

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2024年4月19日まで（2011年1月20日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)、クラス J (BRL)、クラス J (ZAR) の投資信託証券への投資を通じて、米ドル建ての新興経済国の政府および政府機関等の発行する債券等に実質的な投資を行います。各投資信託証券への投資にあたっては、実質的な配分は3分の1程度ずつになることを基本とします。ただし、投資環境、資金動向、為替の変動等により、実質的な通貨配分が3分の1程度ずつからカイ離する場合があります。また、当該外国投資信託への投資を通じて、実質的な保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、3通貨（豪ドル、ブラジルレアル、南アフリカランド）買いの為替取引を行います（このため、基準価額は当該3通貨の対円での為替変動の影響を受けます。）。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。	
主要運用対象	三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ ＜資源国バスケット 通貨コース＞ （毎月分配型）	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド B - クラスJ （AUD）、クラス J（BRL）、 クラス J（ZAR）およびマネー・ マーケット・マザーファンドの投資信 託証券を主要投資対象とします。
	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド B - クラス J（AUD）	ピムコ ケイマン エマージ ング ボンド ファンド （M）への投資を通じて、新興 経済国の政府、政府機関等が 発行もしくは信用保証する米 ドル建ての債券およびその派 生商品等を主要投資対象とし ます。
	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド B - クラス J（BRL）	
	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド B - クラス J（ZAR）	
	マネー・ マーケット・ マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象と します。 外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

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

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ＜資源国バスケット通貨コース＞ （毎月分配型）

第92期（決算日：2018年11月20日）
 第93期（決算日：2018年12月20日）
 第94期（決算日：2019年1月21日）
 第95期（決算日：2019年2月20日）
 第96期（決算日：2019年3月20日）
 第97期（決算日：2019年4月22日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ＜資源国バスケット通貨コース＞（毎月分配型）」は、去る4月22日に第97期の決算を行いましたので、法令に基づいて第92期～第97期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	標準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金						
	円		円		%	%	%	%	百万円	
68期(2016年11月21日)	6,633		80		△2.0	0.0	—	98.7	180	
69期(2016年12月20日)	7,078		80		7.9	0.0	—	98.8	192	
70期(2017年1月20日)	7,358		80		5.1	0.0	—	98.7	198	
71期(2017年2月20日)	7,441		80		2.2	0.0	—	99.3	199	
72期(2017年3月21日)	7,544		80		2.5	0.0	—	98.9	217	
73期(2017年4月20日)	7,119		80		△4.6	—	—	99.0	220	
74期(2017年5月22日)	7,147		80		1.5	—	—	98.6	252	
75期(2017年6月20日)	7,255		80		2.6	—	—	98.9	263	
76期(2017年7月20日)	7,442		80		3.7	—	—	97.7	289	
77期(2017年8月21日)	7,187		80		△2.4	—	—	99.6	280	
78期(2017年9月20日)	7,426		80		4.4	—	—	97.0	334	
79期(2017年10月20日)	7,378		80		0.4	—	—	98.9	341	
80期(2017年11月20日)	7,006		80		△4.0	—	—	99.2	339	
81期(2017年12月20日)	7,296		80		5.3	—	—	99.6	354	
82期(2018年1月22日)	7,381		80		2.3	—	—	99.0	394	
83期(2018年2月20日)	6,983		80		△4.3	—	—	99.1	379	
84期(2018年3月20日)	6,697		80		△3.0	—	—	99.1	372	
85期(2018年4月20日)	6,723		80		1.6	—	—	99.2	377	
86期(2018年5月21日)	6,267		80		△5.6	—	—	99.1	316	
87期(2018年6月20日)	5,873		80		△5.0	—	—	98.9	296	
88期(2018年7月20日)	6,085		80		5.0	—	—	99.3	310	
89期(2018年8月20日)	5,584		80		△6.9	—	—	99.1	286	
90期(2018年9月20日)	5,532		80		0.5	—	—	99.3	284	
91期(2018年10月22日)	5,674		80		4.0	—	—	98.8	302	
92期(2018年11月20日)	5,644		80		0.9	—	—	99.3	302	
93期(2018年12月20日)	5,497		80		△1.2	—	—	97.9	320	
94期(2019年1月21日)	5,572		50		2.3	—	—	98.8	367	
95期(2019年2月20日)	5,624		50		1.8	—	—	99.3	371	
96期(2019年3月20日)	5,624		50		0.9	—	—	99.1	388	
97期(2019年4月22日)	5,604		50		0.5	—	—	99.4	392	

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

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	投 資 信 託 券 率
			騰 落 率	率						
第92期	(期 首) 2018年10月22日	円	%	—	%	—	%	—	%	98.8
	10月末	5,629	△0.8	—	—	—	—	—	98.8	
	(期 末) 2018年11月20日	5,724	0.9	—	—	—	—	—	99.3	
第93期	(期 首) 2018年11月20日	5,644	—	—	—	—	—	—	99.3	
	11月末	5,660	0.3	—	—	—	—	—	101.9	
	(期 末) 2018年12月20日	5,577	△1.2	—	—	—	—	—	97.9	
第94期	(期 首) 2018年12月20日	5,497	—	—	—	—	—	—	97.9	
	12月末	5,317	△3.3	—	—	—	—	—	99.5	
	(期 末) 2019年1月21日	5,622	2.3	—	—	—	—	—	98.8	
第95期	(期 首) 2019年1月21日	5,572	—	—	—	—	—	—	98.8	
	1月末	5,642	1.3	—	—	—	—	—	98.8	
	(期 末) 2019年2月20日	5,674	1.8	—	—	—	—	—	99.3	
第96期	(期 首) 2019年2月20日	5,624	—	—	—	—	—	—	99.3	
	2月末	5,689	1.2	—	—	—	—	—	98.8	
	(期 末) 2019年3月20日	5,674	0.9	—	—	—	—	—	99.1	
第97期	(期 首) 2019年3月20日	5,624	—	—	—	—	—	—	99.1	
	3月末	5,467	△2.8	—	—	—	—	—	99.3	
	(期 末) 2019年4月22日	5,654	0.5	—	—	—	—	—	99.4	

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

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第92期～第97期：2018年10月23日～2019年4月22日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第 92 期 首	5,674円
第 97 期 末	5,604円
既払分配金	360円
騰 落 率	5.3%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

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

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ5.3% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

> 基準価額の主な変動要因

上昇要因

エマージング (新興経済国) 債券市況が上昇したこと
南アフリカランドが対円で上昇したこと
ブラジルレアルや南アフリカランドの為替取引によるプレミアム (金利差相当分の収益) を獲得したこと

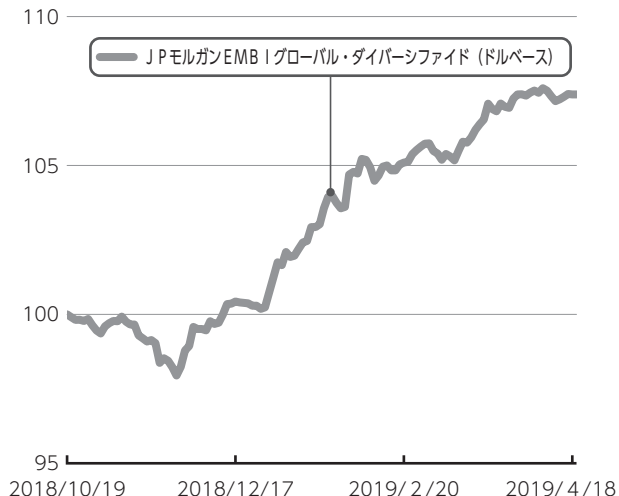
下落要因

豪ドル、ブラジルレアルが対円で下落したこと
豪ドルの為替取引によるコスト (金利差相当分の費用)

第92期～第97期：2018年10月23日～2019年4月22日

投資環境について

債券市況の推移 (当作成期首を100として指数化)



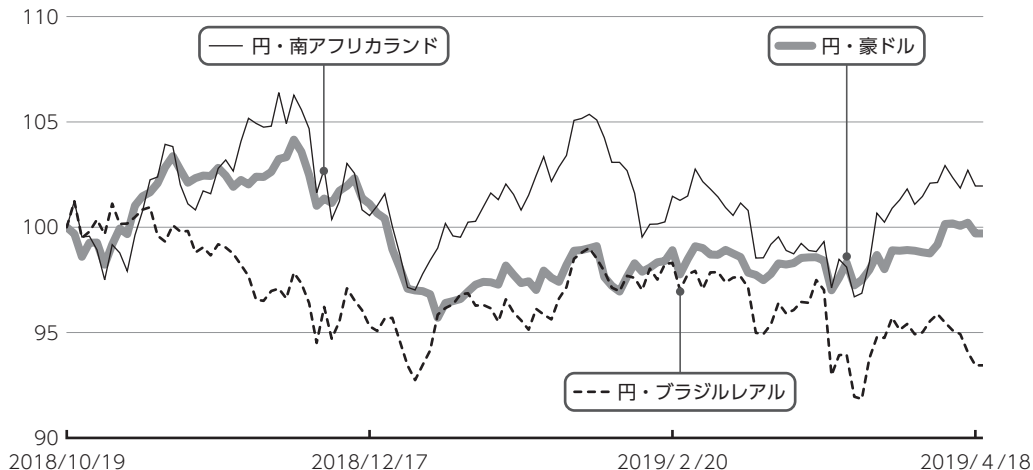
▶ 債券市況

当作成期は、米連邦準備制度理事会（F R B）の追加利上げに対する姿勢や世界経済の減速懸念の高まりなどを背景に市場参加者のリスク回避姿勢が強まり、スプレッド（米国債との利回り格差）が拡大する場面があったものの、2019年に入ってから、F R Bが当面政策金利を据え置く姿勢を示唆したことなどからエマージング債券市況は上昇し、当作成期を通じて見ると堅調に推移しました。

(注) 現地日付ベースで記載しております。

(注) J P モルガン E M B I グローバル・ダイバーシファイドとは、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している米ドル建ての新興国債および国債に準じる債券のパフォーマンスを表す指数で、指数構成国の組入比率に調整を加えた指数です。J P モルガン E M B I グローバル・ダイバーシファイドは、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権は J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しております。

為替市況の推移 (当作成期首を100として指数化、対円)



(注) 現地日付ベースで記載しております。

▶ 為替市況

<豪ドル>

当作成期は、2018年12月上旬から2019年初にかけて米国の利上げが経済を過度に減速させるとの懸念や米中貿易摩擦等を受けた世界経済の減速に対する懸念が高まったこと等を受けて、円が主要国通貨に対して上昇する中、豪ドルも対円で下落しました。その後は米中貿易摩擦に対する懸念が後退したこと等を背景に小幅に反発したものの、当作成期を通じて見ると、豪ドルは対円で下落しました。

<ブラジルレアル>

当作成期は、2018年12月上旬から2019年初にかけて米国の利上げが経済を過度に減速させるとの懸念や米中貿易摩擦等を受けた世界経済の減速に対する懸念が高まったこと等を受けて、円が主要国通貨に対して上昇する中、ブラジルレアルも対円で軟調に推移しました。その後は

年金改革の進捗に対する期待などを背景にブラジルレアルが堅調に推移する場面もあったものの、当作成期を通じて見ると、ブラジルレアルは対円で下落しました。

<南アフリカランド>

当作成期は、2018年12月上旬から2019年初にかけて米国の利上げが経済を過度に減速させるとの懸念や米中貿易摩擦等を受けた世界経済の減速に対する懸念が高まったこと等を受けて、円が主要国通貨に対して上昇する中、南アフリカランドも対円で軟調となりました。その後はFRBが政策金利を当面据え置く姿勢を示唆し、米国の金利上昇の新興国への影響に対する懸念が和らいだことなどから、南アフリカランドは対円で上昇し、当作成期を通じて見ると、南アフリカランドは対円で上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

当作成期の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、2019年4月22日のコール・レートは-0.076%となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)

各円建て外国投資信託であるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)、クラス J (BRL)、クラス J (ZAR) への投資を通じて、エマージング債券を高位に組み入れました。各投資信託証券への投資にあたっては、実質的な配分は3分の1程度ずつになることを基本としました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

当作成期は、豪ドルの為替取引によるコスト、豪ドルやブラジルレアルが対円で下落したことがマイナス要因となったものの、エマージング債券市況が上昇したことや南アフリカランドが上昇したこと、ブラジルレアルや南アフリカランドの為替取引によるプレミアムを享受したことなどがプラス要因となり、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

▶ ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)、クラス J (BRL)、クラス J (ZAR)

基準価額は、それぞれ当作成期首に比べ、分配金再投資ベースでクラス J (AUD) が6.3%の上昇、クラス J (BRL) が1.1%の上昇、クラス J (ZAR) が11.2%の上昇となりました。

保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、3通貨買いの為替取引を行いました。

為替

豪ドルやブラジルレアルが対円で下落したことがマイナス要因となりました。

為替取引によるプレミアム／為替取引によるコスト

豪ドルの短期金利が米ドルの短期金利に対して低位で推移していたため、これら2通貨間の短期金利差を背景とした為替取引によるコストは、当作成期を通じて見ると基準価額に対す

る下落要因となりました。なお、米ドルの短期金利が上昇する一方、豪ドルの短期金利が低下したため、豪ドルと米ドルの短期金利差は拡大しました。

ブラジルレアルの短期金利は米ドルの短期金利に対して高位で推移したため、これら2通貨間の短期金利差を背景とした為替取引によるプレミアムは、基準価額に対する上昇要因となりました。なお、米ドルの短期金利の上昇幅が、ブラジルレアルの短期金利の上昇幅を下回ったため、ブラジルレアルと米ドルの短期金利差は拡大しました。

南アフリカランドの短期金利は米ドルの短期金利に対して高位で推移したため、これら2通貨間の短期金利差を背景とした為替取引によるプレミアムは、基準価額に対する上昇要因となりました。なお、米ドルの短期金利が上昇した一方、南アフリカランドの短期金利が低下したことから、南アフリカランドと米ドルの短期金利差は縮小しました。

国別配分戦略

国別配分戦略については、ファンダメンタルズを評価したナイジェリアやバリュエーション上の魅力があり、国際通貨基金（IMF）の支援が見込まれるアルゼンチンに対して積極姿勢としました。なお、ナイジェリア債券市況が上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

基準価額は当作成期首に比べ横ばいとなりました。

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は横ばいとなりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第92期 2018年10月23日~ 2018年11月20日	第93期 2018年11月21日~ 2018年12月20日	第94期 2018年12月21日~ 2019年1月21日	第95期 2019年1月22日~ 2019年2月20日	第96期 2019年2月21日~ 2019年3月20日	第97期 2019年3月21日~ 2019年4月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	80 (1.398%)	80 (1.434%)	50 (0.889%)	50 (0.881%)	50 (0.881%)	50 (0.884%)
当期の収益	45	45	47	46	43	39
当期の収益以外	34	34	2	3	6	10
翌期繰越分配対象額	2,326	2,292	2,290	2,287	2,280	2,270

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

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

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶ 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)

今後の運用方針

各円建て外国投資信託への投資を通じてエマージング債券を高位に組み入れた運用を行うほか、一部、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券の組み入れを維持し、毎月の分配をめざしていく方針です。

▶ ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)、クラス J (BRL)、クラス J (ZAR)

運用環境の見通し

世界経済については減速を見込んでいるものの、中国による財政や金融面での景気刺激策強化を受けて、2019年後半には世界経済は安定し、緩やかな回復に転じる可能性もあると考えています。エマージング諸国の景気は中国が牽引役となり、先進国と比較して堅調な成長を見込んでおり、中でもファンダメンタルズの改善が見られる国に注目しています。また、足下では米国の利上げ打ち止めなどにより米国金利や米ドルの上昇圧力が緩和したこともエマージング諸国のファンダメンタルズを下支えすると考えています。一方、貿易摩擦や個別国の政策面でのリスクには、引き続き注意が必要と考えています。

今後の運用方針

米ドル建てを中心とした世界のエマージング債券を高位に組み入れた運用を行い、利子収益の確保および値上がり利益の獲得をめざします。

前述の見通しの下、エマージング諸国への投資に関しては、各国の通商政策などが及ぼす影響を見極め、投資国を選別することが重要と考えています。

具体的には、アルゼンチンについて、割安なバリュエーションやIMFからの支援が見込まれることなどから積極姿勢とする方針です。また、ナイジェリアについて、経常収支や足下の成長率などのファンダメンタルズを評価して積極姿勢とする方針です。一方、中国やフィリピン、マレーシアなどのアジア諸国については、相対的な割高感や米中貿易摩擦による中国経済への影響が懸念されることなどから消極姿勢とする方針です。

なお、保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、3通貨買いの為替取引を行います。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

運用環境の見通し

物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日銀の物価目標である2%には届かないと思われる。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

今後の運用方針

コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2018年10月23日～2019年4月22日

1万口当たりの費用明細

項目	第92期～第97期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	46	0.815	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(28)	(0.498)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(17)	(0.295)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.021)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	46	0.817	

作成期中の平均基準価額は、5,613円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

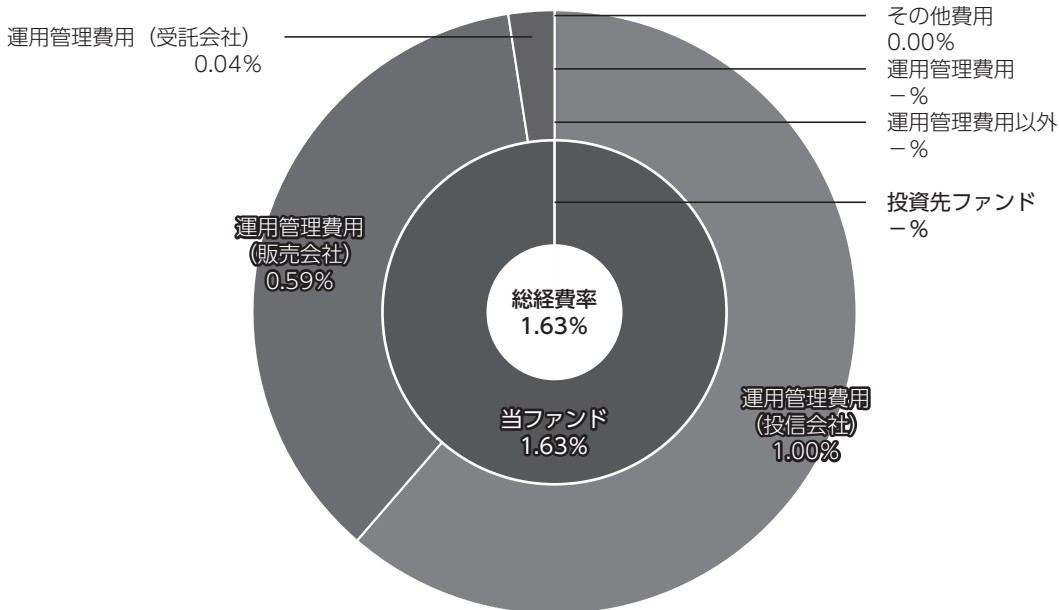
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.63%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.63
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.63
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	－
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	－

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

○売買及び取引の状況

(2018年10月23日～2019年4月22日)

投資信託証券

銘柄		第92期～第97期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)	5	50,490	1	14,666
	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (BRL)	10	45,059	3	17,263
	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (ZAR)	7	45,067	3	20,418
	合計	23	140,617	8	52,349

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2018年10月23日～2019年4月22日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2019年4月22日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	第91期末		第97期末		比率
	口数	金額	口数	評価額	
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)	11	15	134,339	34.2	
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (BRL)	22	28	126,336	32.1	
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (ZAR)	17	21	129,992	33.1	
合計	50	65	390,668	99.4	

(注) 比率は三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄	第91期末		第97期末	
	口数	金額	口数	評価額
マネー・マーケット・マザーファンド	212	212	216	216

○投資信託財産の構成

(2019年4月22日現在)

項 目	第97期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 390,668	% 98.4
マネー・マーケット・マザーファンド	216	0.1
コール・ローン等、その他	6,195	1.5
投資信託財産総額	397,079	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第92期末	第93期末	第94期末	第95期末	第96期末	第97期末
	2018年11月20日現在	2018年12月20日現在	2019年1月21日現在	2019年2月20日現在	2019年3月20日現在	2019年4月22日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	307,512,542	325,614,299	373,627,248	375,265,970	392,768,666	397,079,706
コール・ローン等	3,532,325	3,750,386	9,815,924	4,259,846	4,470,754	6,195,350
投資信託受益証券(評価額)	300,764,010	313,647,706	363,595,117	368,789,917	385,081,705	390,668,149
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	216,207	216,207	216,207	216,207	216,207	216,207
未収入金	3,000,000	8,000,000	—	2,000,000	3,000,000	—
(B) 負債	4,691,238	5,082,954	5,784,137	3,807,357	4,299,465	4,086,022
未払金	—	—	2,000,000	—	—	—
未払収益分配金	4,292,597	4,664,678	3,300,733	3,302,638	3,453,543	3,506,235
未払解約金	—	—	—	—	371,458	—
未払信託報酬	397,850	417,450	482,424	503,731	473,532	578,641
未払利息	7	8	18	7	7	14
その他未払費用	784	818	962	981	925	1,132
(C) 純資産総額(A-B)	302,821,304	320,531,345	367,843,111	371,458,613	388,469,201	392,993,684
元本	536,574,711	583,084,832	660,146,680	660,527,606	690,708,625	701,247,009
次期繰越損益金	△233,753,407	△262,553,487	△292,303,569	△289,068,993	△302,239,424	△308,253,325
(D) 受益権総口数	536,574,711口	583,084,832口	660,146,680口	660,527,606口	690,708,625口	701,247,009口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,644円	5,497円	5,572円	5,624円	5,624円	5,604円

○損益の状況

項 目	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
	2018年10月23日～ 2018年11月20日	2018年11月21日～ 2018年12月20日	2018年12月21日～ 2019年1月21日	2019年1月22日～ 2019年2月20日	2019年2月21日～ 2019年3月20日	2019年3月21日～ 2019年4月22日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,828,566	3,098,880	3,290,771	3,302,210	3,366,004	3,377,181
受取配当金	2,828,779	3,099,178	3,291,165	3,302,470	3,366,160	3,377,437
支払利息	△ 213	△ 298	△ 394	△ 260	△ 156	△ 256
(B) 有価証券売買損益	236,080	△ 6,128,134	5,652,905	3,830,157	1,021,887	△ 736,520
売買益	2,789,459	99,772	5,928,245	4,902,995	1,784,301	5,107,335
売買損	△ 2,553,379	△ 6,227,906	△ 275,340	△ 1,072,838	△ 762,414	△ 5,843,855
(C) 信託報酬等	△ 398,634	△ 418,268	△ 483,408	△ 504,712	△ 474,457	△ 579,773
(D) 当期損益金 (A+B+C)	2,666,012	△ 3,447,522	8,460,268	6,627,655	3,913,434	2,060,888
(E) 前期繰越損益金	△115,368,807	△113,250,218	△119,626,509	△112,545,789	△104,448,266	△102,949,734
(F) 追加信託差損益金	△116,758,015	△141,191,069	△177,836,595	△179,848,221	△198,251,049	△203,858,244
(配当等相当額)	(113,437,393)	(124,625,407)	(142,468,990)	(142,703,089)	(149,971,105)	(152,449,770)
(売買損益相当額)	(△230,195,408)	(△265,816,476)	(△320,305,585)	(△322,551,310)	(△348,222,154)	(△356,308,014)
(G) 計 (D+E+F)	△229,460,810	△257,888,809	△289,002,836	△285,766,355	△298,785,881	△304,747,090
(H) 収益分配金	△ 4,292,597	△ 4,664,678	△ 3,300,733	△ 3,302,638	△ 3,453,543	△ 3,506,235
次期繰越損益金 (G+H)	△233,753,407	△262,553,487	△292,303,569	△289,068,993	△302,239,424	△308,253,325
追加信託差損益金	△116,758,015	△141,191,069	△177,836,595	△179,848,221	△198,251,049	△203,858,244
(配当等相当額)	(113,437,393)	(124,625,407)	(142,468,990)	(142,703,089)	(149,971,105)	(152,449,770)
(売買損益相当額)	(△230,195,408)	(△265,816,476)	(△320,305,585)	(△322,551,310)	(△348,222,154)	(△356,308,014)
分配準備積立金	11,414,628	9,065,165	8,747,694	8,366,764	7,549,674	6,765,441
繰越損益金	△128,410,020	△130,427,583	△123,214,668	△117,587,536	△111,538,049	△111,160,522

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

<注記事項>

- ①作成期首 (前作成期末) 元本額 532,771,666円
 作成期中追加設定元本額 243,301,738円
 作成期中一部解約元本額 74,826,395円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.5604円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は308,253,325円です。

③分配金の計算過程

項 目	2018年10月23日～ 2018年11月20日	2018年11月21日～ 2018年12月20日	2018年12月21日～ 2019年1月21日	2019年1月22日～ 2019年2月20日	2019年2月21日～ 2019年3月20日	2019年3月21日～ 2019年4月22日
費用控除後の配当等収益額	2,460,627円	2,680,612円	3,112,925円	3,068,528円	3,002,048円	2,797,408円
費用控除後・繰越火損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	113,437,393円	124,625,407円	142,468,990円	142,703,089円	149,971,105円	152,449,770円
分配準備積立金額	13,246,598円	11,049,231円	8,935,502円	8,600,874円	8,001,169円	7,474,268円
当ファンドの分配対象収益額	129,144,618円	138,355,250円	154,517,417円	154,372,491円	160,974,322円	162,721,446円
1万口当たり収益分配対象額	2,406円	2,372円	2,340円	2,337円	2,330円	2,320円
1万口当たり分配金額	80円	80円	50円	50円	50円	50円
収益分配金金額	4,292,597円	4,664,678円	3,300,733円	3,302,638円	3,453,543円	3,506,235円

④信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の59以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
1万口当たり分配金 (税込み)	80円	80円	50円	50円	50円	50円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

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

◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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

【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。）の税率が適用されます。

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (AUD)	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (BRL)	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B - クラス J (ZAR)
運用方針	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M) への投資を通じて、新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券およびその派生商品等に実質的な投資を行い、信託財産の成長をめざします。		
主要運用対象	新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券およびその派生商品等		
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・投資を行う新興国債券は、主に新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券（ソブリン債券、準ソブリン債券）ですが、新興国債券と同様の投資効果を持つデリバティブ取引を活用する場合があります。また、資金管理目的で、原則として取得時に「BBB格」相当以上の信用格付けを有する米ドル建ての公社債等にも一部投資を行います。 ・ポートフォリオの平均デュレーションは原則として3年以上8年以内で調整します。 ・投資する債券は、原則として取得時において「CCC格」相当以上の信用格付けを有しているものに限定し、投資する債券の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則として「B格」相当以上を維持します。 ・限定的な範囲内で、米ドル建て以外の新興国債券にも投資を行う場合がありますが、この場合においては米ドル以外の通貨売り、米ドル買いの為替取引を行います。 ・保有外貨建て資産に対し、原則として、米ドル売り、3通貨（豪ドル、ブラジルレアル、南アフリカランド）買いの為替取引を行います。 		
決算日	原則として毎年2月末日		
分配方針	原則として毎月经費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。		

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Cayman Trust Annual Report February 28, 2018版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは、「ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B」で掲載しています。また、「ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M)」を「マスターファンド」と表示する場合があります。

(1) 運用計算書

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B

(2017年3月1日～2018年2月28日)

	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B
	千米ドル
投資収入：	
受取利息（外国税額控除後）*	376
マスターファンドからの配当収入	0
雑収入	22
収入合計	398
費用：	
支払利息	123
雑費用	0
費用合計	123
投資純収入	275
実現純利益（損失）：	
投資有価証券（外国税額控除後）*	810
マスターファンド	40,316
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	73,478
外貨	(172)
実現純利益（損失）	114,432
未実現評価益（評価損）の純変動：	
投資有価証券（外国税額控除後）	31
マスターファンド	32,557
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(44,492)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	(18)
未実現評価益（評価損）の純変動	(11,922)
純利益（損失）	102,510
運用による純資産の純増（減）額	102,785
*外国源泉課税額	0

(注) データ提供元：ピムコジャパンリミテッド

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B

(2017年3月1日～2018年2月28日)

ピムコ ケイマン
エマージング ボンド
ファンド B

千米ドル

純資産の増加（減少）：

運用：

投資純収入	275
実現純利益（損失）	114,432
未実現評価益（評価損）の純変動	(11,922)
運用による純資産の純増（減）額	102,785

分配：

分配額

A (BRL)	(1,259)
D (BRL)	(5,547)
F (AUD)	(1,113)
F (ZAR)	(3,007)
J (AUD)	(22,547)
J (BRL)	(118,292)
J (CNY)	(73)
J (IDR)	(1,159)
J (TRY)	(4,144)
J (ZAR)	(974)
分配金額合計	(158,115)

ファンドユニット取引：

ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額	(128,815)
純資産の増（減）額合計	(184,145)

純資産：

期首	1,251,427
期末	1,067,282

(注) データ提供元：ピムコジャパンリミテッド

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

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

(A) ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B
(2018年2月28日現在)

	元本 (単位:千)	時価 (単位:千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 10.3%		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 10.3%		
COMMERCIAL PAPER 10.2%		
Federal Home Loan Bank		
0.950% due 03/01/2018	\$ 9,900	\$ 9,900
1.363% due 04/02/2018	17,700	17,675
1.419% due 04/11/2018	4,100	4,093
1.419% due 04/09/2018	300	299
1.430% due 04/13/2018	2,300	2,296
1.439% due 04/06/2018 (a)	41,400	41,334
1.458% due 05/02/2018 (a)	9,400	9,373
1.481% due 05/04/2018	1,500	1,496
1.504% due 04/18/2018 (a)	7,400	7,384
1.561% due 05/11/2018	4,500	4,485
1.637% due 05/18/2018	10,000	9,964
		<u>108,299</u>
TIME DEPOSITS 0.1%		
ANZ National Bank		
0.930% due 03/01/2018	202	202
Bank of Nova Scotia		
0.930% due 03/01/2018	290	290
Citibank N.A.		
0.930% due 03/01/2018	104	104
DBS Bank Ltd.		
0.930% due 03/01/2018	2	2
Deutsche Bank AG		
0.930% due 03/01/2018	102	102
DnB NORBank ASA		
0.930% due 03/01/2018	193	193
JPMorgan Chase & Co.		
0.930% due 03/01/2018	201	201
National Australia Bank Ltd.		
0.930% due 03/01/2018	7	7
Royal Bank of Canada		
0.930% due 03/01/2018	3	3
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.930% due 03/01/2018	1	1
		<u>1,105</u>
Total Short-Term Instruments		<u>109,404</u>
(Cost \$109,296)		
Total Investments in Securities		<u>109,404</u>
(Cost \$109,296)		
	口数 (単位:千)	
INVESTMENTS IN AFFILIATES 89.9%		
MUTUAL FUNDS 89.9%		
PIMCO Cayman Emerging Bond Fund (M)		
(Cost \$836,324)	66,422	959,800
Total Investments in Affiliates		<u>959,800</u>
(Cost \$836,324)		
Total Investments 100.2%		\$1,069,204
(Cost \$945,620)		
Financial Derivative		
Instruments (b) (1.2%)		(12,777)
(Cost or Premiums, net \$0)		
Other Assets and Liabilities, net 1.0%		<u>10,855</u>
Net Assets 100.0%		<u>\$1,067,282</u>

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (AMOUNTS IN THOUSANDS*):

* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.

(a) Coupon represents a weighted average rate.

(b) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	05/2018	\$ 693	ZAR 8,374	\$ 10	\$ 0
HUS	03/2018	JPY 4,000	\$ 37	0	0
HUS	03/2018	15,000	139	0	(1)
HUS	03/2018	\$ 3	AUD 4	0	0
HUS	03/2018	9	11	0	0
HUS	03/2018	9	11	0	0
HUS	03/2018	2,501	JPY 269,000	20	0
HUS	03/2018	7	ZAR 81	0	0
HUS	03/2018	21	244	0	0
HUS	03/2018	11	130	0	0
				\$ 30	\$ (1)

F (AUD) AND J (AUD) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	03/2018	AUD 104,872	\$ 82,566	\$ 844	\$ 0
BOA	03/2018	\$ 794	AUD 992	0	(21)
BOA	04/2018	82,565	104,872	0	(841)
BPS	03/2018	AUD 603	\$ 471	1	0
BRC	03/2018	\$ 86,838	AUD 107,394	0	(3,151)
CBK	03/2018	AUD 833	\$ 655	6	0
CBK	03/2018	\$ 88,552	AUD 109,323	0	(3,362)
GLM	03/2018	AUD 105,136	\$ 82,401	474	0
GLM	04/2018	\$ 82,402	AUD 105,136	0	(472)
HUS	03/2018	AUD 4,581	\$ 3,579	9	0
HUS	03/2018	\$ 471	AUD 603	0	(1)
HUS	04/2018	AUD 603	\$ 471	1	0
IND	03/2018	104,935	81,954	184	0
IND	04/2018	\$ 81,955	AUD 104,935	0	(182)
SCX	03/2018	AUD 4,499	\$ 3,516	10	0
SCX	03/2018	\$ 88,248	AUD 109,047	0	(3,274)
SCX	04/2018	3,516	4,499	0	(10)
SSB	03/2018	AUD 5,912	\$ 4,687	80	0
				\$ 1,609	\$ (11,314)

A (BRL), D (BRL) AND J (BRL) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	03/2018	BRL 212,351	\$ 65,078	\$ 0	\$ (285)
BOA	03/2018	\$ 65,582	BRL 212,351	0	(218)
BOA	04/2018	BRL 6,139	\$ 1,883	0	0
BOA	04/2018	\$ 64,870	BRL 212,351	273	0
BPS	03/2018	BRL 145,873	\$ 44,955	53	0
BPS	03/2018	\$ 45,114	BRL 145,873	0	(213)
CBK	03/2018	BRL 791,739	\$ 243,444	198	(460)
CBK	03/2018	\$ 244,055	BRL 791,739	13	(363)
CBK	03/2018	242	800	4	0
CBK	04/2018	73,384	240,589	421	0
DUB	03/2018	BRL 352,902	\$ 108,081	0	(546)
DUB	03/2018	\$ 109,367	BRL 352,902	0	(740)
DUB	04/2018	107,734	352,902	525	0
FBF	03/2018	BRL 350,060	\$ 108,068	316	0
FBF	03/2018	\$ 108,670	BRL 350,060	0	(918)
FBF	04/2018	68,435	222,175	0	(279)
GLM	03/2018	BRL 181,257	\$ 55,859	66	0
GLM	03/2018	\$ 55,750	BRL 181,257	67	(24)

A (BRL), D (BRL) AND J (BRL) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
HUS	03/2018	BRL 681,590	\$ 210,537	\$ 736	\$ 0
HUS	03/2018	\$ 210,076	BRL 681,590	0	(275)
HUS	04/2018	208,401	677,011	0	(716)
JPM	03/2018	BRL 167,474	\$ 51,713	163	0
JPM	03/2018	\$ 51,611	BRL 167,474	0	(61)
JPM	04/2018	BRL 24,471	\$ 7,510	3	0
JPM	04/2018	\$ 36,579	BRL 119,008	0	(72)
MSB	03/2018	BRL 238,016	\$ 73,360	96	0
MSB	03/2018	\$ 73,803	BRL 238,016	0	(539)
MSB	04/2018	73,125	238,016	0	(110)
NGF	03/2018	BRL 132,175	\$ 40,733	48	0
NGF	03/2018	\$ 40,855	BRL 132,175	0	(170)
SDG	03/2018	BRL 2,894	\$ 900	9	0
SDG	03/2018	\$ 892	BRL 2,894	0	(1)
UAG	03/2018	BRL 363,108	\$ 112,108	339	0
UAG	03/2018	\$ 111,996	BRL 363,108	0	(227)
UAG	04/2018	111,745	363,108	0	(355)
				\$ 3,330	\$ 16,572

J (CNY) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	03/2018	\$ 288	CNY 1,930	\$ 17	\$ 0
BPS	06/2018	CNY 25	\$ 4	0	0
BRC	03/2018	\$ 151	CNY 1,008	9	0
DUB	03/2018	289	1,932	16	0
GLM	03/2018	1	7	0	0
HUS	03/2018	CNY 2,237	\$ 354	1	0
HUS	03/2018	\$ 53	CNY 348	2	0
HUS	06/2018	352	2,237	0	(1)
JPM	03/2018	CNY 114	\$ 18	0	0
JPM	03/2018	\$ 95	CNY 602	0	0
JPM	06/2018	CNY 421	\$ 66	0	0
SDG	03/2018	120	18	0	(1)
SDG	03/2018	\$ 9	CNY 58	0	0
UAG	03/2018	CNY 2,237	\$ 355	1	0
UAG	03/2018	\$ 5	CNY 33	0	0
UAG	06/2018	352	2,237	0	(2)
				\$ 46	\$ (4)

J (IDR) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BPS	03/2018	\$ 4,165	IDR 56,154,461	\$ 0	\$ (94)
CBK	03/2018	IDR 956,609	\$ 71	2	0
DUB	03/2018	\$ 2,094	IDR 28,212,937	0	(49)
DUB	03/2018	2,734	37,404,036	0	(21)
GLM	03/2018	125	1,707,717	0	(1)
HUS	03/2018	IDR 65,308,558	\$ 4,764	26	0
HUS	03/2018	\$ 1,237	IDR 16,530,741	0	(38)
HUS	06/2018	4,727	65,308,558	0	(29)
JPM	03/2018	IDR 2,511,585	\$ 185	3	0
JPM	03/2018	\$ 83	IDR 1,111,619	0	(2)
JPM	06/2018	IDR 2,891,408	\$ 208	0	0
SCX	03/2018	1,650,708	121	1	0
SCX	03/2018	\$ 951	IDR 12,838,810	0	(20)
SCX	03/2018	350	4,691,169	0	(10)
SCX	06/2018	120	1,650,708	0	(1)
SDG	03/2018	662	8,982,177	0	(10)
SDG	06/2018	100	1,380,451	0	(1)
				\$ 32	\$ (276)

J (TRY) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	05/2018	\$ 286	TRY 1,111	\$ 0	\$ 0
BPS	04/2018	23	90	0	0
CBK	05/2018	1,624	6,297	0	(9)
DUB	04/2018	98	385	1	0
GLM	04/2018	12	46	0	0
HUS	03/2018	TRY 2,673	\$ 702	0	0
HUS	03/2018	541	142	0	0
HUS	03/2018	\$ 142	TRY 541	0	0
HUS	05/2018	139	541	0	0
JPM	05/2018	TRY 1,938	\$ 502	5	0
JPM	05/2018	\$ 13,161	TRY 50,693	0	(159)
MSB	04/2018	23	91	0	0
RYL	05/2018	415	1,800	0	(4)
SCX	04/2018	24	93	0	0
SCX	05/2018	12,938	50,152	0	(75)
SOG	05/2018	12,880	50,382	42	0
				\$ 48	\$ (247)

F (ZAR) AND J (ZAR) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	05/2018	\$ 12,228	ZAR 147,784	\$ 170	\$ 0
BOA	05/2018	ZAR 9,854	\$ 841	14	0
CBK	05/2018	\$ 12,281	ZAR 147,590	100	0
CBK	05/2018	ZAR 305	\$ 26	0	0
GLM	03/2018	\$ 114	ZAR 1,338	0	(1)
GLM	05/2018	282	3,317	0	(4)
GLM	05/2018	ZAR 1,338	\$ 113	1	0
HUS	03/2018	7,141	605	0	0
HUS	03/2018	1,338	114	1	0
HUS	05/2018	\$ 11,171	ZAR 136,289	263	0
HUS	05/2018	ZAR 533	\$ 44	0	(1)
RYL	05/2018	\$ 248	ZAR 2,934	0	(1)
				\$ 549	\$ (7)
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 5,644	\$ (18,421)

(B) ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M)

(2018年2月28日現在)

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 99.9%		
ARGENTINA 6.0%		
SOVEREIGN ISSUES 6.0%		
Argentina Government International Bond		
2.260% due 12/31/2038	EUR 2,500	\$ 2,101
5.000% due 01/15/2027	1,300	1,542
5.875% due 01/11/2028	\$ 10,600	9,826
6.250% due 11/09/2047	EUR 2,100	2,394
6.875% due 04/22/2021	\$ 10,500	11,134
6.875% due 01/11/2048	5,350	4,905
7.125% due 07/09/2036 (f)	1,800	1,750
7.125% due 08/28/2117 (f)	500	470
7.820% due 12/31/2033	EUR 11,422	15,731
8.280% due 12/31/2033	\$ 1,823	2,003
8.750% due 05/07/2024	2,700	3,092
Provincia de Buenos Aires		
5.375% due 01/20/2023	EUR 1,300	1,671
Provincia de Entre Rios Argentina		
8.750% due 02/09/2025	\$ 3,300	3,362
Provincia de la Rioja		
9.750% due 02/24/2025	3,100	3,325
Total Argentina		63,406
(Cost \$62,485)		
AZERBAIJAN 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
Southern Gas Corridor CJSC		
6.875% due 03/24/2026	2,000	2,221
State Oil Company of the Azerbaijan Republic		
4.750% due 03/13/2023	5,040	5,048
		7,269
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Republic of Azerbaijan International Bond		
4.750% due 03/18/2024	3,100	3,143
Total Azerbaijan		10,412
(Cost \$10,073)		
BAHAMAS 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Bahamas Government International Bond		
6.000% due 11/21/2028	4,050	4,232
Total Bahamas		4,232
(Cost \$4,050)		
BAHRAIN 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Bahrain Government International Bond		
6.750% due 09/20/2029	9,000	8,584
Total Bahrain		8,584
(Cost \$8,939)		
BRAZIL 8.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 8.2%		
Banco do Brasil S.A.		
6.000% due 01/22/2020	20,420	21,410
Banco do Nordeste do Brasil S.A.		
4.375% due 05/03/2019	8,200	8,241
Caixa Economica Federal		
4.500% due 10/03/2018	9,200	9,279
Centrais Eletricas Brasileiras S.A.		
5.750% due 10/27/2021	600	623
6.875% due 07/30/2019	9,985	10,434

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Petrobras Global Finance BV		
5.299% due 01/27/2025	\$ 5,242	\$ 5,144
5.999% due 01/27/2028	4,560	4,497
6.250% due 03/17/2024	6,500	6,793
6.750% due 01/27/2041	1,400	1,356
6.850% due 06/05/2115	4,400	4,169
6.875% due 01/20/2040	8,150	7,975
7.250% due 03/17/2044	700	712
7.375% due 01/17/2027	5,700	6,190
		86,823
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social		
6.500% due 06/10/2019	2,328	2,429
Total Brazil		89,252
(Cost \$84,288)		
CAYMAN ISLANDS 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
Interoceania IV Finance Ltd.		
0.000% due 11/30/2018	23	22
0.000% due 11/30/2025	887	755
Interoceania V Finance Ltd.		
0.000% due 05/15/2030	6,400	4,360
QNB Finance Ltd.		
3.161% due 02/12/2020	8,500	8,504
Total Cayman Islands		13,641
(Cost \$12,777)		
CHILE 1.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.9%		
Corp. Nacional del Cobre de Chile		
3.625% due 08/01/2027	200	194
4.250% due 07/17/2042	12,500	12,123
4.500% due 08/01/2047	500	501
4.875% due 11/04/2044	6,800	7,225
		20,043
SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Chile Government International Bond		
3.625% due 10/30/2042	150	141
3.860% due 06/21/2047	500	476
		617
Total Chile		20,660
(Cost \$20,219)		
CHINA 1.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
China Construction Bank Corp.		
3.875% due 05/13/2025**	900	903
Minmetals Bounteous Finance BV Ltd.		
3.125% due 07/27/2021	400	394
4.200% due 07/27/2026	200	198
Rongshi International Finance Ltd.		
2.875% due 05/04/2022	1,700	1,654
3.625% due 05/04/2027	1,700	1,638
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.		
2.500% due 09/13/2022	9,300	8,902
		13,689
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Export-Import Bank of China		
4.000% due 11/28/2047	2,600	2,474

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Total China		
(Cost \$16,668)		\$ 16,163
COLOMBIA 2.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
Ecopetrol S.A.		
5.875% due 05/28/2045	\$ 8,400	8,457
7.375% due 09/18/2043	2,400	2,864
		11,321
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Colombia Government International Bond		
7.375% due 09/18/2037	9,150	11,726
Total Colombia		23,047
(Cost \$20,911)		
COSTA RICA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Costa Rica Government International Bond		
5.625% due 04/30/2043	7,000	6,355
Total Costa Rica		6,355
(Cost \$6,333)		
CROATIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Croatia Government International Bond		
6.000% due 01/26/2024	2,000	2,198
Total Croatia		2,198
(Cost \$2,258)		
DOMINICAN REPUBLIC 2.4%		
SOVEREIGN ISSUES 2.4%		
Dominican Republic Government International Bond		
5.500% due 01/27/2025	3,600	3,722
5.950% due 01/25/2027	13,300	14,111
6.850% due 01/27/2045	2,400	2,616
6.875% due 01/29/2026	4,700	5,276
Total Dominican Republic		25,725
(Cost \$24,978)		
ECUADOR 2.6%		
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Ecuador Government International Bond		
7.875% due 01/23/2028	2,800	2,803
8.750% due 06/02/2023	2,500	2,669
8.875% due 10/23/2027	500	529
9.625% due 06/02/2027	2,100	2,321
9.650% due 12/13/2026	8,200	9,056
10.750% due 03/28/2022	9,400	10,646
Total Ecuador		28,024
(Cost \$25,670)		
EGYPT 3.0%		
SOVEREIGN ISSUES 3.0%		
Egypt Government International Bond		
5.577% due 02/21/2023	13,600	13,851
7.500% due 01/31/2027	6,900	7,477
7.903% due 02/21/2048	7,200	7,579
8.500% due 01/31/2047	2,500	2,806
Total Egypt		31,713
(Cost \$30,641)		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
EL SALVADOR 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
El Salvador Government International Bond		
7.625% due 02/01/2041	\$ 3,430	\$ 3,637
8.250% due 04/10/2032	4,090	4,619
Total El Salvador		8,256
(Cost \$9,118)		
GABON 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Gabon Government International Bond		
6.375% due 12/12/2024	1,402	1,382
Total Gabon		1,382
(Cost \$1,394)		
GHANA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Republic of Ghana International Bond		
9.250% due 09/15/2022	1,200	1,352
Total Ghana		1,352
(Cost \$1,294)		
GUATEMALA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Guatemala Government Bond		
4.875% due 02/13/2028	2,000	1,999
Total Guatemala		1,999
(Cost \$2,002)		
HONG KONG 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%		
Huaneng Hong Kong Capital Ltd.		
3.800% due 10/30/2022 (a)	4,400	4,230
Nexen Energy ULC		
6.400% due 05/15/2037	2,460	3,053
7.500% due 07/30/2039	1,440	2,021
Total Hong Kong		9,304
(Cost \$9,058)		
INDIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Export-Import Bank of India		
3.875% due 02/01/2028	1,900	1,846
Total India		1,846
(Cost \$1,897)		
INDONESIA 3.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.9%		
Pelabuhan Indonesia III Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,400	3,534
Pertamina Persero PT		
4.875% due 05/03/2022	2,300	2,395
6.000% due 05/03/2042	6,805	7,358
Perusahaan Listrik Negara PT		
5.250% due 10/24/2042	7,000	6,904
		20,191
SOVEREIGN ISSUES 1.9%		
Indonesia Government International Bond		
4.350% due 01/11/2048	2,600	2,476
5.125% due 01/15/2045	1,100	1,140
5.250% due 01/08/2047	2,800	2,973
6.750% due 01/15/2044	6,250	7,925

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia		
3.875% due 04/06/2024 (f)	\$ 2,400	\$ 2,385
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
3.400% due 03/29/2022	2,400	2,385
4.400% due 03/01/2028 (b)	600	601
Total Indonesia		19,885
(Cost \$38,119)		
IRELAND 0.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
Vnesheconbank Via VEB Finance PLC		
6.025% due 07/05/2022	6,100	6,541
6.902% due 07/09/2020	500	535
Total Ireland		7,076
(Cost \$6,689)		
ISRAEL 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Israel Electric Corp. Ltd.		
4.250% due 08/14/2028	4,800	4,734
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Israel Government International Bond		
4.125% due 01/17/2048	1,100	1,065
Total Israel		5,799
(Cost \$5,846)		
IVORY COAST 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Ivory Coast Government International Bond		
5.125% due 06/15/2025	EUR 4,600	5,908
5.375% due 07/23/2024	\$ 654	648
5.750% due 12/31/2032	139	135
6.125% due 06/15/2033	800	775
Total Ivory Coast		7,466
(Cost \$6,768)		
JAMAICA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Jamaica Government International Bond		
6.750% due 04/28/2028	2,500	2,803
7.875% due 07/28/2045	3,000	3,653
Total Jamaica		6,456
(Cost \$5,499)		
JORDAN 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Jordan Government International Bond		
7.375% due 10/10/2047	4,200	4,442
Total Jordan		4,442
(Cost \$4,138)		
KAZAKHSTAN 3.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.7%		
KazMunayGas National Co. JSC		
6.375% due 04/09/2021	14,000	15,045
7.000% due 05/05/2020	12,986	13,902
		28,947

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Kazakhstan Government International Bond		
4.875% due 10/14/2044	\$ 1,600	\$ 1,632
6.500% due 07/21/2045	2,000	2,460
		4,092
Total Kazakhstan		33,039
(Cost \$30,578)		
KENYA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Kenya Government International Bond		
7.250% due 02/28/2028	2,200	2,230
8.250% due 02/28/2048	2,900	2,981
Total Kenya		5,211
(Cost \$5,100)		
LUXEMBOURG 4.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.1%		
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.		
4.375% due 09/19/2022	10,100	10,188
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.		
5.999% due 01/23/2021	2,400	2,538
6.510% due 03/07/2022	1,800	1,959
8.625% due 04/28/2034	1,800	2,415
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
5.180% due 06/28/2019	21,100	21,641
5.500% due 02/26/2024**	3,700	3,762
6.125% due 02/07/2022	500	539
Total Luxembourg		43,042
(Cost \$42,102)		
MACEDONIA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Macedonia Government International Bond		
2.750% due 01/18/2025	EUR 3,400	4,146
5.625% due 07/26/2023	1,500	2,139
Total Macedonia		6,285
(Cost \$6,154)		
MALAYSIA 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Petronas Capital Ltd.		
4.500% due 03/18/2045	\$ 100	103
Total Malaysia		103
(Cost \$99)		
MEXICO 4.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 3.3%		
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC		
3.800% due 08/11/2026	1,500	1,479
Comision Federal de Electricidad		
6.125% due 06/16/2023	3,500	3,855
Petroleos Mexicanos		
6.350% due 02/12/2048	3,334	3,267
6.500% due 03/13/2027	2,900	3,103
6.500% due 06/02/2041	4,035	4,044
6.625% due 06/15/2035	2,150	2,232
6.625% due 06/15/2038	9,800	9,954
6.750% due 09/21/2047	2,000	2,039
8.625% due 02/01/2022	4,580	5,299
		35,272

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Mexico Government International Bond		
5.750% due 10/12/2110	\$ 8,300	\$ 8,424
Total Mexico		43,696
(Cost \$43,849)		
MONGOLIA 1.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Mongolia Government International Bond		
5.125% due 12/05/2022	9,215	9,085
5.625% due 05/01/2023	400	398
8.750% due 03/09/2024	3,800	4,329
Total Mongolia		13,822
(Cost \$13,941)		
NAMIBIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Namibia International Bond		
5.250% due 10/29/2025	1,000	1,004
Total Namibia		1,004
(Cost \$992)		
NETHERLANDS 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV		
6.950% due 07/10/2042	5,730	6,476
Total Netherlands		6,476
(Cost \$6,766)		
NIGERIA 3.1%		
SOVEREIGN ISSUES 3.1%		
Nigeria Government Bond		
5.125% due 07/12/2018	700	704
6.375% due 07/12/2023 (f)	7,000	7,388
6.500% due 11/28/2027	12,600	12,771
6.750% due 01/28/2021	200	211
7.143% due 02/23/2030	5,500	5,658
7.625% due 11/28/2047	1,200	1,235
7.696% due 02/23/2038	3,400	3,536
7.875% due 02/16/2032	1,500	1,621
Total Nigeria		33,124
(Cost \$33,252)		
OMAN 2.8%		
SOVEREIGN ISSUES 2.8%		
Oman Government International Bond		
4.750% due 08/15/2026	2,400	2,312
5.375% due 03/08/2027	9,500	8,448
5.625% due 01/17/2028	16,100	16,050
6.500% due 03/08/2047	3,000	2,948
Total Oman		29,758
(Cost \$29,976)		
PAKISTAN 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Pakistan Government International Bond		
6.875% due 12/05/2027	4,300	4,252
Total Pakistan		4,252
(Cost \$4,300)		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
PANAMA 2.0%		
SOVEREIGN ISSUES 2.0%		
Panama Government International Bond		
4.300% due 04/29/2053	\$ 9,000	\$ 8,896
8.125% due 04/28/2034	4,400	6,063
9.375% due 01/16/2023	4,500	5,740
Total Panama		20,699
(Cost \$18,983)		
PARAGUAY 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Paraguay Government International Bond		
4.625% due 01/25/2023	500	515
4.700% due 03/27/2027	1,800	1,822
6.100% due 08/11/2044	4,800	5,292
Total Paraguay		7,629
(Cost \$7,110)		
PERU 2.2%		
SOVEREIGN ISSUES 2.2%		
Corp. Financiera de Desarrollo S.A.		
4.750% due 02/08/2022	800	825
Fondo MIVIVIENDA S.A.		
3.500% due 01/31/2023	7,400	7,280
Peru Government International Bond		
6.550% due 03/14/2037	2,505	3,245
8.750% due 11/21/2033	8,208	12,415
Total Peru		23,765
(Cost \$22,869)		
QATAR 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Qatar Government International Bond		
4.500% due 01/20/2022	4,800	4,956
Total Qatar		4,956
(Cost \$5,040)		
ROMANIA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Romania Government International Bond		
2.750% due 10/29/2025	EUR 2,200	2,913
2.875% due 05/26/2028	1,700	2,168
Total Romania		5,081
(Cost \$4,367)		
RUSSIA 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
SCF Capital Designated Activity Co.		
5.375% due 06/16/2023	\$ 2,400	2,443
Total Russia		2,443
(Cost \$2,400)		
SAUDI ARABIA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Saudi Government International Bond		
2.875% due 03/04/2023	4,000	3,860
3.625% due 03/04/2028	4,000	3,814
Total Saudi Arabia		7,674
(Cost \$7,930)		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
SENEGAL 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Senegal Government International Bond		
6.250% due 05/23/2033	\$ 1,700	\$ 1,690
Total Senegal		1,690
(Cost \$1,700)		
SERBIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Serbia International Bond		
4.875% due 02/25/2020	4,100	4,201
Total Serbia		4,201
(Cost \$4,207)		
SINGAPORE 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
BOC Aviation Ltd.		
2.750% due 09/18/2022	4,000	3,836
Total Singapore		3,836
(Cost \$3,980)		
SLOVENIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Slovenia Government International Bond		
5.250% due 02/18/2024	3,450	3,805
5.500% due 10/28/2022	300	330
5.650% due 05/10/2023	500	562
Total Slovenia		4,697
(Cost \$4,721)		
SOUTH AFRICA 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Eskom Holdings SOC Ltd.		
6.750% due 08/06/2023	2,600	2,691
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
South Africa Government International Bond		
4.300% due 10/12/2028	7,000	6,602
4.665% due 01/17/2024	4,600	4,661
4.875% due 04/14/2026 (f)	1,300	1,306
5.375% due 07/24/2044	1,600	1,544
Total South Africa		16,804
(Cost \$17,288)		
SPAIN 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Autonomous Community of Catalonia		
4.900% due 09/15/2021	EUR 3,100	4,057
Total Spain		4,057
(Cost \$3,541)		
SRI LANKA 2.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
National Savings Bank		
5.150% due 09/10/2019	\$ 5,400	5,446
8.875% due 09/18/2018	500	513
Total Sri Lanka		5,959

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 2.3%		
Sri Lanka Government International Bond		
5.125% due 04/11/2019	\$ 400	\$ 404
6.000% due 01/14/2019	200	203
6.200% due 05/11/2027	2,700	2,687
6.250% due 10/04/2020	12,200	12,674
6.250% due 07/27/2021	8,315	8,634
		24,602
Total Sri Lanka		30,561
(Cost \$29,909)		
SUPRANATIONAL 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Africa Finance Corp.		
4.375% due 04/29/2020	1,400	1,420
Total Supranational		1,420
(Cost \$1,394)		
TANZANIA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Tanzania Government International Bond		
7.452% due 03/09/2020	4,667	4,872
Total Tanzania		4,872
(Cost \$4,709)		
TRINIDAD AND TOBAGO 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Petroleum Co. of Trinidad & Tobago Ltd.		
6.000% due 05/08/2022	4,020	4,065
Total Trinidad and Tobago		4,065
(Cost \$4,019)		
TUNISIA 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Banque Centrale de Tunisie International Bond		
3.280% due 08/09/2027	¥ 1,600,000	12,226
Total Tunisia		12,226
(Cost \$14,583)		
TURKEY 2.5%		
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
Export Credit Bank of Turkey		
5.375% due 10/24/2023	\$ 2,600	2,609
Turkey Government International Bond		
5.125% due 02/17/2028	200	191
5.750% due 05/11/2047	9,200	8,338
6.000% due 03/25/2027	800	821
6.750% due 05/30/2040	7,400	7,713
6.875% due 03/17/2036	500	529
7.250% due 03/05/2038	6,100	6,718
Total Turkey		26,919
(Cost \$28,406)		

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UKRAINE 3.5%		
SOVEREIGN ISSUES 3.5%		
Ukraine Government International Bond		
0.000% due 05/31/2040	\$ 2,100	\$ 1,427
7.375% due 09/25/2032	3,100	3,015
7.750% due 09/01/2020	11,000	11,583
7.750% due 09/01/2021	8,700	9,224
7.750% due 09/01/2022	700	740
7.750% due 09/01/2023	2,500	2,624
7.750% due 09/01/2024	3,900	4,056
7.750% due 09/01/2027	4,800	4,940
Total Ukraine		37,619
(Cost \$35,624)		
UNITED KINGDOM 0.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC		
9.375% due 03/10/2023	2,231	2,365
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC		
9.625% due 04/27/2022	4,350	4,636
Total United Kingdom		7,001
(Cost \$6,752)		
UNITED STATES 0.3%		
U.S. GOVERNMENT AGENCIES 0.3%		
Federal Home Loan Bank		
4.125% due 12/13/2019	3,465	3,589
Total United States		3,589
(Cost \$3,557)		
URUGUAY 2.3%		
SOVEREIGN ISSUES 2.3%		
Uruguay Government International Bond		
7.625% due 03/21/2036	10,890	15,071
7.875% due 01/15/2033	6,640	9,221
Total Uruguay		24,292
(Cost \$21,692)		
VENEZUELA 1.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.500% due 04/12/2037 (c)	20,990	5,363
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Venezuela Government International Bond (c)		
6.000% due 12/09/2020	1,920	514
7.000% due 03/31/2038 (f)	10,900	2,916
7.650% due 04/21/2025	9,610	2,619
9.250% due 09/15/2027	4,520	1,288
11.950% due 08/05/2031	340	99
		7,436
Total Venezuela		12,799
(Cost \$30,948)		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 12.1%		
REPURCHASE AGREEMENTS (e) 3.4%		
		36,400
TIME DEPOSITS 0.2%		
ANZ National Bank		
0.930% due 03/01/2018	292	292
Bank of Nova Scotia		
0.930% due 03/01/2018	418	418

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.		
0.310% due 03/01/2018	¥ 33	\$ 0
Brown Brothers Harriman & Co.		
0.230% due 03/01/2018	GBP 0	1
Citibank N.A.		
0.930% due 03/01/2018	\$ 150	150
DBS Bank Ltd.		
0.930% due 03/01/2018	3	3
Deutsche Bank AG		
0.930% due 03/01/2018	147	147
DnB NORBank ASA		
0.930% due 03/01/2018	279	279
HSBC Bank		
0.230% due 03/01/2018	GBP 17	23
5.950% due 03/01/2018	ZAR 5	0
JPMorgan Chase & Co.		
0.930% due 03/01/2018	\$ 290	290
National Australia Bank Ltd.		
0.930% due 03/01/2018	11	11
Royal Bank of Canada		
0.930% due 03/01/2018	4	4
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.310% due 03/01/2018	¥ 5	0
0.930% due 03/01/2018	\$ 1	1
Wells Fargo Bank		
0.930% due 03/01/2018	1	0
		1,619
ARGENTINA TREASURY BILLS 1.2%		
2.810% due 03/16/2018	4,200	4,196
2.820% due 05/24/2018	3,700	3,677
2.830% due 05/11/2018	5,200	5,172
		13,045
JAPAN TREASURY BILLS 7.3%		
0.163% due 05/21/2018 (d)	¥ 6,750,000	63,286
0.160% due 05/01/2018 (d)	250,000	2,344
0.154% due 04/23/2018	100,000	937
0.152% due 05/14/2018	1,170,000	10,969
		77,536
Total Short-Term Instruments		128,600
(Cost \$128,530)		
Total Investments 99.9%		\$ 1,060,173
(Cost \$1,053,480)		
Financial Derivative Instruments (g)(i) 0.1%		
(Cost or Premiums, net \$(1,177))		
		1,118
Other Assets and Liabilities, net 0.0%		
		85
Net Assets 100.0%		\$1,061,376

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

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
 ** Contingent convertible security.
 (a) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
 (b) When-Issued security.
 (c) Security is in default.
 (d) Coupon represents a weighted average rate.

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(e) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保債権	担保受取価値	レポ価値	レポ契約の受取 ⁽¹⁾
RDR	1.510%	02/28/2018	03/01/2018	\$ 36,400	U.S. Treasury Notes 3.625% due 02/15/2020; U.S. Treasury Notes 3.625% due 08/15/2019	\$ (37,166)	\$ 36,400	\$ 36,402
Total Repurchase Agreements						\$ (37,166)	\$ 36,400	\$ 36,402

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利	借入日	満期日 ⁽²⁾	借入金額 ⁽³⁾	リバースレポの支払
BRC	1.000%	02/16/2018	N/A	\$ (506)	\$ (506)
JML	(0.500%)	02/02/2018	N/A	(1,403)	(1,403)
JML	0.750%	02/09/2018	N/A	(613)	(613)
JML	1.000%	02/16/2018	N/A	(785)	(785)
JML	1.050%	01/24/2018	N/A	(1,132)	(1,134)
MEI	0.500%	02/23/2018	N/A	(4,005)	(4,005)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (8,448)

⁽²⁾ Open maturity reverse repurchase agreement.

⁽³⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 28, 2018 was \$3,167 at a weighted average interest rate of (0.001%). Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	満期までの残存期間				合計
	オーバーナイト取引	30日以内	31-90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1,134)	\$ (1,134)
Non - U.S. Government Debt	0	0	0	(7,312)	(7,312)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (8,448)	\$ (8,448)
Total Borrowings	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (8,448)	\$ (8,448)
Payable for Reverse Repurchase Agreements					\$ (8,448)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of February 28, 2018:

(f) **Securities with an aggregate market value of \$8,346 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 28, 2018.**

取引相手	レポ契約の受取	リバースレポの支払	売付買戻取引の支払	空売りの支払	合計借入 その他金融取引	担保の (受取)差入れ	ネット エクスポージャー ⁽⁴⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BRC	\$ 0	\$ (506)	\$ 0	\$ 0	\$ (506)	\$ 470	\$ (36)
JML	0	(3,935)	0	0	(3,935)	3,865	(70)
MEI	0	(4,005)	0	0	(4,005)	4,011	6
RDR	36,402	0	0	0	36,402	(37,166)	(764)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 36,402	\$ (8,446)	\$ 0	\$ 0			

¹⁶ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

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

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価益	変動証拠金	
					資産	負債
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Short	06/2018	63	\$ 7	\$ 0	\$ 0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2018	665	14	166	0
Total Futures Contracts				\$ 21	\$ 166	\$ 0

SWAP AGREEMENTS:

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.600%	03/16/2021	\$ 44,700	\$ (137)	\$ (96)	\$ 12	\$ 0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.643%	03/16/2022	44,700	123	87	0	(19)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2027	24,600	(2,853)	(986)	72	0
Total Swap Agreements					\$ (2,867)	\$ (995)	\$ 84	\$ (19)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 28, 2018:

(h) Cash of \$2,198 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 28, 2018. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格	変動証拠金資産			市場価格	変動証拠金負債		
		買いオプション	先物	スワップ		合計	売りオプション	先物
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 166	\$ 84	\$ 260	\$ 0	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)

(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益			
				資産	負債		
BPS	03/2018	EUR	\$ 37,072	\$ 46,048	\$ 833	\$ 0	
BPS	03/2018	\$	3,594	EUR	2,911	0	(43)
BRC	03/2018		1,004	JPY	107,800	6	0
CBK	03/2018	EUR	1,528	\$	1,904	40	0
CBK	04/2018	JPY	100,000		907	0	(34)
CBK	05/2018		180,000		1,656	0	(40)
CBK	05/2018		200,000		1,840	0	(42)
GLM	03/2018	\$	44,022	EUR	35,689	0	(494)
GLM	04/2018	EUR	35,689	\$	44,131	485	0
MSB	03/2018	\$	11,706	JPY	1,248,939	0	(2)
MSB	04/2018	JPY	1,248,939	\$	11,734	0	0
MSB	05/2018		730,000		6,708	0	(169)
MSB	05/2018		6,750,000		63,704	87	0
NAB	03/2018		1,356,739		12,481	0	(233)
UAG	05/2018		50,000		459	0	(11)
UAG	05/2018		260,000		2,392	0	(57)
Total Forward Foreign Currency Contracts					\$ 1,451	\$ (1,125)	

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - BUY PROTECTION⁽¹⁾

取引相手	参照債券	固定支払金利	満期日	2018年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム支払	未実現評価損	スワップの価値	
								資産	負債
CBK	Turkey Government International Bond	(1.000%)	09/20/2020	0.979%	\$ 1,300	\$ 113	\$ (117)	\$ 0	\$ (4)
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	09/20/2020	0.979%	1,300	112	(115)	0	(3)
						\$ 225	\$ (232)	\$ 0	\$ (7)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

取引相手	参照債券	固定受取金利	満期日	2018年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価損(損)益	スワップの価値	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.486%	\$ 3,000	\$ (94)	\$ 112	\$ 18	\$ 0
BOA	Qatar Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.824%	7,500	17	57	74	0
BOA	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2020	0.597%	1,000	(124)	137	13	0
BPS	Brazilian Government International Bond	1.000%	03/20/2018	0.377%	4,900	5	6	11	0
BPS	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2018	0.290%	1,000	8	(3)	5	0
BRC	Egypt Government International Bond	1.000%	12/20/2019	1.651%	7,800	(89)	15	0	(74)
BRC	Egypt Government International Bond	1.000%	06/20/2018	0.989%	3,700	(16)	23	7	0
BRC	Qatar Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.220%	3,300	22	6	28	0
BRC	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.743%	500	(2)	9	7	0
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2021	1.113%	4,000	(285)	277	0	(8)
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2022	1.300%	1,900	(89)	70	0	(19)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.285%	900	(9)	15	6	0
CBK	Nigeria Government International Bond	1.000%	08/20/2018	1.757%	1,000	(10)	7	0	(3)
CBK	Philippine Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.631%	12,600	223	11	234	0
CBK	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.743%	6,800	(13)	97	84	0
DUB	Malaysia Government International Bond	1.000%	03/20/2020	0.280%	2,000	(17)	50	33	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.285%	5,700	(47)	91	44	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2019	0.359%	2,100	10	11	21	0
GST	Qatar Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.220%	5,100	26	17	43	0
GST	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2020	0.597%	3,800	(471)	520	49	0
HUS	Brazil Government International Bond	1.000%	03/20/2018	0.377%	8,500	20	0	20	0
HUS	Qatar Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.220%	1,700	10	4	14	0
HUS	South Africa Government International Bond	1.000%	03/20/2023	1.532%	3,800	(393)	307	0	(86)
MYC	Qatar Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.824%	1,700	(3)	20	17	0
NGF	Egypt Government International Bond	1.000%	12/20/2018	1.256%	7,000	(45)	44	0	(1)
NGF	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.743%	2,600	(23)	55	32	0
NGF	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2021	1.113%	200	(13)	12	0	(1)
						\$ (1,402)	\$ 1,970	\$ 760	\$ (192)
Total Swap Agreements						\$ (1,177)	\$ 1,798	\$ 760	\$ (199)

⁽¹⁾ If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

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

⁽³⁾ Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

⁽⁴⁾ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

マネー・マーケット・マザーファンド

《第28期》決算日2018年11月20日

[計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月20日に第28期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第28期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
24期(2016年11月21日)	10,184	0.0	24.4	—	4,420
25期(2017年5月22日)	10,184	0.0	—	—	1,681
26期(2017年11月20日)	10,184	0.0	—	—	1,266
27期(2018年5月21日)	10,184	0.0	—	—	1,269
28期(2018年11月20日)	10,183	△0.0	—	—	1,882

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率
(期首) 2018年5月21日	10,184	—	—	—
5月末	10,184	0.0	—	—
6月末	10,184	0.0	—	—
7月末	10,184	0.0	—	—
8月末	10,184	0.0	—	—
9月末	10,183	△0.0	—	—
10月末	10,183	△0.0	—	—
(期末) 2018年11月20日	10,183	△0.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

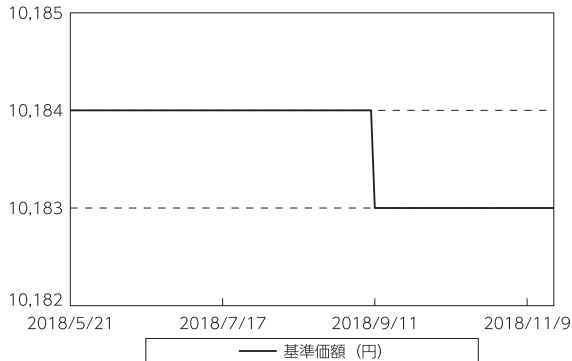
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.01%の下落となりました。

基準価額等の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、2018年11月20日のコール・レートは-0.066%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は下落となりました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日銀の物価目標である2%には届かないと思われます。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2018年5月22日～2018年11月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,183円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2018年5月22日～2018年11月20日)

その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
国 内	コマーシャル・ペーパー	千円 164,899,918	千円 164,299,921

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月22日～2018年11月20日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2018年11月20日現在)

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,799,999	% 95.6

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2018年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 1,799,999	% 95.6
コール・ローン等、その他	82,984	4.4
投資信託財産総額	1,882,983	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	1,882,983,572
コール・ローン等	82,984,049
其他有価証券(評価額)	1,799,999,523
(B) 負債	140,959
未払解約金	140,557
未払利息	167
其他未払費用	235
(C) 純資産総額(A-B)	1,882,842,613
元本	1,848,959,925
次期繰越損益金	33,882,688
(D) 受益権総口数	1,848,959,925口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,183円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,246,790,223円
 期中追加設定元本額 891,597,773円
 期中一部解約元本額 289,428,071円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0183円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	334,544,012円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	2,280,337円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	5,874,002円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,048,688円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	111,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	20,147,276円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	52,804,813円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	635,856円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	3,078,471円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	149,179,043円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	89,620円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	16,402,315円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	2,272,200円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	15,211,722円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	270,734円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	667,045円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	275,663円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	1,049,877円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	5,850,843円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	2,016,707円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,513,806円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,182,898円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	84,006,970円

○損益の状況 (2018年5月22日～2018年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 29,356
受取利息	3,679
支払利息	△ 33,035
(B) 保管費用等	△ 235
(C) 当期損益金(A+B)	△ 29,591
(D) 前期繰越損益金	22,896,956
(E) 追加信託差損益金	16,324,880
(F) 解約差損益金	△ 5,309,557
(G) 計(C+D+E+F)	33,882,688
次期繰越損益金(G)	33,882,688

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

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

三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	847, 016円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	600, 566円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	992, 946円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	1, 979, 971円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	140, 355円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	990, 683円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	19, 635, 282円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	6, 336, 371円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	11, 400, 264円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98, 368円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	12, 561, 714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	50, 290円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	99, 465円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	69, 757円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	30, 457円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	641, 668円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1, 559, 264円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	4, 881, 309円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19, 658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 828, 976円
PIMCO ニューワールドインカム分散コース<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	7, 717, 476円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	348, 598円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1, 936, 118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9, 829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9, 829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	5, 504, 257円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	13, 128, 307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	2, 424, 660円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	9, 340, 694円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	3, 123, 514円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	6, 722, 976円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (毎月分配型)	13, 206, 980円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	2, 304, 081円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	4, 117, 720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	421, 681円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	961, 645円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608, 110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	734, 038円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型)	1, 043, 194円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	37, 783, 200円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	979, 528円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	5, 144, 832円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8, 859, 081円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1, 609, 969円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2, 065, 331円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	40, 261円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	50, 083円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	3, 828, 727円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9, 387, 547円

三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	109,051円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	8,478,079円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	8,067,104円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	3,319,056円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	20,075,917円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	5,899,118円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	10,826,836円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	2,026,238円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	128,636円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	79,540円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	698,261円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	564,702円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	89,371円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3,063,931円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6,324,266円
三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2030 (確定拠出年金)	2,399,448円
マクロー・トータル・リターン・ファンド	9,820円
スマート・プロテクター90 (限定追加型) 2016-12	6,313,826円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジあり)	412,412円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジなし)	1,188,139円
スマート・プロテクター90オープン	981,933円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	609,781円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (資産成長型)	305,382円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,683,229円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (年2回決算型)	17,656,128円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	5,843,481円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (年2回決算型)	25,393,755円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	36,457円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
北欧小型株ファンド (為替ヘッジあり)	9,821円
北欧小型株ファンド (為替ヘッジなし)	9,821円
N a v i o インド債券ファンド	296,406円
N a v i o マネーボールファンド	5,223,339円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11,293,333円
マネーボールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,988,373円
MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,042,045円

ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）	11,784,347円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース（為替ヘッジなし）	10,766,608円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）	21,620,196円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	417,607,779円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020	225,031,917円
合計	1,848,959,925円