

## 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	2026年6月12日まで（2013年5月29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バミューダ エマーシング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY) の投資信託証券への投資を通じて、米ドル建ての新興国の高利回り社債等に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。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、トルコリラ買いの為替取引を行います（このため、基準価額はトルコリラ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)	ピムコ バミューダ エマーシング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY) 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 バミューダ エマーシング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)	ピムコ バミューダ エマーシング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド (M) への投資を通じて、米ドル建ての新興国の高利回り社債およびその派生商品等を主要投資対象とします。
	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。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

※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)

愛称：グローイング・スター



第110期（決算日：2022年7月13日）  
 第111期（決算日：2022年8月15日）  
 第112期（決算日：2022年9月13日）  
 第113期（決算日：2022年10月13日）  
 第114期（決算日：2022年11月14日）  
 第115期（決算日：2022年12月13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)」は、去る12月13日に第115期の決算を行いましたので、法令に基づいて第110期～第115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）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		騰落 率	債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投資 証 組 入 比	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分 込 配	み 金								
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
86期(2020年7月13日)	2,757	25	1.3	—	—	—	—	—	99.0	—	2,485
87期(2020年8月13日)	2,661	25	△ 2.6	—	—	—	—	—	99.0	—	2,361
88期(2020年9月14日)	2,621	25	△ 0.6	—	—	—	—	—	99.0	—	2,264
89期(2020年10月13日)	2,443	25	△ 5.8	—	—	—	—	—	99.0	—	2,048
90期(2020年11月13日)	2,537	25	4.9	—	—	—	—	—	99.1	—	2,059
91期(2020年12月14日)	2,553	25	1.6	—	—	—	—	—	99.0	—	2,060
92期(2021年1月13日)	2,701	25	6.8	—	—	—	—	—	99.0	—	2,150
93期(2021年2月15日)	2,935	25	9.6	—	—	—	—	—	99.0	—	2,280
94期(2021年3月15日)	2,812	25	△ 3.3	—	—	—	—	—	99.0	—	2,160
95期(2021年4月13日)	2,653	25	△ 4.8	—	—	—	—	—	99.0	—	2,009
96期(2021年5月13日)	2,606	25	△ 0.8	—	—	—	—	—	99.0	—	1,943
97期(2021年6月14日)	2,682	25	3.9	—	—	—	—	—	99.0	—	1,947
98期(2021年7月13日)	2,617	25	△ 1.5	—	—	—	—	—	99.0	—	1,877
99期(2021年8月13日)	2,652	25	2.3	—	—	—	—	—	99.0	—	1,883
100期(2021年9月13日)	2,712	25	3.2	—	—	—	—	—	99.0	—	1,868
101期(2021年10月13日)	2,558	25	△ 4.8	—	—	—	—	—	99.0	—	1,719
102期(2021年11月15日)	2,337	25	△ 7.7	—	—	—	—	—	98.2	—	1,555
103期(2021年12月13日)	1,659	25	△27.9	—	—	—	—	—	99.0	—	1,069
104期(2022年1月13日)	1,716	25	4.9	—	—	—	—	—	99.0	—	1,080
105期(2022年2月14日)	1,747	25	3.3	—	—	—	—	—	99.0	—	1,053
106期(2022年3月14日)	1,462	25	△14.9	—	—	—	—	—	99.0	—	871
107期(2022年4月13日)	1,679	25	16.6	—	—	—	—	—	99.0	—	996
108期(2022年5月13日)	1,546	25	△ 6.4	—	—	—	—	—	98.9	—	922
109期(2022年6月13日)	1,475	25	△ 3.0	—	—	—	—	—	99.0	—	881
110期(2022年7月13日)	1,441	10	△ 1.6	—	—	—	—	—	99.0	—	918
111期(2022年8月15日)	1,506	10	5.2	—	—	—	—	—	99.0	—	952
112期(2022年9月13日)	1,598	10	6.8	—	—	—	—	—	99.0	—	1,013
113期(2022年10月13日)	1,584	10	△ 0.3	—	—	—	—	—	99.0	—	988
114期(2022年11月14日)	1,579	10	0.3	—	—	—	—	—	99.0	—	972
115期(2022年12月13日)	1,662	10	5.9	—	—	—	—	—	99.0	—	1,019

(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	託 券 率
			騰 落 率	率						
第110期	(期 首) 2022年6月13日	円		%	%	%	%	%	%	99.0
	6月末	1,475		—	—	—	—	—	—	99.1
	(期 末) 2022年7月13日	1,547		4.9	—	—	—	—	—	99.1
第111期	(期 首) 2022年7月13日	1,451		△1.6	—	—	—	—	—	99.0
	7月末	1,441		—	—	—	—	—	—	99.0
	(期 末) 2022年8月15日	1,425		△1.1	—	—	—	—	—	99.1
第112期	(期 首) 2022年8月15日	1,516		5.2	—	—	—	—	—	99.0
	8月末	1,506		—	—	—	—	—	—	99.0
	(期 末) 2022年9月13日	1,547		2.7	—	—	—	—	—	99.3
第113期	(期 首) 2022年9月13日	1,608		6.8	—	—	—	—	—	99.0
	9月末	1,598		—	—	—	—	—	—	99.0
	(期 末) 2022年10月13日	1,537		△3.8	—	—	—	—	—	99.1
第114期	(期 首) 2022年10月13日	1,594		△0.3	—	—	—	—	—	99.0
	10月末	1,584		—	—	—	—	—	—	99.0
	(期 末) 2022年11月14日	1,602		1.1	—	—	—	—	—	99.0
第115期	(期 首) 2022年11月14日	1,589		0.3	—	—	—	—	—	99.0
	11月末	1,579		—	—	—	—	—	—	99.0
	(期 末) 2022年12月13日	1,628		3.1	—	—	—	—	—	99.2
		1,672		5.9	—	—	—	—	—	99.0

(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。

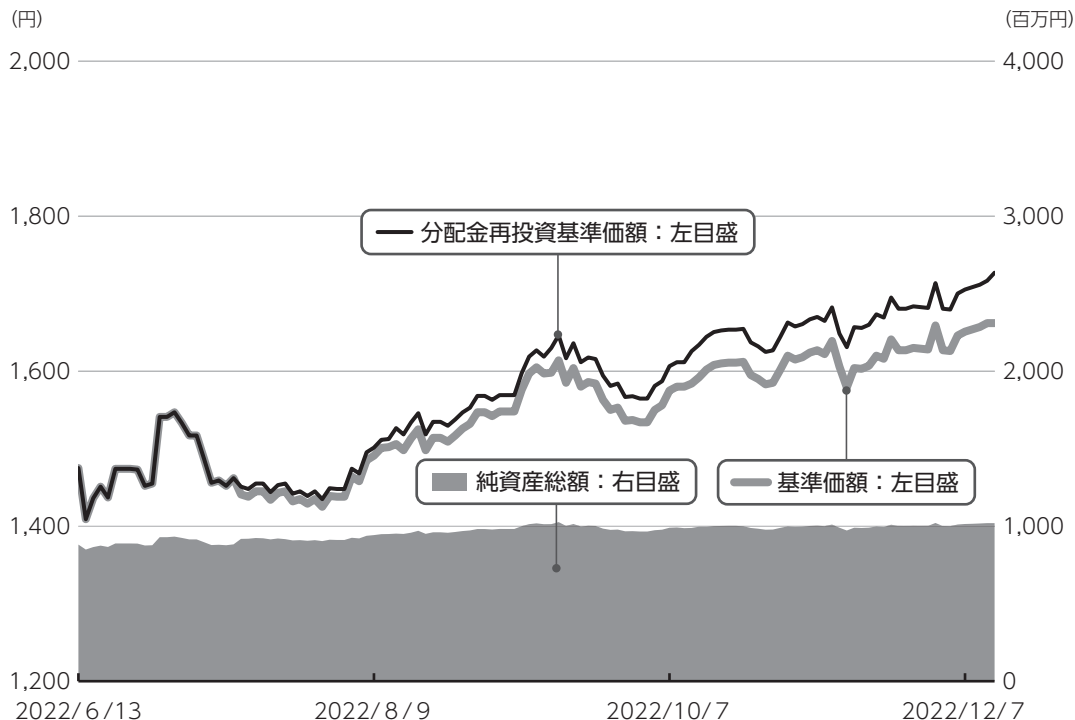
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第110期～第115期：2022年6月14日～2022年12月13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110期首	1,475円
第115期末	1,662円
既払分配金	60円
騰落率	17.1%

(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17.1% (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

為替取引によるプレミアム (金利差相当分の収益) の獲得等が基準価額の上昇要因となりました。

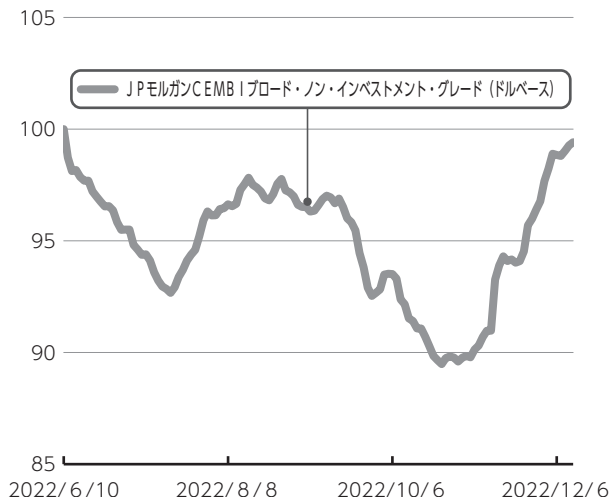
#### 下落要因

新興国高利回り社債市況が下落したことや、トルコリラが円に対して下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

第110期～第115期：2022年6月14日～2022年12月13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)

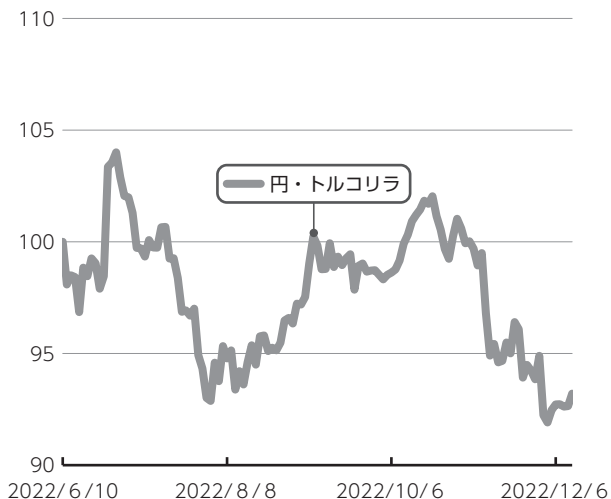


▶ **債券市況**  
**新興国高利回り社債市況は下落しました。**  
 当作成期は、米国の金利上昇に対する懸念や、新興国の信用リスクへの懸念の高まり等を背景に、市場参加者のリスク回避姿勢が強まったこと等から、新興国高利回り社債市況は下落しました。

(注) 現地日付ベースで記載しております。

(注) JPモルガンCEMBIブロード・ノン・インベストメント・グレードとは、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社債(非投資適格)の代表的な指数です。

## 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

**トルコリラは対円で下落しました。**

当作成期を通じてみると、トルコ中央銀行による利下げ等を背景に、トルコリラは対円で下落しました。

### ▶ 国内短期金融市場

**無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。**

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、足下のコール・レートは-0.075%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)

円建ての外国投資信託への投資を通じて、米ドル建ての新興国の高利回り社債を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざしました。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。

### ▶ ピムコ バミューダ エマージングマーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)

米ドル建ての新興国の高利回り社債等に投資を行いました。

### 国別・セクター配分戦略

国別選択では、格付対比で利回りが魅力的である南アフリカ等を積極方針とした一方、利回り面での魅力が乏しいことなどを踏まえ、フィリピン等を消極姿勢としました。

保有外貨建て資産に対しては、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行いました。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド  
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めざした運用を行いました。



## 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、1万円当たり、税込み)

項目	第110期 2022年6月14日~ 2022年7月13日	第111期 2022年7月14日~ 2022年8月15日	第112期 2022年8月16日~ 2022年9月13日	第113期 2022年9月14日~ 2022年10月13日	第114期 2022年10月14日~ 2022年11月14日	第115期 2022年11月15日~ 2022年12月13日
当期分配金 (対基準価額比率)	<b>10</b> (0.689%)	<b>10</b> (0.660%)	<b>10</b> (0.622%)	<b>10</b> (0.627%)	<b>10</b> (0.629%)	<b>10</b> (0.598%)
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	1,806	1,821	1,836	1,849	1,862	1,878

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

## 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)

円建て外国投資信託への投資を通じて米ドル建ての新興国高利回り社債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・マザーファンドの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 バミューダ エマージングマーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)

新興国への投資に際しては、一部の国では米連邦準備制度理事会 (FRB) に先立って利上げを開始したことに加え、資源価格の上昇が落ち着いてきたことなどからインフレがピークアウトの兆しをみせており、2023年の成長率は2022年からやや持ち直すとの見通しです。ただし、エマージング諸国間において金融・財政政策、国内の政治情勢、地政学リスクの影響度合いの観点からパフォーマンスには大きな差異が生じるものとみており、投資対象の選別がより一層重要になると考えています。ファンダメンタルズが良好な国の中では、安定した現金創出能力と国際競争力を有し、バリュエーション

上魅力がある则认为企業を選好します。実際の投資に際しては格付対比で利回りが魅力的である南アフリカ等を積極方針とします。一方、利回り面での魅力が乏しいことなどを踏まえ、フィリピン等を消極姿勢とします。

なお、引き続き、保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、トルコリラ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

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン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。

2022年6月14日~2022年12月13日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第110期~第115期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	15	0.943	(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 )	(9)	(0.590)	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 )	(5)	(0.331)	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 )	(0)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	15	0.945	

作成期中の平均基準価額は、1,545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。

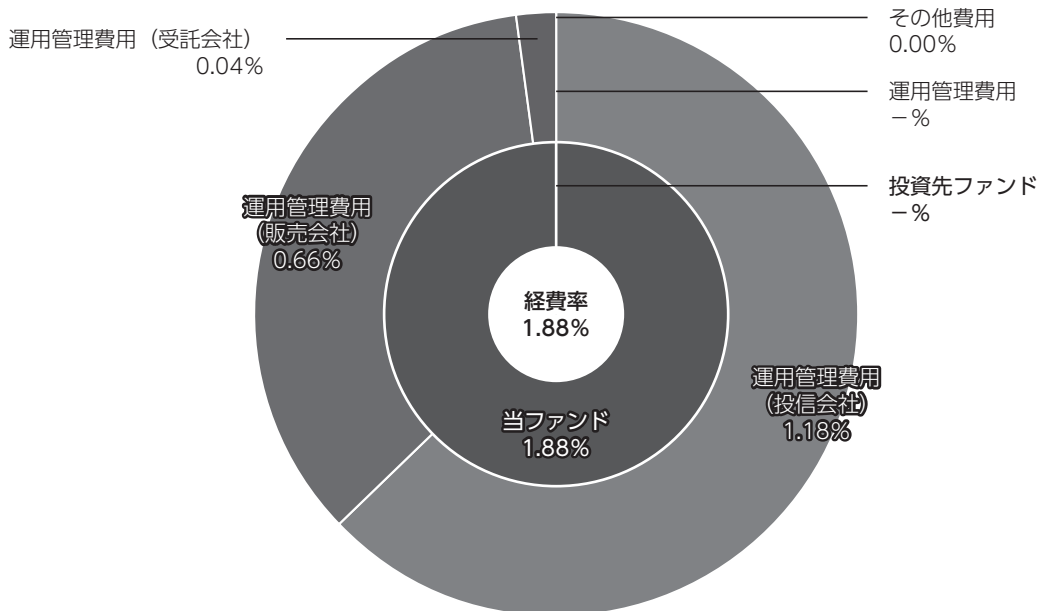
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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)

## ■経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**経費率（年率）は1.88%**です。



経費率 (①+②)	(%)	1.88
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.88
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	－

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2022年6月14日～2022年12月13日)

### 投資信託証券

銘柄		第110期～第115期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ビムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)	千口 161	千円 151,366	千口 85	千円 82,780

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年6月14日～2022年12月13日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2022年12月13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109期末	第115期末		
		口数	口数	評価額	比率
	ビムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)	千口 936	千口 1,011	千円 1,009,770	% 99.0
合 計		936	1,011	1,009,770	99.0

(注) 比率は三菱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) の純資産総額に対する比率。

### 親投資信託残高

銘柄		第109期末	第115期末	
		口数	口数	評価額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 1,149	千口 1,149	千円 1,170

## ○投資信託財産の構成

(2022年12月13日現在)

項 目	第115期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 1,009,770	% 98.2
マネー・マーケット・マザーファンド	1,170	0.1
コール・ローン等、その他	17,006	1.7
投資信託財産総額	1,027,946	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第110期末	第111期末	第112期末	第113期末	第114期末	第115期末
	2022年7月13日現在	2022年8月15日現在	2022年9月13日現在	2022年10月13日現在	2022年11月14日現在	2022年12月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	968,828,083	960,040,908	1,021,426,009	1,002,452,261	981,543,517	1,027,946,709
コール・ローン等	58,566,170	5,235,774	5,567,796	14,242,391	8,012,206	5,726,105
投資信託受益証券(評価額)	909,091,765	943,004,986	1,003,338,065	979,259,722	962,511,163	1,009,770,571
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,170,148	1,170,148	1,170,148	1,170,148	1,170,148	1,170,033
未収入金	—	10,630,000	11,350,000	7,780,000	9,850,000	11,280,000
(B) 負債	50,690,763	7,892,328	8,217,122	13,669,489	9,289,827	8,271,758
未払金	42,740,000	—	—	—	—	—
未払収益分配金	6,372,671	6,321,163	6,340,735	6,241,399	6,156,712	6,135,761
未払解約金	199,999	—	413,592	5,892,970	1,490,015	633,760
未払信託報酬	1,375,683	1,568,421	1,460,240	1,532,423	1,640,215	1,499,605
未払利息	8	1	6	17	17	13
その他未払費用	2,402	2,743	2,549	2,680	2,868	2,619
(C) 純資産総額(A-B)	918,137,320	952,148,580	1,013,208,887	988,782,772	972,253,690	1,019,674,951
元本	6,372,671,779	6,321,163,259	6,340,735,905	6,241,399,547	6,156,712,984	6,135,761,789
次期繰越損益金	△5,454,534,459	△5,369,014,679	△5,327,527,018	△5,252,616,775	△5,184,459,294	△5,116,086,838
(D) 受益権総口数	6,372,671,779口	6,321,163,259口	6,340,735,905口	6,241,399,547口	6,156,712,984口	6,135,761,789口
1万口当たり基準価額(C/D)	1,441円	1,506円	1,598円	1,584円	1,579円	1,662円

○損益の状況

項 目	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期	第115期
	2022年6月14日～ 2022年7月13日	2022年7月14日～ 2022年8月15日	2022年8月16日～ 2022年9月13日	2022年9月14日～ 2022年10月13日	2022年10月14日～ 2022年11月14日	2022年11月15日～ 2022年12月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	15,103,094	16,041,297	16,228,199	16,111,632	15,987,228	16,088,934
受取配当金	15,103,302	16,041,371	16,228,375	16,112,114	15,987,812	16,089,483
受取利息	4	—	—	2	—	—
支払利息	△ 212	△ 74	△ 176	△ 484	△ 584	△ 549
(B) 有価証券売買損益	△ 28,500,831	33,271,606	49,645,332	△ 16,877,178	△ 11,315,433	42,253,308
売買益	4,737	33,274,523	49,734,662	361,397	49,441	42,425,140
売買損	△ 28,505,568	△ 2,917	△ 89,330	△ 17,238,575	△ 11,364,874	△ 171,832
(C) 信託報酬等	△ 1,378,085	△ 1,571,614	△ 1,462,789	△ 1,535,103	△ 1,643,083	△ 1,502,224
(D) 当期繰越損益 (A+B+C)	△ 14,775,822	47,741,739	64,410,742	△ 2,300,649	3,028,712	56,840,018
(E) 前期繰越損益金	△1,598,322,886	△1,599,968,759	△1,549,700,187	△1,462,854,454	△1,446,248,643	△1,439,280,591
(F) 追加信託差損益金	△3,835,063,080	△3,810,466,496	△3,835,896,838	△3,781,220,273	△3,735,082,651	△3,727,510,504
(配当等相当額)	( 525,206,745)	( 523,442,967)	( 530,573,602)	( 524,558,308)	( 519,658,769)	( 520,124,785)
(売買損益相当額)	(△4,360,269,825)	(△4,333,909,463)	(△4,366,470,440)	(△4,305,778,581)	(△4,254,741,420)	(△4,247,635,289)
(G) 計 (D+E+F)	△5,448,161,788	△5,362,693,516	△5,321,186,283	△5,246,375,376	△5,178,302,582	△5,109,951,077
(H) 収益分配金	△ 6,372,671	△ 6,321,163	△ 6,340,735	△ 6,241,399	△ 6,156,712	△ 6,135,761
次期繰越損益金 (G+H)	△5,454,534,459	△5,369,014,679	△5,327,527,018	△5,252,616,775	△5,184,459,294	△5,116,086,838
追加信託差損益金	△3,835,063,080	△3,810,466,496	△3,835,896,838	△3,781,220,273	△3,735,082,651	△3,727,510,504
(配当等相当額)	( 525,206,745)	( 523,442,967)	( 530,573,602)	( 524,558,308)	( 519,658,769)	( 520,124,785)
(売買損益相当額)	(△4,360,269,825)	(△4,333,909,463)	(△4,366,470,440)	(△4,305,778,581)	(△4,254,741,420)	(△4,247,635,289)
分配準備積立金	626,148,231	627,816,824	633,779,692	629,888,279	627,310,191	632,479,333
繰越損益金	△2,245,619,610	△2,186,365,007	△2,125,409,872	△2,101,284,781	△2,076,686,834	△2,021,055,667

(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 5,976,879,515円  
 作成期中追加設定元本額 546,119,724円  
 作成期中一部解約元本額 387,237,450円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.1662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5,116,086,838円です。

③分配金の計算過程

項 目	2022年6月14日～ 2022年7月13日	2022年7月14日～ 2022年8月15日	2022年8月16日～ 2022年9月13日	2022年9月14日～ 2022年10月13日	2022年10月14日～ 2022年11月14日	2022年11月15日～ 2022年12月13日
費用控除後の配当等収益額	13,725,007円	15,530,197円	15,867,767円	14,576,522円	14,344,139円	15,674,612円
費用控除後・繰越大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	525,206,745円	523,442,967円	530,573,602円	524,558,308円	519,658,769円	520,124,785円
分配準備積立金額	618,795,895円	618,607,790円	624,252,660円	621,553,156円	619,122,764円	622,940,482円
当ファンドの分配対象収益額	1,157,727,647円	1,157,580,954円	1,170,694,029円	1,160,687,986円	1,153,125,672円	1,158,739,879円
1万口当たり収益分配対象額	1,816円	1,831円	1,846円	1,859円	1,872円	1,888円
1万口当たり分配金額	10円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金金額	6,372,671円	6,321,163円	6,340,735円	6,241,399円	6,156,712円	6,135,761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、「三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ」の各信託(<マネーパルファンド>を除く)の信託財産の純資産総額の合計額に年10,000分の72.5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110期	第111期	第112期	第113期	第114期	第115期
1万口当たり分配金 (税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

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

## ◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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



<参考>投資する投資信託証券およびその概要

<b>ファンド名</b>	ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B - クラス J (TRY)
<b>運用方針</b>	ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド (M) への投資を通じて、米ドル建ての新興国の高利回り社債およびその派生商品等を実質的な投資を行い、信託財産の成長をめざします。
<b>主要運用対象</b>	米ドル建ての新興国の高利回り社債およびその派生商品等
<b>主な組入制限</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 通常、ファンドの80%以上を米ドル建ての新興国の高利回り社債に投資します。</li> <li>・ 一部、国債等にも投資を行う場合があります。</li> <li>・ 投資する公社債は原則として取得時においてCCC格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。</li> <li>・ 投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB-格相当以上に維持します。</li> <li>・ ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として0～8年の範囲で調整します。</li> <li>・ 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、純資産総額の5%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。</li> <li>・ 投資する公社債は、主に新興経済国の企業が発行する米ドル建て高利回り社債ですが、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。</li> <li>・ 限定的な範囲で米ドル建て以外の公社債等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。</li> <li>・ 保有外貨建て資産に対し、原則として、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行います。</li> </ul>
<b>決算日</b>	毎年6月30日
<b>分配方針</b>	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Bermuda Trust IV Annual Report June 30, 2022版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは「ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B」で掲載しています。また、「ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート 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 バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B

(2021年7月1日～2022年6月30日)

ピムコ バミューダ  
エマージング マーケット  
ハイ イールド コーポレート  
ボンド ファンド B  
千米ドル

<b>投資収入：</b>	
受取利息(外国税額控除後)*	38
収入合計	38
<b>費用：</b>	
支払利息	2
雑費	0
費用合計	2
<b>投資純収入</b>	<b>36</b>
<b>実現純利益(損失)：</b>	
投資有価証券(外国税額控除後)*	(6)
マスターファンド	7,026
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	10,249
外貨	71
実現純利益(損失)	17,340
<b>未実現評価益(評価損)の純変動：</b>	
投資有価証券	(1)
マスターファンド	(30,242)
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(13,228)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	(2)
未実現評価益(評価損)の純変動	(43,473)
純利益(損失)	(26,133)
<b>運用による純資産の純増(減)額</b>	<b>(26,097)</b>
*外国税	0

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド  
ファンド B

(2021年7月1日～2022年6月30日)

ピムコ バミューダ  
エマージング マーケット  
ハイ イールド コーポレート  
ボンド ファンド B

千米ドル

<b>純資産の増加（減少）：</b>	
<b>運用：</b>	
投資純収入	36
実現純利益（損失）	17,340
未実現評価益（評価損）の純変動	(43,473)
運用による純資産の純増（減）額	(26,097)
<b>分配：</b>	
J (AUD)	(885)
J (BRL)	(13,485)
J (IDR)	(174)
J (INR)	(196)
J (KRW)	(137)
J (MXN)	(788)
J (TRY)	(2,756)
J (ZAR)	(339)
合計	(18,760)
<b>ファンドユニット取引：</b>	
ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額	(32,363)
<b>純資産の増（減）額合計</b>	<b>(77,220)</b>
<b>純資産：</b>	
期首	187,579
期末	110,359

(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 バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボンド ファンド B

(2022年6月30日現在)

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 9.9%</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 9.9%</b>		
<b>TIME DEPOSITS 2.3%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
1.060% due 07/01/2022	\$ 64	\$ 64
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
1.060% due 07/01/2022	89	89
<b>BNP Paribas Bank</b>		
1.060% due 07/01/2022	2	2
<b>Citibank N.A.</b>		
1.060% due 07/01/2022	362	362
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
1.060% due 07/01/2022	305	305
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
1.060% due 07/01/2022	725	725
<b>Royal Bank of Canada</b>		
1.060% due 07/01/2022	34	34
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
1.060% due 07/01/2022	322	322
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
1.060% due 07/01/2022	688	688
		<u>2,591</u>
<b>U.S. TREASURY BILLS 7.6%</b>		
0.830% due 07/26/2022 (a)	1,000	999
0.955% due 08/02/2022 (b)	7,300	7,293
		<u>8,292</u>
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<u>10,883</u>
<b>(Cost \$10,884)</b>		
<b>Total Investments in Securities</b>		<u>10,883</u>
<b>(Cost \$10,884)</b>		
	口数 (単位:千)	
<b>INVESTMENTS IN AFFILIATES 89.8%</b>		
<b>OTHER INVESTMENT COMPANIES 89.8%</b>		
<b>PIMCO Bermuda Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund (M)</b>		
<b>(Cost \$106,850)</b>	8,044	99,107
<b>Total Investments in Affiliates</b>		<u>99,107</u>
<b>(Cost \$106,850)</b>		
<b>Total Investments 99.7%</b>		<u>\$ 109,990</u>
<b>(Cost \$117,734)</b>		
<b>Financial Derivative Instruments (c) (5.3%)</b>		(5,855)
<b>(Cost or Premiums, net \$0)</b>		
<b>Other Assets and Liabilities, net 5.6%</b>		<u>6,224</u>
<b>Net Assets 100.0%</b>		<u>\$ 110,359</u>

**NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:**

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.  
 (a) Coupon represents a yield to maturity.  
 (b) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(c) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

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
AZD	07/2022	AUD 2,558	\$ 1,778	\$ 19	\$ 0
AZD	08/2022	\$ 1,778	AUD 2,558	0	(19)
BDA	07/2022	AUD 3,023	\$ 2,089	21	0
BDA	07/2022	\$ 2,959	AUD 4,110	0	(133)
BDA	08/2022	2,087	3,006	0	(20)
JPM	07/2022	AUD 1,088	\$ 748	0	0
JPM	08/2022	\$ 749	AUD 1,088	0	0
MBC	07/2022	AUD 349	\$ 251	11	0
MBC	07/2022	\$ 3,073	AUD 4,276	0	(132)
MYI	07/2022	AUD 1,417	\$ 975	1	0
MYI	08/2022	\$ 586	AUD 851	0	(1)
SCX	07/2022	AUD 2,614	\$ 1,798	0	0
SCX	07/2022	\$ 104	AUD 145	0	(5)
SCX	08/2022	1,798	2,614	0	0
TOR	07/2022	AUD 2,029	\$ 1,396	1	0
TOR	08/2022	\$ 1,397	AUD 2,029	0	(1)
UAG	07/2022	AUD 52	\$ 38	2	0
UAG	07/2022	\$ 2,881	AUD 4,033	0	(107)
				\$ 55	\$ (418)

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
AZD	07/2022	BRL 162,521	\$ 31,061	\$ 0	(17)
BPS	07/2022	\$ 33,482	BRL 162,521	0	(2,404)
BPS	08/2022	BRL 24,291	\$ 4,607	4	0
BPS	08/2022	\$ 2,142	BRL 11,130	0	(32)
BRC	07/2022	BRL 2,820	\$ 575	36	0
BRC	07/2022	\$ 538	BRL 2,820	1	0
CBK	07/2022	BRL 160,370	\$ 31,033	386	0
CBK	07/2022	\$ 32,232	BRL 160,370	0	(1,568)
CBK	08/2022	30,437	158,532	0	(392)
GLM	07/2022	BRL 165,297	\$ 32,014	405	0
GLM	07/2022	\$ 32,795	BRL 165,297	0	(1,188)
GLM	08/2022	BRL 2,652	\$ 503	0	0
GLM	08/2022	\$ 30,089	BRL 157,091	0	(297)
JPM	07/2022	BRL 4,365	\$ 887	52	0
JPM	07/2022	\$ 847	BRL 4,365	0	(13)
MYI	07/2022	BRL 158,532	\$ 30,831	517	0
MYI	07/2022	\$ 30,508	BRL 158,532	0	(193)
MYI	08/2022	30,585	158,532	0	(640)
RBC	08/2022	BRL 1,235	\$ 234	0	0
SCX	07/2022	1,390	270	4	0
SCX	07/2022	\$ 265	BRL 1,390	0	0
TOR	07/2022	BRL 3,757	\$ 715	0	(3)
TOR	07/2022	\$ 717	BRL 3,757	1	0
TOR	08/2022	710	3,757	2	0
UAG	07/2022	BRL 1,194	\$ 247	19	0
UAG	07/2022	\$ 228	BRL 1,194	0	0
				\$ 1,407	\$ (6,643)

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
BDA	07/2022	IDR 294,101	\$ 20	\$ 0	0
BPS	07/2022	5,617,672	378	1	0
BPS	08/2022	\$ 370	IDR 5,509,674	0	(2)
CBK	07/2022	IDR 787,371	\$ 53	0	0
CBK	07/2022	\$ 438	IDR 6,378,031	0	(10)
CBK	08/2022	IDR 735,457	\$ 49	0	0
CBK	08/2022	\$ 45	IDR 671,447	0	0

J (IDR) 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
GLM	07/2022	\$ 405	IDR 5,899,854	\$ 0	\$ (9)
HUS	07/2022	IDR 6,212,904	\$ 416	0	0
HUS	07/2022	\$ 10	IDR 143,870	0	0
HUS	08/2022	\$ 369	5,540,642	1	0
SOG	07/2022	IDR 5,499,748	\$ 369	0	0
SOG	07/2022	\$ 409	IDR 5,953,074	0	(10)
SOG	08/2022	\$ 369	5,505,328	0	(1)
				\$ 2	\$ (32)

J (INR) 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	07/2022	INR 1,770	\$ 23	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2022	\$ 438	INR 34,116	0	(6)
CBK	07/2022	INR 29,889	\$ 378	0	0
CBK	07/2022	\$ 10	INR 772	0	0
CBK	08/2022	\$ 378	29,960	0	0
GLM	07/2022	\$ 416	32,409	0	(5)
HUS	07/2022	INR 37,482	\$ 475	1	0
HUS	08/2022	\$ 428	INR 33,901	0	0
SCX	07/2022	INR 30,460	\$ 386	0	0
SCX	07/2022	\$ 8	INR 625	0	0
SCX	08/2022	\$ 378	29,909	0	(1)
SOG	07/2022	INR 634	\$ 8	0	0
SOG	07/2022	\$ 414	INR 32,263	0	(6)
UAG	07/2022	INR 18	\$ 0	0	0
UAG	08/2022	\$ 3,955	50	0	0
				\$ 1	\$ (18)

J (KRW) 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
CBK	07/2022	KRW 579,485	\$ 448	\$ 2	\$ 0
CBK	07/2022	\$ 457	KRW 565,555	0	(21)
CBK	08/2022	\$ 401	520,318	0	0
JPM	07/2022	KRW 496,517	\$ 383	1	0
JPM	08/2022	\$ 382	KRW 494,908	0	0
MYI	08/2022	KRW 69,107	\$ 53	0	0
SCX	07/2022	\$ 501,880	388	2	0
SCX	07/2022	\$ 430	KRW 532,768	0	(20)
SCX	08/2022	\$ 354	459,067	0	0
SOG	07/2022	\$ 396	KRW 491,289	0	(18)
UAG	07/2022	KRW 10,100	\$ 8	0	0
				\$ 5	\$ (58)

J (MXN) 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	07/2022	\$ 1,446	MXN 28,866	\$ 0	\$ (15)
BPS	07/2022	MXN 28,839	\$ 1,428	0	(2)
BPS	07/2022	\$ 1,442	MXN 28,866	0	(11)
BPS	08/2022	\$ 1,381	28,093	4	0
CBK	07/2022	MXN 278	\$ 14	0	0
CBK	07/2022	\$ 1,446	MXN 28,866	0	(16)
GLM	07/2022	MXN 28,918	\$ 1,432	0	(1)
GLM	08/2022	\$ 801	40	0	0
GLM	08/2022	\$ 1,349	MXN 27,428	3	0
JPM	07/2022	MXN 745	\$ 37	0	0
MBC	07/2022	\$ 907	45	0	0
MYI	07/2022	\$ 3,530	175	0	0
RBC	07/2022	\$ 45	MXN 907	0	0
RBC	08/2022	MXN 907	\$ 45	0	0

J (MXN) 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
SCX	07/2022	MXN 3,548	\$ 175	\$ 0	(1)
SCX	08/2022	\$ 174	MXN 3,548	1	0
UAG	07/2022	MXN 27,428	\$ 1,357	0	(3)
UAG	07/2022	\$ 158	MXN 3,157	0	(2)
UAG	08/2022	1,349	27,428	3	0
				\$ 11	\$ (51)

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	07/2022	TRY 13,700	\$ 821	1	0
BOA	08/2022	\$ 163	TRY 2,906	8	0
BOA	09/2022	821	14,455	7	0
BOA	09/2022	948	17,265	42	0
BPS	07/2022	TRY 10	\$ 1	0	0
BPS	07/2022	\$ 0	TRY 4	0	0
BPS	07/2022	55	959	3	0
CBK	07/2022	TRY 1,051	\$ 63	0	0
GLM	07/2022	\$ 812	TRY 12,784	0	(46)
GLM	07/2022	30	538	2	0
GLM	07/2022	157	2,736	6	0
HUS	07/2022	204	3,544	8	0
JPM	07/2022	TRY 11,672	\$ 701	2	0
JPM	08/2022	\$ 701	TRY 11,966	3	0
MYI	07/2022	TRY 4,929	\$ 295	0	0
MYI	07/2022	1,487	89	0	0
MYI	07/2022	\$ 37	TRY 683	3	0
MYI	07/2022	941	14,601	0	(67)
MYI	07/2022	187	3,209	5	0
MYI	08/2022	89	1,520	0	0
MYI	08/2022	1,258	19,916	0	(84)
UAG	07/2022	TRY 54	\$ 3	0	0
UAG	07/2022	2,253	128	0	(7)
UAG	07/2022	\$ 876	TRY 15,047	24	0
UAG	07/2022	695	11,888	16	0
UAG	07/2022	213	3,682	7	0
UAG	08/2022	727	12,832	29	0
				\$ 166	\$ (204)

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
BPS	07/2022	ZAR 582	\$ 37	\$ 2	0
CBK	07/2022	\$ 574	ZAR 8,929	0	(29)
GLM	07/2022	573	8,978	0	(25)
GLM	07/2022	ZAR 8,554	\$ 523	1	0
GLM	08/2022	\$ 511	ZAR 8,394	0	0
MBC	07/2022	601	9,419	0	(26)
MBC	07/2022	ZAR 8,392	\$ 511	0	(2)
MBC	08/2022	\$ 511	ZAR 8,417	1	0
MYI	07/2022	ZAR 1,238	\$ 76	0	0
SCX	07/2022	\$ 19	ZAR 291	0	(1)
SCX	07/2022	ZAR 8,354	\$ 519	9	0
SCX	08/2022	\$ 519	ZAR 8,379	0	(9)
SOG	07/2022	ZAR 1,779	\$ 111	2	0
SOG	08/2022	\$ 74	ZAR 1,209	0	0
TOR	08/2022	ZAR 176	\$ 11	0	0
				\$ 15	\$ (92)
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>				<b>\$ 1,662</b>	<b>\$ (7,517)</b>

(B) ピムコ バミューダ エマージング マーケット ハイ イールド コーポレート ボ  
 ンド ファンド (M)  
 (2022年6月30日現在)

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 100.1%</b>		
<b>ARGENTINA 2.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.2%</b>		
<b>YPF S.A.</b>		
6.950% due 07/21/2027	\$ 3,100	\$ 1,764
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.1%</b>		
<b>Argentina Government International Bond</b>		
0.500% due 07/09/2030	66	14
1.125% due 07/09/2035	144	31
<b>Argentina Treasury Bond BONCER</b>		
1.400% due 03/25/2023	ARS 6,295	57
<b>Provincia de Neuquen Argentina</b>		
4.625% due 04/27/2030	\$ 2,685	1,611
		<u>1,713</u>
<b>Total Argentina</b>		<b>3,477</b>
<b>(Cost \$4,780)</b>		
<b>AUSTRALIA 0.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.6%</b>		
<b>Mineral Resources Ltd.</b>		
8.000% due 11/01/2027	900	879
<b>Total Australia</b>		
		<u>879</u>
<b>(Cost \$900)</b>		
<b>AZERBAIJAN 0.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC</b>		
7.230% due 03/17/2026	200	188
<b>Total Azerbaijan</b>		
		<u>188</u>
<b>(Cost \$199)</b>		
<b>BERMUDA 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>Geopark Ltd.</b>		
5.500% due 01/17/2027	1,600	1,343
<b>Total Bermuda</b>		
		<u>1,343</u>
<b>(Cost \$1,558)</b>		
<b>BRAZIL 6.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 6.1%</b>		
<b>Banco BTG Pactual S.A.</b>		
4.500% due 01/10/2025	700	675
<b>Banco Daycoval S.A.</b>		
4.250% due 12/13/2024	1,300	1,251
<b>Banco do Brasil S.A.</b>		
3.875% due 10/10/2022	1,600	1,603
<b>BRF S.A.</b>		
4.875% due 01/24/2030	1,700	1,349
<b>CSN Inova Ventures</b>		
6.750% due 01/28/2028	500	437
<b>CSN Resources S.A.</b>		
4.625% due 06/10/2031	1,400	996
<b>Globo Comunicacao e Participacoes S.A.</b>		
4.875% due 01/22/2030	200	157
<b>Natura Cosméticos S.A.</b>		
4.125% due 05/03/2028	1,300	1,072
<b>Odebrecht Oil &amp; Gas Finance Ltd.</b>		
0.000% due 08/01/2022 (a)	4,523	19

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Oi S.A.</b>		
10.000% due 07/27/2025 (b)	\$ 650	\$ 319
<b>Rede D'or Finance Sarl</b>		
4.500% due 01/22/2030	588	497
<b>Usiminas International Sarl</b>		
5.875% due 07/18/2026	800	786
<b>XP, Inc.</b>		
3.250% due 07/01/2026	300	265
		<u>9,426</u>
<b>STRUCTURED NOTES 0.4%</b>		
<b>Vale S.A.</b>		
3.202% due 03/30/2170 (a)	BRL 7,700	631
<b>Total Brazil</b>		
		<u>10,057</u>
<b>(Cost \$12,041)</b>		
<b>BRITISH VIRGIN ISLANDS 1.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.5%</b>		
<b>Champion Path Holdings Ltd.</b>		
4.850% due 01/27/2028	\$ 800	470
<b>Studio City Co. Ltd.</b>		
7.000% due 02/15/2027	300	261
<b>Studio City Finance Ltd.</b>		
5.000% due 01/15/2029	3,200	1,657
<b>Total British Virgin Islands</b>		
		<u>2,388</u>
<b>(Cost \$4,330)</b>		
<b>CANADA 2.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.7%</b>		
<b>Canacol Energy Ltd.</b>		
5.750% due 11/24/2028	1,600	1,299
<b>First Quantum Minerals Ltd.</b>		
6.875% due 10/15/2027	1,600	1,433
7.500% due 04/01/2025	1,500	1,421
<b>Total Canada</b>		
		<u>4,153</u>
<b>(Cost \$4,664)</b>		
<b>CAYMAN ISLANDS 9.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 9.5%</b>		
<b>Agile Group Holdings Ltd.</b>		
7.875% due 07/31/2024 (a)	700	152
<b>Arabian Centres Sukuk Ltd.</b>		
5.375% due 11/26/2024	2,150	2,050
<b>Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.</b>		
0.000% due 06/05/2034	2,808	1,783
<b>Health &amp; Happiness H&amp;H International Holdings Ltd.</b>		
5.625% due 10/24/2024	1,300	1,138
<b>IHS Holding Ltd.</b>		
5.625% due 11/29/2026	800	659
<b>Kaisa Group Holdings Ltd. (c)</b>		
8.500% due 09/30/2022	1,500	211
9.375% due 06/30/2024	1,100	154
<b>Melco Resorts Finance Ltd.</b>		
4.875% due 06/06/2025	2,300	1,722
5.375% due 12/04/2029	500	303
5.750% due 07/21/2028	900	581
<b>MGM China Holdings Ltd.</b>		
5.250% due 06/18/2025	2,300	1,768
<b>Odebrecht Holdco Finance Ltd.</b>		
0.000% due 09/10/2058	12,279	107

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>		
6.720% due 12/01/2022	\$ 362	\$ 349
7.720% due 12/01/2026 (b)	1,894	473
<b>OEK Finance Ltd. (b)</b>		
4.375% due 10/25/2029	446	11
5.250% due 12/27/2033	3,760	94
7.125% due 12/26/2046	2,788	70
<b>Powerlong Real Estate Holdings Ltd.</b>		
5.950% due 04/30/2025	1,500	240
<b>Sunac China Holdings Ltd.</b>		
7.000% due 07/09/2025 (c)	1,400	210
<b>Wynn Macau Ltd.</b>		
5.500% due 01/15/2026	3,600	2,499
<b>Total Cayman Islands</b>		
		<u>14,574</u>
<b>(Cost \$29,564)</b>		
<b>CHILE 0.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Alfa Desarrollo SpA</b>		
4.550% due 09/27/2051	199	144
<b>Total Chile</b>		
		<u>144</u>
<b>(Cost \$200)</b>		
<b>CHINA 1.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.7%</b>		
<b>Greenland Global Investment Ltd.</b>		
7.250% due 01/22/2025	1,000	275
<b>New Metro Global Ltd.</b>		
4.800% due 12/15/2024	1,200	660
<b>Yango Justice International Ltd.</b>		
7.500% due 04/15/2024 (c)	700	56
<b>Zoomlion HK SPV Co. Ltd.</b>		
6.125% due 12/20/2022	1,700	1,702
<b>Total China</b>		
		<u>2,693</u>
<b>(Cost \$4,630)</b>		
<b>COLOMBIA 3.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.0%</b>		
<b>Banco Davivienda S.A.</b>		
6.650% due 04/22/2031 (a)(d)	1,900	1,521
<b>Ecopetrol S.A.</b>		
4.625% due 11/02/2031	600	456
5.875% due 05/28/2045	1,950	1,331
6.875% due 04/29/2030	1,400	1,242
		<u>4,550</u>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Colombia Government International Bond</b>		
3.875% due 02/15/2061	800	462
<b>Total Colombia</b>		
		<u>5,012</u>
<b>(Cost \$7,004)</b>		
<b>CYPRUS 0.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.8%</b>		
<b>MHP SE</b>		
7.750% due 05/10/2024	2,500	1,311
<b>Total Cyprus</b>		
		<u>1,311</u>
<b>(Cost \$2,500)</b>		



	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>DOMINICAN REPUBLIC 0.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Dominican Republic International Bond</b>		
5.300% due 01/21/2041	\$ 500	\$ 348
<b>Total Dominican Republic</b>		<b>348</b>
<b>(Cost \$490)</b>		
<b>GUATEMALA 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>CT Trust</b>		
5.125% due 02/03/2032	1,700	1,366
<b>Total Guatemala</b>		<b>1,366</b>
<b>(Cost \$1,651)</b>		
<b>HONG KONG 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>Fortune Star BVI Ltd.</b>		
5.950% due 10/19/2025	200	128
<b>Huarong Finance 2019 Co. Ltd.</b>		
3.375% due 02/24/2030	200	151
<b>Yanlord Land HK Co. Ltd.</b>		
5.125% due 05/20/2026	1,400	1,066
<b>Total Hong Kong</b>		<b>1,345</b>
<b>(Cost \$1,753)</b>		
<b>INDIA 2.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.5%</b>		
<b>JSW Steel Ltd.</b>		
5.050% due 04/05/2032	1,500	1,116
<b>Muthoot Finance Ltd.</b>		
4.400% due 09/02/2023	400	390
6.125% due 10/31/2022	1,200	1,199
<b>Shriram Transport Finance Co. Ltd.</b>		
4.150% due 07/18/2025	500	438
5.100% due 07/16/2023	800	767
<b>Total India</b>		<b>3,910</b>
<b>(Cost \$4,412)</b>		
<b>INDONESIA 3.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.6%</b>		
<b>Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT</b>		
3.750% due 03/30/2026 (d)	1,900	1,729
<b>Cikarang Listrindo Tbk PT</b>		
4.950% due 09/14/2026	1,300	1,207
<b>LLPL Capital Pte Ltd.</b>		
6.875% due 02/04/2039	610	569
<b>Medco Oak Tree Pte Ltd.</b>		
7.375% due 05/14/2026	2,200	2,007
<b>Total Indonesia</b>		<b>5,512</b>
<b>(Cost \$6,203)</b>		
<b>IRELAND 0.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>Alfa Bank AD Via Alfa Bond Issuance PLC</b>		
5.950% due 04/15/2030 (c)(d)	3,300	363
<b>Sovcombank Via SovCom Capital DAC (c)</b>		
3.400% due 01/28/2025	1,500	105
8.000% due 04/07/2030 (d)	700	49
<b>Total Ireland</b>		<b>517</b>
<b>(Cost \$5,550)</b>		

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>ISRAEL 3.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.5%</b>		
<b>Delek Overriding Royalty Leviathan Ltd.</b>		
7.494% due 12/30/2023	\$ 800	\$ 604
<b>Enegean Israel Finance Ltd.</b>		
4.500% due 03/30/2024	500	472
4.875% due 03/30/2026	1,900	1,684
<b>Leviathan Bond Ltd.</b>		
6.125% due 06/30/2025	500	472
6.500% due 06/30/2027	2,200	2,038
<b>Total Israel</b>		<b>5,470</b>
<b>(Cost \$6,043)</b>		
<b>JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.6%</b>		
<b>Corsair International Ltd.</b>		
4.850% due 01/28/2027	EUR 600	592
5.200% due 01/28/2029	300	293
<b>Total Jersey, Channel Islands</b>		<b>885</b>
<b>(Cost \$1,005)</b>		
<b>LUXEMBOURG 5.0%</b>		
	SHARES	
<b>COMMON STOCKS 0.0%</b>		
<b>Constellation Oil Services Holding S.A. (g)</b>		
	1,092,161	118
	額面金額 (単位: 千)	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 5.0%</b>		
<b>Alice Financing S.A.</b>		
3.000% due 01/15/2028	EUR 1,000	783
<b>Andrade Gutierrez International S.A.</b>		
9.500% due 12/30/2024 (c)	\$ 1,100	610
<b>Constellation Oil Services Holding S.A.</b>		
3.000% due 12/31/2026 (b)	900	665
<b>Guara Norte Sarl</b>		
5.198% due 06/15/2034	1,311	1,066
<b>Nexa Resources S.A.</b>		
6.500% due 01/18/2028	1,800	1,720
<b>Petrorio Luxembourg Trading Sarl</b>		
6.125% due 06/09/2026	1,100	1,014
<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b>		
5.250% due 05/23/2023 (c)(d)	2,900	203
<b>Unigel Luxembourg S.A.</b>		
8.750% due 10/01/2026	1,600	1,586
<b>Total Luxembourg</b>		<b>7,647</b>
<b>(Cost \$11,668)</b>		
<b>MAURITIUS 3.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.5%</b>		
<b>Greenko Dutch BV</b>		
3.850% due 03/29/2026	1,843	1,568
<b>Greenko Power II Ltd.</b>		
4.300% due 12/13/2028	293	235
<b>India Green Energy Holdings</b>		
5.375% due 04/29/2024	1,400	1,310

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>MTN Mauritius Investment Ltd.</b>		
4.755% due 11/11/2024	\$ 2,400	\$ 2,339
<b>Total Mauritius</b>		<b>5,452</b>
<b>(Cost \$6,073)</b>		
<b>MEXICO 4.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 4.4%</b>		
<b>Banco Mercantil del Norte S.A. (a)(d)</b>		
6.875% due 07/06/2022	900	893
8.375% due 10/14/2030	600	580
<b>BBVA Bancomer S.A.</b>		
5.125% due 01/18/2033 (d)	2,450	2,079
<b>Cibanco S.A. Ibm</b>		
4.952% due 07/18/2029	500	448
<b>Cydsa SAB de C.V.</b>		
6.250% due 10/04/2027	700	624
<b>Metalsa S.A. de C.V.</b>		
3.750% due 05/04/2031	700	495
<b>Petroleos Mexicanos</b>		
5.950% due 01/28/2031	300	220
6.750% due 09/21/2047	800	497
<b>Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V.</b>		
7.500% due 11/12/2025	1,000	877
<b>Total Mexico</b>		<b>6,713</b>
<b>(Cost \$8,006)</b>		
<b>MOROCCO 1.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.7%</b>		
<b>OCP S.A.</b>		
5.125% due 06/23/2051	1,100	733
6.875% due 04/25/2044	2,300	1,924
<b>Total Morocco</b>		<b>2,657</b>
<b>(Cost \$3,878)</b>		
<b>MULTINATIONAL 1.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.3%</b>		
<b>ATP Tower Holdings LLC</b>		
4.050% due 04/27/2026	1,200	993
<b>Digicel International Finance Ltd.</b>		
8.750% due 05/25/2024	1,030	960
<b>Total Multinational</b>		<b>1,953</b>
<b>(Cost \$2,002)</b>		
<b>NETHERLANDS 5.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 5.4%</b>		
<b>IHS Netherlands Holdco BV</b>		
8.000% due 09/18/2027	2,126	1,868
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV</b>		
3.750% due 05/09/2027	EUR 2,200	1,953
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV</b>		
7.125% due 01/31/2025	\$ 2,500	2,443
<b>Total Netherlands</b>		<b>8,271</b>
<b>(Cost \$10,434)</b>		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>NIGERIA 1.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.6%</b>		
<b>Access Bank PLC</b>		
6.125% due 09/21/2026	\$ 1,400	\$ 1,136
<b>SEPLAT Energy PLC</b>		
7.750% due 04/01/2026	900	809
<b>United Bank for Africa PLC</b>		
6.750% due 11/19/2026	600	530
<b>Total Nigeria</b>		<b>2,475</b>
<b>(Cost \$2,932)</b>		
<b>OMAN 0.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Oman Government International Bond</b>		
6.250% due 01/25/2031	400	387
<b>Total Oman</b>		<b>387</b>
<b>(Cost \$400)</b>		
<b>PERU 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>Compania de Minas Buenaventura SAA</b>		
5.500% due 07/23/2026	800	722
<b>Peru LNG Srl</b>		
5.375% due 03/22/2030	800	648
<b>Total Peru</b>		<b>1,370</b>
<b>(Cost \$1,555)</b>		
<b>SOUTH AFRICA 5.8%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.7%</b>		
<b>Sasol Financing Ltd.</b>		
0.560% due 11/23/2022 (e)	1,094	1,084
	SHARES	
<b>COMMON STOCKS 0.7%</b>		
<b>Petra Diamonds Ltd.</b>		
	977,619	1,063
		額面金額 (単位:千)
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 4.4%</b>		
<b>Absa Group Ltd.</b>		
6.375% due 05/27/2026 (a)(d)	\$ 400	363
<b>Growthpoint Properties International Pty Ltd.</b>		
5.872% due 05/02/2023	1,900	1,899
<b>Sasol Financing USA LLC</b>		
5.875% due 03/27/2024	2,300	2,255
6.500% due 09/27/2028	2,500	2,269
		<b>6,786</b>
<b>Total South Africa</b>		<b>8,933</b>
<b>(Cost \$9,242)</b>		
<b>SPAIN 0.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.7%</b>		
<b>International Airport Finance S.A.</b>		
12.000% due 03/15/2033	1,087	1,061
<b>Total Spain</b>		<b>1,061</b>
<b>(Cost \$1,087)</b>		

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>TURKEY 6.1%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.7%</b>		
<b>SOCAR Turkey Enerji A/S</b>		
3.450% due 08/11/2026	EUR 1,100	\$ 1,087
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 5.4%</b>		
<b>Akbank T.A.S.</b>		
5.125% due 03/31/2025	1,900	1,677
<b>Arcelik A/S</b>		
5.000% due 04/03/2023	850	837
<b>QNB Finansbank A/S</b>		
6.875% due 09/07/2024	2,650	2,661
<b>Turk Telekomunikasyon A/S</b>		
4.875% due 06/19/2024	2,000	1,785
<b>Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust</b>		
4.200% due 03/15/2027	1,250	1,040
<b>Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S</b>		
6.950% due 03/14/2026	300	268
		<b>8,268</b>
<b>Total Turkey</b>		<b>9,355</b>
<b>(Cost \$9,736)</b>		
<b>UKRAINE 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Ukraine Government International Bond</b>		
4.375% due 01/27/2030	EUR 300	79
7.750% due 09/01/2024	\$ 300	77
<b>Total Ukraine</b>		<b>156</b>
<b>(Cost \$549)</b>		
<b>UNITED ARAB EMIRATES 2.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.8%</b>		
<b>Kuwait Projects Co. SPC Ltd.</b>		
4.229% due 10/29/2026	1,800	1,514
<b>Oztel Holdings SPC Ltd.</b>		
6.625% due 04/24/2028	2,769	2,797
<b>Total United Arab Emirates</b>		<b>4,311</b>
<b>(Cost \$4,525)</b>		
<b>UNITED KINGDOM 2.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.5%</b>		
<b>MARB BondCo PLC</b>		
3.950% due 01/29/2031	1,400	1,078
<b>Petra Diamonds U.S. Treasury PLC</b>		
10.500% due 03/08/2026 (b)	1,018	1,026
<b>Rolls-Royce PLC</b>		
5.750% due 10/15/2027	GBP 100	114
<b>Tullow Oil PLC</b>		
10.250% due 05/15/2026	\$ 758	726
<b>Vedanta Resources Finance II PLC</b>		
8.950% due 03/11/2025	1,100	872
<b>Total United Kingdom</b>		<b>3,816</b>
<b>(Cost \$4,315)</b>		
<b>UNITED STATES 6.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 6.3%</b>		
<b>Gran Tierra Energy, Inc.</b>		
7.750% due 05/23/2027	700	599
<b>Kosmos Energy Ltd.</b>		
7.125% due 04/04/2026	3,200	2,725

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Rio Oil Finance Trust Series 2018-1</b>		
8.200% due 04/06/2028	\$ 3,224	\$ 3,355
<b>SierraCol Energy Andina LLC</b>		
6.000% due 06/15/2028	1,200	878
<b>Stillwater Mining Co.</b>		
4.000% due 11/16/2026	2,500	2,089
<b>Total United States</b>		<b>9,646</b>
<b>(Cost \$10,687)</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 9.3%</b>		
<b>TIME DEPOSITS 2.6%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
1.060% due 07/01/2022	95	95
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
1.060% due 07/01/2022	132	132
<b>BNP Paribas Bank</b>		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 44	46
0.370% due 07/04/2022	HKD 2	0
1.060% due 07/01/2022	\$ 3	3
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
3.850% due 07/01/2022	ZAR 666	41
<b>Citibank N.A.</b>		
1.060% due 07/01/2022	\$ 536	536
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
1.060% due 07/01/2022	451	451
<b>HSBC Bank PLC</b>		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 16	16
0.520% due 07/01/2022	GBP 1	1
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
1.060% due 07/01/2022	\$ 1,071	1,071
<b>Royal Bank of Canada</b>		
1.060% due 07/01/2022	50	50
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 43	45
1.060% due 07/01/2022	\$ 476	476
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 5	5
1.060% due 07/01/2022	\$ 1,018	1,018
<b>The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd.</b>		
0.370% due 07/04/2022	HKD 92	12
		<b>3,998</b>
<b>ARGENTINA TREASURY BILLS 0.0%</b>		
51.282% due 09/30/2022 (f)	ARS 12,500	42
<b>U.S. TREASURY BILLS (H) 6.7%</b>		
0.808% due 07/21/2022	\$ 5,500	5,497
1.074% due 08/23/2022	4,800	4,790
		<b>10,287</b>
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<b>14,327</b>
<b>(Cost \$14,346)</b>		
<b>Total Investments in Securities 100.1%</b>	<b>\$ 154,220</b>	
<b>(Cost \$200,932)</b>		
<b>Financial Derivative</b>		
Instruments (h)(i) (0.0%)		(46)
<b>(Cost or Premiums, net \$ (12))</b>		
<b>Other Assets and Liabilities, net (0.1%)</b>		
		(89)
<b>Net Assets 100.0%</b>	<b>\$ 154,085</b>	

**NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:**

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (b) Payment in-kind security.
- (c) Security is in default.
- (d) Contingent convertible security.
- (e) All or portion of this amount represent unfunded loan commitments. The interest rate for the unfunded portion will be determined at the time of funding. See Note 4, Securities and Other Investments, in the Notes to Financial Statements for more information regarding unfunded loan commitments.
- (f) Coupon represents a yield to maturity.

**(g) RESTRICTED SECURITIES:**

銘柄名	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	純資産比率
Constellation Oil Services Holding S.A.	N/A	N/A	06/10/2022	\$ 118	\$ 118	0.08%

**BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS**

Cash of \$582 has been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of June 30, 2022.

The average amount of borrowings outstanding during the period ended June 30, 2022 was \$4,791 at a weighted average interest rate of 10.055%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

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

**FUTURES CONTRACTS:**

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価 (損) 益	変動証拠金	
					資産	負債
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2022	13	\$ 55	\$ 0	\$ (49)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2022	67	(57)	25	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2022	18	(7)	10	0
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	155	(137)	125	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Short	09/2022	27	35	0	(26)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	Short	09/2022	3	13	0	(3)
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (98)</b>	<b>\$ 160</b>	<b>\$ (78)</b>

**SWAP AGREEMENTS:**

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

参照債券	固定受取金利	満期日	2022年6月30日時点の インフラード クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>		想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格	未実現 評価 (損) 益	変動証拠金	
			EUR	100				資産	負債
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	06/20/2026	9.623%	EUR	100	\$ (14)	\$ (21)	\$ 0	\$ (6)

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

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格 <sup>(4)</sup>	未実現 評価 (損) 益	変動証拠金	
						資産	負債
iTraxx Europe Crossover Series 37 Index	5.000%	06/20/2027	EUR 100	\$ (3)	\$ (5)	\$ 0	\$ (1)
iTraxx Europe Series 36 Index	1.000%	12/20/2026	1,600	(8)	(11)	0	(4)
iTraxx Europe Series 37 Index	1.000%	06/20/2027	2,600	(23)	(34)	0	(7)
				<b>\$ (34)</b>	<b>\$ (50)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (12)</b>

**INTEREST RATE SWAPS**

変動金利の 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価 (損) 益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.500%	12/15/2023	\$ 16,100	\$ 645	\$ 655	\$ 0	\$ (21)
Pay	3-Month ZAR-SAIBOR	6.635%	02/04/2027	ZAR 52,900	(168)	(139)	0	(4)
Receive	3-Month ZAR-SAIBOR	7.205%	04/22/2027	9,700	19	19	1	0
Receive	3-Month ZAR-SAIBOR	7.210%	04/22/2027	7,500	14	14	0	0
Receive	Secured Overnight Financing Rate	0.250%	06/15/2023	\$ 1,300	34	27	0	(1)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	0.250%	12/15/2023	1,500	59	46	0	(4)
					<b>\$ 603</b>	<b>\$ 622</b>	<b>\$ 1</b>	<b>\$ (30)</b>
<b>Total Swap Agreements</b>					<b>\$ 555</b>	<b>\$ 551</b>	<b>\$ 1</b>	<b>\$ (48)</b>

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of June 30, 2022:

Cash of \$897 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of June 30, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格		変動証拠金資産		市場価格		変動証拠金負債	
	買いオプション	先物	スワップ	合計	売りオプション	先物	スワップ	合計
<b>Total Exchange-Traded or Centrally Cleared</b>	\$ 0	\$ 160	\$ 1	\$ 161	\$ 0	\$ (78)	\$ (48)	\$ (126)

- <sup>13)</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- <sup>14)</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- <sup>15)</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- <sup>16)</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

(ii) 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	07/2022	\$ 5,383	EUR 5,118	\$ 0	\$ (32)
BPS	07/2022	207	GBP 164	0	(7)
BPS	08/2022	EUR 5,028	\$ 5,288	31	0
BPS	08/2022	ZAR 36,154	2,264	67	0
BPS	11/2022	9,757	605	17	0
BRC	11/2022	7,077	441	14	0
CBK	07/2022	EUR 81	87	2	0
CBK	11/2022	ZAR 861	57	5	0
DUB	12/2022	275	17	1	0
GLM	07/2022	642	40	1	0
GLM	09/2022	\$ 194	HKD 1,519	0	0
MYI	08/2022	2,421	ZAR 36,154	0	(224)
SCX	09/2022	ZAR 251	\$ 16	1	0
SCX	11/2022	\$ 1,049	ZAR 15,845	0	(94)
SDG	07/2022	EUR 5,037	\$ 5,414	148	0
SDG	07/2022	GBP 164	200	0	0
SDG	08/2022	\$ 200	GBP 164	0	0
UAG	09/2022	70	HKD 551	0	0
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>				\$ 287	\$ (357)

WRITTEN OPTIONS:

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	売/買 プロテクション	権利行使 レート	行使期限	想定元本 <sup>(1)</sup>	プレミアム支払 (受取)	市場価格
BOA	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.400%	08/17/2022	2,400	\$ (7)	\$ (8)
<b>Total Written Options</b>						\$ (7)	\$ (8)

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照債券	固定 (支払) 金利	満期日	2022年6月30日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(3)</sup>	想定元本 <sup>(5)</sup>	プレミアム 支払 (受取)	未実現 評価 (損) 益	スワップの価値 資産	負債
BOA	Mexico Government International Bond	(1.000%)	12/20/2023	0.965%	\$ 2,150	\$ 33	\$ (35)	\$ 0	\$ (2)

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

取引相手	参照債券	固定 (支払) 金利	満期日	2022年6月30日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(4)</sup>	想定元本 <sup>(5)</sup>	プレミアム		未実現		スワップの価値	
						支払 (受取)	評価 (損) 益	資産	負債		
MYC	Mexico Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	1.183%	\$ 2,050	\$ (2)	\$ 10	\$ 8	\$ 0		
						\$ 31	\$ (25)	\$ 8	\$ (2)		

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION<sup>(3)</sup>

取引相手	参照債券	固定受取金利	満期日	2022年6月30日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(4)</sup>	想定元本 <sup>(5)</sup>	プレミアム		未実現		スワップの価値	
						支払 (受取)	評価 (損) 益	資産	負債		
BRC	America Movil SAB de C.V.	1.000%	12/20/2025	1.222%	\$ 1,600	\$ (40)	\$ 29	\$ 0	\$ (11)		
BRC	ONB Finance Ltd.	1.000%	06/20/2023	0.609%	500	4	(2)	2	0		
						\$ (36)	\$ 27	\$ 2	\$ (11)		
<b>Total Swap Agreements</b>						<b>\$ (5)</b>	<b>\$ 2</b>	<b>\$ 10</b>	<b>\$ (13)</b>		

<sup>(2)</sup> Notional amount represents the number of contracts.

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

<sup>(4)</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

<sup>(5)</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

<sup>(6)</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

## マネー・マーケット・マザーファンド

### 《第36期》決算日2022年11月21日

[計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月21日に第36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36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 円	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率			
32期(2020年11月20日)	10,182		0.0	—	—	百万円 1,133
33期(2021年5月20日)	10,182		0.0	—	—	1,245
34期(2021年11月22日)	10,182		0.0	—	—	1,637
35期(2022年5月20日)	10,182		0.0	—	—	2,897
36期(2022年11月21日)	10,181		△0.0	—	—	2,660

(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) 「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 円	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落	率			
(期首) 2022年5月20日	10,182		—	—	—	—
5月末	10,182		0.0	—	—	—
6月末	10,182		0.0	—	—	—
7月末	10,182		0.0	—	—	—
8月末	10,182		0.0	—	—	—
9月末	10,182		0.0	—	—	—
10月末	10,182		0.0	—	—	—
(期末) 2022年11月21日	10,181		△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。

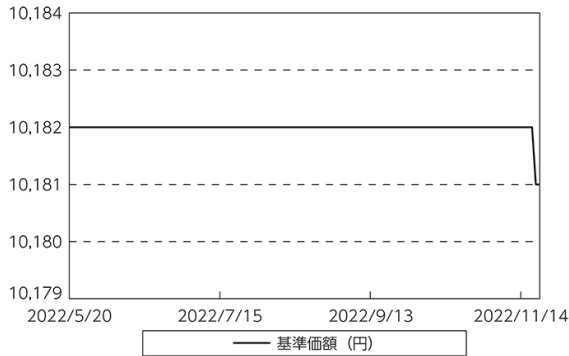
## ○運用経過

## ●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て0.01%の下落となりました。

基準価額等の推移



## ●基準価額の変動要因

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・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、足下のコール・レートは-0.072%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。

## ○今後の運用方針

- ・今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン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

(2022年5月21日～2022年11月21日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2022年5月21日～2022年11月21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 283,299,750	千円 283,499,756

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年5月21日～2022年11月21日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2022年11月21日現在)

## 国内その他有価証券

区分	当期	期末
	評価額	比率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,199,999	% 82.7

(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

(2022年11月21日現在)

項目	当期	期末
	評価額	比率
その他有価証券	千円 2,199,999	% 82.7
コール・ローン等、その他	460,725	17.3
投資信託財産総額	2,660,724	100.0



○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	2,660,724,177
コール・ローン等	460,724,244
その他有価証券(評価額)	2,199,999,933
(B) 負債	1,146
未払解約金	68
未払利息	1,078
(C) 純資産総額(A-B)	2,660,723,031
元本	2,613,319,906
次期繰越損益金	47,403,125
(D) 受益権総口数	2,613,319,906口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,181円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,845,789,751円  
 期中追加設定元本額 1,894,698,772円  
 期中一部解約元本額 2,127,168,617円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0181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 ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,569,488,380円
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	523,697,712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<マネープールファンド>	71,490,321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>	61,998,360円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	51,826,756円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	43,878,184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)	24,765,135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)	16,341,949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)	13,122,469円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347円
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)	9,893,887円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,874,414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
ピムコ・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)	9,376,245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
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
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)	7,489,236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)	7,196,270円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	6,895,341円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	6,887,212円
ピムコ・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)	6,675,966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
ピムコ・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)	5,990,990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)	5,812,610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)	5,548,198円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	5,484,593円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,411,821円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	5,038,306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)	4,489,124円

○損益の状況 (2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 112,556
受取利息	6,409
支払利息	△ 118,965
(B) 当期損益金(A)	△ 112,556
(C) 前期繰越損益金	51,746,903
(D) 追加信託差損益金	34,483,023
(E) 解約差損益金	△38,714,245
(F) 計(B+C+D+E)	47,403,125
次期繰越損益金(F)	47,403,125

(注) (D)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) (E)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 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)	4,433,586円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	4,289,171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)	3,857,128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
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)	3,517,041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<米ドルインカム> (年2回分配型)	3,319,056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
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
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)	2,895,129円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	2,711,846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)	2,664,317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)	2,590,474円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	2,515,903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)	2,210,674円
三菱UFJ J/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)	2,178,993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> (毎月分配型)	2,119,621円
三菱UFJ J/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
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)	2,007,890円
バリュエーション・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1,936,118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)	1,628,929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 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)	1,491,640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)	1,453,944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)	1,378,553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>	1,355,194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)	1,339,040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)	1,171,788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)	1,149,232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)	1,145,161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)	1,074,934円
三菱UFJ J/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)	1,020,693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)	1,016,827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)	870,254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)	845,131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)	669,935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)	665,580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)	629,892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)	521,457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)	511,609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)	490,224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)	416,840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)	368,276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)	282,290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)	278,281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)	217,015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)	215,434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
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)	208,430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)	177,761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)	175,974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)	169,198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)	138,420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)	132,542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)	125,118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 /マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97,104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
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
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89,287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
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)	74,308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)	60,179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)	50,114円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351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)	20,635円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	11,006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)	10,795円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10,787円
バリュール・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュール・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9,829円
バリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	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<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> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替ヘッジなし)	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替リスク軽減型)	983円
合計	2,613,319,906円