11,759 | 8,646.21 | 0.01 | EUR SPAIN 6%/98-31.01.2029 | 1,651 | 2,657.15 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF KENYA 8.25%/18-28.02.2048 | 7,350 | 6,778.48 | 0.01 | CHF SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025 | 40 | 38.88 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF NIGERIA 7.143%/18-23.02.2030 | 19,599 | 13,620.91 | 0.02 | USD SRI LANKA (reg. -S-) 5.75%/16-18.01.2022 | 14,699 | 9,561.71 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF PHILIPPINES 3%/18-01.02.2028 | 7,332 | 7,668.71 | 0.01 | USD SRI LANKA (reg. -S-) 5.875%/12-25.07.2022 | 4,900 | 3,372.74 | 0.00 |
| USD REPUBLIC OF PHILIPPINES 3.7%/16-01.03.2041 | 14,699 | 16,216.50 | 0.02 | USD SRI LANKA (reg. -S-) 6.85%/15-03.11.2025 | 9,799 | 5,850.69 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF PHILIPPINES 3.75%/19-14.01.2029 | 4,999 | 5,551.32 | 0.01 | EUR STANDARD CHARTERED (subordinated) (reg. -S-) 1.625%/14-13.06.2021 | 2,751 | 3,003.50 | 0.00 |
| EUR REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026 | 35,000 | 40,608.13 | 0.05 | USD STARBUCKS CORP 3.1%/18-01.03.2023 | 13,332 | 13,579.55 | 0.02 |
| USD REPUBLIC OF SENEGAL 6.25%/17-23.05.2033 | 9,799 | 8,773.00 | 0.01 | USD STATE OF QATAR 3.375%/19-14.03.2024 | 12,249 | 12,479.41 | 0.01 |
| EUR REPUBLIC OF SLOVENIA 2.125%/15-28.07.2025 | 1,376 | 1,680.94 | 0.00 | USD STATE OF QATAR 4%/19-14.03.2029 | 7,618 | 8,174.62 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.3%/16-12.10.2028 | 14,699 | 12,063.52 | 0.01 | USD STATE OF QATAR 4.5%/18-23.04.2028 | 11,248 | 12,329.27 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.85%/17-27.09.2027 | 9,799 | 8,618.75 | 0.01 | USD STATE OF QATAR 5.103%/18-23.04.2048 | 15,679 | 19,037.05 | 0.02 |
| USD REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.85%/19-30.09.2029 | 4,900 | 4,034.45 | 0.00 | USD STATE OIL COMPANY OF AZERBAIJAN (reg. -S-) 4.75%/13-13.03.2023 | 4,900 | 4,752.75 | 0.01 |
| USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN 5.375%/19-20.02.2029 | 4,900 | 4,863.54 | 0.01 | USD STATE OIL COMPANY OF AZERBAIJAN (reg. -S-) 6.95%/15-18.03.2030 | 4,900 | 4,909.55 | 0.01 |
| USD REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975%/18-20.04.2055 | 4,900 | 5,578.85 | 0.01 | USD STATE SAVINGS BANK OF UKRAINE STEP-UP 15-20.03.2025 | 12,518 | 5,632.25 | 0.01 |
| USD REYNOLDS AMERICAN 4.45%/15-12.06.2025 | 6,666 | 6,769.11 | 0.01 | USD STATE STREET 2.55%/15-18.08.2020 | 9,999 | 10,012.88 | 0.01 |
| USD RIO TINTO FINANCE USA 3.75%/15-15.06.2025 | 13,332 | 14,123.21 | 0.02 | USD STILLWATER MINING CO 7.125%/17-27.06.2025 | 12,697 | 11,417.21 | 0.01 |
| USD RIYAD BANK FIX-TO-FRN FRN/20-25.02.2030 | 12,697 | 11,466.34 | 0.01 | USD SULTANATE OF OMAN 6.75%-17.01.2048 | 17,149 | 11,299.04 | 0.01 |
| CHF ROCHE KAPITALMARKT 1.625%/12-23.09.2022 | 107 | 114.81 | 0.00 | USD SUMITOMO MITSUI BANKING T. 3 3.2%/12-18.07.2022 | 2,113 | 2,147.90 | 0.00 |
| USD ROCKWELL COLLINS 3.5%/17-15.03.2027 | 7,332 | 7,598.61 | 0.01 | USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL 2.058%/16-14.07.2021 | 3,333 | 3,308.23 | 0.00 |
| | | | | USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL 2.632%/16-14.07.2026 | 4,999 | 5,001.04 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|---------------|------------------|
| USD SUNRISE CAYMAN LTD 5.25%/19-11.03.2024 | 5,079 | 5,453.00 | 0.01 | USD US S. S-2021 3%/14-30.11.2021 | 94,029 | 96,614.33 | 0.11 |
| USD SUNTRUST BANK 2.8%/19-17.05.2022 | 2,400 | 2,429.63 | 0.00 | USD US S. -V-2021 1.125%/16-28.02.2021 | 93,507 | 94,354.69 | 0.11 |
| USD SUZANO AUSTRIA GMBH 7%/17-16.03.2047 | 8,888 | 8,498.72 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -AF-2023- 2.875%/18-30.11.2023 | 21 | 22.57 | 0.00 |
| USD SYSCO 3.3%/16-15.07.2026 | 8,332 | 8,220.42 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -AH-2022- 2.5%/19-15.01.2022 | 66,659 | 69,306.66 | 0.08 |
| USD TAJIKISTAN INT BOND 7.125%/17-14.09.2027 | 9,799 | 5,995.13 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -AV-2021- 2.5%/19-31.01.2021 | 39,995 | 40,766.91 | 0.05 |
| USD TARGET 3.5%/14-01.07.2024 | 13,332 | 14,239.87 | 0.02 | USD US TREASURY N/B S. -B-2029- 2.625%/19-15.02.2029 | 13,332 | 15,575.19 | 0.02 |
| USD TC ZIRAAT BANKASI AS 5.125%/17-29.09.2023 | 7,350 | 6,511.10 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -C-2029- 2.375%/19-15.05.2029 | 26,663 | 30,667.10 | 0.04 |
| USD TELFON CELUAR DEL PARAGU 5.875%/19-15.04.2027 | 5,079 | 4,587.40 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -E-2029- 1.625%/19-15.08.2029 | 6,666 | 7,237.66 | 0.01 |
| USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.975%/19-11.04.2029 | 16,505 | 18,287.88 | 0.02 | USD US TREASURY N/B S. -F-2028- 3.125%/18-15.11.2028 | 29,330 | 35,406.52 | 0.04 |
| USD TERMOCANDELARIA POWER 7.875%/19- 30.01.2029 | 10,157 | 8,246.84 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.06.2021 | 39,995 | 40,701.29 | 0.05 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III B.V 7.125%/19-31.01.2025 | 10,157 | 10,051.16 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2%/17-31.05.2024 | 28,663 | 30,611.38 | 0.04 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 3.15%/16-01.10.2026 | 12,697 | 10,829.10 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2.25%/17-15.08.2027 | 59,993 | 67,294.93 | 0.08 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 4.1%/16-01.10.2046 | 20,314 | 15,028.40 | 0.02 | USD US TREASURY N/B 2.25%/17-15.11.2027 | 59,993 | 67,398.04 | 0.08 |
| CHF THE EXPORT IMPORT BANK OF KOREA 0%/19-27.05.2025 | 80 | 76.89 | 0.00 | USD US TREASURY N/B 2.375%/17-15.05.2027 | 33,663 | 37,922.99 | 0.04 |
| USD THREE GORGES FIN I KY 2.3%/19-16.10.2024 | 9,799 | 9,915.81 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2.875%/18-15.08.2028 | 57,626 | 68,116.11 | 0.08 |
| USD TIME WARNER 3.8%/16-15.02.2027 | 7,332 | 8,052.63 | 0.01 | USD US TREASURY S. -B-2027- 2.25%/17-15.02.2027 | 19,998 | 22,300.41 | 0.03 |
| USD TNB GLOBAL VENTURES CAP S. -1- 3.244%/16-19.10.2026 | 7,618 | 7,929.86 | 0.01 | USD US TREASURY S. E-2021 2.125%/11-15.08.2021 | 73,718 | 75,567.07 | 0.09 |
| USD TORONTO-DOMINION BANK 3.5%/18-19.07.2023 | 6,666 | 7,028.88 | 0.01 | USD US TREASURY S. E-2021 2.375%/14-15.08.2024 | 43,629 | 47,419.65 | 0.05 |
| CHF TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024 | 120 | 126.99 | 0.00 | USD US TREASURY S. F-2026 2%/16-15.11.2026 | 14,998 | 16,420.66 | 0.02 |
| USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 2.75%/14-19.06.2021 | 13,332 | 13,429.03 | 0.02 | USD US TREASURY S. F-2023 2.75%/13-15.11.2023 | 67,700 | 73,507.85 | 0.08 |
| EUR TOYOTA MOTOR CREDIT (reg. -S-) 0.75%/15-21.07.2022 | 2,751 | 2,986.81 | 0.00 | USD US 1.625%/16-15.05.2026 | 37,611 | 40,109.05 | 0.05 |
| USD TOYOTA MOTOR CREDIT S. -B- 1.9%/16-08.04.2021 | 6,666 | 6,699.45 | 0.01 | USD UZBEK INDUSTRIAL AND CON 5.75%/19-02.12.2024 | 5,079 | 4,650.27 | 0.01 |
| USD TRADE AND DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA (reg. -S-) S. 1 9.375%/15-19.05.2020 | 4,900 | 4,863.83 | 0.01 | USD VALE 5.625%/12-11.09.2042 | 5,079 | 5,096.58 | 0.01 |
| CHF TRANSPower NEW ZEALAND LIMITED 0.02%/19-16.12.2027 | 32 | 30.37 | 0.00 | USD VALERO ENERGY 3.4%/16-15.09.2026 | 7,332 | 6,582.04 | 0.01 |
| CHF TRANSURBAN FINANCE 0.625%/16-23.06.2023 | 131 | 134.09 | 0.00 | USD VEB FINANCE (reg. -S-) 6.8%/10-22.11.2025 | 9,799 | 10,340.92 | 0.01 |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026 | 470,000 | 365,317.39 | 0.42 | USD VEDANTA RESOURCES (reg. -S-) 6.375%/17-30.07.2022 | 7,618 | 2,952.93 | 0.00 |
| AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029 | 34,000 | 22,704.78 | 0.03 | USD VEDANTA RESOURCES 9.25%/19-23.04.2026 | 20,314 | 7,925.67 | 0.01 |
| USD TRUST F/1401 4.869%/19-15.01.2030 | 6,348 | 5,469.59 | 0.01 | USD VENEZUELA 9.25%/97-15.09.2027 | 19,599 | 1,844.46 | 0.00 |
| USD TRUST F/1401 6.39%/19-15.01.2050 | 5,079 | 4,627.01 | 0.01 | EUR VERIZON COMMUNICATIONS 0.5%/16-02.06.2022 | 1,376 | 1,497.36 | 0.00 |
| USD TURKEY 4.875%/16-09.10.2026 | 14,699 | 12,424.24 | 0.01 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 2.625%/16-15.08.2026 | 7,999 | 8,282.59 | 0.01 |
| USD TURKEY 6%/11-14.01.2041 | 9,799 | 7,671.83 | 0.01 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.376%/17-15.02.2025 | 6,666 | 7,148.46 | 0.01 |
| USD TURKEY 6.875%/06-17.03.2036 | 9,799 | 8,694.80 | 0.01 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 4.329%/18-21.09.2028 | 7,232 | 8,272.33 | 0.01 |
| USD TURKIYE HALK BANKASI (reg. -S-) 4.75%/15-11.02.2021 | 5,079 | 4,827.67 | 0.01 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.15%/13-15.09.2023 | 6,666 | 7,430.76 | 0.01 |
| USD TYSON FOODS 3.95%/14-15.08.2024 | 6,666 | 7,137.66 | 0.01 | USD VFU FUNDING (VF UKRAINE) 6.2%/20-11.02.2025 | 6,348 | 5,112.25 | 0.01 |
| EUR UBS GROUP FUNDING (Jersey) LIMITED (reg. -S-) 1.25%/16-01.09.2026 | 2,751 | 2,862.76 | 0.00 | USD VISA 3.15%/15-14.12.2025 | 13,332 | 14,522.76 | 0.02 |
| CHF UBS GROUP FUNDING T. 1 0.75%/16-22.02.2022 | 48 | 48.76 | 0.00 | USD VMWARE INC 3.9%/17-21.08.2027 | 7,332 | 7,249.80 | 0.01 |
| USD UKRAINE GOVERNMENT 7.375%/17-25.09.2032 | 8,330 | 7,556.25 | 0.01 | USD VODAFONE GROUP PLC 3.75%/18-16.01.2024 | 2,440 | 2,540.29 | 0.00 |
| USD UKRAINE GOVERNMENT 9.75%/18-01.11.2028 | 4,900 | 4,778.23 | 0.01 | CHF VORARLBERGER LANDES UND HYPOTHEKENBANK 0.125%/16-06.10.2021 | 40 | 40.78 | 0.00 |
| USD UKRAINE RAIL (RAIL CAPL) 8.25%/19-09.07.2024 | 9,799 | 7,937.59 | 0.01 | USD VTB CAPITAL (reg. -S-) (subordinated) 6.95%/12-17.10.2022 | 10,157 | 10,104.49 | 0.01 |
| USD UNIFIN FINANCIERA SA DE 8.375%/19-27.01.2028 | 12,697 | 7,790.96 | 0.01 | EUR VW INTL FINANCE 0.5%/17-30.03.2021 | 2,063 | 2,239.18 | 0.00 |
| USD UNILEVER CAPITAL CORP 3.5%/18-22.03.2028 | 19,998 | 21,604.57 | 0.02 | USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.45%/16-01.06.2026 | 7,332 | 7,268.79 | 0.01 |
| USD UNION LIFE INSURANCE 3%/16-19.09.2021 | 7,618 | 5,166.23 | 0.01 | USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.8%/14-18.11.2024 | 1,333 | 1,372.74 | 0.00 |
| USD UNION NATIONAL BANK PJSC 4%/18-13.03.2023 | 12,697 | 12,524.47 | 0.01 | USD WALT DISNEY S. -F- 1.85%/16-30.07.2026 | 2,340 | 2,309.04 | 0.00 |
| USD UNITED MEXICAN STATES 4.15%/17-28.03.2027 | 11,865 | 12,072.98 | 0.01 | USD WASTE MANAGEMENT INC 3.45%/19-15.06.2029 | 3,333 | 3,569.90 | 0.00 |
| USD UNITED MEXICAN STATES 4.5%/19-22.04.2029 | 6,666 | 6,837.63 | 0.01 | USD WELLS FARGO & COMPANY 2.625%/17-22.07.2022 | 19,998 | 20,191.94 | 0.02 |
| USD UNITED PARCEL SERVICE 2.5%/17-01.04.2023 | 13,332 | 13,605.14 | 0.02 | USD WELLS FARGO 3%/16-23.10.2026 | 9,999 | 10,228.15 | 0.01 |
| USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023 | 52,656 | 55,173.18 | 0.06 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.25%/19-29.01.2027 | 93 | 97.81 | 0.00 |
| USD UNITED STATES S. B-2024 2.75%/14-15.02.2024 | 78,127 | 85,274.57 | 0.10 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.3%/17-28.11.2025 | 80 | 79.37 | 0.00 |
| USD UNITED STATES S. -B-2025 2%/15-15.02.2025 | 63,187 | 68,019.79 | 0.08 | EUR WESTPAC BANKING CORP 0.375%/17-05.03.2023 | 2,063 | 2,210.54 | 0.00 |
| USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.65%/18-16.08.2023 | 6,259 | 6,603.00 | 0.01 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.4%/18-06.06.2024 | 32 | 32.09 | 0.00 |
| USD UNITEDHEALTH GROUP 3.75%/15-15.07.2025 | 13,332 | 14,421.58 | 0.02 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.5%/18-16.05.2028 | 51 | 49.64 | 0.00 |
| USD URUGUAY 4.375%/15-27.10.2027 | 11,566 | 12,502.88 | 0.01 | CHF WESTPAC BANKING 0.375%/16-05.02.2024 | 53 | 53.68 | 0.00 |
| USD URUGUAY 5.1%/14-18.06.2050 | 5,880 | 6,709.56 | 0.01 | CHF WESTPAC BANKING 0.40%/15-09.06.2023 | 37 | 37.56 | 0.00 |
| USD URUGUAY 7.625%/06-21.03.2036 | 7,350 | 10,180.25 | 0.01 | USD WESTPAC BANKING 2%/16-19.08.2021 | 4,999 | 4,985.64 | 0.01 |
| USD URUGUAY 7.875%/03-15.01.2033 | 4,900 | 6,746.12 | 0.01 | USD YASAR HOLDING 8.875%/14-06.05.2020 | 5,079 | 4,754.94 | 0.01 |
| USD US BANCORP 3.375%/19-05.02.2024 | 6,666 | 6,946.95 | 0.01 | USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 6.95%/17-21.07.2027 | 20,314 | 10,356.29 | 0.01 |
| USD US S. AJ-2021 2.25%/14-31.03.2021 | 62,792 | 64,087.45 | 0.07 | USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 7%/17-15.12.2047 | 7,618 | 3,861.74 | 0.00 |
| USD US S. B-2021 3.625%/11-15.02.2021 | 41,430 | 42,679.67 | 0.05 | USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5%/19-26.02.2024 | 9,649 | 8,586.47 | 0.01 |
| USD US S. C-2021 3.125%/11-15.05.2021 | 48,767 | 50,367.57 | 0.06 | USD YUZHOU PROPERTIES 6%/16-25.10.2023 | 6,348 | 5,262.64 | 0.01 |
| USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022 | 67,700 | 69,810.77 | 0.08 | USD YUZHOU PROPERTIES 6%/17-25.01.2022 | 5,079 | 4,661.50 | 0.01 |
| USD US S. C-2023 1.75%/13-15.05.2023 | 45,585 | 47,575.90 | 0.05 | USD 3M S. -F- 1.625%/16-19.09.2021 | 2,246 | 2,243.50 | 0.00 |
| USD US S. C-2024 2.5%/14-15.05.2024 | 67,700 | 73,637.43 | 0.08 | | | | |
| USD US S. C-2025- 2.125%/15-15.05.2025 | 56,417 | 61,274.29 | 0.07 | | | | |
| USD US S. E-2023 2.5%/13-15.08.2023 | 60,178 | 64,531.51 | 0.07 | | | | |
| USD US S. -E-2025- 2%/15-15.08.2025 | 53,327 | 57,684.64 | 0.07 | | | | |
| USD US S. F-2021 2%/11-15.11.2021 | 44,370 | 45,645.57 | 0.05 | | | | |
| USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022 | 86,506 | 89,506.81 | 0.10 | | | | |
| USD US S. -F-2025- 2.25%/15-15.11.2025 | 49,994 | 54,883.94 | 0.06 | | | | |
| USD US S. M-2022 2.125%/15-30.06.2022 | 49,300 | 51,337.47 | 0.06 | | | | |
| USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021 | 92,836 | 95,320.12 | 0.11 | | | | |
| | | | | 債券 | | 14,246,737.30 | 16.43 |
| | | | | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている | | | |
| | | | | 証券：債券 | | 14,246,737.30 | 16.43 |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|---------------|------------------|
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： | | | |
| 投資信託 | | | |
| 投資信託受益証券 (クローズド・エンド型) | | | |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 824 | 761.04 | 0.00 |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST LIMITED | 377 | 348.15 | 0.00 |
| GBP F&C UK REAL ESTATE INVESTMENT | 372 | 319.37 | 0.00 |
| GBP PICTON PROPERTY INCOME | 869 | 959.06 | 0.00 |
| GBP UK COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 997 | 927.25 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 (クローズド・エンド型) | | 3,314.87 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 (オープン・エンド型) | | | |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD | 23,254 | 2,262,381.66 | 2.61 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD | 1,266 | 1,116,925.04 | 1.29 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD | 8,850 | 7,483,832.84 | 8.64 |
| JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY | 621 | 557,712.01 | 0.64 |
| CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD | 2,432 | 1,327,327.35 | 1.53 |
| EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR | 339 | 744,811.01 | 0.86 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD | 694 | 1,117,860.50 | 1.29 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD | 429 | 480,238.34 | 0.55 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND -EB- USD | 264 | 412,113.56 | 0.48 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND -EB- USD | 4,897 | 462,227.83 | 0.53 |
| USD CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD | 5,903 | 2,766,729.14 | 3.19 |
| 投資信託受益証券 (オープン・エンド型) | | 18,732,159.28 | 21.61 |
| 証券取引所または他の組織された市場に 上場されている証券：投資信託 | | | |
| | | 18,735,474.15 | 21.61 |
| 証券取引所に上場されていない証券：株式 (およびエクイティ型証券) | | | |
| 株式 (およびエクイティ型証券) | | | |
| USD DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 403 | 1,463.40 | 0.00 |
| CAD FIRST CAPITAL REALTY INC | 226 | 2,159.58 | 0.00 |
| EUR WAREHOUSES DE PAUW N.V. | 205 | 5,885.60 | 0.01 |
| 株式 (およびエクイティ型証券) | | 9,508.58 | 0.01 |
| 証券取引所に上場されていない証券： | | | |
| 株式 (およびエクイティ型証券) | | 9,508.58 | 0.01 |
| ポートフォリオ合計 | | 83,603,455.53 | 96.42 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | | 3,370,643.36 | 3.89 |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | | -296,947.17 | -0.34 |
| その他の純資産 | | 33,040.98 | 0.03 |
| 純資産総額 | | 86,710,192.70 | 100.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

クレディ・スイス（Lux）ポートフォリオ・ファンド・イールド・USD

投資有価証券明細表

| | | | |
|-------------|-------|-----------------------|-------|
| 国別内訳 | | | |
| アメリカ合衆国 | 52.78 | パキスタン | 0.05 |
| ルクセンブルグ | 17.44 | イスラエル | 0.05 |
| ドイツ | 3.21 | ジャマイカ | 0.04 |
| アイルランド | 2.84 | エルサルバドル | 0.04 |
| カナダ | 2.56 | コスタリカ | 0.04 |
| フランス | 1.95 | モロッコ | 0.04 |
| イギリス | 1.82 | コートジボワール | 0.04 |
| 日本 | 1.41 | ケニア | 0.04 |
| オランダ | 1.10 | ウクライナ | 0.04 |
| オーストラリア | 1.09 | 中華人民共和国 | 0.04 |
| 国際機関 | 1.02 | パラグアイ | 0.04 |
| スペイン | 0.86 | エクアドル | 0.03 |
| イタリア | 0.56 | アルメニア | 0.03 |
| スイス | 0.53 | ニュージーランド | 0.03 |
| ルウェー | 0.50 | モンゴル | 0.03 |
| メキシコ | 0.40 | クウェート | 0.03 |
| ケイマン諸島 | 0.36 | セネガル | 0.03 |
| チリ | 0.34 | グアテマラ | 0.02 |
| ベルギー | 0.29 | アンゴラ | 0.02 |
| フィリピン | 0.25 | エチオピア | 0.02 |
| コロンビア | 0.21 | タジキスタン | 0.02 |
| 韓国 | 0.19 | スロベニア | 0.02 |
| ウルグアイ | 0.18 | ウズベキスタン | 0.02 |
| 香港 | 0.18 | イラク | 0.02 |
| フィンランド | 0.16 | ベラルーシ | 0.02 |
| トルコ | 0.16 | ヨルダン | 0.02 |
| サウジアラビア | 0.16 | ナミビア | 0.02 |
| アラブ首長国連邦 | 0.15 | ベネズエラ | 0.02 |
| ブラジル | 0.14 | ガボン | 0.01 |
| バミューダ | 0.14 | ボリビア | 0.01 |
| カタール | 0.13 | リベリア | 0.01 |
| インドネシア | 0.13 | チュニジア | 0.01 |
| ヴァージン諸島（英領） | 0.13 | ハンガリー | 0.01 |
| ペルー | 0.12 | パハマ | 0.01 |
| オーストリア | 0.12 | トーゴ | 0.01 |
| バーレーン | 0.12 | アルゼンチン | 0.01 |
| エジプト | 0.12 | ジョージア | 0.01 |
| パナマ | 0.11 | 合計 | 96.25 |
| ポーランド | 0.11 | | |
| 南アフリカ | 0.11 | 業種別内訳 | |
| ロシア | 0.09 | 国および中央政府 | 27.80 |
| マレーシア | 0.09 | 投資信託／ファンド | 18.32 |
| カザフスタン | 0.09 | 銀行・その他の金融機関 | 9.91 |
| シンガポール | 0.08 | 金融・投資・その他の多角化企業 | 6.34 |
| オマーン | 0.08 | インターネット・ソフトウェア・ITサービス | 4.27 |
| ガーナ | 0.07 | 医薬品・化粧品・医療品 | 3.66 |
| インド | 0.07 | 国際機関 | 2.56 |
| ボルトガル | 0.07 | 不動産 | 2.38 |
| スリランカ | 0.06 | カントン（州）・連邦国家・プロビンス（州） | 1.74 |
| スウェーデン | 0.06 | コンピューターハードウェア・ネットワーク | 1.72 |
| ジャージー | 0.06 | 石油 | 1.53 |
| アゼルバイジャン | 0.06 | エネルギー・水道 | 1.49 |
| ドミニカ共和国 | 0.06 | 食品・清涼飲料 | 1.41 |
| ルーマニア | 0.06 | 通信 | 1.35 |
| ナイジェリア | 0.05 | 電子・半導体 | 0.93 |
| | | 保険会社 | 0.81 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| | |
|--------------------|-------|
| 宿泊・仕出し・娯楽施設 | 0.79 |
| 各種消費財 | 0.78 |
| 小売り・百貨店 | 0.77 |
| 機械工学・産業機器 | 0.75 |
| 交通・運輸 | 0.74 |
| バイオテクノロジー | 0.68 |
| 建築材・建設業 | 0.68 |
| グラフィック出版・印刷メディア | 0.55 |
| 化学 | 0.51 |
| タバコ・アルコール飲料 | 0.45 |
| 繊維・衣服・革製品 | 0.41 |
| 各種サービス | 0.40 |
| 電気機器・部品 | 0.38 |
| ヘルスケア・社会福祉 | 0.36 |
| 公共・非営利機関 | 0.34 |
| 自動車 | 0.34 |
| 鉱業・石炭・鉄鋼 | 0.21 |
| 航空・宇宙産業 | 0.21 |
| 林業・紙製品・林産品 | 0.21 |
| 環境サービス・リサイクル | 0.09 |
| 各種貿易会社 | 0.09 |
| 貴金属・宝石 | 0.08 |
| 包装業 | 0.06 |
| 抵当・資金貸出機関（MBS、ABS） | 0.04 |
| 分類不能／非分類機関 | 0.03 |
| 写真・光学 | 0.02 |
| ゴム・タイヤ | 0.02 |
| 非鉄金属 | 0.02 |
| 農業・漁業 | 0.01 |
| 各種資本財 | 0.01 |
| 合計 | 96.25 |

投資有価証券明細表

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|--------------|------------------|
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| CHF ABB (reg. shares) | 1,770 | 31,107.35 | 0.01 |
| USD ABBVIE | 6,485 | 494,111.44 | 0.16 |
| USD ACADIA REALTY TRUST | 479 | 5,936.14 | 0.00 |
| USD ACCENTURE -A- | 2,908 | 474,771.35 | 0.16 |
| EUR ACCOR | 366 | 10,038.33 | 0.00 |
| JPY ACTIVIA PROPERTIES | 4 | 12,125.89 | 0.00 |
| USD ACUITY BRANDS | 194 | 16,660.42 | 0.01 |
| CHF ADECCO (reg. shares) | 210 | 8,278.35 | 0.00 |
| EUR ADIDAS (reg. shares) | 376 | 84,955.18 | 0.03 |
| EUR ADO PROPERTIES | 157 | 3,556.10 | 0.00 |
| USD ADOBE INC | 2,213 | 704,289.43 | 0.23 |
| USD ADVANCE AUTO PARTS | 299 | 27,863.31 | 0.01 |
| JPY ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT | 7 | 20,364.16 | 0.01 |
| EUR AEDIFICA | 133 | 13,775.94 | 0.00 |
| EUR AEGON | 3,729 | 9,467.54 | 0.00 |
| JPY AEON | 1,289 | 28,642.71 | 0.01 |
| JPY AEON FINANCIAL SERVICE | 222 | 2,380.80 | 0.00 |
| JPY AEON MALL | 643 | 8,117.61 | 0.00 |
| JPY AEON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9 | 8,208.43 | 0.00 |
| EUR AEROPORTS DE PARIS | 349 | 33,461.09 | 0.01 |
| USD AES | 3,032 | 41,231.92 | 0.01 |
| USD AGILENT TECHNOLOGIES | 1,373 | 98,305.56 | 0.03 |
| USD AGREE REALTY | 231 | 14,288.45 | 0.00 |
| EUR AIR LIQUIDE | 986 | 126,198.16 | 0.04 |
| JPY AJINOMOTO | 864 | 16,083.32 | 0.00 |
| EUR AKZO NOBEL NV | 1,139 | 74,966.08 | 0.02 |
| CHF ALCON INC | 372 | 18,984.87 | 0.01 |
| USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES | 12 | 3,309.54 | 0.00 |
| USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES | 1,182 | 162,014.02 | 0.05 |
| USD ALIGN TECHNOLOGY | 322 | 56,080.40 | 0.02 |
| USD ALLEGION | 400 | 36,809.41 | 0.01 |
| USD ALLIANT ENERGY | 1,062 | 51,262.83 | 0.02 |
| EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted) | 1,272 | 219,000.89 | 0.07 |
| CAD ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 695 | 21,833.46 | 0.01 |
| CHF ALLREAL HOLDING (reg. shares) | 76 | 14,021.17 | 0.00 |
| USD ALLSTATE | 1,402 | 128,629.18 | 0.04 |
| USD ALLY FINANCIAL | 1,639 | 23,648.92 | 0.01 |
| USD ALPHABET -A- | 1,423 | 1,653,008.20 | 0.52 |
| USD ALPHABET -C- | 1,354 | 1,574,020.24 | 0.50 |
| EUR ALSTRIA OFFICE REIT | 907 | 12,978.75 | 0.00 |
| EUR AMADEUS IT GROUP -A- | 899 | 42,602.47 | 0.01 |
| USD AMAZON.COM | 70 | 136,050.75 | 0.04 |
| USD AMERCO | 46 | 13,326.73 | 0.00 |
| USD AMERICAN ASSETS TRUST | 279 | 6,970.11 | 0.00 |
| USD AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 769 | 21,349.72 | 0.01 |
| USD AMERICAN EXPRESS | 4,339 | 371,421.32 | 0.12 |
| USD AMERICAN FINANCE TRUST INC | 599 | 3,745.94 | 0.00 |
| USD AMERICAN FINANCIAL GROUP | 313 | 21,921.12 | 0.01 |
| USD AMERICAN HOMES 4 RENT -A- | 1,461 | 33,896.92 | 0.01 |
| USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 3,767 | 91,343.37 | 0.03 |
| USD AMERICAN TOWER | 1,941 | 422,599.99 | 0.14 |
| USD AMERICAN WATER WORKS | 802 | 95,928.48 | 0.03 |
| USD AMERICOLD REALTY TRUST | 1,084 | 36,898.94 | 0.01 |
| USD AMERIPRISE FINANCIAL | 545 | 55,897.24 | 0.02 |
| USD AMERISOURCEBERGEN | 665 | 58,810.35 | 0.02 |
| USD AMGEN | 2,725 | 552,532.71 | 0.18 |
| AUD AMP | 5,898 | 4,819.22 | 0.00 |
| NZD AMP NZ OFFICE TRUST | 5,788 | 5,850.57 | 0.00 |
| JPY ANA HOLDINGS | 226 | 5,518.07 | 0.00 |
| EUR ANDRITZ | 145 | 4,557.02 | 0.00 |
| USD AON | 1,030 | 169,959.48 | 0.05 |
| AUD APA GROUP | 2,073 | 13,020.27 | 0.00 |
| USD APACHE | 1,490 | 6,227.84 | 0.00 |
| USD APARTMENT INVESTMENT & MANAGEMENT CO -A- | 833 | 29,279.46 | 0.01 |
| USD APPLE | 742 | 188,680.67 | 0.06 |
| USD APPLE HOSPITALITY REIT | 1,182 | 10,834.99 | 0.00 |
| USD APPLIED MATERIALS | 4,069 | 186,444.51 | 0.06 |
| USD APTIV PLC | 1,099 | 54,122.64 | 0.02 |
| USD ARAMARK HOLDINGS | 1,191 | 23,788.77 | 0.01 |
| USD ARCH CAPITAL GROUP | 1,774 | 50,476.85 | 0.02 |
| USD ARCONIC (reg shares) | 1,663 | 26,708.07 | 0.01 |
| USD ARMADA HOFFLER PROPERTIES | 307 | 3,289.03 | 0.00 |
| EUR AROUNDTOWN PROPERTY HOLDINGS | 6,491 | 32,435.21 | 0.01 |
| USD ARTHUR J. GALLAGHER | 803 | 65,462.13 | 0.02 |
| CAD ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 696 | 3,901.72 | 0.00 |
| JPY ASAH GLASS | 355 | 8,751.01 | 0.00 |
| JPY ASAH KASEI | 2,482 | 17,586.08 | 0.01 |
| EUR ASCENCIO | 27 | 1,241.18 | 0.00 |
| SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 20,935 | 41,609.94 | 0.01 |
| HKD ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 536 | 5,022.39 | 0.00 |
| EUR ASML HOLDING | 1,492 | 396,803.49 | 0.13 |
| EUR ASSICURAZIONI GENERALI | 2,166 | 29,490.51 | 0.01 |
| GBP ASSOCIATED BRITISH FOODS | 1,081 | 24,313.11 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| GBP ASSURA | 12,738 | 13,189.03 | 0.00 | USD CELANESE -A- | 519 | 38,120.56 | 0.01 |
| USD ASSURANT | 261 | 27,211.34 | 0.01 | CHF CEMBRA MONEY (reg. shares) | 26 | 2,389.27 | 0.00 |
| JPY ASTELLAS PHARMA | 3,760 | 58,204.53 | 0.02 | USD CENTENE | 2,570 | 152,683.64 | 0.05 |
| AUD ASX | 340 | 16,063.74 | 0.00 | JPY CENTRAL JAPAN RAILWAY | 289 | 46,339.12 | 0.01 |
| EUR ATOS | 205 | 13,903.04 | 0.00 | USD CENTURYLINK | 4,121 | 38,983.57 | 0.01 |
| SEK ATRIUM LJUNGBERG AB | 246 | 3,839.80 | 0.00 | USD CERNER | 1,392 | 87,696.26 | 0.03 |
| USD AT&T | 1,442 | 42,037.58 | 0.01 | USD C.H. ROBINSON WORLDWIDE | 568 | 37,619.39 | 0.01 |
| NZD AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT | 1,707 | 5,048.52 | 0.00 | HKD CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 10,600 | 6,400.43 | 0.00 |
| AUD AURIZON HOLDINGS | 3,500 | 9,062.14 | 0.00 | USD CHARLES SCHWAB | 5,067 | 170,367.61 | 0.05 |
| AUD AUSNET SERVICES | 3,239 | 3,390.38 | 0.00 | AUD CHARTER HALL LONG WALE REIT | 2,415 | 6,488.37 | 0.00 |
| AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP | 5,044 | 52,356.88 | 0.02 | AUD CHARTER HALL RETAIL | 1,998 | 3,803.42 | 0.00 |
| USD AUTODESK | 967 | 150,959.80 | 0.05 | CAD CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES (units) | 1,252 | 7,871.99 | 0.00 |
| USD AVALONBAY COMMUNITIES | 787 | 115,816.89 | 0.04 | USD CHATHAM LODGING TRUST | 259 | 1,536.75 | 0.00 |
| USD AVERY DENNISON | 360 | 36,627.43 | 0.01 | USD CHENIERE ENERGY | 1,013 | 33,929.74 | 0.01 |
| GBP AVIVA | 11,884 | 39,566.73 | 0.01 | USD CHEVRON | 1,293 | 93,708.84 | 0.03 |
| EUR AXA | 7,349 | 127,308.51 | 0.04 | CHF CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI | 0 | 6,395.04 | 0.00 |
| USD AXALTA COATING SYSTEMS | 842 | 14,545.82 | 0.00 | CAD CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,440 | 13,071.74 | 0.00 |
| USD BAKER HUGHES A GE CO | 2,917 | 30,630.61 | 0.01 | USD CHUBB N | 1,991 | 222,366.41 | 0.07 |
| USD BALL | 1,334 | 86,235.64 | 0.03 | JPY CHUGAI PHARMACEUTICAL | 444 | 51,459.74 | 0.02 |
| CHF BALOISE-HOLDING (reg. shares) | 70 | 9,118.71 | 0.01 | JPY CHUO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 653 | 18,887.14 | 0.01 |
| EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA (reg. shares) | 13,900 | 44,468.12 | 0.01 | CHF CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares) | 539 | 29,558.20 | 0.01 |
| EUR BANCO DE SABADELL (reg. shares) | 11,718 | 6,030.42 | 0.00 | USD CIGNA CORP | 1,639 | 290,472.99 | 0.10 |
| EUR BANCO ESPIRITO SANTO (reg. shares) | 2,923 | 0.00 | 0.00 | USD CISCO SYSTEMS | 1,303 | 51,203.37 | 0.02 |
| USD BANK OF AMERICA | 1,744 | 37,035.54 | 0.01 | USD CITIGROUP | 437 | 18,418.47 | 0.01 |
| USD BANK OF NEW YORK MELLON | 3,687 | 124,190.00 | 0.04 | USD CITIZENS FINANCIAL GROUP | 1,874 | 35,257.13 | 0.01 |
| EUR BANKINTER (reg. shares) | 1,404 | 5,153.23 | 0.00 | USD CITRIX SYSTEMS | 574 | 81,187.57 | 0.03 |
| GBP BARRATT DEVELOPMENTS | 3,089 | 16,891.77 | 0.01 | SGD CITY DEVELOPMENTS | 3,335 | 16,957.76 | 0.01 |
| CHF BARRY CALLEBAUT (reg. shares) | 2 | 4,887.58 | 0.00 | EUR CITYCON OYJ | 409 | 2,522.83 | 0.00 |
| EUR BASF (reg. shares) | 3,529 | 167,078.87 | 0.05 | GBP CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 3,349 | 4,003.28 | 0.00 |
| USD BECTON DICKINSON | 1,186 | 272,542.46 | 0.09 | HKD CK ASSET HOLDINGS LTD | 14,541 | 79,638.32 | 0.02 |
| EUR BEFIMMO SICAFI | 116 | 5,549.98 | 0.00 | CHF CLARIANT (reg. shares) | 292 | 4,902.83 | 0.00 |
| EUR BEIERSDORF | 210 | 21,319.26 | 0.01 | USD CLOROX | 540 | 93,581.50 | 0.03 |
| AUD BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 864 | 3,317.17 | 0.00 | HKD CLP HOLDINGS | 2,892 | 26,680.12 | 0.01 |
| JPY BENESSE HOLDING | 142 | 3,611.88 | 0.00 | USD CME GROUP -A- | 1,571 | 271,690.69 | 0.09 |
| GBP BERKELEY GROUP HOLDINGS | 362 | 16,238.35 | 0.01 | USD CMS ENERGY | 1,253 | 73,599.01 | 0.02 |
| USD BEST BUY | 1,028 | 58,623.63 | 0.02 | EUR CNH Industrial N.V. (reg. shares) | 2,116 | 12,108.52 | 0.00 |
| GBP BIG YELLOW GROUP | 826 | 10,285.72 | 0.00 | EUR CNP ASSURANCES | 343 | 3,353.41 | 0.00 |
| USD BIOGEN | 791 | 250,288.12 | 0.09 | USD COCA-COLA | 19,226 | 850,759.32 | 0.27 |
| USD BIOMARIN PHARMACEUTICAL | 794 | 67,052.89 | 0.02 | AUD COCA-COLA AMATIL | 891 | 4,819.01 | 0.00 |
| USD BLACKROCK | 508 | 223,486.13 | 0.07 | EUR COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 31 | 1,159.89 | 0.00 |
| AUD BLUESCOPE STEEL | 904 | 4,776.38 | 0.00 | USD COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PL | 445 | 16,695.62 | 0.01 |
| EUR BMW | 690 | 35,683.57 | 0.01 | GBP COCA-COLA HBC AG | 606 | 13,049.24 | 0.00 |
| EUR BMW (pref. shares) | 118 | 5,090.26 | 0.00 | AUD COCHLEAR | 102 | 11,661.26 | 0.00 |
| EUR BNP PARIBAS -A- | 1,609 | 48,568.69 | 0.02 | EUR COFINIMMO SICAFI | 139 | 18,225.06 | 0.01 |
| CAD BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 216 | 3,473.54 | 0.00 | USD COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 2,367 | 110,015.65 | 0.03 |
| HKD BOC HONG KONG | 6,509 | 18,011.77 | 0.01 | AUD COLES GROUP LTD | 1,993 | 18,489.88 | 0.01 |
| USD BOOKING HOLDINGS INC | 184 | 247,714.47 | 0.09 | USD COLGATE-PALMOLIVE | 3,574 | 237,141.80 | 0.07 |
| AUD BORAL | 2,060 | 2,585.26 | 0.00 | USD COLONY CAPITAL INC -A- | 2,727 | 4,772.22 | 0.00 |
| USD BORG WARNER | 869 | 21,178.80 | 0.01 | EUR COLRUYT | 115 | 6,216.63 | 0.00 |
| USD BOSTON PROPERTIES | 1,562 | 144,048.06 | 0.04 | USD COLUMBIA PROPERTY TRUST | 655 | 8,188.90 | 0.00 |
| EUR BOUYGUES | 467 | 13,681.16 | 0.00 | USD COMERICA | 722 | 21,192.25 | 0.01 |
| AUD BRAMBLES | 2,745 | 17,740.29 | 0.01 | JPY COMFORIA RESIDENTIAL REIT | 3 | 9,522.69 | 0.00 |
| USD BRANDYWINE REALTY TRUST | 996 | 10,478.58 | 0.00 | CAD COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,030 | 5,870.27 | 0.00 |
| JPY BRIDGESTONE | 1,135 | 34,943.45 | 0.01 | EUR COMMERZBANK | 2,086 | 7,574.40 | 0.00 |
| USD BRISTOL MYERS SQUIBB | 10,280 | 572,994.67 | 0.19 | AUD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 3,144 | 118,942.07 | 0.04 |
| GBP BRITISH LAND | 7,696 | 32,084.90 | 0.01 | GBP COMPASS GROUP PLC | 4,847 | 75,963.77 | 0.02 |
| USD BRIXMOR PROPERTY GROUP | 1,670 | 15,865.21 | 0.00 | AUD COMPUTERSHARE | 859 | 5,107.69 | 0.00 |
| USD BROOKFIELD PROPERTY REIT INC -A- | 370 | 3,137.33 | 0.00 | USD CONOCOPHILLIPS | 4,866 | 149,886.61 | 0.05 |
| GBP BT GROUP | 25,486 | 37,258.63 | 0.01 | USD CONSOLIDATED EDISON | 1,478 | 115,293.05 | 0.04 |
| USD BUNGE | 596 | 24,465.13 | 0.01 | AUD COPART | 901 | 61,715.68 | 0.02 |
| AUD BUNNINGS WAREHOUSE PROPERTY TRUST | 2,660 | 5,454.33 | 0.00 | USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 630 | 13,947.85 | 0.00 |
| GBP BURBERRY GROUP | 1,248 | 20,503.99 | 0.01 | USD COSTCO WHOLESALE | 88 | 25,201.94 | 0.01 |
| USD CADENCE DESIGN SYSTEMS | 1,252 | 82,666.02 | 0.03 | USD COUSINS PROPERTIES INC | 820 | 23,987.15 | 0.01 |
| EUR CA-IMMOBILIEN ANLAGEN | 372 | 12,527.13 | 0.00 | EUR COVESTRO | 714 | 21,829.88 | 0.01 |
| EUR CAIXABANK | 7,482 | 13,955.76 | 0.00 | EUR COVIVIO FONCIERE DES REGIONS | 249 | 14,041.38 | 0.00 |
| USD CAMDEN PROPERTY TRUST | 960 | 76,106.63 | 0.02 | EUR CREDIT AGRICOLE | 2,405 | 17,657.64 | 0.01 |
| USD CAMPBELL SOUP | 713 | 32,923.97 | 0.01 | EUR CRH PLC | 1,649 | 44,955.08 | 0.01 |
| CAD CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 952 | 28,476.67 | 0.01 | GBP CRODA INTERNATIONAL PLC | 390 | 20,653.71 | 0.01 |
| SGD CAPITACOMMERCIAL TRUST (units) | 19,493 | 20,946.69 | 0.01 | CAD CROMBIE | 499 | 4,350.58 | 0.00 |
| GBP CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES | 3,967 | 8,161.20 | 0.00 | AUD CROMWELL PROPERTY GROUP | 13,065 | 6,397.25 | 0.00 |
| SGD CAPITALAND | 18,001 | 36,031.83 | 0.01 | CHF CS GROUP (reg. shares) | 2,658 | 21,974.21 | 0.01 |
| SGD CAPITAMALL TRUST | 17,492 | 21,990.67 | 0.01 | AUD CSL | 805 | 146,114.25 | 0.05 |
| USD CAPRI HOLDINGS LTD | 634 | 6,843.05 | 0.00 | USD CSX | 3,256 | 186,544.84 | 0.06 |
| USD CARDINAL HEALTH | 1,263 | 60,564.22 | 0.02 | USD CUBESMART | 1,091 | 29,223.63 | 0.01 |
| USD CARETRUST REIT | 537 | 7,942.95 | 0.00 | USD CUMMINS | 650 | 87,983.74 | 0.03 |
| USD CARMAX | 669 | 36,032.46 | 0.01 | GBP CUSTODIAN REIT | 2,130 | 2,614.20 | 0.00 |
| EUR CARMILA SA | 202 | 2,873.61 | 0.00 | JPY CYBERAGENT | 198 | 7,681.30 | 0.00 |
| EUR CARREFOUR | 1,264 | 19,994.42 | 0.01 | USD CYRUSONE | 640 | 39,529.84 | 0.01 |
| EUR CASINO GUICHARD PERRACHON | 108 | 4,168.74 | 0.00 | JPY DAI NIPPON PRINTING | 478 | 10,182.10 | 0.00 |
| JPY CASIO COMPUTER | 380 | 5,340.76 | 0.00 | JPY DAICEL CORP | 489 | 3,573.87 | 0.00 |
| SEK CASTELLUM | 1,454 | 24,658.07 | 0.01 | JPY DAIFUKU | 200 | 12,714.29 | 0.00 |
| SEK CATENA AB | 134 | 3,930.01 | 0.00 | JPY DAIKIN INDUSTRIES | 503 | 61,397.09 | 0.02 |
| USD CATERPILLAR | 3,724 | 432,160.14 | 0.14 | JPY DAIWA HOUSE INDUSTRY | 1,114 | 27,625.70 | 0.01 |
| USD CBOE HOLDINGS | 477 | 42,585.24 | 0.01 | JPY DAIWA OFFICE INVESTMENT | 1 | 8,103.06 | 0.00 |
| USD CBRE GROUP | 1,392 | 52,492.50 | 0.02 | JPY DAIWAHSE RESIDENTIAL INVESTMENT | 11 | 26,092.28 | 0.01 |
| SGD CDL HOSPITALITY TRUST (stapled security) | 4,237 | 2,380.80 | 0.00 | EUR DANONE | 1,287 | 82,795.00 | 0.03 |
| | | | | USD DARDEN RESTAURANTS | 547 | 29,795.02 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|-------------|------------------|---|-----------|--------------|------------------|
| SGD DBS GROUP HOLDINGS | 3,181 | 41,485.97 | 0.01 | AUD FORTESCUE METALS GROUP | 2,437 | 14,914.25 | 0.00 |
| GBP DCC | 298 | 18,871.15 | 0.01 | USD FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 628 | 27,143.15 | 0.01 |
| USD DEERE & CO | 1,319 | 182,174.04 | 0.06 | HKD FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,257 | 6,722.56 | 0.00 |
| USD DELL TECHNOLOGIES INC | 698 | 27,603.20 | 0.01 | USD FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 382 | 7,147.09 | 0.00 |
| USD DELTA AIR LINES | 737 | 21,034.99 | 0.01 | USD FRANKLIN RESOURCES | 1,287 | 21,473.32 | 0.01 |
| JPY DENSO | 853 | 27,594.09 | 0.01 | USD FRANKLIN STREET PROPERTIES | 588 | 3,368.68 | 0.00 |
| USD DENTSPLY SIRONA | 1,025 | 39,803.34 | 0.01 | EUR FRAPORT | 83 | 3,362.60 | 0.00 |
| GBP DERWENT LONDON | 541 | 21,947.32 | 0.01 | SGD FRASERS CENTREPOINT TRUST | 3,816 | 6,003.55 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE BOERSE (reg. shares) | 396 | 54,272.63 | 0.02 | SGD FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 8,953 | 5,564.94 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE EUROSHOP (reg. shares) | 280 | 3,218.35 | 0.00 | EUR FRESenius | 979 | 36,446.61 | 0.01 |
| EUR DEUTSCHE POST (reg. shares) | 2,061 | 56,036.86 | 0.02 | JPY FRONTIER REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 6,899.84 | 0.00 |
| EUR DEUTSCHE TELEKOM (reg. shares) | 4,284 | 55,529.40 | 0.02 | JPY FUJITSU | 391 | 35,297.01 | 0.01 |
| EUR DEUTSCHE WOHNEN (reg. shares) | 2,678 | 102,005.20 | 0.03 | JPY FUKUOKA REIT | 4 | 4,053.35 | 0.00 |
| USD DEVON ENERGY | 1,485 | 10,258.73 | 0.00 | EUR GALP ENERGIA -B- | 1,045 | 11,918.95 | 0.00 |
| USD DEXCOM | 407 | 109,523.15 | 0.03 | USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES | 1,143 | 31,681.70 | 0.01 |
| AUD DEXUS PROPERTY GROUP (stapled security) | 7,825 | 43,533.20 | 0.01 | USD GAP | 867 | 6,106.48 | 0.00 |
| USD DIAMONDROCK HOSPITALITY | 1,169 | 5,939.07 | 0.00 | USD GARMIN (reg. shares) | 579 | 43,382.59 | 0.01 |
| USD DIGITAL REALTY | 1,477 | 205,164.71 | 0.06 | GBP GCP STUDENT LIVING | 2,461 | 4,057.99 | 0.00 |
| SEK DIOS FASTIGHETER | 449 | 3,005.61 | 0.00 | CHF GEBERIT | 34 | 14,833.85 | 0.00 |
| USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 1,352 | 48,209.43 | 0.01 | EUR GECINA | 375 | 49,605.02 | 0.02 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -A- | 632 | 12,281.75 | 0.00 | USD GENERAL MILLS | 2,662 | 140,471.31 | 0.04 |
| USD DISCOVERY COMMUNICATIONS -C- | 1,634 | 28,658.79 | 0.01 | USD GENUINE PARTS | 626 | 42,121.83 | 0.01 |
| USD DOMINION RESOURCES | 3,600 | 259,870.05 | 0.09 | EUR GETLINK SE | 916 | 11,049.63 | 0.00 |
| USD DOMINO'S PIZZA | 167 | 54,097.10 | 0.02 | USD GETTY REALTY | 185 | 4,385.43 | 0.00 |
| USD DOUGLAS EMMETT | 934 | 28,493.78 | 0.01 | USD GILEAD SCIENCES | 5,546 | 414,591.77 | 0.14 |
| USD DOVER | 633 | 53,151.69 | 0.02 | CHF GIVAUDAN (reg. shares) | 10 | 32,423.32 | 0.01 |
| USD DOW INC | 1,316 | 38,478.40 | 0.01 | GBP GLAXOSMITHKLINE | 15,247 | 286,353.67 | 0.10 |
| CAD DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 616 | 4,061.93 | 0.00 | USD GLOBAL NET LEASE | 528 | 7,061.64 | 0.00 |
| CAD DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 284 | 4,661.27 | 0.00 | JPY GLOBAL ONE REAL ESTATE INVESTMENT | 5 | 4,384.48 | 0.00 |
| USD DTE ENERGY | 846 | 80,376.80 | 0.02 | JPY GLP J-REIT | 20 | 22,043.24 | 0.01 |
| CHF DUFREY | 32 | 996.57 | 0.00 | USD GOLDMAN SACHS GROUP | 572 | 88,455.32 | 0.03 |
| USD DUKE REALTY | 3,703 | 119,891.33 | 0.04 | AUD GOODMAN GROUP (stapled security) | 2,893 | 21,424.84 | 0.01 |
| USD E TRADE FINANCIAL | 974 | 33,432.06 | 0.01 | NZD GOODMAN PROPERTY TRUST | 6,004 | 7,634.45 | 0.00 |
| JPY EAST JAPAN RAILWAY | 601 | 45,530.41 | 0.01 | AUD GPT GROUP (stapled security) | 13,909 | 30,901.55 | 0.01 |
| USD EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 416 | 10,247.04 | 0.00 | GBP GRAINGER | 3,247 | 10,434.90 | 0.00 |
| USD EASTGROUP PROPERTIES | 216 | 22,546.86 | 0.01 | EUR GRAND CITY PROPERTIES | 594 | 12,496.40 | 0.00 |
| USD EAST-WEST BANCORP | 609 | 15,674.47 | 0.00 | CAD GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT (units) | 304 | 12,401.21 | 0.00 |
| GBP EASYJET | 482 | 3,413.35 | 0.00 | GBP GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 1,367 | 11,550.74 | 0.00 |
| USD EATON | 1,791 | 139,136.37 | 0.04 | CHF GURIT-HEBERLEIN | 1 | 824.90 | 0.00 |
| USD ECOLAB | 1,141 | 177,862.60 | 0.06 | EUR HAMBORNER REIT | 378 | 3,384.00 | 0.00 |
| USD EDISON INTERNATIONAL | 1,548 | 84,797.86 | 0.03 | GBP HAMMERSON | 4,103 | 3,937.14 | 0.00 |
| EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares) | 5,330 | 21,394.95 | 0.01 | HKD HANG LUNG PROPERTIES | 10,980 | 22,296.87 | 0.01 |
| USD EDWARDS LIFESCIENCES | 916 | 172,759.23 | 0.05 | HKD HANG SENG BANK | 1,345 | 23,000.94 | 0.01 |
| EUR EIFFAGE | 163 | 11,555.13 | 0.00 | USD HANNESBRANDS | 1,513 | 11,904.37 | 0.00 |
| JPY EISAI | 498 | 36,564.65 | 0.01 | USD HARLEY-DAVIDSON | 776 | 14,683.31 | 0.00 |
| USD ELECTRONIC ARTS | 1,289 | 129,132.57 | 0.04 | USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 1,562 | 55,061.20 | 0.02 |
| USD EMPIRE STATE REALTY TRUST -A- | 850 | 7,615.67 | 0.00 | AUD HARVEY NORMAN HOLDINGS | 989 | 1,785.16 | 0.00 |
| GBP EMPERIC STUDENT | 3,230 | 2,646.99 | 0.00 | USD HASBRO | 589 | 42,111.19 | 0.01 |
| CHF EMS-CHEMIE HOLDING | 6 | 4,080.42 | 0.00 | USD HCA HOLDINGS | 1,178 | 105,882.41 | 0.03 |
| EUR ENAGAS | 519 | 10,297.64 | 0.00 | USD HEALTHCARE REALTY TRUST | 740 | 20,674.71 | 0.01 |
| NOK ENTRIA ASA | 904 | 10,676.33 | 0.00 | USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA -A- | 1,212 | 29,418.38 | 0.01 |
| EUR E.ON (reg. shares) | 4,676 | 48,439.71 | 0.01 | USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 5,061 | 120,703.35 | 0.04 |
| USD EPR PROPERTIES | 438 | 10,615.60 | 0.00 | EUR HEIDELBERGCEMENT | 311 | 13,340.60 | 0.00 |
| USD EQUINIX | 374 | 233,310.25 | 0.07 | GBP HELICAL | 522 | 2,266.07 | 0.00 |
| USD EQUITABLE HOLDINGS INC | 1,974 | 28,528.29 | 0.01 | EUR HENKEL | 216 | 15,993.45 | 0.00 |
| USD EQUITY COMMONWEALTH | 678 | 21,507.05 | 0.01 | EUR HENKEL (pref. shares) | 372 | 29,843.92 | 0.01 |
| USD EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 977 | 56,183.84 | 0.02 | USD HENRY JACK & ASSOCIATES | 345 | 53,591.51 | 0.02 |
| USD EQUITY RESIDENTIAL | 2,069 | 127,677.50 | 0.04 | USD HENRY SCHEIN | 622 | 31,443.91 | 0.01 |
| USD ERIE INDEMNITY -A- | 118 | 17,472.39 | 0.01 | USD HESS | 1,271 | 42,322.36 | 0.01 |
| USD ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TR | 513 | 6,704.66 | 0.00 | USD HEWLETT-PACKARD | 5,630 | 54,668.21 | 0.02 |
| USD ESSEX PROPERTY TRUST | 370 | 81,488.73 | 0.03 | CHF HIAG IMMOBILIEN HOLDING (reg shares) | 15 | 1,396.97 | 0.00 |
| EUR ESSILORLUXOTTICA | 592 | 63,793.92 | 0.02 | EUR HIBERNIA REIT -144A- (reg. shares) | 3,664 | 4,269.57 | 0.00 |
| USD ESTEE LAUDER COMPANIES -A- | 957 | 152,564.65 | 0.05 | USD HIGHWOODS PROPERTIES | 574 | 20,346.32 | 0.01 |
| EUR EURAZEO | 79 | 3,545.66 | 0.00 | USD HILTON WORLDWIDE HOLDINGS (reg. shares) | 1,179 | 80,476.62 | 0.02 |
| EUR EUROCOMMERCIAL (cert. shares) | 264 | 2,560.10 | 0.00 | JPY HINO MOTORS | 561 | 3,019.33 | 0.00 |
| EUR EURONEXT NV | 508 | 37,761.24 | 0.01 | JPY HIROSE ELECTRIC | 66 | 6,824.15 | 0.00 |
| USD EVERSOURCE ENERGY | 1,441 | 112,714.66 | 0.03 | JPY HITACHI CHEMICAL | 203 | 8,648.96 | 0.00 |
| EUR EXOR HOLDING | 226 | 11,668.04 | 0.00 | JPY HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY | 211 | 4,271.64 | 0.00 |
| USD EXPEDIA | 588 | 33,105.64 | 0.01 | JPY HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES | 135 | 10,007.68 | 0.00 |
| USD EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON | 737 | 49,170.18 | 0.02 | JPY HITACHI METALS | 420 | 4,430.91 | 0.00 |
| USD EXTRA SPACE STORAGE | 710 | 68,013.52 | 0.02 | HKD HKEX | 2,130 | 64,256.57 | 0.02 |
| USD EXXON MOBIL | 1,303 | 49,457.94 | 0.02 | HKD HKT (stapled security) | 6,662 | 9,076.47 | 0.00 |
| SEK FABEGE AB | 1,423 | 18,286.62 | 0.01 | USD HOLLYFRONTIER | 617 | 15,133.54 | 0.00 |
| USD FACTSET RESEARCH SYSTEMS | 174 | 45,297.39 | 0.01 | USD HOLOGIC | 1,163 | 40,836.75 | 0.01 |
| JPY FAST RETAILING | 116 | 47,510.77 | 0.01 | USD HOME DEPOT | 5,473 | 1,021,842.86 | 0.33 |
| USD FASTENAL | 2,558 | 79,926.56 | 0.02 | JPY HONDA MOTOR | 3,282 | 73,875.02 | 0.02 |
| SEK FASTIGHETS BALDER -B- | 523 | 18,852.77 | 0.01 | HKD HONG KONG & CHINA GAS | 17,852 | 29,434.89 | 0.01 |
| EUR FAURECIA | 767 | 22,975.67 | 0.01 | USD HONGKONG LAND HOLDINGS | 6,262 | 23,483.36 | 0.01 |
| USD FEDERAL REALITY INVESTMENT TRUST | 737 | 54,965.05 | 0.02 | USD HORMEL FOODS | 1,258 | 58,659.63 | 0.02 |
| GBP FERGUSON | 695 | 43,571.85 | 0.01 | USD HOST HOTELS AND RESORTS | 7,068 | 78,035.52 | 0.02 |
| EUR FERROVIAL | 1,017 | 24,404.12 | 0.01 | USD HP | 6,555 | 113,801.35 | 0.04 |
| USD FIFTH THIRD BANCORP | 3,105 | 46,112.08 | 0.01 | CAD H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UNITS | 1,612 | 10,115.68 | 0.00 |
| USD FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST | 722 | 23,979.43 | 0.01 | USD HUDSON PACIFIC | 853 | 21,634.07 | 0.01 |
| USD FIRST REPUBLIC BANK | 725 | 59,675.69 | 0.02 | SEK HUFVUDSTADEN -A- | 590 | 8,077.12 | 0.00 |
| NZD FLETCHER BUILDING | 1,501 | 3,115.11 | 0.00 | JPY HULIC | 2,541 | 25,839.91 | 0.01 |
| USD FLOWSERVE | 549 | 13,109.71 | 0.00 | JPY HULIC REIT | 6 | 7,281.58 | 0.00 |
| CHF FLUGHAFEN ZUERICH | 4 | 449.78 | 0.00 | USD HUMANA | 581 | 182,533.26 | 0.06 |
| | | | | USD HUNTINGTON BANCSHARES | 4,357 | 35,767.82 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| HKD HYSAN DEVELOPMENT | 3,297 | 10,720.12 | 0.00 | USD KILROY REALTY | 587 | 37,404.78 | 0.01 |
| EUR IBERDROLA | 31,615 | 311,649.13 | 0.11 | USD KIMBERLY-CLARK | 1,504 | 192,291.68 | 0.06 |
| USD IBM | 5,006 | 555,297.72 | 0.18 | USD KIMCO REALTY | 2,328 | 22,508.89 | 0.01 |
| EUR ICADE | 172 | 13,592.56 | 0.00 | USD KINDER MORGAN | 8,873 | 123,516.71 | 0.04 |
| JPY ICHIGO REAL ESTATE INVESTMENT | 6 | 4,469.30 | 0.00 | GBP KINGFISHER | 6,402 | 11,423.81 | 0.00 |
| USD IDEX | 328 | 45,332.87 | 0.01 | EUR KINGSPAN GROUP | 321 | 17,150.60 | 0.01 |
| USD IDEXX LABORATORIES | 384 | 92,946.79 | 0.03 | USD KITE REALTY GROUP TRUST | 467 | 4,419.14 | 0.00 |
| CHF IDORSIA LTD | 27 | 703.44 | 0.00 | NZD KIWI PROPERTY | 8,342 | 4,648.93 | 0.00 |
| EUR IGD SIIQ (reg shares) | 353 | 1,452.48 | 0.00 | USD KKR & CO INC -A- | 2,191 | 51,413.43 | 0.02 |
| USD IHS MARKIT | 1,700 | 101,977.43 | 0.03 | EUR KLEPIERRE | 1,441 | 27,776.00 | 0.01 |
| USD ILLINOIS TOOL WORKS | 1,418 | 201,545.45 | 0.06 | SEK KLOVERN -B- | 2,756 | 4,110.69 | 0.00 |
| GBP IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 1,323 | 1,501.30 | 0.00 | JPY KOBAYASHI PHARMACEUTICAL | 96 | 8,937.68 | 0.00 |
| USD INDEPENDENCE REALTY TRUST | 529 | 4,716.84 | 0.00 | USD KOHL'S | 670 | 9,779.05 | 0.00 |
| EUR INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL INDITEX | 2,275 | 59,058.02 | 0.02 | EUR KOJAMO OYJ | 971 | 18,416.31 | 0.01 |
| JPY INDUSTRIAL & INFRASTRUCTURE FUND INVESTMENT | 9 | 12,036.62 | 0.00 | JPY KOMATSU | 1,837 | 30,263.17 | 0.01 |
| USD INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIE | 364 | 6,380.52 | 0.00 | JPY KONAMI | 183 | 5,614.57 | 0.00 |
| EUR INFINEON TECHNOLOGIES (reg. shares) | 5,412 | 79,744.26 | 0.02 | EUR KONE -B- | 517 | 29,259.69 | 0.01 |
| GBP INFORMA | 3,798 | 20,844.29 | 0.01 | JPY KONICA MINOLTA | 889 | 3,617.09 | 0.00 |
| EUR ING GROUP | 14,853 | 77,928.47 | 0.02 | EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | 5,054 | 118,041.38 | 0.04 |
| EUR INGENICO GROUP | 126 | 13,423.84 | 0.00 | EUR KONINKLIJKE DSM | 378 | 42,934.10 | 0.01 |
| EUR INMOBILIARIA COLONIAL SA | 1,753 | 16,610.83 | 0.01 | EUR KONINKLIJKE KPN | 7,444 | 17,774.38 | 0.01 |
| USD INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTI | 91 | 6,930.38 | 0.00 | EUR KONINKLIJKE VOPAK | 146 | 7,618.39 | 0.00 |
| JPY INPEX | 2,012 | 11,348.79 | 0.00 | JPY KUBOTA | 2,063 | 26,398.46 | 0.01 |
| AUD INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 4,063 | 15,419.47 | 0.00 | CHF KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL | 43 | 5,921.40 | 0.00 |
| USD INTEL | 20,378 | 1,102,834.16 | 0.35 | SEK KUNGSLEDEN | 1,016 | 7,694.46 | 0.00 |
| USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE | 2,441 | 197,137.24 | 0.06 | JPY KURARAY | 625 | 6,324.32 | 0.00 |
| GBP INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 525 | 22,872.33 | 0.01 | JPY KURITA WATER INDUSTRIES | 194 | 4,499.28 | 0.00 |
| USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | 455 | 46,416.10 | 0.01 | JPY KYOCERA | 638 | 37,853.55 | 0.01 |
| USD INTERNATIONAL PAPER | 1,622 | 50,482.64 | 0.02 | JPY KYUSHU RAILWAY COMPANY | 318 | 9,124.55 | 0.00 |
| CAD INTERRENT REAL ESTATE INVESTME | 640 | 5,989.24 | 0.00 | USD LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 434 | 54,891.87 | 0.02 |
| GBP INTERTEK GROUP | 490 | 28,694.94 | 0.01 | CHF LAFARGEHOLCIM (reg. shares) | 569 | 20,794.63 | 0.01 |
| EUR INTERVEST OFFICES | 122 | 3,192.88 | 0.00 | USD LAM RESEARCH | 640 | 153,637.62 | 0.05 |
| EUR INTESA SANPAOLO | 29,315 | 47,876.47 | 0.01 | GBP LAND SECURITIES GROUP PLC | 3,845 | 26,545.10 | 0.01 |
| GBP INTU PROPERTIES PLC | 4,786 | 264.32 | 0.00 | CHF LANDIS+GYR GROUP AG | 20 | 1,374.11 | 0.00 |
| USD INTUIT | 1,141 | 262,443.32 | 0.09 | EUR LAR ESPANA | 322 | 1,423.00 | 0.00 |
| USD INVESCO | 1,895 | 17,208.61 | 0.01 | JPY LASALLE LOGIPORT | 7 | 10,021.42 | 0.00 |
| USD INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 68 | 3,717.91 | 0.00 | JPY LAWSON | 99 | 5,435.57 | 0.00 |
| JPY INVINCIBLE INVESTMENT | 26 | 5,929.65 | 0.00 | EUR LEASINVEST REAL ESTATE | 13 | 1,221.34 | 0.00 |
| USD INVITATION HOMES (reg. shares) | 3,023 | 64,596.54 | 0.02 | EUR LEG IMMOBILIEN (reg. shares) | 373 | 41,989.98 | 0.01 |
| USD IQVIA HOLDINGS INC | 710 | 76,622.77 | 0.02 | GBP LEGAL & GENERAL GROUP | 18,097 | 43,499.72 | 0.01 |
| EUR IRISH RESIDENT | 2,341 | 3,133.34 | 0.00 | EUR LEGRAND | 1,001 | 64,248.93 | 0.02 |
| USD IRON MOUNTAIN REIT | 1,205 | 28,684.43 | 0.01 | AUD LENDLEASE GROUP | 992 | 6,252.76 | 0.00 |
| GBP ITV | 10,992 | 8,998.48 | 0.00 | USD LENNOX INTERNATIONAL | 149 | 27,139.26 | 0.01 |
| GBP J. SAINSBURY | 5,369 | 14,008.29 | 0.00 | USD LEXINGTON REALITY TRUST | 1,351 | 13,419.62 | 0.00 |
| JPY JAPAN EXCELLENT | 7 | 7,973.91 | 0.00 | USD LIBERTY BROADB c -C- | 475 | 52,627.58 | 0.02 |
| JPY JAPAN HOTEL REIT INVESTMENT | 24 | 7,020.24 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -A- | 605 | 9,988.29 | 0.00 |
| JPY JAPAN LOGISTICS | 5 | 10,328.46 | 0.00 | USD LIBERTY GLOBAL -C- | 1,921 | 30,172.32 | 0.01 |
| JPY JAPAN PRIME REALTY INVESTMENT | 5 | 13,746.81 | 0.00 | USD LIFE STORAGE | 266 | 25,153.34 | 0.01 |
| JPY JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT | 7 | 41,118.07 | 0.01 | USD LINCOLN NATIONAL | 840 | 22,118.93 | 0.01 |
| JPY JAPAN RENTAL HOUSING INVESTMENTS | 8 | 6,880.96 | 0.00 | USD LINDE PLC | 2,360 | 408,291.78 | 0.14 |
| JPY JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT | 19 | 21,943.02 | 0.01 | CHF LINDT & SPRUENGLI | 1 | 10,748.59 | 0.00 |
| SGD JARDINE CYCLE & CARRIAGE | 175 | 2,424.22 | 0.00 | USD LKQ | 1,366 | 28,009.54 | 0.01 |
| USD JAZZ PHARMACEUTICALS | 238 | 23,709.77 | 0.01 | USD LOEWS | 1,142 | 39,789.13 | 0.01 |
| USD JBG SMITH PROPERTIES | 691 | 22,009.85 | 0.01 | CHF LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares) | 84 | 3,630.74 | 0.00 |
| EUR JC DECAUX | 170 | 3,076.08 | 0.00 | GBP LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 961 | 86,740.80 | 0.03 |
| EUR JERONIMO MARTINS | 525 | 9,465.86 | 0.00 | GBP LONDONMETRIC PROPERTY | 4,388 | 9,569.92 | 0.00 |
| JPY JFE HOLDINGS | 965 | 6,282.85 | 0.00 | CHF LONZA GROUP (reg. shares) | 74 | 30,610.87 | 0.01 |
| USD JOHNSON & JOHNSON | 11,537 | 1,512,823.76 | 0.48 | EUR L'OREAL | 1,062 | 278,285.46 | 0.10 |
| USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 3,358 | 90,540.90 | 0.03 | USD LOWE'S COMPANIES | 3,384 | 291,177.00 | 0.01 |
| GBP JOHNSON MATTHEY | 587 | 13,091.44 | 0.00 | USD LTC PROPERTIES | 222 | 6,855.94 | 0.00 |
| USD JONES LANG LASALLE | 222 | 22,434.67 | 0.01 | USD LULULEMON ATHLETICA | 495 | 93,838.15 | 0.03 |
| USD JP MORGAN CHASE | 1,293 | 116,431.23 | 0.04 | EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 371 | 137,662.93 | 0.04 |
| CHF JULIUS BAER GRUPPE | 179 | 6,100.96 | 0.00 | GBP LXI REIT PLC | 2,780 | 3,750.10 | 0.00 |
| JPY KAJIMA | 882 | 9,059.83 | 0.00 | USD MACERICH | 791 | 4,455.14 | 0.00 |
| JPY KANSAI PAINT | 351 | 6,697.00 | 0.00 | USD MACK-CALI REALTY | 510 | 7,771.24 | 0.00 |
| USD KANSAS CITY SOUTHERN INDUSTRIES | 444 | 56,497.00 | 0.02 | AUD MACQUARIE GROUP | 595 | 31,239.74 | 0.01 |
| JPY KAO | 963 | 78,786.61 | 0.02 | USD MANPOWER | 229 | 12,140.84 | 0.00 |
| JPY KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES | 282 | 4,094.81 | 0.00 | USD MANULIFE US REAL ESTATE INVEST | 7,681 | 5,568.81 | 0.00 |
| EUR KBC GROUP | 521 | 24,030.84 | 0.01 | SGD MAPLETREE COMMERCIAL TRUST REIT (reg. shares) | 11,788 | 15,150.88 | 0.00 |
| JPY KDDI | 3,555 | 105,033.84 | 0.03 | SGD MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 8,281 | 14,133.16 | 0.00 |
| JPY KEIO CORP | 203 | 11,997.20 | 0.00 | SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 13,746 | 15,253.52 | 0.00 |
| USD KELLOGG | 1,097 | 65,819.55 | 0.02 | USD MARATHON OIL | 3,364 | 11,067.08 | 0.00 |
| JPY KENEDIX OFFICE INVESTMENT | 2 | 10,744.42 | 0.00 | USD MARATHON PETROLEUM (when issued) | 2,858 | 67,508.38 | 0.02 |
| JPY KENEDIX RESIDENTIAL INVESTMENT CORPORATION | 5 | 7,627.21 | 0.00 | GBP MARKS & SPENCER | 5,917 | 7,280.73 | 0.00 |
| JPY KENEDIYX RETAIL REIT | 3 | 3,921.47 | 0.00 | USD MARSH & MCLENNAN | 2,222 | 192,106.78 | 0.06 |
| USD KENNEDY-WILSON HOLDINGS | 707 | 9,482.43 | 0.00 | JPY MARUI | 375 | 6,302.53 | 0.00 |
| SGD KEPPPEL | 2,556 | 9,495.50 | 0.00 | USD MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 2,636 | 59,651.17 | 0.02 |
| SGD KEPPPEL DC REIT TRUST (reg. -S-) | 6,540 | 10,517.79 | 0.00 | USD MASCO | 1,215 | 42,003.96 | 0.01 |
| SGD KEPPPEL REIT | 10,689 | 7,132.16 | 0.00 | USD MASTERCARD | 4,111 | 993,115.11 | 0.32 |
| EUR KERING | 158 | 82,493.31 | 0.03 | USD MC CORMICK (non voting) | 556 | 78,485.87 | 0.02 |
| EUR KERRY GROUP -A- | 553 | 63,845.78 | 0.02 | USD MCDONALD'S | 4,016 | 664,016.90 | 0.22 |
| USD KEYCORP | 4,330 | 44,907.13 | 0.01 | JPY MCUBS MIDCITY INVESTMENT | 9 | 6,356.01 | 0.00 |
| JPY KEYENCE | 368 | 118,591.87 | 0.04 | USD MEDICAL PROPERTIES TRUST | 2,901 | 50,152.31 | 0.02 |
| USD KEYSIGHT TECHNOLOGIES. | 805 | 67,380.20 | 0.02 | EUR MEDIABANCA | 6,887 | 37,994.59 | 0.01 |
| JPY KIKKOMAN | 286 | 12,199.61 | 0.00 | USD MEDTRONIC | 265 | 23,912.36 | 0.01 |
| CAD KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 478 | 5,301.34 | 0.00 | GBP MEGGITT | 2,357 | 8,485.67 | 0.00 |
| | | | | USD MERCADOLIBRE | 199 | 97,342.64 | 0.03 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|--------------|------------------|
| EUR MERCIALYS | 332 | 2,410.82 | 0.00 | CHF NOVARTIS (reg. shares) | 2,301 | 189,861.08 | 0.06 |
| EUR MERCK | 269 | 27,659.39 | 0.01 | EUR NSI NV | 95 | 3,748.19 | 0.00 |
| USD MERCK & CO | 12,462 | 958,855.90 | 0.31 | JPY NSK | 701 | 4,507.96 | 0.00 |
| NZD MERIDIAN ENERGY | 2,257 | 5,405.88 | 0.00 | JPY NTT DOCOMO | 2,686 | 84,016.85 | 0.03 |
| EUR MERLIN PROPERTIES | 1,785 | 13,456.34 | 0.00 | USD NUCOR | 1,331 | 47,951.72 | 0.01 |
| EUR METRO AG | 359 | 3,102.78 | 0.00 | USD NVIDIA | 2,550 | 672,191.14 | 0.22 |
| EUR METSO | 219 | 5,223.50 | 0.00 | USD NVR | 16 | 40,506.81 | 0.01 |
| USD METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 105 | 72,175.14 | 0.02 | SEK NYFOSA AB | 859 | 4,341.45 | 0.00 |
| EUR MICHELIN (reg. shares) | 356 | 31,696.66 | 0.01 | JPY OBAYASHI | 1,273 | 10,919.03 | 0.00 |
| USD MICROSOFT | 32,881 | 5,185,696.34 | 1.62 | USD OCCIDENTAL PETROLEUM | 3,846 | 44,538.10 | 0.01 |
| USD MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 642 | 66,148.19 | 0.02 | JPY ODAKYU ELECTRIC RAILWAY | 583 | 12,802.00 | 0.00 |
| AUD MIRVAC GROUP | 28,020 | 35,843.27 | 0.01 | USD OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 269 | 7,325.78 | 0.00 |
| JPY MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 2,518 | 14,993.94 | 0.00 | USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 1,272 | 33,762.64 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI ELECTRIC | 3,626 | 44,844.88 | 0.01 | USD OMNICOM GROUP | 953 | 52,293.19 | 0.02 |
| JPY MITSUBISHI ESTATE | 8,563 | 126,518.46 | 0.04 | JPY OMRON | 378 | 19,711.52 | 0.01 |
| JPY MITSUBISHI MATERIALS | 220 | 4,523.79 | 0.00 | EUR OMV | 307 | 8,475.98 | 0.00 |
| JPY MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE | 787 | 3,880.71 | 0.00 | USD ONEOK (new) | 1,779 | 38,790.58 | 0.01 |
| JPY MITSUI CHEMICALS | 362 | 6,881.67 | 0.00 | JPY ONO PHARMACEUTICAL | 747 | 17,197.42 | 0.01 |
| JPY MITSUI FUDOSAN | 6,835 | 118,433.16 | 0.04 | USD ORACLE | 479 | 23,157.49 | 0.01 |
| JPY MITUI FUDOSAN LOGISTICS PARK | 2 | 9,299.49 | 0.00 | EUR ORANGE | 4,161 | 50,832.63 | 0.02 |
| JPY MIZUHO FINANCIAL GROUP | 48,026 | 54,985.44 | 0.02 | AUD ORICA | 719 | 6,756.61 | 0.00 |
| CHF MOBIMO HOLDING | 35 | 9,756.31 | 0.00 | JPY ORIENTAL LAND | 395 | 50,623.87 | 0.02 |
| USD MOHAWK INDUSTRIES | 239 | 18,190.70 | 0.01 | AUD ORIGIN ENERGY | 3,096 | 8,300.64 | 0.00 |
| GBP MONDI | 1,473 | 25,227.48 | 0.01 | EUR ORION CORPORATION (new) -B- | 219 | 8,944.51 | 0.00 |
| USD MONMOUTH REAL ESTATE -A- | 531 | 6,395.42 | 0.00 | JPY ORIX | 2,631 | 31,698.89 | 0.01 |
| EUR MONTEA SCA | 68 | 6,265.67 | 0.00 | JPY ORIX JREIT | 14 | 18,662.43 | 0.01 |
| USD MOODY'S | 749 | 158,362.88 | 0.05 | JPY OSAKA GAS | 738 | 13,916.14 | 0.00 |
| JPY MORI HILLS REIT INVESTMENT CORP | 8 | 11,164.00 | 0.00 | JPY OTSUKA | 205 | 8,761.65 | 0.00 |
| JPY MORI TRUST SOGO REIT | 5 | 6,510.55 | 0.00 | SGD OVERSEA-CHINESE BANKING (reg. shares) | 5,859 | 35,553.31 | 0.01 |
| GBP MORRISON (W.M.) SUPERMARKETS | 7,282 | 16,072.76 | 0.00 | USD OWENS CORNING | 506 | 19,653.93 | 0.01 |
| USD MOSAIC | 1,441 | 15,591.18 | 0.00 | USD PACCAR | 1,540 | 94,131.66 | 0.03 |
| USD MOTOROLA SOLUTIONS | 761 | 101,137.37 | 0.03 | JPY PANASONIC | 4,390 | 33,545.00 | 0.01 |
| USD M&T BANK | 542 | 56,073.29 | 0.02 | SEK PANDOX -B- | 484 | 4,004.13 | 0.00 |
| HKD MTR | 2,698 | 13,938.43 | 0.00 | USD PARAMOUNT GROUP | 1,100 | 9,677.53 | 0.00 |
| EUR MTU AERO ENGINES | 369 | 54,049.35 | 0.02 | CHF PARGESA HOLDING | 31 | 2,028.12 | 0.00 |
| EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS- GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted) | 301 | 60,791.34 | 0.02 | USD PARK HOTELS & RESORTS | 1,342 | 10,618.29 | 0.00 |
| JPY MURATA MANUFACTURING | 1,144 | 58,001.88 | 0.02 | USD PARKER-HANNIFIN | 557 | 72,262.51 | 0.02 |
| JPY NABTESCO | 222 | 5,132.04 | 0.00 | JPY PARK24 | 230 | 3,383.98 | 0.00 |
| JPY NAGOYA RAILROAD | 370 | 10,386.03 | 0.00 | CHF PARTNERS GROUP | 23 | 15,770.63 | 0.00 |
| USD NASDAQ OMX GROUP | 487 | 46,251.94 | 0.01 | USD PAYPAL HOLDINGS | 219 | 20,932.87 | 0.01 |
| AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK | 5,130 | 52,374.30 | 0.02 | HKD PCCW | 7,449 | 4,103.40 | 0.00 |
| GBP NATIONAL GRID PLC | 10,636 | 124,845.29 | 0.04 | GBP PEARSON | 2,373 | 16,258.23 | 0.01 |
| USD NATIONAL HEALTH INVESTORS | 239 | 11,816.41 | 0.00 | USD PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 741 | 8,066.23 | 0.00 |
| USD NATIONAL OILWELL VARCO | 1,615 | 15,870.58 | 0.00 | USD PENTAIR | 727 | 21,643.27 | 0.01 |
| USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 966 | 31,105.63 | 0.01 | USD PEOPLES UNITED FINANCIAL | 2,135 | 23,592.10 | 0.01 |
| USD NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 334 | 9,886.99 | 0.00 | USD PEPSCO | 6,440 | 773,389.15 | 0.25 |
| EUR NATIXIS | 1,976 | 6,433.72 | 0.00 | EUR PERNOD-RICARD | 592 | 84,085.24 | 0.03 |
| EUR NATURGY ENERGY GROUP | 617 | 10,904.21 | 0.00 | USD PERRIGO CO PLC | 543 | 26,092.61 | 0.01 |
| JPY NEC | 490 | 17,892.39 | 0.01 | USD PHILLIPS 66 | 1,937 | 103,908.70 | 0.03 |
| EUR NESTE OYJ | 2,079 | 70,376.06 | 0.02 | GBP PHOENIX SPREE DEUTSCHLAND LTD | 460 | 1,531.18 | 0.00 |
| CHF NESTLE (reg. shares) | 3,108 | 319,454.70 | 0.11 | USD PHYSICIANS REALTY TRUST | 1,058 | 14,754.70 | 0.00 |
| HKD NEW WORLD DEVELOPMENT | 30,917 | 33,266.87 | 0.01 | USD PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST -A- | 700 | 12,357.34 | 0.00 |
| AUD NEWCREST MINING | 1,351 | 19,058.93 | 0.01 | USD PINNACLE WEST CAPITAL | 484 | 36,684.76 | 0.01 |
| USD NEWELL BRANDS | 1,688 | 22,423.12 | 0.01 | USD PIONEER NATURAL RESOURCES | 736 | 51,612.88 | 0.02 |
| USD NEWMONT MINING | 3,588 | 162,455.07 | 0.05 | USD PNC FINANCIAL SERVICES | 1,927 | 184,407.88 | 0.06 |
| GBP NEWRIVER REIT | 1,623 | 1,201.64 | 0.00 | USD PPG INDUSTRIES | 1,059 | 88,525.37 | 0.03 |
| GBP NEXT | 404 | 20,409.77 | 0.01 | JPY PREMIER INVESTMENT | 7 | 7,646.47 | 0.00 |
| JPY NGK INSULATORS | 514 | 6,749.91 | 0.00 | GBP PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 6,471 | 12,886.92 | 0.00 |
| JPY NGK SPARK PLUG | 309 | 4,359.22 | 0.00 | USD PRINCIPAL FINANCIAL | 1,296 | 40,629.53 | 0.01 |
| USD NIELSEN HOLDINGS PLC | 1,488 | 18,660.01 | 0.01 | USD PROCTER & GAMBLE | 12,302 | 1,353,216.41 | 0.43 |
| USD NIKE -B- | 6,772 | 560,341.01 | 0.18 | USD PROGRESSIVE | 2,563 | 189,272.09 | 0.06 |
| JPY NIKON | 630 | 5,826.02 | 0.00 | USD PROLOGIS | 7,383 | 593,402.17 | 0.19 |
| JPY NINTENDO | 228 | 87,814.61 | 0.03 | GBP PRUDENTIAL | 7,923 | 101,734.76 | 0.03 |
| JPY NIPPON ACCOMMODATIONS FUND | 2 | 13,233.19 | 0.00 | USD PRUDENTIAL FINANCIAL | 1,769 | 92,251.66 | 0.03 |
| JPY NIPPON BUILDING FUND | 7 | 45,935.49 | 0.01 | USD PS BUSINESS PARKS | 112 | 15,218.96 | 0.00 |
| JPY NIPPON EXPRESS | 156 | 7,647.68 | 0.00 | CHF PSP SWISS PROPERTY (reg. shares) | 212 | 26,396.79 | 0.01 |
| JPY NIPPON PROLOGIS REIT | 15 | 38,509.82 | 0.01 | USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 2,188 | 98,251.19 | 0.03 |
| JPY NIPPON REIT INVESTMENT | 2 | 6,987.46 | 0.00 | USD PUBLIC STORAGE | 838 | 166,336.46 | 0.05 |
| JPY NIPPON YUSEN | 303 | 3,605.74 | 0.00 | EUR PUMA | 877 | 52,353.92 | 0.02 |
| USD NISOURCE | 1,572 | 39,256.98 | 0.01 | USD PVH | 314 | 11,836.09 | 0.00 |
| JPY NISSIN FOOD HOLDINGS | 125 | 10,424.70 | 0.00 | EUR QIAGEN (reg. shares) | 472 | 18,978.32 | 0.01 |
| JPY NITORI HOLDINGS | 159 | 21,489.33 | 0.01 | USD QTS REALTY TRUST -A- | 322 | 18,658.18 | 0.01 |
| JPY NITTO DENKO | 310 | 13,875.80 | 0.00 | USD QUEST DIAGNOSTICS | 603 | 48,385.48 | 0.01 |
| GBP NMC HEALTH | 380 | 4,422.14 | 0.00 | JPY RAKUTEN | 1,689 | 12,831.55 | 0.00 |
| EUR NN GROUP | 646 | 17,434.83 | 0.01 | AUD RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 284 | 9,966.78 | 0.00 |
| USD NOBLE ENERGY | 2,008 | 12,125.75 | 0.00 | EUR RANDSTAD HOLDING | 825 | 29,104.77 | 0.01 |
| EUR NOKIAN TYRES | 260 | 6,305.47 | 0.00 | USD RAYMOND JAMES FINANCIAL | 536 | 33,893.78 | 0.01 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS | 863 | 14,035.76 | 0.00 | GBP RDI REIT PLC | 1,370 | 1,105.72 | 0.00 |
| JPY NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND | 24 | 30,746.63 | 0.01 | USD REALTY INCOME | 1,842 | 91,825.44 | 0.03 |
| JPY NOMURA RESEARCH INSTITUTE | 665 | 14,104.31 | 0.00 | GBP RECKITT BENCKISER GROUP | 2,167 | 165,282.53 | 0.05 |
| USD NORDSTROM | 419 | 6,427.15 | 0.00 | EUR RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA | 1,146 | 48,477.91 | 0.02 |
| USD NORFOLK SOUTHERN | 1,151 | 168,011.05 | 0.05 | JPY RECRUIT HOLDINGS | 2,730 | 70,694.63 | 0.02 |
| CAD NORTHERN APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 268 | 6,167.74 | 0.00 | EUR RED ELECTRICA CORPORACION | 904 | 16,224.45 | 0.01 |
| USD NORTHERN TRUST | 866 | 65,370.66 | 0.02 | USD REGENCY CENTERS | 941 | 36,180.71 | 0.01 |
| CAD NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 578 | 3,919.74 | 0.00 | GBP REGIONAL REIT | 2,006 | 2,039.22 | 0.00 |
| USD NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 905 | 9,918.76 | 0.00 | USD REGIONS FINANCIAL | 4,269 | 38,295.55 | 0.01 |
| | | | | USD REINSURANCE GROUP AMERICA | 264 | 22,172.25 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|--|-----------|-------------|------------------|--|-----------|-------------|------------------|
| GBP RELX | 5,928 | 127,302.40 | 0.04 | JPY SOHO SECURITY SERVICES | 140 | 6,844.65 | 0.00 |
| GBP RENTOKIL INITIAL | 5,611 | 26,981.53 | 0.01 | EUR SOLVAY | 155 | 11,253.43 | 0.00 |
| EUR REPSOL | 6,731 | 61,532.48 | 0.02 | JPY SOMPO HOLDINGS | 662 | 20,492.41 | 0.01 |
| USD RESMED | 617 | 90,910.80 | 0.03 | CHF SONOVA HOLDING (reg. shares) | 57 | 10,270.87 | 0.00 |
| JPY RESONA HOLDINGS | 4,111 | 12,384.87 | 0.00 | JPY SONY | 2,561 | 152,352.09 | 0.05 |
| EUR RETAIL ESTATES | 55 | 2,861.30 | 0.00 | USD SOUTHERN | 4,579 | 247,889.49 | 0.09 |
| USD RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT | 670 | 5,553.54 | 0.00 | USD SOUTHWEST AIRLINES | 604 | 21,492.46 | 0.01 |
| USD RETAIL PROPERTIES OF AMERICA -A- | 1,220 | 6,307.61 | 0.00 | USD S&P GLOBAL | 1,071 | 262,540.44 | 0.09 |
| USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY | 637 | 26,118.80 | 0.01 | GBP SPIRAX-SARCO ENGINEERING | 223 | 22,613.21 | 0.01 |
| JPY R-INVESCO OFFICE REIT | 47 | 6,232.21 | 0.00 | USD SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 557 | 14,567.20 | 0.00 |
| CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,785 | 20,226.53 | 0.01 | GBP SSE | 3,157 | 51,090.26 | 0.02 |
| USD RLJ LODGING TRUST | 981 | 7,570.57 | 0.00 | EUR ST GOBAIN | 1,026 | 24,960.36 | 0.01 |
| USD ROBERT HALF INTERNATIONAL | 492 | 18,567.72 | 0.01 | CHF STADLER RAIL AG | 32 | 1,491.89 | 0.00 |
| CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares) | 743 | 241,135.84 | 0.07 | USD STAG INDUSTRIAL | 839 | 18,897.40 | 0.01 |
| USD ROCKWELL AUTOMATION | 500 | 75,491.16 | 0.02 | GBP STANDARD CHARTERED | 8,272 | 45,723.48 | 0.01 |
| USD ROPER TECHNOLOGIES | 460 | 143,534.34 | 0.04 | GBP STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 7,280 | 20,211.83 | 0.01 |
| USD ROSS STORES | 1,568 | 136,395.65 | 0.04 | GBP STANDARD LIFE INVESTMENTS PROPERTY | 2,217 | 2,325.34 | 0.00 |
| USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 748 | 24,055.71 | 0.01 | USD INCOME FUND | | | |
| EUR ROYAL DUTCH SHELL -A- | 1,084 | 19,390.22 | 0.01 | USD STANLEY BLACK & DECKER | 659 | 65,879.03 | 0.02 |
| EUR ROYAL PHILIPS | 1,888 | 76,460.86 | 0.02 | JPY STANLEY ELECTRIC | 260 | 5,140.12 | 0.00 |
| USD RPT REALTY | 447 | 2,697.89 | 0.00 | USD STARBUCKS | 5,433 | 357,140.38 | 0.12 |
| GBP RSA INSURANCE GROUP | 3,130 | 16,314.72 | 0.01 | USD STATE STREET | 1,639 | 87,326.20 | 0.03 |
| EUR RWE -A- | 1,216 | 31,974.75 | 0.01 | USD STERIS PLC | 381 | 53,335.70 | 0.02 |
| NZD RYMAN HEALTHCARE | 704 | 4,301.15 | 0.00 | EUR STMICROELECTRONICS | 1,989 | 43,382.54 | 0.01 |
| USD RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 272 | 9,768.98 | 0.00 | AUD STOCKLAND TRUST | 17,084 | 26,453.82 | 0.01 |
| USD SABRA HEALTH CARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,126 | 12,298.93 | 0.00 | EUR STORA ENSO -R- | 4,301 | 43,638.84 | 0.01 |
| | | | | USD STORE CAPITAL | 1,211 | 21,936.39 | 0.01 |
| GBP SAFESTORE HOLDINGS | 1,104 | 8,765.96 | 0.00 | CHF STRAUMANN HOLDING (reg. shares) | 8 | 6,149.35 | 0.00 |
| EUR SAFRAN | 501 | 44,034.47 | 0.01 | JPY SUMITOMO CHEMICAL | 2,935 | 8,728.43 | 0.00 |
| USD SALESFORCE.COM | 3,815 | 549,331.08 | 0.18 | JPY SUMITOMO METAL MINING | 458 | 9,416.83 | 0.00 |
| SEK SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORD -B- | 5,020 | 9,626.48 | 0.00 | JPY SUMITOMO REALTY & DEVELOPMENT | 2,136 | 52,140.99 | 0.02 |
| EUR SANOFI | 1,155 | 101,544.12 | 0.03 | JPY SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES | 336 | 3,171.27 | 0.00 |
| JPY SANTEN PHARMACEUTICAL | 707 | 12,161.02 | 0.00 | USD SUMMIT HOTEL PROPERTIES | 583 | 2,460.90 | 0.00 |
| EUR SAP SE | 2,396 | 270,249.87 | 0.09 | CAD SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 597 | 3,720.03 | 0.00 |
| EUR SARTORIUS (pref. shares) | 74 | 18,070.86 | 0.01 | USD SUN COMMUNITIES | 511 | 63,803.00 | 0.02 |
| USD SAUL CENTERS | 67 | 2,177.47 | 0.00 | HKD SUN HUNG KAI PROPERTIES | 10,546 | 139,054.81 | 0.04 |
| USD SBA COMMUNICATIONS -A- (reg. shares) | 497 | 134,216.23 | 0.04 | USD SUNSTONE HOTEL INVESTORS | 1,257 | 10,948.76 | 0.00 |
| AUD SCENTRE GROUP | 28,354 | 27,159.44 | 0.01 | SGD SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,080 | 9,727.53 | 0.00 |
| CHF SCHINDLER HOLDING | 16 | 3,368.53 | 0.00 | JPY SUNTORY BEVERAGE & FOOD | 272 | 10,303.57 | 0.00 |
| CHF SCHINDLER HOLDING (part. cert.) | 33 | 7,137.54 | 0.00 | USD SVB FINANCIAL GROUP | 236 | 35,597.61 | 0.01 |
| USD SCHLUMBERGER | 6,088 | 82,131.51 | 0.03 | HKD SWIRE PACIFIC -A- | 866 | 5,581.55 | 0.00 |
| EUR SCHNEIDER ELECTRIC | 1,153 | 99,379.55 | 0.03 | HKD SWIRE PROPERTIES | 7,743 | 21,776.69 | 0.01 |
| GBP SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LIMITED | 2,804 | 1,350.90 | 0.00 | CHF SWISS LIFE HOLDING (reg. shares) | 38 | 12,872.87 | 0.00 |
| | | | | CHF SWISS PRIME SITE | 488 | 47,759.02 | 0.01 |
| GBP SCHRODERS | 377 | 11,617.08 | 0.00 | CHF SWISS REINSURANCE | 324 | 24,929.18 | 0.01 |
| CHF SCHWEITER TECHNOLOGIES | 1 | 1,139.63 | 0.00 | CHF SWISSCOM (reg. shares) | 28 | 15,228.88 | 0.00 |
| JPY SECOM | 416 | 34,565.70 | 0.01 | AUD SYDNEY AIRPORT (stapled security) | 1,946 | 6,656.70 | 0.00 |
| AUD SEEK | 588 | 5,334.30 | 0.00 | EUR SYMRISE | 268 | 25,030.39 | 0.01 |
| JPY SEGA SAMMY HOLDINGS | 342 | 4,165.36 | 0.00 | JPY SYSMEX | 332 | 24,135.53 | 0.01 |
| GBP SEGRO PLC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,199 | 87,145.24 | 0.03 | USD T ROWE PRICE GROUP | 1,034 | 100,969.87 | 0.03 |
| JPY SEKISUI CHEMICAL | 714 | 9,471.28 | 0.00 | EUR TAG IMMOBILIEN | 681 | 13,482.29 | 0.00 |
| JPY SEKISUI HOUSE | 1,220 | 20,173.51 | 0.01 | JPY TAISEI | 399 | 12,214.18 | 0.00 |
| JPY SEKISUI HOUSE REIT | 22 | 13,851.04 | 0.00 | JPY TAKEDA PHARMACEUTICAL | 3,014 | 92,349.04 | 0.03 |
| USD SEMPRA ENERGY | 1,247 | 140,875.38 | 0.04 | USD TANGER FACTORY OUTLET CENTERS | 518 | 2,591.01 | 0.00 |
| USD SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING P | 674 | 19,502.18 | 0.01 | USD TAPESTRY INC | 1,328 | 17,195.46 | 0.01 |
| USD SERITAGE GROWTH PROPERTIES -A- | 184 | 1,677.90 | 0.00 | USD TARGA RESOURCES | 980 | 6,770.08 | 0.00 |
| USD SERVICE PROPERTIES TRUST | 921 | 4,971.23 | 0.00 | GBP TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 2,427 | 3,219.60 | 0.00 |
| EUR SES | 759 | 4,456.46 | 0.00 | USD TAUBMAN CENTERS | 336 | 14,073.55 | 0.00 |
| JPY SEVEN & I HOLDINGS | 1,515 | 50,198.82 | 0.02 | GBP TAYLOR WIMPEY | 9,951 | 14,498.79 | 0.00 |
| CHF SFS GROUP (reg. shares) | 5 | 349.53 | 0.00 | USD TD AMERITRADE HOLDING | 1,164 | 40,332.48 | 0.01 |
| GBP SHAFTESBURY | 1,201 | 9,195.58 | 0.00 | JPY T&D HOLDINGS | 1,096 | 8,972.56 | 0.00 |
| JPY SHARP | 419 | 4,402.10 | 0.00 | USD TE CONNECTIVITY (reg. shares) | 1,495 | 94,181.96 | 0.03 |
| USD SHERWIN-WILLIAMS | 358 | 164,663.40 | 0.05 | USD TECHNIPFMC (reg. shares) | 2,256 | 15,202.36 | 0.00 |
| JPY SHIMADZU | 439 | 11,558.67 | 0.00 | HKD TECHTRONIC INDUSTRIES | 2,410 | 15,641.24 | 0.00 |
| JPY SHIMIZU | 1,165 | 9,118.28 | 0.00 | JPY TEIJIN | 349 | 5,910.57 | 0.00 |
| JPY SHIN-ETSU CHEMICAL | 714 | 70,955.49 | 0.02 | SEK TELEFON LM ERICSSON -B- | 5,627 | 46,034.19 | 0.01 |
| JPY SHISEIDO | 794 | 46,920.13 | 0.01 | EUR TELEFONICA | 9,742 | 44,610.41 | 0.01 |
| AUD SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GROUP | 5,084 | 7,063.07 | 0.00 | EUR TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) | 1,781 | 4,414.92 | 0.00 |
| JPY SHOWA DENKO | 266 | 5,519.45 | 0.00 | EUR TELEPERFORMANCE | 122 | 25,475.12 | 0.01 |
| EUR SIEMENS (reg. shares) | 2,138 | 181,768.08 | 0.06 | AUD TELSTRA | 7,315 | 13,744.37 | 0.00 |
| USD SIGNATURE BANK | 250 | 20,084.97 | 0.01 | CHF TEMENOS GROUP | 52 | 6,853.30 | 0.00 |
| CHF SIKA NOM. | 131 | 21,641.00 | 0.01 | EUR TENARIS | 983 | 6,021.10 | 0.00 |
| USD SIMON PROPERTY GROUP | 1,739 | 95,385.65 | 0.03 | USD TERRENO REALTY GROUP | 374 | 19,365.11 | 0.01 |
| SGD SINGAPORE AIRLINES | 947 | 3,819.68 | 0.00 | GBP TESCO | 29,803 | 84,551.44 | 0.03 |
| SGD SINGAPORE EXCHANGE | 1,415 | 9,131.71 | 0.00 | USD TESLA MOTORS | 593 | 310,656.63 | 0.11 |
| SGD SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 2,843 | 3,653.85 | 0.00 | USD TEXAS INSTRUMENTS | 4,109 | 410,566.02 | 0.14 |
| SGD SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 14,353 | 25,604.77 | 0.01 | HKD THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,222 | 95,118.92 | 0.03 |
| HKD SINO LAND | 17,849 | 22,659.95 | 0.01 | CHF THE SWATCH GROUP | 27 | 5,405.97 | 0.00 |
| GBP SIRIUS REAL ESTATE LTD | 5,030 | 4,110.15 | 0.00 | CHF THE SWATCH GROUP (reg. shares) | 42 | 1,640.32 | 0.00 |
| USD SITE CENTERS CORP | 866 | 4,509.86 | 0.00 | USD TIFFANY & CO | 482 | 62,425.10 | 0.02 |
| USD SL GREEN REALTY | 450 | 19,397.52 | 0.01 | USD TJX COS | 5,314 | 254,066.88 | 0.09 |
| CAD SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 726 | 9,604.34 | 0.00 | EUR TLG IMMOBILIEN | 71 | 1,130.54 | 0.00 |
| GBP SMITH & NEPHEW | 2,654 | 47,200.78 | 0.01 | JPY TOBU RAILWAY | 378 | 13,199.37 | 0.00 |
| EUR SNAM | 3,992 | 18,415.65 | 0.01 | JPY TOHO | 224 | 6,844.04 | 0.00 |
| USD SNAP-ON | 237 | 25,736.25 | 0.01 | JPY TOKYO ELECTRON | 313 | 59,041.97 | 0.02 |
| CHF SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares) | 8 | 18,716.52 | 0.01 | JPY TOKYO GAS | 742 | 17,561.10 | 0.01 |
| CHF SOFTWAREONE HOLDING AG | 94 | 1,854.56 | 0.00 | JPY TOKYO TATEMONO | 1,075 | 11,418.51 | 0.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE (reg. -S-) 6.95%/12-10.07.2042 | 61,969 | 65,210.14 | 0.02 | CHF MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625%/15- 30.12.2021 | 399 | 412.38 | 0.00 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 6.375%/18- 24.10.2048 | 25,820 | 25,637.93 | 0.01 | USD MONGOLIA (reg. -S-) T. 2 5.125%/12- 05.12.2022 | 30,985 | 27,885.19 | 0.01 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 4.75%/17-19.04.2027 | 77,461 | 74,888.18 | 0.02 | USD MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/19- 23.01.2030 | 221,738 | 245,718.45 | 0.08 |
| USD KAZMUNAYGAS NATIONAL COMPANY (reg. -S-) 5.75%/17-29.04.2047 | 51,641 | 51,645.09 | 0.02 | EUR MORGAN STANLEY 1.75%/15-30.01.2025 | 120,180 | 130,617.45 | 0.04 |
| USD KENYA (reg. -S-) 6.875%/14-24.06.2024 | 77,461 | 73,362.19 | 0.02 | USD MORGAN STANLEY 2.75%/17-19.05.2022 | 487,823 | 492,891.05 | 0.15 |
| EUR KFW 0.625%/17-22.02.2027 | 20,030 | 23,123.85 | 0.01 | USD MORGAN STANLEY 3.125%/18-23.01.2023 | 443,475 | 453,306.91 | 0.14 |
| USD KFW 1.5%/16-15.06.2021 | 143,686 | 145,453.26 | 0.05 | USD MOROCCO (reg. -S-) 4.25%/12-11.12.2022 | 51,641 | 51,265.02 | 0.02 |
| USD KFW 1.75%/19-14.09.2029 | 3,750,000 | 3,993,149.99 | 1.25 | USD MOROCCO (reg. -S-) 5.5%/12-11.12.2042 | 51,641 | 54,698.11 | 0.02 |
| USD KFW 2%/17-29.09.2022 | 2,000,000 | 2,071,600.00 | 0.65 | USD MPLX 4.125%/17-01.03.2027 | 221,738 | 190,215.33 | 0.06 |
| CHF KFW 2.5%/05-25.08.2025 | 2,792 | 3,307.87 | 0.00 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.25%/19- 26.02.2029 | 1,914 | 2,016.00 | 0.00 |
| USD KINDER MORGAN 4.3%/14-01.06.2025 | 221,738 | 226,032.59 | 0.07 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.3%/17- 20.12.2024 | 1,914 | 1,863.67 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA (reg. -S-) 6.125%/ 13-01.08.2023 | 103,282 | 98,067.22 | 0.03 | CHF MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.5%/18- 14.06.2028 | 2,393 | 2,575.65 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 7%/16-12.10.2028 | 206,564 | 189,074.09 | 0.06 | CHF MUNICIPALITY FINANCE 1.375%/12- 08.06.2027 | 1,994 | 2,261.78 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF JORDAN (reg. -S-) 5.75%/16- 31.01.2027 | 61,969 | 54,575.00 | 0.02 | CHF NA DEVELOPMENT BANK 0.3%/18-24.07.2026 | 877 | 919.01 | 0.00 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 4.5%/16- 26.10.2046 | 103,282 | 105,418.83 | 0.03 | USD NAMIBIA (reg. -S-) 5.5%/11-03.11.2021 | 61,969 | 59,476.76 | 0.02 |
| USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA (reg. -S-) 3.25%/16-26.10.2026 | 51,641 | 51,809.31 | 0.02 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.125%/19- 21.06.2027 | 5,982 | 5,842.50 | 0.00 |
| USD KOC HOLDING AS 6.5%/19-11.03.2025 | 17,630 | 16,298.36 | 0.01 | USD NATIONAL AUSTRALIA BANK NEW YORK BRANCH T. -17- 2.5%/16-12.07.2026 | 76,278 | 76,829.20 | 0.02 |
| USD KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/ 15-11.02.2025 | 1,500,000 | 1,598,220.00 | 0.49 | CHF NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.3%/17- 31.10.2025 | 2,393 | 2,324.64 | 0.00 |
| AUD KOMMUNALBANKEN A/S 4.5%/13-17.04.2023 | 12,000 | 8,145.14 | 0.00 | EUR NATIONAL AUSTRALIA BANK 1.875%/12- 13.01.2023 | 53,280 | 61,647.42 | 0.02 |
| CHF KOMMUNEKREDIT 0.625%/15-09.07.2027 | 1,595 | 1,724.52 | 0.00 | USD NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.7%/18- 04.11.2021 | 139,916 | 143,473.06 | 0.04 |
| USD KOREA EAST-WEST POWER CO 3.875%/18- 19.07.2023 | 16,027 | 17,123.28 | 0.01 | CHF NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0%/19- 11.07.2025 | 2,209 | 2,291.41 | 0.00 |
| USD KOREA GAS CORPORATION (reg. -S-) T. -11- 2.25%/16-18.07.2026 | 24,040 | 24,237.93 | 0.01 | EUR NETHERLANDS (reg. -S-) 1.75%/13- 15.07.2023 | 153,830 | 182,283.57 | 0.06 |
| CHF KOREA GAS CORPORATION 0%/19-28.11.2023 | 837 | 846.95 | 0.00 | EUR NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026 | 40,060 | 46,623.53 | 0.01 |
| CHF KOREA NATIONAL OIL CORP 0.373%/18- 01.06.2023 | 558 | 570.69 | 0.00 | EUR NETHERLANDS 2%/14-15.07.2024 | 60,090 | 73,365.17 | 0.02 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) T. 7 3.25%/14-10.07.2024 | 54,491 | 57,550.53 | 0.02 | CHF NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.25%/19- 18.10.2027 | 1,994 | 1,947.50 | 0.00 |
| USD KOREA NATIONAL OIL (reg. -S-) 2.625%/16-14.04.2026 | 332,606 | 344,327.35 | 0.11 | USD NEXTERA ENERGY CAPITAL 3.55%/17- 01.05.2027 | 243,911 | 250,282.25 | 0.08 |
| USD KOREA RESOURCES CORP 4%/18-18.04.2023 | 40,067 | 42,153.09 | 0.01 | USD NISOURCE INC 3.49%/17-15.05.2027 | 243,911 | 247,255.31 | 0.08 |
| CHF KOREA WESTERN POWER CO LTD 0.125%/19- 27.02.2024 | 1,324 | 1,345.82 | 0.00 | CHF NORDEA BANK 0.25%/15-27.11.2023 | 3,988 | 4,051.63 | 0.00 |
| USD KOREA WESTERN POWER CO 3.75%/18- 07.06.2023 | 40,067 | 42,795.37 | 0.01 | CHF NORDEA BANK 0.55%/15-23.06.2025 | 1,515 | 1,498.90 | 0.00 |
| USD KSA SUKUK LTD S. -1- 2.894%/17- 20.04.2022 | 103,282 | 103,558.72 | 0.03 | CHF NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025 | 3,988 | 4,148.49 | 0.00 |
| EUR LAND NORDRHEIN-WESTFALEN 0.5%/17- 16.02.2027 | 100,150 | 113,812.69 | 0.04 | USD NOVARTIS CAPITAL 3%/15-20.11.2025 | 554,344 | 593,707.79 | 0.18 |
| USD LCPR SR SECURED FIN DAC 6.75%/19- 15.10.2027 | 16,027 | 15,992.74 | 0.00 | USD NOVARTIS CAPITAL 3.4%/14-06.05.2024 | 288,259 | 308,716.52 | 0.10 |
| CHF LGT BANK 1.5%/14-10.05.2021 | 4,786 | 5,020.22 | 0.00 | EUR NOVARTIS FINANCE (reg. -S-) 0.125%/16- 20.09.2023 | 40,060 | 43,284.20 | 0.01 |
| EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC 1.5%/17- 12.09.2027 | 80,120 | 82,969.30 | 0.03 | EUR NWB (reg. -S-) S. -1418- 0.5%/ 15-27.10.2022 | 83,725 | 93,736.32 | 0.03 |
| USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05%/18- 16.08.2023 | 221,738 | 229,103.66 | 0.07 | EUR OBRIGACIOES DO TESOURO -144A- 1.95%/19- 15.06.2029 | 12,018 | 14,579.14 | 0.00 |
| USD LONGFOR HOLDINGS LTD 3.95%/19- 16.09.2029 | 37,663 | 35,368.34 | 0.01 | EUR OBRIGACIOES DO TESOURO -144A- 2.125%/18-17.10.2028 | 28,042 | 34,386.62 | 0.01 |
| USD LOWE'S COS INC 3.65%/19-05.04.2029 | 144,129 | 148,012.24 | 0.05 | CHF OEKB 1%/12-28.09.2021 | 798 | 837.53 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023 | 1,276 | 1,214.75 | 0.00 | CHF OEKB 2.625%/06-22.11.2024 | 1,994 | 2,327.73 | 0.00 |
| CHF MACQUARIE BANK 3%/12-29.11.2022 | 1,595 | 1,666.81 | 0.00 | CHF OEKB 3%/07-14.06.2022 | 1,595 | 1,762.44 | 0.00 |
| USD MAF GLOBAL SECURITIES (subordinated) FIX-TO-FLOATERS 6.375%/18-PERPETUAL | 40,067 | 30,502.75 | 0.01 | USD OIL & NATURAL GAS CORPORATION LTD 3.375%/19-05.12.2029 | 68,114 | 55,481.08 | 0.02 |
| USD MALAYSIA SOVEREIGN SUKUK 3.043%/15- 22.04.2025 | 154,923 | 162,707.76 | 0.05 | USD OIL INDIA LTD 5.125%/19-04.02.2029 | 20,034 | 17,678.05 | 0.01 |
| USD MAR SUKUK LTD 3.025%/19-13.11.2024 | 64,108 | 61,117.53 | 0.02 | USD OMAN (reg. -S-) 5.375%/17-08.03.2027 | 77,461 | 55,681.61 | 0.02 |
| CHF MCDONALD'S 0.17%/16-04.10.2024 | 1,196 | 1,198.79 | 0.00 | USD OMAN (reg. -S-) 6.5%/17-08.03.2047 | 51,641 | 33,685.40 | 0.01 |
| USD MCDONALD'S 3.7%/15-30.01.2026 | 221,738 | 233,321.10 | 0.07 | OMAN SOVEREIGN SUKUK 5.932%/18- 31.10.2025 | 51,641 | 46,120.54 | 0.01 |
| USD MEDTRONIC 3.15%/15-15.03.2022 | 332,606 | 344,756.41 | 0.11 | CHF ONTARIO (PROVINCE OF) 0.25%/17- 28.06.2029 | 1,595 | 1,641.26 | 0.00 |
| USD MENDOZA PROVINCE 8.375%/16-19.05.2024 | 16,027 | 7,154.24 | 0.00 | USD ONTARIO (PROVINCE OF) 3.05%/19- 29.01.2024 | 690,047 | 744,981.87 | 0.23 |
| USD MERCK & CO 2.35%/15-10.02.2022 | 209,985 | 215,623.55 | 0.07 | CHF OP CORPORATE BANK 1%/14-14.07.2021 | 3,988 | 4,107.27 | 0.00 |
| USD MERCK & CO 3.875%/10-15.01.2021 | 268,524 | 271,496.72 | 0.08 | USD ORACLE 1.9%/16-15.09.2021 | 139,695 | 140,171.01 | 0.04 |
| CHF MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19- 11.06.2027 | 2,792 | 2,712.08 | 0.00 | USD ORACLE 2.65%/16-15.07.2026 | 228,390 | 233,352.57 | 0.07 |
| USD METINVEST BV 7.75%/18-23.04.2023 | 16,027 | 11,313.37 | 0.00 | USD PAKISTAN (reg. -S-) 8.25%/14-15.04.2024 | 175,579 | 156,244.49 | 0.05 |
| USD METINVEST B.V. 7.75%/19-17.10.2029 | 25,643 | 17,950.10 | 0.01 | USD PANAMA 7.125%/05-29.01.2026 | 258,205 | 312,017.28 | 0.10 |
| USD METINVEST BV 8.5%/18-23.04.2026 | 80,134 | 56,348.89 | 0.02 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 5%/16-15.04.2026 | 72,297 | 73,854.63 | 0.02 |
| USD METRO (reg. -S-) 5%/17-25.01.2047 | 51,641 | 51,522.19 | 0.02 | USD PARAGUAY (reg. -S-) 6.1%/14-11.08.2044 | 51,641 | 54,337.65 | 0.02 |
| USD MHP LUX SA 6.95%/18-03.04.2026 | 32,054 | 25,720.89 | 0.01 | USD PEPSICO INC 3%/17-15.10.2027 | 388,041 | 412,906.33 | 0.13 |
| EUR MICROSOFT 2.125%/13-06.12.2021 | 83,725 | 94,113.89 | 0.03 | USD PERU 5.625%/10-18.11.2050 | 103,282 | 151,511.49 | 0.05 |
| USD MICROSOFT 3.125%/15-03.11.2025 | 140,360 | 153,562.11 | 0.05 | USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGAS S. -8- 3.375%/19-05.02.2030 | 103,282 | 95,556.44 | 0.03 |
| USD MICROSOFT 3.3%/17-06.02.2027 | 332,606 | 368,867.04 | 0.11 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5.75%/18- 01.02.2029 | 40,067 | 37,799.79 | 0.01 |
| USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR (reg. -S-) 6%/15-15.03.2025 | 32,054 | 29,835.95 | 0.01 | USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 7.375%/17- 17.01.2027 | 48,081 | 49,265.82 | 0.02 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.25%/19- 25.03.2029 | 18,431 | 16,831.11 | 0.01 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA (reg. -S-) 9%/11-17.11.2021 | 103,282 | 7,155.37 | 0.00 |
| USD MILLICOM INTL CELLULAR 6.625%/18- 15.10.2026 | 24,040 | 22,725.55 | 0.01 | USD PETROLEOS DE VENEZUELA 5.5%/07- 12.04.2037 | 309,846 | 21,196.55 | 0.01 |
| USD MINEJESA CAPITAL BV 4.625%/17-10.08.2030 | 60,101 | 54,090.71 | 0.02 | USD PETROLEOS DEL PERU SA 5.625%/17- 19.06.2047 | 180,743 | 163,608.90 | 0.05 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.407%/19- 07.03.2024 | 221,738 | 228,593.66 | 0.07 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.5%/11- 02.06.2041 | 51,641 | 32,942.29 | 0.01 |
| USD MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.455%/18- 02.03.2023 | 135,260 | 138,498.02 | 0.04 | USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.875%/16- 04.02.2026 | 103,282 | 78,203.01 | 0.02 |
| USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.85%/ 16-01.03.2026 | 137,034 | 143,999.22 | 0.04 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.5%/18-13.03. 2027 -C14- | 51,641 | 38,184.36 | 0.01 |
| USD MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018%/18- 05.03.2028 | 443,475 | 476,496.22 | 0.15 | USD PETROLEOS MEXICANOS 6.95%/20- 28.01.2060 | 16,027 | 10,664.44 | 0.00 |
| EUR MOLSON COORS BREWING 1.25%/16- 15.07.2024 | 80,120 | 86,557.86 | 0.03 | USD PETROLEOS VENEZUELA (REG-.S.) 6%/14- 16.05.2024 | 103,282 | 7,243.16 | 0.00 |
| CHF MONDELEZ INTERNATIONAL (reg. -S-) 0.65%/16-26.07.2022 | 4,387 | 4,529.33 | 0.00 | USD PETRONAS CAPITAL (REG.-S-) 3.5%/15- 18.03.2025 | 25,820 | 26,408.67 | 0.01 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表 (続き)

| 銘柄 | 数量/ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) | 銘柄 | 数量/ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率 (%) |
|---|-----------|--------------|------------------|---|----------------|--------------|------------------|
| USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL 2.632%/16-14.07.2026 | 166,303 | 166,358.03 | 0.05 | USD US S. R 2021 2%/14-31.10.2021 | 3,088,161 | 3,170,793.23 | 0.99 |
| USD SUNRISE CAYMAN LTD 5.25%/19-11.03.2024 | 16,027 | 17,208.38 | 0.01 | USD US S. S-2021 3%/14-30.11.2021 | 3,127,830 | 3,213,844.97 | 1.01 |
| USD SUNTRUST BANK 2.8%/19-17.05.2022 | 79,826 | 80,820.94 | 0.03 | USD US S. -V-2021 1.125%/16-28.02.2021 | 3,110,490 | 3,138,678.59 | 0.98 |
| USD SUZANO AUSTRIA GMBH 7%/17-16.03.2047 | 28,047 | 26,819.98 | 0.01 | USD US TREASURY N/B S. -AF-2023-2.875%/18-30.11.2023 | 687 | 750.65 | 0.00 |
| USD SYSCO 3.3%/16-15.07.2026 | 277,172 | 273,449.50 | 0.08 | USD US TREASURY N/B S. -AH-2022-2.5%/19-15.01.2022 | 2,217,375 | 2,305,464.04 | 0.72 |
| USD TAJIKISTAN INT BOND 7.125%/17-14.09.2027 | 103,282 | 63,185.82 | 0.02 | USD US TREASURY N/B S. -AV-2021-2.5%/19-31.01.2021 | 1,330,425 | 1,356,098.26 | 0.42 |
| USD TARGET 3.5%/14-01.07.2024 | 443,475 | 473,684.59 | 0.15 | USD US TREASURY N/B S. -B-2029-2.625%/19-15.02.2029 | 443,475 | 518,103.61 | 0.16 |
| USD TC ZIRAAT BANKASTI AS 5.125%/17-29.09.2023 | 77,461 | 68,623.87 | 0.02 | USD US TREASURY N/B S. -C-2029-2.375%/19-15.05.2029 | 886,950 | 1,020,131.25 | 0.32 |
| USD TELFON CELUAR DEL PARAGUAY 5.875%/19-15.04.2027 | 16,027 | 14,476.76 | 0.00 | USD US TREASURY N/B S. -E-2029-1.625%/19-15.08.2029 | 221,738 | 240,758.46 | 0.07 |
| USD TENCENT HOLDINGS LTD 3.975%/19-11.04.2029 | 52,087 | 57,712.26 | 0.02 | USD US TREASURY N/B S. -F-2028-3.125%/18-15.11.2028 | 975,645 | 1,177,786.63 | 0.36 |
| USD TERMOCANDELARIA POWER 7.875%/19-30.01.2029 | 32,054 | 26,025.08 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 1.625%/19-30.06.2021 | 1,330,425 | 1,353,915.53 | 0.42 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III B.V. 7.125%/19-31.01.2025 | 32,054 | 31,719.11 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2%/17-31.05.2024 | 953,471 | 1,018,277.66 | 0.32 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 3.15%/16-01.10.2026 | 40,067 | 34,174.11 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2.25%/17-15.08.2027 | 1,995,638 | 2,238,544.35 | 0.70 |
| USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 4.1%/16-01.10.2046 | 64,108 | 47,426.09 | 0.01 | USD US TREASURY N/B 2.25%/17-15.11.2027 | 1,995,638 | 2,241,974.36 | 0.70 |
| CHF THE EXPORT IMPORT BANK OF KOREA 0%/19-27.05.2025 | 2,393 | 2,298.67 | 0.00 | USD US TREASURY N/B 2.375%/17-15.05.2027 | 1,119,775 | 1,261,496.02 | 0.39 |
| USD THREE GORGES FIN I KY 2.3%/19-16.10.2024 | 103,282 | 104,507.88 | 0.03 | USD US TREASURY N/B 2.875%/18-15.08.2028 | 1,916,921 | 2,265,860.51 | 0.71 |
| USD TIME WARNER 3.8%/16-15.02.2027 | 243,911 | 267,868.25 | 0.08 | USD US TREASURY S. -B-2027-2.25%/17-15.02.2027 | 665,213 | 741,815.99 | 0.23 |
| USD TNB GLOBAL VENTURES CAP S. -1-3.244%/16-19.10.2026 | 24,040 | 25,024.77 | 0.01 | USD US TREASURY S. E-2021 2.125%/11-15.08.2021 | 2,452,218 | 2,513,714.59 | 0.79 |
| USD TORONTO-DOMINION BANK 3.5%/18-19.07.2023 | 221,738 | 233,813.36 | 0.07 | USD US TREASURY S. E-2021 2.375%/14-15.08.2024 | 1,451,317 | 1,577,399.63 | 0.49 |
| CHF TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 1%/14-29.08.2024 | 3,589 | 3,796.70 | 0.00 | USD US TREASURY S. F-2026 2%/16-15.11.2026 | 498,909 | 546,227.90 | 0.17 |
| USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 2.75%/14-19.06.2021 | 443,475 | 446,712.44 | 0.14 | USD US TREASURY S. F-2023 2.75%/13-15.11.2023 | 2,252,033 | 2,445,215.11 | 0.77 |
| EUR TOYOTA MOTOR CREDIT (reg. -S-) 0.75%/15-21.07.2022 | 80,120 | 86,978.08 | 0.03 | USD US 1.625%/16-15.05.2026 | 1,251,132 | 1,334,214.84 | 0.41 |
| USD TOYOTA MOTOR CREDIT S. -B-1.9%/16-08.04.2021 | 221,738 | 222,855.09 | 0.07 | USD UZBEK INDUSTRIAL AND CON 5.75%/19-02.12.2024 | 16,027 | 14,675.17 | 0.00 |
| USD TRADE AND DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA (reg. -S-) S. 1 9.375%/15-19.05.2020 | 51,641 | 51,262.43 | 0.02 | USD VALE 5.625%/12-11.09.2042 | 16,027 | 16,083.61 | 0.00 |
| CHF TRANSPower NEW ZEALAND LIMITED 0.02%/19-16.12.2027 | 949 | 907.88 | 0.00 | USD VALERO ENERGY 3.4%/16-15.09.2026 | 243,911 | 218,949.41 | 0.07 |
| CHF TRANSURBAN FINANCE 0.625%/16-23.06.2023 | 3,908 | 4,008.97 | 0.00 | USD VEB FINANCE (reg. -S-) 6.8%/10-22.11.2025 | 103,282 | 108,988.25 | 0.03 |
| AUD TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026 | 1,234,000 | 959,152.45 | 0.30 | USD VEDANTA RESOURCES (reg. -S-) 6.375%/17-30.07.2022 | 24,040 | 9,318.75 | 0.00 |
| AUD TREASURY CORP VICTORIA 2.5%/19-22.10.2029 | 65,000 | 43,406.21 | 0.01 | USD VEDANTA RESOURCES 9.25%/19-23.04.2026 | 64,108 | 25,011.54 | 0.01 |
| USD TRUST F/1401 4.869%/19-15.01.2030 | 20,034 | 17,260.75 | 0.01 | USD VENEZUELA 9.25%/97-15.09.2027 | 206,564 | 19,439.72 | 0.01 |
| USD TRUST F/1401 6.39%/19-15.01.2050 | 16,027 | 14,601.77 | 0.00 | EUR VERIZON COMMUNICATIONS 0.5%/16-02.06.2022 | 40,060 | 43,604.20 | 0.01 |
| USD TURKEY 4.875%/16-09.10.2026 | 154,923 | 130,945.47 | 0.04 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 2.625%/16-15.08.2026 | 266,085 | 275,517.76 | 0.09 |
| USD TURKEY 6%/11-14.01.2041 | 103,282 | 80,857.35 | 0.03 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 3.376%/17-15.02.2025 | 221,738 | 237,791.33 | 0.07 |
| USD TURKEY 6.875%/06-17.03.2036 | 103,282 | 91,638.95 | 0.03 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 4.329%/18-21.09.2028 | 240,585 | 275,176.57 | 0.09 |
| USD TURKIYE HALK BANKASTI (reg. -S-) 4.75%/15-11.02.2021 | 16,027 | 15,234.99 | 0.00 | USD VERIZON COMMUNICATIONS 5.15%/13-15.09.2023 | 221,738 | 247,181.92 | 0.08 |
| USD TYSON FOODS 3.95%/14-15.08.2024 | 221,738 | 237,432.12 | 0.07 | USD VFU FUNDING (VF UKRAINE) 6.2%/20-11.02.2025 | 20,034 | 16,133.05 | 0.00 |
| EUR UBS GROUP FUNDING (Jersey) LIMITED (reg. -S-) 1.25%/16-01.09.2026 | 80,120 | 83,365.79 | 0.03 | USD VISA 3.15%/15-14.12.2025 | 443,475 | 483,095.13 | 0.15 |
| CHF UBS GROUP FUNDING T. 1 0.75%/16-22.02.2022 | 1,436 | 1,457.84 | 0.00 | USD VMDWARE INC 3.9%/17-21.08.2027 | 243,911 | 241,162.41 | 0.07 |
| USD UKRAINE GOVERNMENT 7.375%/17-25.09.2032 | 87,790 | 79,639.25 | 0.02 | USD VODAFONE GROUP PLC 3.75%/18-16.01.2024 | 81,156 | 84,502.00 | 0.03 |
| USD UKRAINE GOVERNMENT 9.75%/18-01.11.2028 | 51,641 | 50,360.27 | 0.02 | CHF VORARBERGER LANDES UND | 1,196 | 1,219.20 | 0.00 |
| USD UKRAINE RAIL (RAIL CAPL) 8.25%/19-09.07.2024 | 103,282 | 83,658.36 | 0.03 | USD HYPOTHEKENBANK 0.125%/16-06.10.2021 | 32,054 | 31,887.39 | 0.01 |
| USD UNIFIN FINANCIERA SA DE 8.375%/19-27.01.2028 | 40,067 | 24,586.43 | 0.01 | USD VTB CAPITAL (reg. -S-) (subordinated) 6.95%/12-17.10.2022 | 60,090 | 65,206.53 | 0.02 |
| USD UNILEVER CAPITAL CORP 3.5%/18-22.03.2028 | 665,213 | 718,669.09 | 0.22 | EUR VW INTL FINANCE 0.5%/17-30.03.2021 | 243,911 | 241,794.14 | 0.07 |
| USD UNION LIFE INSURANCE 3%/16-19.09.2021 | 24,040 | 16,303.42 | 0.01 | USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.45%/16-01.06.2026 | 44,348 | 45,663.74 | 0.01 |
| USD UNION NATIONAL BANK PJSC 4%/18-13.03.2023 | 40,067 | 39,524.28 | 0.01 | USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.8%/14-18.11.2024 | 77,830 | 76,809.53 | 0.02 |
| USD UNITED MEXICAN STATES 4.15%/17-28.03.2027 | 394,693 | 401,603.88 | 0.12 | USD WALT DISNEY S. -F- 1.85%/16-30.07.2026 | 110,869 | 118,751.54 | 0.04 |
| USD UNITED MEXICAN STATES 4.5%/19-22.04.2029 | 221,738 | 227,451.71 | 0.07 | USD WASTE MANAGEMENT INC 3.45%/19-15.06.2029 | 665,213 | 671,678.47 | 0.21 |
| USD UNITED PARCEL SERVICE 2.5%/17-01.04.2023 | 443,475 | 452,570.74 | 0.14 | USD WELLS FARGO & COMPANY 2.625%/17-22.07.2022 | 332,606 | 340,236.29 | 0.11 |
| USD UNITED STATES OF AMERICA TREASURY NOTES S. B-2023 2%/13-15.02.2023 | 1,751,571 | 1,835,318.31 | 0.57 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.25%/19-29.01.2027 | 2,792 | 2,924.14 | 0.00 |
| USD UNITED STATES S. B-2024 2.75%/14-15.02.2024 | 2,598,875 | 2,836,631.22 | 0.89 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.3%/17-28.11.2025 | 2,393 | 2,372.86 | 0.00 |
| USD UNITED STATES S. -B-2025 2%/15-15.02.2025 | 2,101,894 | 2,262,656.53 | 0.71 | EUR WESTPAC BANKING CORP 0.375%/17-05.03.2023 | 60,090 | 64,372.46 | 0.02 |
| USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.65%/18-16.08.2023 | 208,212 | 219,646.52 | 0.07 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.4%/18-06.06.2024 | 957 | 959.53 | 0.00 |
| USD UNITEDHEALTH GROUP 3.75%/15-15.07.2025 | 443,475 | 479,729.16 | 0.15 | CHF WESTPAC BANKING CORP 0.5%/18-16.05.2028 | 1,515 | 1,484.02 | 0.00 |
| USD URUGUAY 4.375%/15-27.10.2027 | 273,378 | 295,533.09 | 0.09 | CHF WESTPAC BANKING 0.375%/16-05.02.2024 | 1,595 | 1,604.99 | 0.00 |
| USD URUGUAY 5.1%/14-18.06.2050 | 61,969 | 70,715.48 | 0.02 | CHF WESTPAC BANKING 0.40%/15-09.06.2023 | 1,117 | 1,122.91 | 0.00 |
| USD URUGUAY 7.625%/06-21.03.2036 | 77,461 | 107,294.95 | 0.03 | USD WESTPAC BANKING 2%/16-19.08.2021 | 166,303 | 165,845.82 | 0.05 |
| USD URUGUAY 7.875%/03-15.01.2033 | 51,641 | 71,100.83 | 0.02 | USD YASAR HOLDING 8.875%/14-06.05.2020 | 16,027 | 15,005.48 | 0.00 |
| USD US BANCORP 3.375%/19-05.02.2024 | 221,738 | 231,088.21 | 0.07 | USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 6.95%/17-21.07.2027 | 64,108 | 32,682.01 | 0.01 |
| USD US S. AJ-2021 2.25%/14-31.03.2021 | 2,088,768 | 2,131,848.41 | 0.67 | USD YPF SOCIEDAD ANONIMA 7%/17-15.12.2047 | 24,040 | 12,186.76 | 0.00 |
| USD US S. B-2021 3.625%/11-15.02.2021 | 1,378,165 | 1,419,725.60 | 0.44 | USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5%/19-26.02.2024 | 30,451 | 27,096.88 | 0.01 |
| USD US S. C-2021 3.125%/11-15.05.2021 | 1,622,232 | 1,675,461.29 | 0.52 | USD YUZHOU PROPERTIES 6%/16-25.10.2023 | 20,034 | 16,607.65 | 0.01 |
| USD US S. C-2022 1.75%/12-15.05.2022 | 2,252,033 | 2,322,233.02 | 0.73 | USD YUZHOU PROPERTIES 6%/17-25.01.2022 | 16,027 | 14,710.59 | 0.00 |
| USD US S. C-2023 1.75%/13-15.05.2023 | 1,516,374 | 1,582,597.22 | 0.49 | USD 3M S. -F- 1.625%/16-19.09.2021 | 74,726 | 74,629.15 | 0.02 |
| USD US S. C-2024 2.5%/14-15.05.2024 | 2,252,033 | 2,449,525.64 | 0.77 | 債券 | 178,700,918.27 | 55.33 | |
| USD US S. C-2025-2.125%/15-15.05.2025 | 1,876,698 | 2,038,269.75 | 0.63 | 証券取引所または他の組織された市場に上場されている | | | |
| USD US S. E-2023 2.5%/13-15.08.2023 | 2,001,802 | 2,146,619.99 | 0.67 | 証券：債券 | 178,700,918.27 | 55.33 | |
| USD US S. -E-2025-2%/15-15.08.2025 | 1,773,900 | 1,918,861.19 | 0.59 | | | | |
| USD US S. F-2021 2%/11-15.11.2021 | 1,475,952 | 1,518,385.16 | 0.47 | | | | |
| USD US S. F-2022 1.625%/12-15.11.2022 | 2,877,599 | 2,977,415.56 | 0.93 | | | | |
| USD US S. -F-2025-2.25%/15-15.11.2025 | 1,663,032 | 1,825,696.78 | 0.57 | | | | |
| USD US S. M-2022 2.125%/15-30.06.2022 | 1,639,949 | 1,707,724.64 | 0.53 | | | | |

注記は当財務書類の一部である。

純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

投資有価証券明細表（続き）

| 銘柄 | 数量／ 額面 | 時価 (米ドル) | 純資産 比率(%) |
|---|-----------|----------------|--------------|
| 証券取引所または他の組織された市場に上場されている証券： | | | |
| 投資信託 | | | |
| 投資信託受益証券（クローズド・エンド型） | | | |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 2,863 | 2,644.84 | 0.00 |
| GBP F&C COMMERCIAL PROPERTY TRUST LIMITED | 1,310 | 1,209.93 | 0.00 |
| GBP F&C UK REAL ESTATE INVESTMENT | 1,294 | 1,109.91 | 0.00 |
| GBP PICTON PROPERTY INCOME | 3,020 | 3,333.05 | 0.00 |
| GBP UK COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 3,465 | 3,222.48 | 0.00 |
| 投資信託受益証券（クローズド・エンド型） | | 11,520.21 | 0.00 |
| 投資信託受益証券（オープン・エンド型） | | | |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD | 68,317 | 6,646,560.93 | 2.06 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS LOCAL -QBX USD- USD | 14,420 | 12,718,346.96 | 3.93 |
| USD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD | 11,128 | 9,409,846.61 | 2.91 |
| JPY CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QBX- JPY | 1,823 | 1,637,212.54 | 0.51 |
| CAD CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CANADA ESG BLUE -QBX CAD ACC- CAD | 2,529 | 1,380,267.63 | 0.43 |
| EUR CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -DB- EUR | 630 | 1,383,892.42 | 0.43 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -DB- USD | 2,540 | 4,091,040.84 | 1.27 |
| USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -MB- USD | 7,308 | 8,189,159.26 | 2.54 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ROBOTICS EQUITY FUND -EB- USD | 980 | 1,531,452.97 | 0.47 |
| USD CS INVESTMENT FUNDS 6 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) CHINA RMB EQUITY FUND -EB- CSIF 2 - CREDIT SUISSE (LUX) | 14,088 | 1,329,766.32 | 0.41 |
| USD COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD | 21,767 | 10,201,561.92 | 3.16 |
| 投資信託受益証券（オープン・エンド型） | | 58,519,108.40 | 18.12 |
| 証券取引所または他の組織された市場に 上場されている証券：投資信託 | | 58,530,628.61 | 18.12 |
| 証券取引所に上場されていない証券： | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | | |
| USD DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 1,334 | 4,842.34 | 0.00 |
| CAD FIRST CAPITAL REALTY INC | 746 | 7,145.99 | 0.00 |
| EUR WAREHOUSES DE PAUW N.V. | 712 | 20,454.27 | 0.01 |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | 32,442.60 | 0.01 |
| 証券取引所に上場されていない証券： | | | |
| 株式（およびエクイティ型証券） | | 32,442.60 | 0.01 |
| ポートフォリオ合計 | | 310,887,835.45 | 96.25 |
| 銀行預金およびブローカー預金 | | 11,451,513.86 | 3.55 |
| 銀行およびブローカーへの未払金 | | -215,983.02 | -0.07 |
| その他の純資産 | | 863,983.35 | 0.27 |
| 純資産総額 | | 322,987,349.64 | 100.00 |

注記は当財務書類の一部である。
純資産比率における差異は四捨五入によるものである。

《お知らせ》

特記すべき事項はありません。