

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	2021年6月21日まで（2013年7月1日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託の投資信託証券への投資を通じて、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、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。投資信託証券への投資にあたっては、異なる通貨への投資効果を有する別に定める投資信託証券（以下「指定投資信託証券」といいます。）の中から、通貨の分散に配慮して投資を行うことを基本とします。各指定投資信託証券への投資にあたっては、実質的な配分は概ね均等になることを基本とします。指定投資信託証券は、長期的な経済構造の変化に応じて見直しを行います。この際、投資信託証券が指定投資信託証券から外れることや、新たに指定投資信託証券（ファンド設定時に設定された投資信託も含みます。）に指定されることがあります。指定投資信託証券への投資を通じて、実質的な保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、各対象通貨買いの為替取引を行います。ただし、対象通貨が米ドルの指定投資信託証券においては当該為替取引を行いません。（このため、基準価額はすべての対象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。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。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	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）	指定投資信託証券およびマネー・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。
	指定投資信託証券	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債券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。	

※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）

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）

第47期（決算日：2017年7月20日）
 第48期（決算日：2017年8月21日）
 第49期（決算日：2017年9月20日）
 第50期（決算日：2017年10月20日）
 第51期（決算日：2017年11月20日）
 第52期（決算日：2017年12月20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「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）」は、去る12月20日に第52期の決算を行いましたので、法令に基づいて第47期～第52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。

MUFG
 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 URL:<http://www.am.mufig.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
 （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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 税 分	価 込 配	額 み 期 騰 落	率 中 率	債 組 入 比	券 率 率	債 先 物 比	率 率	投 資 信 託 証 組 入 比	純 資 産 総 額
	円		円		%		%		%	%	百万円
23期(2015年7月21日)	10,007		70		△1.1		0.1		—	99.2	24,745
24期(2015年8月20日)	9,460		70		△4.8		0.1		—	99.2	23,094
25期(2015年9月24日)	8,732		70		△7.0		0.1		—	99.2	20,919
26期(2015年10月20日)	9,058		70		4.5		0.1		—	98.9	20,987
27期(2015年11月20日)	9,162		70		1.9		0.1		—	99.2	20,069
28期(2015年12月21日)	8,622		70		△5.1		0.1		—	98.7	18,069
29期(2016年1月20日)	7,879		70		△7.8		0.1		—	99.2	16,269
30期(2016年2月22日)	7,745		70		△0.8		0.1		—	99.2	14,954
31期(2016年3月22日)	8,347		70		8.7		0.1		—	98.6	15,067
32期(2016年4月20日)	8,406		70		1.5		0.1		—	99.2	14,312
33期(2016年5月20日)	8,083		70		△3.0		0.1		—	99.2	13,300
34期(2016年6月20日)	7,851		70		△2.0		0.0		—	99.2	12,511
35期(2016年7月20日)	8,282		70		6.4		0.0		—	98.9	12,837
36期(2016年8月22日)	7,983		70		△2.8		0.0		—	98.7	11,958
37期(2016年9月20日)	7,883		50		△0.6		0.0		—	99.1	11,447
38期(2016年10月20日)	8,069		50		3.0		0.0		—	98.8	10,756
39期(2016年11月21日)	7,889		50		△1.6		0.0		—	98.9	10,180
40期(2016年12月20日)	8,386		50		6.9		0.0		—	98.7	10,551
41期(2017年1月20日)	8,379		50		0.5		0.0		—	98.7	10,330
42期(2017年2月20日)	8,441		50		1.3		0.0		—	99.2	10,084
43期(2017年3月21日)	8,565		50		2.1		0.0		—	99.2	10,033
44期(2017年4月20日)	8,369		50		△1.7		—		—	99.2	9,638
45期(2017年5月22日)	8,612		50		3.5		—		—	99.2	9,680
46期(2017年6月20日)	8,675		50		1.3		—		—	98.9	9,477
47期(2017年7月20日)	8,832		50		2.4		—		—	98.4	9,461
48期(2017年8月21日)	8,615		50		△1.9		—		—	99.2	9,033
49期(2017年9月20日)	9,025		50		5.3		—		—	99.2	9,389
50期(2017年10月20日)	8,984		50		0.1		—		—	99.2	9,185
51期(2017年11月20日)	8,758		50		△2.0		—		—	99.3	8,768
52期(2017年12月20日)	8,880		50		2.0		—		—	99.3	8,819

(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) 当ファンドは、新興経済国の政府および政府機関等の発行する債券等を実質的な投資を行う一方で、米ドル売り、各対象通貨買いの為替取引(対象通貨が米ドルの場合を除く)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が、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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) 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 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率			
第47期	(期 首) 2017年6月20日	円 8,675	% —	% —	% —	% 98.9
	6月末	8,766	1.0	—	—	99.0
	(期 末) 2017年7月20日	8,882	2.4	—	—	98.4
第48期	(期 首) 2017年7月20日	8,832	—	—	—	98.4
	7月末	8,819	△0.1	—	—	99.3
	(期 末) 2017年8月21日	8,665	△1.9	—	—	99.2
第49期	(期 首) 2017年8月21日	8,615	—	—	—	99.2
	8月末	8,839	2.6	—	—	99.1
	(期 末) 2017年9月20日	9,075	5.3	—	—	99.2
第50期	(期 首) 2017年9月20日	9,025	—	—	—	99.2
	9月末	8,973	△0.6	—	—	99.2
	(期 末) 2017年10月20日	9,034	0.1	—	—	99.2
第51期	(期 首) 2017年10月20日	8,984	—	—	—	99.2
	10月末	8,906	△0.9	—	—	99.4
	(期 末) 2017年11月20日	8,808	△2.0	—	—	99.3
第52期	(期 首) 2017年11月20日	8,758	—	—	—	99.3
	11月末	8,839	0.9	—	—	99.3
	(期 末) 2017年12月20日	8,930	2.0	—	—	99.3

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

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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

当作成期中の基準価額等の推移について（第47期～第52期：2017/6/21～2017/12/20）

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ5.9%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。



第47期首： 8,675円
第52期末： 8,880円
（既払分配金 300円）
騰落率： 5.9%
（分配金再投資ベース）

- ・ 分配金再投資基準価額は、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、お客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、各個人のお客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。
- ・ 米ドル売り、各対象通貨買い（豪ドル、ブラジルレアル、メキシコペソ、カナダドル、インドネシアルピア、インドルピー、韓国ウォン、ロシアルーブル、トルコリラ、ユーロ、英ポンド）の為替取引により、ユーロなどの一部対象通貨を除き為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）を享受したこと。
- ・ 多くの対象通貨が対円で上昇したこと。

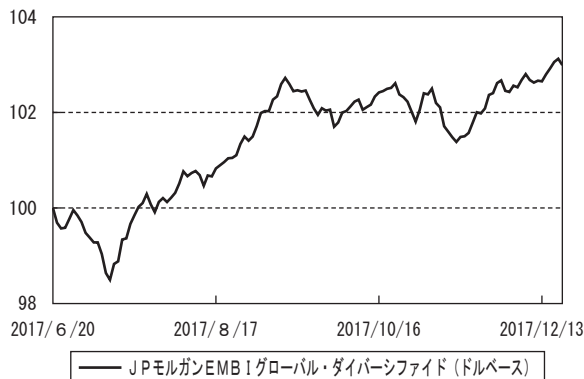
下落要因

- ・ トルコリラやメキシコペソ、インドネシアルピアなどが対円で下落したこと。

投資環境について

（第47期～第52期：2017/6/21～2017/12/20）

債券市況の推移 （当作成期首を100として指数化）

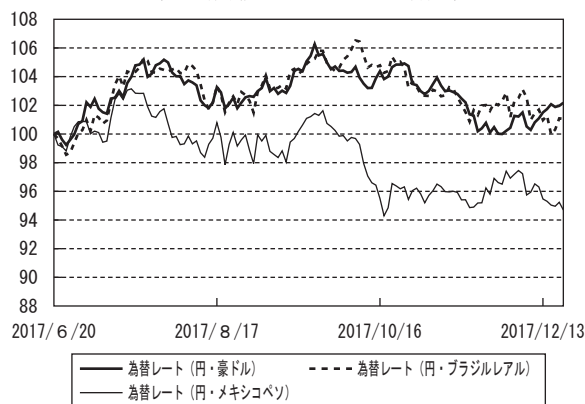


◎債券市況

- ・ 当作成期は、原油価格が堅調となったことや世界的に株式市況が堅調となったことなどを背景に市場参加者のリスク許容度が改善したことなどから、エマージング債券市況は上昇しました。

・ JPMorgan EMBI 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。JPMorgan EMBI 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）



◎為替市況
（主な上昇通貨）

・ユーロ

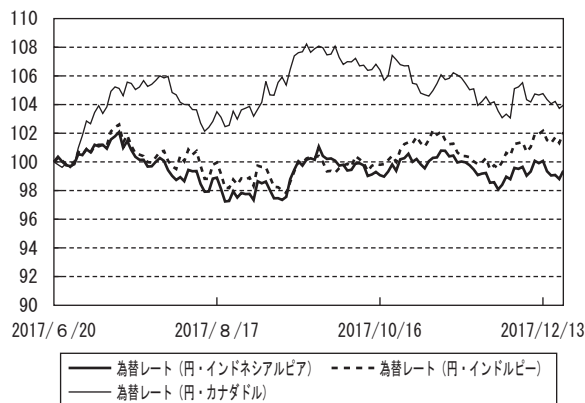
当作成期は、2017年6月下旬のドラギ欧州中央銀行（ECB）総裁のインフレや金融政策についての発言が金融緩和の調整を示唆したものと受け止められたことや欧州諸国で堅調な経済指標が発表されたことなどを受けて、ユーロは対円で上昇しました。

（主な下落通貨）

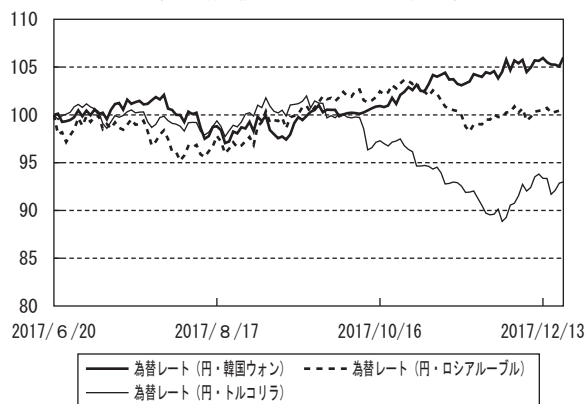
・トルコリラ

当作成期は、米国とトルコの間でのビザ発給が相互に停止されたとの報道などを受けて、米国との関係悪化に対する懸念が高まったことなどがマイナスに影響し、トルコリラは対円で下落しました。

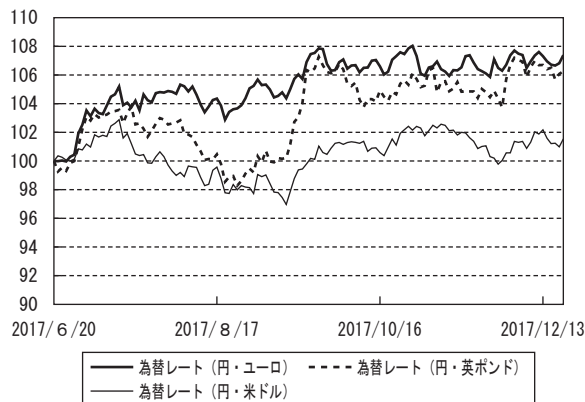
為替市況の推移
（当作成期首を100として指数化）



為替市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



為替市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



◎国内短期金融市場

- ・ 当作成期の短期金融市場を見ると、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、マイナス金利の適用以降であることから、マイナス圏で推移しました。2017年12月20日のコール・レートは-0.047%となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜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）＞

- ・各円建て外国投資信託（以下「指定投資信託証券」）への投資を通じて、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、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用を行うとともに、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。投資する外国投資信託においては、先進国と新興国の複数の通貨（以下「対象通貨」）に分散投資を行い、各対象通貨の配分は概ね均等としました。
- ・当作成期は、エマージング債券市況が上昇したことや、多くの対象通貨が対円で上昇したこと、米ドル売り、各対象通貨買いの為替取引により、ユーロなどの一部対象通貨を除き為替取引によるプレミアムを享受したことがプラスに寄与し、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

＜指定投資信託証券＞

各指定投資信託証券の騰落率は下表の通りです。

指定投資信託証券の騰落率

(%)

指定投資信託証券									作成期中騰落率
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(AUD)	6.2
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(BRL)	8.1
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(MXN)	1.2
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(CAD)	7.6
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(IDR)	5.0
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(INR)	8.3
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(KRW)	9.9
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(RUB)	8.3
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(TRY)	1.7
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(EUR)	10.5
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(GBP)	9.8
ピムコ	エマージング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(USD)	5.5

（注）騰落率は分配金再投資ベース。

- ・各指定投資信託証券の対象通貨買い（豪ドル、ブラジルレアル、メキシコペソ、カナダドル、インドネシアルピア、インドルピー、韓国ウォン、ロシアルーブル、トルコリラ、ユーロ、英ポンド）の為替取引を行いました。
- ・多くの対象通貨が対円で上昇したことがプラ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（金利差相当分の費用）

- ・世界通貨分散コースの米ドルを除く11通貨平均の短期金利はユーロなどの一部対象通貨を除き米ドルの短期金利に対して概ね高位で推移したため、これらの短期金利差を背景とした為替取引ではプレミアムを享受する環境となりました。なお、主にトルコリラやメキシコペソ、ブラジルレアルを中心とした為替取引によるプレミアムが相対的に大きなプラス要因となりました。

◎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の改善などを評価して積極姿勢としたブラジルの債券市況が上昇したこと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

- ・当ファンドは、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う一方で、米ドル売り、各対象通貨買いの為替取引（対象通貨が米ドルの場合を除く）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が、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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。
- ・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47期	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期
	2017年6月21日～ 2017年7月20日	2017年7月21日～ 2017年8月21日	2017年8月22日～ 2017年9月20日	2017年9月21日～ 2017年10月20日	2017年10月21日～ 2017年11月20日	2017年11月21日～ 2017年12月20日
当期分配金	50	50	50	50	50	50
(対基準価額比率)	0.563%	0.577%	0.551%	0.553%	0.568%	0.560%
当期の収益	50	50	50	50	50	50
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,839	1,849	1,872	1,881	1,890	1,908

(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

＜P I M C O 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）＞

◎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。

＜指定投資信託証券＞

◎運用環境の見通し

- ・エマージング諸国は、国際収支や外貨準備の動向、財政赤字の削減などの観点でファンダメンタルズは良好な状態にあると見ており、世界的に資産価格が金融政策等により割高な状態にあると見られる中で、エマージング市場の資産の相対的な魅力度は高いと考えています。しかし、短期的には米国の政治動向や先進国の金融政策の動向、コモディティ価格の動向などの外部環境の変化による影響について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、先進国の金融政策や保護主義的な通商政策がもたらす影響が国によって異なることを考慮し、各国の財政状況や対外収支などのファンダメンタルズに基づいて投資対象国を慎重に選別する方針です。
- ・政治動向には留意が必要なものの、ファンダメンタルズの改善が続いているブラジル、ファンダメンタルズの改善などが期待でき、中南米諸国の中では相対的に割安感があると考えられるアルゼンチンなどについて積極姿勢とします。一方、地政学的リスクや脆弱なファンダメンタルズ、高い対外資金依存度などを考慮してハンガリーを消極姿勢とするほか、低水準の利回りや中国の経済成長の鈍化の影響が懸念されるフィリピンについて消極姿勢とする方針です。
- ・また、保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、各対象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

(2017年6月21日～2017年12月20日)

項 目	第47期～第52期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	79	0.893	(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)	(44)	(0.492)	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)	(34)	(0.379)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	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	79	0.895	
作成期中の平均基準価額は、8,857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) 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。

○売買及び取引の状況

(2017年6月21日～2017年12月20日)

投資信託証券

銘柄		第47期～第52期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内		千口	千円	千口	千円
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (AUD)	4	37,837	12	102,333
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (BRL)	11	56,814	24	125,367
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (MXN)	10	71,213	14	102,333
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド III - クラスJ (USD)	3	35,073	10	102,333
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド III - クラスJ (EUR)	2	21,074	14	128,752
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド III - クラスJ (GBP)	2	23,481	14	118,668
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (CAD)	3	27,294	15	124,472
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (TRY)	19	109,779	17	102,333
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (INR)	5	44,898	11	102,461
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (IDR)	6	54,637	12	102,333
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (RUB)	9	54,055	18	102,960
	ビムコ エマーゼンダ ボンド インカム ファンド II - クラスJ (KRW)	2	26,536	12	121,444
合計		81	562,699	178	1,335,795

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2017年6月21日～2017年12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

(2017年12月20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46期末	第52期末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		千口	千口	千円	%
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (AUD)		94	87	734,712	8.3
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (BRL)		156	142	718,271	8.1
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (MXN)		111	107	714,228	8.1
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド III - クラスJ (USD)		80	73	728,482	8.3
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド III - クラスJ (EUR)		92	80	729,530	8.3
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド III - クラスJ (GBP)		96	85	731,938	8.3
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (CAD)		99	88	718,708	8.1
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (TRY)		132	134	753,320	8.5
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (INR)		88	82	739,662	8.4
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (IDR)		97	91	725,241	8.2
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (RUB)		136	128	731,200	8.3
ビムコ エマージング ボンド インカム ファンド II - クラスJ (KRW)		84	74	730,510	8.3
合 計		1,271	1,175	8,755,809	99.3

(注) 比率はP I M C O 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) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘	柄	第46期末	第52期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
マネー・マーケット・マザーファンド		12,234	12,234	12,459

○投資信託財産の構成

(2017年12月20日現在)

項 目	第52期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	8,755,809	98.6
マネー・マーケット・マザーファンド	12,459	0.1
コール・ローン等、その他	115,365	1.3
投資信託財産総額	8,883,633	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第47期末	第48期末	第49期末	第50期末	第51期末	第52期末
	2017年7月20日現在	2017年8月21日現在	2017年9月20日現在	2017年10月20日現在	2017年11月20日現在	2017年12月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	9,538,756,850	9,134,950,368	9,458,710,429	9,253,583,906	8,885,124,712	8,883,633,944
コール・ローン等	61,551,829	63,143,186	49,433,023	70,346,249	118,656,267	73,365,167
投資信託受益証券(評価額)	9,314,745,543	8,963,347,704	9,317,817,928	9,114,778,179	8,705,008,967	8,755,809,299
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	12,459,478	12,459,478	12,459,478	12,459,478	12,459,478	12,459,478
未収入金	150,000,000	96,000,000	79,000,000	56,000,000	49,000,000	42,000,000
(B) 負債	77,020,069	101,364,649	69,275,522	67,701,754	116,493,465	64,399,309
未払収益分配金	53,566,257	52,431,222	52,018,813	51,125,124	50,060,343	49,658,904
未払解約金	9,627,976	34,384,256	3,692,025	3,000,000	52,761,859	1,826,633
未払信託報酬	13,800,647	14,522,680	13,539,984	13,551,896	13,646,266	12,890,224
未払利息	107	98	93	105	196	120
その他未払費用	25,082	26,393	24,607	24,629	24,801	23,428
(C) 純資産総額(A-B)	9,461,736,781	9,033,585,719	9,389,434,907	9,185,882,152	8,768,631,247	8,819,234,635
元本	10,713,251,460	10,486,244,556	10,403,762,683	10,225,024,965	10,012,068,658	9,931,780,862
次期繰越損益金	△ 1,251,514,679	△ 1,452,658,837	△ 1,014,327,776	△ 1,039,142,813	△ 1,243,437,411	△ 1,112,546,227
(D) 受益権総口数	10,713,251,460口	10,486,244,556口	10,403,762,683口	10,225,024,965口	10,012,068,658口	9,931,780,862口
1万口当たり基準価額(C/D)	8.832円	8.615円	9.025円	8.984円	8.758円	8.880円

○損益の状況

項 目	第47期	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期
	2017年6月21日～ 2017年7月20日	2017年7月21日～ 2017年8月21日	2017年8月22日～ 2017年9月20日	2017年9月21日～ 2017年10月20日	2017年10月21日～ 2017年11月20日	2017年11月21日～ 2017年12月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	80,249,124	77,299,488	77,426,521	74,593,302	72,635,618	72,370,436
受取配当金	80,252,519	77,302,826	77,430,281	74,595,695	72,638,620	72,373,002
受取利息	97	31	89	132	—	64
支払利息	△ 3,492	△ 3,369	△ 3,849	△ 2,525	△ 3,002	△ 2,630
(B) 有価証券売買損益	155,288,332	△ 237,958,888	413,638,048	△ 52,120,108	△ 234,831,860	110,772,933
売買益	170,823,630	1,133,271	417,033,142	34,088,692	17,221,064	114,251,098
売買損	△ 15,535,298	△ 239,092,159	△ 3,395,094	△ 86,208,800	△ 252,052,924	△ 3,478,165
(C) 信託報酬等	△ 13,825,729	△ 14,549,073	△ 13,564,591	△ 13,576,525	△ 13,671,067	△ 12,913,652
(D) 当期損益金(A+B+C)	221,711,727	△ 175,208,473	477,499,978	8,896,669	△ 175,867,309	170,229,717
(E) 前期繰越損益金	△1,754,953,753	△1,552,567,000	△1,753,764,560	△1,304,563,161	△1,318,558,894	△1,528,205,089
(F) 追加信託差損益金	335,293,604	327,547,858	313,955,619	307,648,803	301,049,135	295,088,049
(配当等相当額)	(943,239,187)	(923,652,015)	(923,486,937)	(908,315,300)	(889,535,576)	(884,933,682)
(売買損益相当額)	(△ 607,945,583)	(△ 596,104,157)	(△ 609,531,318)	(△ 600,666,497)	(△ 588,486,441)	(△ 589,845,633)
(G) 計(D+E+F)	△1,197,948,422	△1,400,227,615	△ 962,308,963	△ 988,017,689	△1,193,377,068	△1,062,887,323
(H) 収益分配金	△ 53,566,257	△ 52,431,222	△ 52,018,813	△ 51,125,124	△ 50,060,343	△ 49,658,904
次期繰越損益金(G+H)	△1,251,514,679	△1,452,658,837	△1,014,327,776	△1,039,142,813	△1,243,437,411	△1,112,546,227
追加信託差損益金	335,293,604	327,547,858	313,955,619	307,648,803	301,049,135	295,088,049
(配当等相当額)	(943,239,187)	(923,652,015)	(923,486,937)	(908,315,300)	(889,535,576)	(884,933,682)
(売買損益相当額)	(△ 607,945,583)	(△ 596,104,157)	(△ 609,531,318)	(△ 600,666,497)	(△ 588,486,441)	(△ 589,845,633)
分配準備積立金	1,027,979,728	1,016,116,433	1,024,292,207	1,015,892,242	1,003,500,345	1,010,529,818
繰越損益金	△2,614,788,011	△2,796,323,128	△2,352,575,602	△2,362,683,858	△2,547,986,891	△2,418,164,094

(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 10,925,664,681円
 作成期中追加設定元本額 115,139,196円
 作成期中一部解約元本額 1,109,023,015円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8880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1,112,546,227円です。

③分配金の計算過程

項 目	2017年6月21日～ 2017年7月20日	2017年7月21日～ 2017年8月21日	2017年8月22日～ 2017年9月20日	2017年9月21日～ 2017年10月20日	2017年10月21日～ 2017年11月20日	2017年11月21日～ 2017年12月20日
費用控除後の配当等収益額	75,538,670円	62,750,405円	75,287,378円	61,016,776円	58,964,543円	67,266,938円
費用控除後・繰越大損金額後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	943,239,187円	923,652,015円	923,486,937円	908,315,300円	889,535,576円	884,933,682円
分配準備積立金額	1,006,007,315円	1,005,797,250円	1,001,023,642円	1,006,000,590円	994,596,145円	992,921,784円
当ファンドの分配対象収益額	2,024,785,172円	1,992,199,670円	1,999,797,957円	1,975,332,666円	1,943,096,264円	1,945,122,404円
1万口当たり収益分配対象額	1,889円	1,899円	1,922円	1,931円	1,940円	1,958円
1万口当たり分配金額	50円	50円	50円	50円	50円	50円
収益分配金金額	53,566,257円	52,431,222円	52,018,813円	51,125,124円	50,060,343円	49,658,904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47期	第48期	第49期	第50期	第51期	第52期
1 万口当たり分配金 (税込み)	50円	50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 (<http://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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017年12月20日現在)

＜マネー・マーケット・マザーファンド＞

下記は、マネー・マーケット・マザーファンド全体(1,265,731千円)の内容です。

国内その他有価証券

区 分	第52期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円	%
	1,199,998	93.1

（注）比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(AUD)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(BRL)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(MXN)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(CAD)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(IDR)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(INR)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(KRW)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(RUB)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅱ	－	クラスJ	(TRY)																																																																																																				
	ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(EUR)																																																																																																				
ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(GBP)																																																																																																					
ビムコ	エマーヅィング	ボンド	インカム	ファンド	Ⅲ	－	クラスJ	(USD)																																																																																																					
運用方針	ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド(Ⅲ)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債券およびその派生商品等																																																																																																												
主な組入制限	・ 通常、ファンドの純資産総額の80%以上を新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する債券およびその派生商品に投資します。 ・ 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ます。 ・ 投資する債券の平均格付けは、原則としてB－格相当以上に維持します。 ・ 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。 ・ 米ドル建ておよび米ドル建て以外の資産に投資を行います。 ・ 資金管理目的で、米国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等にも投資を行います。 ・ 保有外貨建て資産に対し、以下の為替対応を行います。																																																																																																												
<table><tr><td colspan="10">ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅱ － クラスJ</td></tr><tr><td colspan="5">AUD (豪ドル)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">BRL (ブラジルレアル)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、ブラジルレアル買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">MXN (メキシコペソ)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">CAD (カナダドル)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、カナダドル買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">IDR (インドネシアルピア)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、インドネシアルピア買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">INR (インドルピー)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">KRW (韓国ウォン)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、韓国ウォン買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">RUB (ロシアルーブル)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、ロシアルーブル買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">TRY (トルコリラ)</td><td colspan="5">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。</td></tr></table>										ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅱ － クラスJ										AUD (豪ドル)					原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。					BRL (ブラジルレアル)					原則として、米ドル売り、ブラジルレアル買いの為替取引を行います。					MXN (メキシコペソ)					原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。					CAD (カナダドル)					原則として、米ドル売り、カナダドル買いの為替取引を行います。					IDR (インドネシアルピア)					原則として、米ドル売り、インドネシアルピア買いの為替取引を行います。					INR (インドルピー)					原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。					KRW (韓国ウォン)					原則として、米ドル売り、韓国ウォン買いの為替取引を行います。					RUB (ロシアルーブル)					原則として、米ドル売り、ロシアルーブル買いの為替取引を行います。					TRY (トルコリラ)					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。				
ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅱ － クラスJ																																																																																																													
AUD (豪ドル)					原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。																																																																																																								
BRL (ブラジルレアル)					原則として、米ドル売り、ブラジルレアル買いの為替取引を行います。																																																																																																								
MXN (メキシコペソ)					原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。																																																																																																								
CAD (カナダドル)					原則として、米ドル売り、カナダドル買いの為替取引を行います。																																																																																																								
IDR (インドネシアルピア)					原則として、米ドル売り、インドネシアルピア買いの為替取引を行います。																																																																																																								
INR (インドルピー)					原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。																																																																																																								
KRW (韓国ウォン)					原則として、米ドル売り、韓国ウォン買いの為替取引を行います。																																																																																																								
RUB (ロシアルーブル)					原則として、米ドル売り、ロシアルーブル買いの為替取引を行います。																																																																																																								
TRY (トルコリラ)					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。																																																																																																								
<table><tr><td colspan="10">ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅲ － クラスJ</td></tr><tr><td colspan="5">EUR (ユーロ)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、ユーロ買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">GBP (英ポンド)</td><td colspan="5">原則として、米ドル売り、英ポンド買いの為替取引を行います。</td></tr><tr><td colspan="5">USD (米ドル)</td><td colspan="5">原則として、為替ヘッジを行いません。</td></tr></table>										ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅲ － クラスJ										EUR (ユーロ)					原則として、米ドル売り、ユーロ買いの為替取引を行います。					GBP (英ポンド)					原則として、米ドル売り、英ポンド買いの為替取引を行います。					USD (米ドル)					原則として、為替ヘッジを行いません。																																																																
ビムコ エマーヅィング ボンド インカム ファンド Ⅲ － クラスJ																																																																																																													
EUR (ユーロ)					原則として、米ドル売り、ユーロ買いの為替取引を行います。																																																																																																								
GBP (英ポンド)					原則として、米ドル売り、英ポンド買いの為替取引を行います。																																																																																																								
USD (米ドル)					原則として、為替ヘッジを行いません。																																																																																																								
決算日	原則として毎年10月31日																																																																																																												
分配方針	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わ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 II Annual Report October 31, 2016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 エマージング ボンド インカム ファンド II」、「ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド III」で掲載しています。また、「ピムコ エマージング ボンド インカム 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

(A) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド II

(2015年11月1日～2016年10月31日)

ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド II		千米ドル
投資収入：		
受取利息		179
雑収入		1
収入合計		180
費用：		
支払利息		70
雑費用		1
費用合計		71
投資純収入		109
実現純利益（損失）：		
投資有価証券		19
マスターファンド		(3, 799)
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		11, 790
外貨		(140)
実現純利益（損失）		7, 870
未実現評価益（評価損）の純変動：		
投資有価証券		21
マスターファンド		48, 256
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		(11, 140)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨		(10)
未実現評価益（評価損）の純変動		37, 127
純利益（損失）		44, 997
運用による純資産の純増（減）額		45, 106

(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。

(B) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド III
(2015年11月1日～2016年10月31日)

ピムコ エマージング
ボンド インカム ファンド III
千米ドル

投資収入：

受取利息	4
雑収入	0
収入合計	4

費用：

支払利息	0
雑費用	0
費用合計	0

投資純収入

4

実現純利益（損失）：

投資有価証券	2
マスターファンド	(621)
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(1, 872)
外貨	15
実現純利益（損失）	(2, 476)

未実現評価益（評価損）の純変動：

投資有価証券	(1)
マスターファンド	4, 309
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(785)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	(1)
未実現評価益（評価損）の純変動	3, 522
純利益（損失）	1, 046

運用による純資産の純増（減）額

1, 050

(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

(A) ピムコ エマーシング ボンド インカム ファンド II

(2015年11月1日～2016年10月31日)

ピムコ エマーシング
ボンド インカム ファンド II

千米ドル

純資産の増加（減少）:

運用:

投資純収入	109
実現純利益（損失）	7,870
未実現評価益（評価損）の純変動	37,127
運用による純資産の純増（減）額	45,106

分配:

分配額

J (AUD)	(15,129)
J (BRL)	(3,395)
J (CAD)	(899)
J (IDR)	(1,604)
J (INR)	(1,552)
J (KRW)	(975)
J (MXN)	(18,584)
J (RUB)	(2,032)
J (TRY)	(1,652)
分配金額合計	(45,822)

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	(155,642)
-------------------------	-----------

純資産の増（減）額合計

(156,358)

純資産:

期首	516,011
期末	359,653

(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。

(B) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド III
(2015年11月 1 日～2016年10月31日)

ピムコ エマージング
ボンド インカム ファンド III
千米ドル

純資産の増加（減少）：

運用：

投資純収入	4
実現純利益（損失）	(2, 476)
未実現評価益（評価損）の純変動	3, 522
運用による純資産の純増（減）額	1, 050

分配：

分配額

J (EUR)	(776)
J (GBP)	(853)
J (USD)	(847)
分配金額合計	(2, 476)

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	(14, 428)
-------------------------	-----------

純資産の増（減）額合計

(15, 854)

純資産：

期首	41, 704
期末	25, 850

(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 エマージング ボンド インカム ファンド II
(2016年10月31日現在)

元本 (単位: 千)		時価 (単位: 千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 8.0%		
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 1.9%		
U.S. Treasury Notes		
0.524% due 07/31/2018	\$ 6,800	\$ 6,805
Total U.S. Treasury Obligations		6,805
(Cost \$6,799)		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 6.1%		
TIME DEPOSITS 0.2%		
ANZ National Bank		
0.150% due 11/01/2016	128	128
Citibank N.A.		
0.150% due 11/01/2016	101	101
DBS Bank Ltd.		
0.150% due 11/01/2016	201	201
DnB NORBank ASA		
0.150% due 11/01/2016	7	7
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.150% due 11/01/2016	109	109
		546
U.S. TREASURY BILLS 5.9%		
0.320% due 01/19/2017	2,600	2,599
0.400% due 03/02/2017 (a)	6,100	6,093
0.436% due 02/23/2017 (c)	159	159
0.486% due 03/09/2017 (a)	12,500	12,484
		21,335
Total Short-Term Instruments		21,881
(Cost \$21,874)		
Total Investments in Securities		28,686
(Cost \$28,673)		
口数 (単位: 千)		
INVESTMENTS IN AFFILIATES 92.1%		
MUTUAL FUNDS 92.1%		
PIMCO Emerging Bond Income Fund (M)		
(Cost \$301,880)	24,349	331,392
Total Investments in Affiliates		331,392
(Cost \$301,880)		
Total Investments 100.1%		\$ 360,078
(Cost \$330,553)		
Financial Derivative		
Instruments (b) 0.3%		978
(Cost or Premiums, net \$0)		
Other Assets and Liabilities, net (0.4%)		(1,403)
Net Assets 100.0%		\$ 359,653

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	11/2016	\$ 1,424	JPY 143,525	\$ 0	\$ (59)
BOA	11/2016	856	90,000	0	0
HUS	11/2016	738	77,770	2	0
HUS	11/2016	1,385	145,470	0	(1)

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
MSB	11/2016	JPY 143,525	\$ 1,414	\$ 50	\$ 0
				\$ 52	\$ (60)

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	11/2016	AUD 68,586	\$ 52,192	\$ 17	\$ 0
AZD	11/2016	\$ 53,758	AUD 70,156	0	(373)
AZD	12/2016	51,684	67,951	0	(18)
BDA	11/2016	AUD 3,032	\$ 2,307	0	0
CBK	11/2016	508	387	1	0
JPM	11/2016	1,656	1,272	12	0
NAB	11/2016	68,168	51,849	0	(24)
NAB	11/2016	\$ 53,855	AUD 70,256	0	(395)
NAB	12/2016	51,807	68,168	25	0
SCX	11/2016	AUD 547	\$ 415	0	(1)
SOG	11/2016	375	288	3	0
UAG	11/2016	68,536	51,986	1	(167)
UAG	11/2016	\$ 52,937	AUD 69,760	147	0
UAG	12/2016	51,795	68,339	167	0
				\$ 373	\$ (978)

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
BPS	11/2016	BRL 7,215	\$ 2,303	\$ 31	\$ (7)
BPS	11/2016	\$ 2,268	BRL 7,215	10	0
BPS	12/2016	2,044	6,433	0	(31)
CBK	11/2016	BRL 94	\$ 29	0	(1)
CBK	11/2016	\$ 30	BRL 94	0	0
DUB	11/2016	BRL 11	\$ 4	0	0
DUB	11/2016	\$ 4	BRL 11	0	0
DUB	12/2016	868	2,855	26	0
DUB	02/2017	3,947	13,204	106	0
FBF	11/2016	BRL 3,758	\$ 1,181	0	(5)
FBF	11/2016	\$ 1,153	BRL 3,758	33	0
GLM	11/2016	BRL 590	\$ 184	0	(2)
GLM	11/2016	\$ 185	BRL 590	1	0
JPM	11/2016	BRL 8,619	\$ 2,722	22	(22)
JPM	11/2016	\$ 2,667	BRL 8,619	52	0
JPM	12/2016	BRL 269	\$ 84	0	0
JPM	12/2016	\$ 3,656	BRL 12,465	67	(22)
MSB	11/2016	BRL 6,228	\$ 1,958	0	(1)
MSB	11/2016	\$ 1,908	BRL 6,228	59	0
MSB	12/2016	2,557	8,455	89	0
RBC	11/2016	BRL 223	\$ 70	0	0
RBC	11/2016	\$ 68	BRL 223	2	0
SCX	12/2016	BRL 627	\$ 196	0	0
				\$ 498	\$ (91)

J (CAD) 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	11/2016	CAD 35	\$ 26	\$ 0	\$ 0
AZD	11/2016	\$ 20	CAD 27	0	0
BDA	11/2016	CAD 111	\$ 83	0	0
CBK	11/2016	3,777	2,820	2	0
CBK	11/2016	\$ 3,031	CAD 3,970	0	(68)
CBK	12/2016	2,621	3,777	0	(2)
GLM	12/2016	CAD 100	\$ 75	0	0
HUS	11/2016	73	55	1	0
IND	11/2016	\$ 307	CAD 405	0	(5)
IND	12/2016	CAD 87	\$ 65	0	0
JPM	11/2016	3,874	2,894	3	0
JPM	11/2016	\$ 3,021	CAD 3,997	0	(39)

J (CAD) 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
JPM	12/2016	\$ 2,852	CAD 3,817	\$ 0	\$ (3)
MSB	11/2016	CAD 182	\$ 139	3	0
NAB	11/2016	\$ 2,975	CAD 3,902	0	(64)
SCX	11/2016	CAD 211	\$ 160	3	0
SCX	11/2016	\$ 20	CAD 27	0	0
TOR	11/2016	CAD 3,901	\$ 2,915	4	0
TOR	12/2016	\$ 2,915	CAD 3,901	0	(4)
UAG	11/2016	CAD 41	\$ 31	0	0
				\$ 16	\$ (185)

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
AZD	11/2016	\$ 4,048	IDR 53,901,876	\$ 82	\$ 0
BPS	11/2016	IDR 241,290	\$ 18	0	0
BRC	11/2016	1,393,494	104	0	(2)
CBK	11/2016	30,468,883	2,338	4	0
CBK	11/2016	\$ 18	IDR 238,431	0	0
CBK	01/2017	2,316	30,468,883	0	(8)
GLM	11/2016	IDR 584,282	\$ 45	0	0
HUS	11/2016	1,031,073	78	0	(1)
JPM	11/2016	53,238,404	4,064	1	(16)
JPM	11/2016	\$ 180	IDR 2,414,340	5	0
JPM	01/2017	IDR 3,118,851	\$ 236	0	0
JPM	01/2017	\$ 3,623	IDR 47,937,634	10	0
MSB	11/2016	IDR 411,553	\$ 31	0	0
SCX	11/2016	7,602,245	580	0	(3)
SCX	11/2016	\$ 2,169	IDR 28,698,853	29	0
SCX	01/2017	IDR 738,556	\$ 56	0	0
SOG	11/2016	3,730,581	282	0	(4)
TOR	01/2017	1,446,814	110	0	0
UAG	11/2016	40,980,151	3,122	0	(17)
UAG	11/2016	\$ 4,073	IDR 54,429,456	97	0
UAG	01/2017	3,090	40,980,151	16	0
				\$ 244	\$ (51)

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
BPS	11/2016	\$ 2,498	INR 169,166	\$ 35	\$ 0
BRC	11/2016	INR 346	\$ 5	0	0
BRC	11/2016	\$ 3,525	INR 238,809	50	0
GLM	11/2016	INR 210,030	\$ 3,136	0	(9)
GLM	01/2017	\$ 3,105	INR 210,030	9	0
HUS	11/2016	INR 162,888	\$ 2,431	0	(7)
HUS	01/2017	\$ 2,358	INR 159,334	5	0
JPM	11/2016	INR 41,226	\$ 612	0	(5)
JPM	11/2016	\$ 343	INR 23,196	4	0
JPM	01/2017	INR 23,380	\$ 346	0	(1)
MSB	11/2016	5,589	83	0	(1)
SCX	11/2016	1,936	29	0	0
SCX	11/2016	\$ 21	INR 1,406	0	0
SOG	11/2016	INR 43,645	\$ 651	0	(3)
SOG	01/2017	\$ 78	INR 5,282	0	0
UAG	11/2016	INR 239,842	\$ 3,586	0	(5)
UAG	11/2016	\$ 4,031	INR 272,924	55	0
UAG	01/2017	INR 4,112	\$ 61	0	0
UAG	01/2017	\$ 3,508	INR 236,807	4	0
				\$ 162	\$ (31)

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
BOA	11/2016	KRW 323,663	\$ 291	\$ 8	\$ 0

J (KRW) 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
BPS	11/2016	\$ 25,852	KRW 23	\$ 1	\$ 0
BPS	01/2017	KRW 62,833	\$ 56	1	0
GLM	11/2016	38,256	35	1	0
GLM	11/2016	\$ 180	KRW 201,024	0	(5)
HUS	11/2016	KRW 188,935	\$ 170	5	0
JPM	11/2016	4,086,603	3,636	71	0
JPM	01/2017	244,260	215	2	0
JPM	01/2017	\$ 3,118	KRW 3,502,513	0	(63)
MSB	11/2016	KRW 123,557	\$ 111	3	0
SCX	11/2016	176,784	161	7	0
SCX	11/2016	\$ 3,168	KRW 3,520,531	0	(96)
SCX	01/2017	KRW 161,857	\$ 141	0	0
SOG	11/2016	3,663,692	3,267	71	0
SOG	11/2016	\$ 3,716	KRW 4,134,049	0	(109)
SOG	01/2017	2,957	3,322,570	0	(59)
UAG	11/2016	KRW 3,357,767	\$ 2,963	34	0
UAG	11/2016	\$ 3,712	KRW 4,129,505	0	(110)
UAG	01/2017	2,962	3,357,767	0	(34)
				\$ 204	\$ (476)

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
BQA	02/2017	MXN 6,678	\$ 347	\$ 0	\$ (4)
BQA	02/2017	\$ 28,294	MXN 542,898	240	0
BPS	02/2017	MXN 6,195	\$ 328	3	0
BRC	02/2017	\$ 29,565	MXN 568,233	300	0
CBK	11/2016	MXN 25,859	\$ 1,375	0	0
CBK	11/2016	\$ 148	MXN 2,793	1	0
CBK	02/2017	MXN 30,483	\$ 1,613	13	(2)
GLM	02/2017	\$ 28,238	MXN 542,898	296	0
HUS	11/2016	MXN 2,793	\$ 149	1	0
HUS	02/2017	5,016	267	3	0
HUS	02/2017	\$ 29,507	MXN 565,473	213	0
JPM	02/2017	MXN 15,258	\$ 805	3	0
SCX	02/2017	\$ 27,959	MXN 534,363	127	0
				\$ 1,200	\$ (6)

J (RUB) 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
BQA	12/2016	\$ 54	RUB 3,405	\$ 0	\$ 0
BPS	12/2016	RUB 30,701	\$ 478	0	(2)
BRC	12/2016	2,670	42	1	0
CBK	12/2016	1,906	30	0	0
FBF	12/2016	\$ 3,229	RUB 209,729	46	0
GLM	12/2016	RUB 7,007	\$ 110	0	0
MSB	12/2016	\$ 3,156	RUB 205,615	55	0
SCX	12/2016	RUB 10,472	\$ 164	1	0
SCX	12/2016	\$ 3,051	RUB 196,295	14	0
SOG	12/2016	RUB 10,643	\$ 168	1	0
				\$ 118	\$ (2)

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
BQA	01/2017	\$ 2,601	TRY 8,151	\$ 0	\$ (16)
CBK	11/2016	TRY 142	\$ 46	0	0
CBK	11/2016	\$ 75	TRY 233	0	0
CBK	01/2017	TRY 233	\$ 74	0	0
CBK	01/2017	\$ 2,906	TRY 9,227	20	0
HUS	11/2016	TRY 233	\$ 75	0	0
SOG	01/2017	\$ 2,909	TRY 9,139	0	(11)

J (TRY) 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
TOR	01/2017	\$	366	TRY	1,149	\$ 0 (2)
					\$ 20	\$ (29)
Total Forward Foreign Currency Contracts					\$ 2,887	\$ (1,909)

(B) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド III
(2016年10月31日現在)

元本 (単位: 千)		時価 (単位: 千)	
INVESTMENTS IN SECURITIES 3.5%			
SHORT-TERM INSTRUMENTS 3.5%			
TIME DEPOSITS 0.8%			
ANZ National Bank			
0.150% due 11/01/2016	\$	47	\$ 47
Citibank N.A.			
0.150% due 11/01/2016		38	38
DBS Bank Ltd.			
0.150% due 11/01/2016		74	74
DnB NORBank ASA			
0.150% due 11/01/2016		3	3
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
0.150% due 11/01/2016		40	40
			202
U.S. TREASURY BILLS 2.7%			
0.306% due 02/02/2017		200	200
0.486% due 03/02/2017		500	499
			699
Total Short-Term Instruments			901
(Cost \$901)			
Total Investments in Securities			901
(Cost \$901)			
		口数 (単位: 千)	
INVESTMENTS IN AFFILIATES 98.4%			
MUTUAL FUNDS 98.4%			
PIMCO Emerging Bond Income Fund (M)			
(Cost \$23,375)		1,870	25,446
Total Investments in Affiliates			25,446
(Cost \$23,375)			
Total Investments 101.9%	\$		26,347
(Cost \$24,276)			
Financial Derivative			
Instruments (a) (2.9%)			(745)
(Cost or Premiums, net \$0)			
Other Assets and Liabilities, net 1.0%			248
Net Assets 100.0%	\$		25,850

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

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

(a) 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
HUS	11/2016	\$ 222	JPY 23,350	\$ 1	\$ 0
HUS	11/2016	195	20,500	0	0
				\$ 1	\$ 0

J (EUR) 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	11/2016	EUR	2,749	\$	3,001	\$	0	\$	(12)
BOA	11/2016	\$	3,039	EUR	2,715		0		(63)
BOA	12/2016		2,851		2,609		12		0

J (EUR) 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
BPS	11/2016	EUR 2,834	\$ 3,100	\$ 4	\$ (10)
BPS	12/2016	\$ 2,917	EUR 2,667	10	0
CBK	11/2016	EUR 28	\$ 31	0	0
CBK	11/2016	\$ 18	EUR 16	0	(1)
FBF	11/2016	EUR 39	\$ 42	0	0
GLM	11/2016	126	139	1	0
GLM	11/2016	\$ 3,140	EUR 2,798	0	(73)
HUS	11/2016	EUR 68	\$ 74	0	0
HUS	11/2016	\$ 3,107	EUR 2,765	0	(76)
JPM	11/2016	EUR 2,606	\$ 2,853	0	(4)
JPM	12/2016	60	66	0	0
JPM	12/2016	\$ 2,857	EUR 2,606	4	0
SCX	11/2016	153	139	0	(1)
SCX	11/2016	74	68	0	0
SCX	12/2016	EUR 68	\$ 75	0	0
UAG	11/2016	141	154	0	0
UAG	12/2016	\$ 154	EUR 141	0	0
				\$ 31	\$ (240)

J (GBP) 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	11/2016	\$ 74	GBP 61	\$ 0	\$ 0
AZD	12/2016	GBP 61	\$ 74	0	0
BOA	11/2016	2,462	3,000	0	(6)
BOA	12/2016	\$ 2,907	GBP 2,384	6	0
BPS	11/2016	3,016	2,317	0	(187)
BPS	12/2016	GBP 53	\$ 64	0	0
CBK	11/2016	138	170	1	0
CBK	11/2016	\$ 861	GBP 705	0	(1)
GLM	11/2016	GBP 21	\$ 26	1	0
GLM	11/2016	\$ 18	GBP 14	0	(1)
HUS	11/2016	GBP 2,358	\$ 2,872	0	(7)
HUS	11/2016	61	74	0	0
HUS	11/2016	\$ 2,999	GBP 2,302	0	(189)
HUS	12/2016	2,874	2,358	7	0
JPM	11/2016	2,932	2,262	0	(171)
SCX	11/2016	GBP 35	\$ 43	0	0
SCX	11/2016	\$ 27	GBP 22	0	0
SOG	11/2016	GBP 2,458	\$ 3,005	3	0
SOG	12/2016	\$ 2,950	GBP 2,412	0	(3)
UAG	11/2016	GBP 124	\$ 161	10	0
				\$ 28	\$ (565)
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 80	\$ (805)

(G) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド (M)
(2016年10月31日現在)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 99.5%		
ANGOLA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Angolan Government International Bond		
9.500% due 11/12/2025	\$ 1,000	\$ 983
Total Angola		983
(Cost \$929)		
ARGENTINA 4.3%		
SOVEREIGN ISSUES 4.3%		
Argentina Government International Bond		
2.500% due 12/31/2038	5,900	4,047
3.875% due 01/15/2022	EUR 1,700	1,836
5.000% due 01/15/2027	1,700	1,773
6.250% due 04/22/2019	\$ 4,500	4,781
6.625% due 07/06/2028	150	155
6.875% due 04/22/2021	3,600	3,904
7.125% due 07/06/2036	150	155
7.500% due 04/22/2026	9,500	10,402
7.625% due 04/22/2046	3,900	4,269
8.750% due 06/02/2017	3,500	3,637
8.750% due 05/07/2024	700	844
Argentine Bonos del Tesoro		
15.500% due 10/17/2026	ARS 15,979	1,071
16.000% due 10/17/2023	6,743	452
18.200% due 10/03/2021	10,400	734
Provincia de Buenos Aires		
9.950% due 06/09/2021	\$ 800	914
10.875% due 01/26/2021 (d)	600	693
Provincia de Cordoba		
7.125% due 06/10/2021	200	207
Total Argentina		39,874
(Cost \$38,098)		
AZERBAIJAN 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Southern Gas Corridor CJSC		
6.875% due 03/24/2026	2,300	2,599
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Republic of Azerbaijan International Bond		
4.750% due 03/18/2024	2,400	2,487
State Oil Company of the Azerbaijan Republic		
4.750% due 03/13/2023	3,800	3,793
		6,280
Total Azerbaijan		8,879
(Cost \$8,428)		
BERMUDA 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%		
China Resources Gas Group Ltd.		
4.500% due 04/05/2022	7,000	7,581
Total Bermuda		7,581
(Cost \$7,353)		
BRAZIL 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 5.8%		
Banco do Brasil S.A.		
3.875% due 10/10/2022	6,086	5,827
Caixa Economica Federal		
4.500% due 10/03/2018	5,000	5,114
Centrais Eletricas Brasileiras S.A.		
5.750% due 10/27/2021	6,580	6,605

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
Petrobras Global Finance BV		
4.875% due 03/17/2020	\$ 20,400	\$ 20,599
5.625% due 05/20/2043	14,300	11,307
5.750% due 01/20/2020	1,500	1,552
6.750% due 01/27/2041	500	445
6.850% due 06/05/2115	1,000	855
6.875% due 01/20/2040	500	450
8.375% due 05/23/2021	1,100	1,220
		53,974
SOVEREIGN ISSUES 2.2%		
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social		
6.369% due 06/16/2018	1,800	1,909
Brazil Government International Bond		
2.625% due 01/05/2023	2,900	2,687
5.625% due 02/21/2047	2,700	2,592
Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais		
5.333% due 02/15/2028	14,100	13,888
		21,076
Total Brazil		75,050
(Cost \$76,035)		
BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Rosneft Finance S.A.		
7.250% due 02/02/2020	1,600	1,766
Total British Virgin Islands		1,766
(Cost \$1,729)		
CAYMAN ISLANDS 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Interoceania V Finance Ltd.		
0.000% due 05/15/2030	2,000	1,230
Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.		
0.000% due 05/31/2018	271	264
Total Cayman Islands		1,494
(Cost \$1,134)		
CHILE 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%		
Corp. Nacional del Cobre de Chile		
4.875% due 11/04/2044	12,800	12,872
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Chile Government International Bond		
3.625% due 10/30/2042	2,000	2,050
Total Chile		14,922
(Cost \$14,773)		
CHINA 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%		
Dianjian Haixing Ltd.		
4.050% due 10/21/2019 (a)	900	931
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.		
3.125% due 07/27/2021	300	303
4.200% due 07/27/2026 (d)	300	306
Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.		
4.375% due 04/10/2024	6,300	6,876
Total China		8,416
(Cost \$7,797)		

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
COLOMBIA 3.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
Ecopetrol S.A.		
5.875% due 05/28/2045	\$ 8,850	\$ 7,854
7.375% due 09/18/2043	4,475	4,576
		12,430
SOVEREIGN ISSUES 1.7%		
Colombia Government International Bond		
5.625% due 02/26/2044	5,400	5,927
6.125% due 01/18/2041	4,300	4,934
7.375% due 09/18/2037	3,700	4,754
		15,615
Total Colombia		28,045
(Cost \$28,280)		
COSTA RICA 1.1%		
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Costa Rica Government International Bond		
5.625% due 04/30/2043	5,400	4,831
7.000% due 04/04/2044	5,050	5,246
Instituto Costarricense de Electricidad		
6.375% due 05/15/2043	500	434
Total Costa Rica		10,511
(Cost \$10,432)		
CROATIA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Croatia Government International Bond		
6.000% due 01/26/2024	5,100	5,767
Total Croatia		5,767
(Cost \$5,453)		
DOMINICAN REPUBLIC 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Dominican Republic Government International Bond		
6.850% due 01/27/2045	1,600	1,672
6.875% due 01/29/2026	4,000	4,440
Total Dominican Republic		6,112
(Cost \$6,163)		
ECUADOR 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Ecuador Government International Bond		
10.750% due 03/28/2022	8,400	8,904
Total Ecuador		8,904
(Cost \$8,400)		
EGYPT 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Egypt Government International Bond		
5.875% due 06/11/2025	3,100	2,882
Total Egypt		2,882
(Cost \$3,074)		
EL SALVADOR 2.1%		
SOVEREIGN ISSUES 2.1%		
El Salvador Government International Bond		
5.875% due 01/30/2025	5,400	5,373
7.625% due 09/21/2034	2,700	2,923
7.625% due 02/01/2041	1,790	1,846
7.650% due 06/15/2035	6,465	6,730
8.250% due 04/10/2032	2,450	2,682

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Total El Salvador (Cost \$19,882)		\$ 19,554
GABON 0.7% SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Gabon Government International Bond		
6.375% due 12/12/2024	\$ 7,283	6,709
Total Gabon (Cost \$7,556)		6,709
GHANA 0.7% SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Republic of Ghana International Bond		
7.875% due 08/07/2023	300	288
9.250% due 09/15/2022	5,650	5,870
Total Ghana (Cost \$6,016)		6,158
GUATEMALA 0.5% SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Guatemala Government Bond		
4.875% due 02/13/2028	2,800	2,946
5.750% due 06/06/2022	700	784
8.125% due 10/06/2034	700	938
Total Guatemala (Cost \$4,590)		4,668
HONG KONG 0.4% CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
CNPC General Capital Ltd.		
2.750% due 05/14/2019	3,900	3,980
Total Hong Kong (Cost \$3,883)		3,980
HUNGARY 1.8% SOVEREIGN ISSUES 1.8%		
Hungary Government International Bond		
5.375% due 02/21/2023	2,000	2,273
5.375% due 03/25/2024	9,600	11,048
5.750% due 11/22/2023	3,400	3,972
Total Hungary (Cost \$16,081)		17,293
INDIA 0.3% SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Export-Import Bank of India		
3.375% due 08/05/2026	2,700	2,683
Total India (Cost \$2,700)		2,683
INDONESIA 6.9% CORPORATE BONDS & NOTES 3.9%		
Majapahit Holding BV		
7.750% due 01/20/2020	3,000	3,443
Pelabuhan Indonesia II PT		
4.250% due 05/05/2025	4,600	4,629
Pelabuhan Indonesia III Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,100	3,295

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Pertamina Persero PT		
4.875% due 05/03/2022	\$ 900	\$ 963
5.250% due 05/23/2021	1,200	1,299
5.625% due 05/20/2043	300	302
6.450% due 05/30/2044	12,100	13,364
Perusahaan Gas Negara Persero Tbk		
5.125% due 05/16/2024	7,800	8,344
Perusahaan Listrik Negara PT		
5.500% due 11/22/2021	400	444
		36,083
SOVEREIGN ISSUES 3.0%		
Indonesia Government International Bond		
2.625% due 06/14/2023	EUR 1,800	2,054
3.375% due 07/30/2025	3,600	4,276
3.750% due 04/25/2022	\$ 17,100	17,799
4.125% due 01/15/2025	1,900	1,998
4.750% due 01/08/2026	800	874
5.125% due 01/15/2045	450	491
6.750% due 01/15/2044	500	660
		28,152
Total Indonesia (Cost \$60,763)		64,235
IRELAND 1.5% CORPORATE BONDS & NOTES 1.5%		
Russian Railways via RZD Capital PLC		
3.450% due 10/06/2020	2,400	2,384
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC		
3.035% due 02/21/2018	EUR 1,700	1,889
5.942% due 11/21/2023	\$ 1,800	1,864
6.025% due 07/05/2022	4,800	5,036
6.902% due 07/09/2020	2,500	2,700
Total Ireland (Cost \$13,502)		13,873
IVORY COAST 0.8% SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Ivory Coast Government International Bond		
5.375% due 07/23/2024	3,400	3,443
6.375% due 03/03/2028	3,800	3,979
Total Ivory Coast (Cost \$7,090)		7,422
JAMAICA 0.2% SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Jamaica Government International Bond		
7.875% due 07/28/2045	1,900	2,195
Total Jamaica (Cost \$1,900)		2,195
JORDAN 0.6% SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Jordan Government International Bond		
5.750% due 01/31/2027 (b)	5,300	5,280
Total Jordan (Cost \$5,280)		5,280
KAZAKHSTAN 5.5% CORPORATE BONDS & NOTES 4.4%		
Intergas Finance BV		
6.375% due 05/14/2017	2,416	2,446

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
KazMunayGas National Co. JSC		
6.375% due 04/09/2021	\$ 1,000	\$ 1,102
7.000% due 05/05/2020	19,600	21,829
9.125% due 07/02/2018	1,970	2,164
Samruk-Energy JSC		
3.750% due 12/20/2017	13,300	13,411
		40,952
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
KazAgro National Management Holding JSC		
3.255% due 05/22/2019	EUR 6,500	7,065
Kazakhstan Government International Bond		
6.500% due 07/21/2045	\$ 3,100	3,719
		10,784
Total Kazakhstan (Cost \$52,461)		51,736
KENYA 0.6% SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Kenya Government International Bond		
5.875% due 06/24/2019	5,400	5,609
Total Kenya (Cost \$5,516)		5,609
LITHUANIA 1.1% SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Lithuania Government International Bond		
6.625% due 02/01/2022	6,200	7,519
7.375% due 02/11/2020	2,400	2,825
Total Lithuania (Cost \$9,944)		10,344
LUXEMBOURG 4.7% CORPORATE BONDS & NOTES 4.7%		
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.		
4.375% due 09/19/2022	14,500	14,347
6.000% due 11/27/2023	4,100	4,351
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.		
9.250% due 04/23/2019	2,740	3,132
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
5.180% due 06/28/2019	6,400	6,747
5.500% due 02/26/2024	15,700	15,602
Total Luxembourg (Cost \$43,385)		44,179
MEXICO 5.7% CORPORATE BONDS & NOTES 3.9%		
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC		
3.800% due 08/11/2026	1,100	1,092
Comision Federal de Electricidad		
4.750% due 02/23/2027	1,400	1,428
Petroleos Mexicanos		
1.875% due 04/21/2022	EUR 1,400	1,486
2.750% due 04/21/2027	3,000	2,904
4.250% due 01/15/2025	\$ 3,200	3,088
5.125% due 03/15/2023	EUR 1,200	1,467
5.500% due 01/21/2021	\$ 5,900	6,269
5.625% due 01/23/2046	6,200	5,385
6.375% due 01/23/2045	8,300	7,931
6.500% due 06/02/2041	1,860	1,817
6.875% due 08/04/2026	3,200	3,585
		36,452

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 1.8%		
Mexico Government International Bond		
3.800% due 01/30/2025	\$ 6,500	\$ 6,646
4.000% due 03/15/2115	EUR 6,200	6,175
4.800% due 01/23/2046	\$ 1,900	1,865
5.550% due 01/21/2045	2,100	2,360
		17,046
Total Mexico (Cost \$54,316)		53,498
MONGOLIA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Mongolia Government International Bond		
4.125% due 01/05/2018	1,500	1,448
5.125% due 12/05/2022	4,150	3,683
Total Mongolia (Cost \$5,645)		5,131
MOROCCO 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Morocco Government International Bond		
3.500% due 06/19/2024	EUR 1,200	1,424
Total Morocco (Cost \$1,604)		1,424
NAMIBIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Namibia International Bond		
5.250% due 10/29/2025	\$ 800	834
Total Namibia (Cost \$793)		834
NETHERLANDS 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV		
6.375% due 10/06/2020	11,000	11,839
Total Netherlands (Cost \$11,912)		11,839
OMAN 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Oman Government International Bond		
3.625% due 06/15/2021	1,200	1,211
4.750% due 06/15/2026	2,600	2,629
Total Oman (Cost \$3,781)		3,840
PANAMA 2.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Autoridad del Canal de Panama		
4.950% due 07/29/2035	1,300	1,471
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
Panama Government International Bond		
4.300% due 04/29/2053	8,800	9,020
6.700% due 01/26/2036	2,280	3,041
7.125% due 01/29/2026	8,800	11,682
		23,743
Total Panama (Cost \$22,781)		25,214

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
PERU 2.5%		
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
Corp. Financiera de Desarrollo S.A.		
4.750% due 02/08/2022	\$ 12,900	\$ 14,171
Fondo MIVIVIENDA S.A.		
3.500% due 01/31/2023	6,300	6,520
Peru Government International Bond		
3.750% due 03/01/2030	EUR 700	899
8.750% due 11/21/2033	\$ 1,200	1,896
Total Peru (Cost \$22,334)		23,486
PHILIPPINES 1.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.		
7.390% due 12/02/2024	7,100	9,470
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Philippines Government International Bond		
3.950% due 01/20/2040	5,800	6,261
Total Philippines (Cost \$14,467)		15,731
POLAND 1.0%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Poland Government International Bond		
3.250% due 04/06/2026	3,500	3,639
5.000% due 03/23/2022	800	907
5.125% due 04/21/2021	4,000	4,523
Total Poland (Cost \$8,738)		9,069
ROMANIA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Romania Government International Bond		
2.750% due 10/29/2025	EUR 3,700	4,349
2.875% due 05/26/2028	800	927
Total Romania (Cost \$5,056)		5,276
RUSSIA 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
SCF Capital Ltd.		
5.375% due 06/16/2023	\$ 3,500	3,639
Total Russia (Cost \$3,500)		3,639
SAUDI ARABIA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Saudi Government International Bond		
2.375% due 10/26/2021	200	199
3.250% due 10/26/2026	2,400	2,369
4.500% due 10/26/2046	4,100	4,037
Total Saudi Arabia (Cost \$6,585)		6,605
SENEGAL 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Senegal Government International Bond		
8.750% due 05/13/2021	2,450	2,777
Total Senegal (Cost \$2,700)		2,777

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SLOVENIA 1.6%		
SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
Slovenia Government International Bond		
5.250% due 02/18/2024	\$ 12,900	\$ 15,030
Total Slovenia (Cost \$14,814)		15,030
SOUTH AFRICA 4.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%		
Eskom Holdings SOC Ltd.		
5.750% due 01/26/2021	10,630	10,720
6.750% due 08/06/2023	2,200	2,275
		12,995
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
South Africa Government International Bond		
3.750% due 07/24/2026	EUR 200	229
4.875% due 04/14/2026	\$ 5,000	5,202
5.875% due 05/30/2022 (d)	16,500	18,664
		24,095
Total South Africa (Cost \$36,628)		37,090
SPAIN 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Autonomous Community of Catalonia		
4.900% due 09/15/2021	EUR 2,200	2,582
Xunta de Galicia		
6.964% due 12/28/2017	300	356
Total Spain (Cost \$2,933)		2,938
SRI LANKA 2.4%		
SOVEREIGN ISSUES 2.4%		
Sri Lanka Government International Bond		
5.750% due 01/18/2022	\$ 1,900	1,931
5.875% due 07/25/2022	7,526	7,696
6.125% due 06/03/2025	600	604
6.250% due 10/04/2020	2,800	2,933
6.250% due 07/27/2021	6,145	6,445
6.825% due 07/18/2026	1,600	1,694
6.850% due 11/03/2025	1,000	1,057
Total Sri Lanka (Cost \$21,840)		22,360
SUPRANATIONAL 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Africa Finance Corp.		
4.375% due 04/29/2020	700	732
Total Supranational (Cost \$695)		732
TANZANIA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Tanzania Government International Bond		
7.250% due 03/09/2020	4,822	5,044
Total Tanzania (Cost \$4,977)		5,044

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
TRINIDAD AND TOBAGO 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Trinidad & Tobago Government International Bond		
4.500% due 08/04/2026	\$ 1,800	\$ 1,841
Total Trinidad and Tobago		1,841
(Cost \$1,800)		
TUNISIA 1.0%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Banque Centrale de Tunisie International Bond		
3.280% due 08/09/2027	¥ 200,000	1,646
4.500% due 06/22/2020	EUR 800	903
5.750% due 01/30/2025	\$ 1,800	1,743
8.250% due 09/19/2027	4,413	4,838
Total Tunisia		9,130
(Cost \$9,875)		
TURKEY 1.7%		
SOVEREIGN ISSUES 1.7%		
Export Credit Bank of Turkey		
5.375% due 10/24/2023	9,900	9,910
Turkey Government International Bond		
4.875% due 04/16/2043	6,800	6,061
Total Turkey		15,971
(Cost \$16,607)		
UKRAINE 2.3%		
SOVEREIGN ISSUES 2.3%		
Ukraine Government International Bond		
7.750% due 09/01/2019	5,300	5,299
7.750% due 09/01/2020	6,000	5,961
7.750% due 09/01/2021	2,600	2,568
7.750% due 09/01/2022	600	589
7.750% due 09/01/2023	500	486
7.750% due 09/01/2024	1,700	1,643
7.750% due 09/01/2026 (d)	1,800	1,722
7.750% due 09/01/2027 (d)	3,500	3,335
Total Ukraine		21,603
(Cost \$20,762)		
UNITED ARAB EMIRATES 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
DP World Ltd.		
6.850% due 07/02/2037	5,100	5,835
Total United Arab Emirates		5,835
(Cost \$5,744)		
UNITED STATES 1.4%		
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.3%		
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
3.241% due 01/25/2035	443	443
GSAA Trust		
0.904% due 06/25/2035	2,115	2,102
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
0.854% due 08/25/2045	793	741
		3,286
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 1.1%		
U.S. Treasury Notes		
2.000% due 08/15/2025 (f)	10,100	10,275
Total United States		13,561
(Cost \$13,393)		

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
URUGUAY 2.7%		
SOVEREIGN ISSUES 2.7%		
Uruguay Government International Bond		
4.375% due 10/27/2027	\$ 5,100	\$ 5,412
5.100% due 06/18/2050	14,022	14,004
7.875% due 01/15/2033	3,910	5,449
Total Uruguay		24,865
(Cost \$24,101)		
VENEZUELA 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.375% due 04/12/2027	7,160	2,637
5.500% due 04/12/2037	11,131	4,107
8.500% due 11/02/2017	2,380	1,738
9.750% due 05/17/2035	1,020	458
		8,940
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Venezuela Government International Bond		
7.000% due 03/31/2038 (d)	10,040	4,252
7.650% due 04/21/2025	1,665	728
8.250% due 10/13/2024	1,730	771
		5,751
Total Venezuela		14,691
(Cost \$23,238)		
VIETNAM 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Vietnam Government International Bond		
4.800% due 11/19/2024	3,300	3,507
Total Vietnam		3,507
(Cost \$3,227)		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 8.8%		
REPURCHASE AGREEMENTS (c) 8.7%		
		81,600
TIME DEPOSITS 0.1%		
ANZ National Bank		
0.150% due 11/01/2016	169	169
Citibank N.A.		
0.150% due 11/01/2016	135	135
DBS Bank Ltd.		
0.150% due 11/01/2016	267	267
Deutsche Bank AG		
(0.568%) due 11/01/2016	EUR 85	93
DnB NORBank ASA		
0.150% due 11/01/2016	\$ 9	9
0.728% due 11/01/2016	AUD 1	1
HSBC Bank		
0.010% due 11/01/2016	SGD 1	1
JPMorgan Chase & Co.		
0.150% due 11/01/2016	\$ 1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.568%) due 11/01/2016	EUR 46	50
(0.420%) due 11/01/2016	¥ 8	0
0.150% due 11/01/2016	\$ 145	145
Wells Fargo Bank		
6.550% due 11/01/2016	ZAR 1	0
		871

	時価 (単位：千)
Total Short-Term Instruments	\$ 82,471
(Cost \$82,471)	
Total Investments in Securities 99.5%	\$ 932,136
(Cost \$925,944)	
Financial Derivative	
Instruments (e)(g) 0.0%	(47)
(Cost or Premiums, net \$(4,597))	
Other Assets and Liabilities, net 0.5%	4,449
Net Assets 100.0%	\$ 936,538

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

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

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(c) 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	レボ価値	レボ契約 の受取 ⁽¹⁾
BOS	0.480%	10/25/2016	11/08/2016	\$ 26,300	U.S. Treasury Bond 3.125% due 08/15/2044; U.S. Treasury Bond 3.750% due 08/15/2041 U.S. Treasury Note 1.375% due 01/31/2021	\$ (26,648) (57,139)	\$ 26,300 55,300	\$ 26,305 55,301
MBC	0.540%	10/31/2016	11/01/2016	55,300				
Total Repurchase Agreements						\$ (83,787)	\$ 81,600	\$ 81,606

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入金額 ⁽¹⁾	リバースレボ の支払
BPS	(1.250%)	08/05/2016	N/A ⁽²⁾	\$ (684)	\$ (682)
BRC	(0.750%)	09/06/2016	N/A ⁽²⁾	(1,624)	(1,622)
BRC	(0.750%)	09/13/2016	N/A ⁽²⁾	(686)	(685)
BRC	(0.450%)	10/12/2016	N/A ⁽²⁾	(17,134)	(17,130)
CFR	(0.750%)	08/30/2016	N/A ⁽²⁾	(870)	(869)
JML	(0.750%)	10/13/2016	11/03/2016	(1,425)	(1,424)
JML	(0.500%)	08/26/2016	N/A ⁽²⁾	(313)	(313)
Total Reverse Repurchase Agreements				\$	(22,725)

⁽¹⁾ Open maturity reverse repurchase agreement.

⁽²⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2016 was \$3,118 at a weighted average interest rate of (0.711%).

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	\$ (313)	\$ (313)	
Non - U.S. Government Debt	0	(1,424)	0	(20,988)	(22,412)	
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (1,424)	\$ 0	\$ (21,301)	\$ (22,725)	

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 October 31, 2016:

- (d) Securities with an aggregate market value of \$22,531 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of October 31, 2016.

取引相手	レボ契約 の受取	リバースレボ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの 支払	合計借入 その他金融取引	担保の差入 (受取)	ネットエクス ポージャー ⁽⁶⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 26,305	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 26,305	\$ (26,913)	\$ (608)
BPS	0	(682)	0	0	(682)	693	11
BRC	0	(19,437)	0	0	(19,437)	19,256	(181)
CFR	0	(869)	0	0	(869)	847	(22)
JML	0	(1,737)	0	0	(1,737)	1,735	(2)
MBC	55,301	0	0	0	55,301	(57,139)	(1,838)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 81,606	\$ (22,725)	\$ 0	\$ 0			

¹⁴ 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 7, Principal Risks, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

(e) 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	
90-Day Eurodollar December Futures	Long	12/2016	1,300	\$ (139)	\$ 16	\$ 0	
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2017	1,300	304	0	(16)	
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2016	72	(3)	0	(3)	
Total Futures Contracts				\$ 162	\$ 16	\$ (19)	

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION¹⁵

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	市場価格 ⁽³⁾	未実現評価益	変動証拠金		
						資産	負債	
CDX-EM-25 Index	1.000%	06/20/2021	\$ 1,900	\$ (116)	\$ 10	\$ 0	\$ (1)	
CDX-EM-26 Index	1.000%	12/20/2021	23,300	(1,508)	24	0	(19)	
				\$ (1,624)	\$ 34	\$ 0	\$ (20)	

¹⁵ 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.

¹⁶ 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.

¹⁷ The prices and resulting values for credit default swap agreements on credit indices serve as an indicator 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 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.

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	2.350%	10/02/2025	\$ 4,800	\$ (287)	\$ (287)	\$ 0	\$ (6)	
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.440%	01/02/2019	BRL 8,500	29	14	1	0	
					\$ (258)	\$ (273)	\$ 1	\$ (6)	
Total Swap Agreements					\$ (1,882)	\$ (239)	\$ 1	\$ (26)	

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 October 31, 2016:

(f) Securities with an aggregate market value of \$3,860 and cash of \$1,325 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of October 31, 2016. See Note 7, Principal Risks, 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			
買いオポジション	先物	スワップ	合計		売りオポジション	先物	スワップ	合計	
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 16	\$ 1	17	\$ 0	\$ (19)	\$ (26)	\$ (45)	

(g) 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	11/2016	KRW	1,813,140	\$ 1,646	\$ 64	0
BOA	11/2016	TWD	189,610	5,946	0	(60)
BOA	11/2016	\$	5,755	JPY 581,500	0	(219)
BOA	11/2016	ZAR	60,527	\$ 4,232	0	(250)
BPS	11/2016	BRL	2,602	818	0	(4)
BPS	11/2016	GBP	3,642	4,455	8	0
BPS	11/2016	\$	834	BRL 2,602	0	(12)

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
BPS	11/2016	\$ 54,019	EUR 49,445	\$ 183	\$ 0
BPS	11/2016	\$ 1,968	ZAR 28,016	106	0
BPS	12/2016	BRL 2,602	\$ 827	12	0
BPS	12/2016	EUR 49,445	54,084	0	(183)
BRC	11/2016	SGD 4,061	3,018	100	0
DUB	11/2016	BRL 4,842	1,522	0	(7)
DUB	11/2016	\$ 1,517	BRL 4,842	12	0
FBF	11/2016	JPY 649,700	\$ 6,372	187	0
GLM	11/2016	EUR 49,445	55,452	1,250	0
GLM	11/2016	KRW 1,230,858	1,098	24	0
HUS	11/2016	BRL 4,838	1,517	0	(11)
HUS	11/2016	\$ 1,521	BRL 4,838	7	0
JPM	11/2016	JPY 101,900	\$ 1,000	30	0
MSB	11/2016	BRL 2,607	798	0	(25)
MSB	11/2016	\$ 819	BRL 2,607	4	0
SCX	11/2016	MYR 9,765	\$ 2,398	75	0
SCX	11/2016	\$ 1,590	KRW 1,813,140	0	(8)
SCX	11/2016	1,098	1,230,858	0	(24)
SCX	11/2016	2,331	MYR 9,765	0	(8)
SCX	11/2016	2,912	SGD 4,061	5	0
SCX	01/2017	KRW 1,813,140	\$ 1,590	9	0
SCX	01/2017	MYR 9,765	2,327	9	0
SCX	01/2017	SGD 4,061	2,913	0	(5)
UAG	11/2016	\$ 18,382	JPY 1,844,100	0	(826)
UAG	11/2016	1,543	TWD 48,296	0	(13)
UAG	03/2017	TWD 48,296	\$ 1,551	19	0
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 2,104	\$ (1,855)

WRITTEN OPTIONS:

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

取引相手	銘柄	行使価格	行使期限	想定元本	プレミアム (受取)	市場価格
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW 1,140,000	11/17/2016	\$ 4,400	\$ (27)	\$ (59)
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL 3,380	12/14/2016	2,500	(24)	(18)
JPM	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$ 1,070	12/22/2016	EUR 3,900	(30)	(16)
JPM	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL 3,400	12/19/2016	\$ 4,400	(45)	(33)
Total Written Options					\$ (128)	\$ (126)

TRANSACTIONS IN WRITTEN CALL AND PUT OPTIONS FOR THE PERIOD ENDED OCTOBER 31, 2016

	米ドル建て 想定元本	ユーロ建て 想定元本	プレミアム
Balance at 10/31/2015	\$ 0	EUR 0	\$ 0
Sales	28,164	13,300	(342)
Closing Buys	0	0	0
Expirations	(16,864)	(9,400)	216
Exercised	0	0	0
Balance at 10/31/2016	\$ 11,300	EUR 3,900	\$ (126)

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照債券	固定受取 金利	満期日	2016年10月31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 ⁽³⁾	プレミアム 支払 (受取)	未実現 評価益	スワップの価値	
								資産	負債
BOA	Colombia Government International Bond	1.000 %	12/20/2017	0.554%	\$ 600	\$ (3)	\$ 6	\$ 3	\$ 0
BOA	Colombia Government International Bond	1.000 %	06/20/2019	0.936%	2,100	(4)	10	6	0
BOA	Peru Government International Bond	1.000 %	06/20/2018	0.382%	6,800	64	13	77	0
BPS	Mexico Government International Bond	1.000 %	06/20/2017	0.445%	400	2	0	2	0
BPS	Mexico Government International Bond	1.000 %	06/20/2018	0.650%	700	5	0	5	0
BRC	Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2016	0.593%	600	(8)	9	1	0
BRC	Brazil Government International Bond	1.000 %	03/20/2020	1.776%	9,500	(608)	378	0	(230)
BRC	Brazil Government International Bond	1.000 %	06/20/2020	1.937%	3,700	(221)	104	0	(117)

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

取引相手	参照債券	固定受取 金利	満期日	2016年10月31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 ⁽³⁾	プレミアム 支払 (受取)	未実現 評価益	スワップの価値	
								資産	負債
BRC	Colombia Government International Bond	1.000 %	06/20/2019	0.936%	\$ 100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
BRC	Mexico Government International Bond	1.000 %	06/20/2017	0.445%	2,400	12	0	12	0
BRC	Peru Government International Bond	1.000 %	12/20/2018	0.426%	7,100	(150)	245	95	0
BRC	Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2020	1.820%	5,200	(594)	431	0	(163)
BRC	South Africa Government International Bond	1.000 %	12/20/2021	2.405%	1,400	(100)	8	0	(92)
CBK	Brazil Government International Bond	1.000 %	03/20/2020	1.776%	200	(8)	4	0	(4)
CBK	Peru Government International Bond	1.000 %	03/20/2019	0.472%	3,800	(51)	103	52	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2016	0.593%	1,000	(13)	15	2	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2020	2.076%	1,200	(82)	35	0	(47)
GST	Colombia Government International Bond	1.000 %	12/20/2017	0.554%	1,100	(2)	9	7	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000 %	06/20/2019	0.936%	2,400	(7)	14	7	0
GST	Peru Government International Bond	1.000 %	06/20/2018	0.382%	100	1	0	1	0
GST	Peru Government International Bond	1.000 %	03/20/2019	0.472%	12,700	(182)	356	174	0
GST	Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2020	1.820%	6,600	(817)	611	0	(206)
HUS	Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2020	2.076%	900	(66)	31	0	(35)
HUS	Mexico Government International Bond	1.000 %	03/20/2017	0.412%	1,500	5	0	5	0
HUS	Peru Government International Bond	1.000 %	03/20/2019	0.472%	15,000	(219)	424	205	0
JPM	Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2016	0.593%	200	(2)	3	1	0
JPM	Peru Government International Bond	1.000 %	06/20/2018	0.382%	400	3	1	4	0
JPM	Peru Government International Bond	1.000 %	12/20/2018	0.426%	3,580	(81)	129	48	0
JPM	Peru Government International Bond	1.000 %	03/20/2019	0.472%	8,500	(120)	236	118	0
JPM	Petroleos Mexicanos	1.000 %	12/20/2016	0.530%	2,000	(18)	21	3	0
JPM	Russia Government International Bond	1.000 %	09/20/2020	1.740%	10,500	(1,196)	918	0	(278)
NGF	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC	1.000 %	12/20/2016	1.983%	1,100	(14)	14	0	0
SCX	Nigeria Government International Bond	5.000 %	09/20/2017	5.314%	1,100	3	1	4	0
Total Swap Agreements						\$ (4,471)	\$ 4,129	\$ 830	\$ (1,172)

⁽¹⁾ 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.

⁽²⁾ 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 an indicator 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.

⁽³⁾ 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26期》決算日2017年11月20日

[計算期間：2017年5月23日～2017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26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26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		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率					
22期(2015年11月20日)	円		%		%			百万円
	10,185		0.0		91.2		—	27,834
23期(2016年5月20日)	10,183		△0.0		39.0		—	5,562
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

(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		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落	率				
(期 首)	円		%		%		%
2017年5月22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	10,184		0.0		—		—
10月末	10,184		0.0		—		—
(期 末)							
2017年11月20日	10,184		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。

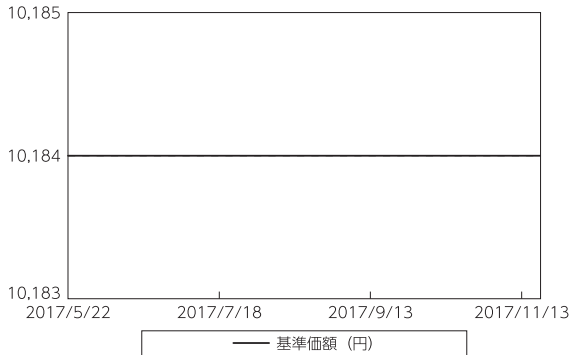
○運用経過

●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横ばいとなりました。

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見ると、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、マイナス金利の適用以降であることから、マイナス圏で推移しました。2017年11月20日のコール・レートは-0.047%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、基準価額は横ばいとなりました。

○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

(2017年5月23日～2017年11月20日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2017年5月23日～2017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 162,499,934	千円 162,899,937

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月23日～2017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

(2017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, 199, 999	% 94. 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

(2017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, 199, 999	% 94. 4
コール・ローン等、その他	71, 624	5. 6
投資信託財産総額	1, 271, 623	100. 0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,271,623,466
コール・ローン等	71,623,500
その他有価証券(評価額)	1,199,999,966
(B) 負債	5,066,562
未払解約金	5,066,444
未払利息	118
(C) 純資産総額(A－B)	1,266,556,904
元本	1,243,696,990
次期繰越損益金	22,859,914
(D) 受益権総口数	1,243,696,990口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,184円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,651,473,732円
期中追加設定元本額 203,575,952円
期中一部解約元本額 611,352,694円
また、1口当たり純資産額は、期末1.0184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 D C金利連動アロケーション型バランスファンド	313,747,092円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135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)	8,898,354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)	62,265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)	31,213,655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)	94,134,350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>	143,999,990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
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	2,383,743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)	26,506,400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)	457,302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)	2,100,667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)	344,406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>	6,013,964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)	9,071,898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<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)	407,171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<マネーボールファンド>	75,631,547円

○損益の状況 (2017年5月23日～2017年11月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 11,420
受取利息	3,609
支払利息	△ 15,029
(B) 当期損益金(A)	△ 11,420
(C) 前期繰越損益金	30,374,272
(D) 追加信託差損益金	3,745,720
(E) 解約差損益金	△11,248,658
(F) 計(B＋C＋D＋E)	22,859,914
次期繰越損益金(F)	22,859,914

(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 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)	1,364,852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)	1,647,957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<マネーボールファンド>	1,008,013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)	31,208,972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)	5,622,977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)	69,931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)	158,381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)	20,660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)	40,278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)	955,887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ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	12,234,366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 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	9,834,580円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 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 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	14,819,878円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 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)	24,184,985円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	3,737,703円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 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)	686,803円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 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)	243,113円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型)	1,809,102円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドA>	38,413,663円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドB>	979,536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)	8,473,583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)	2,464,335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)	983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)	983円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	5,920,244円
米国バンクロンファンド<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	256,356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）	1,551,577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）	25,537,767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）	16,492,587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）	3,165,280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）	1,071,396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 債券バランズファンド＜為替リスク軽減型＞（毎月決算型）	983円
三菱UFJ 債券バランズファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）	983円
三菱UFJ 債券バランズファンド＜為替リスク軽減型＞（年1回決算型）	983円
三菱UFJ 債券バランズファンド＜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
マクロ・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）	256,285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）	982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）	982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）	982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）	982円
Navio インド債券ファンド	885,566円
Navio マネーボールファンド	1,853,235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）	9,991,647円
ビムコ・エマーシング・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・エマーシング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）	21,620,196円
合計	1,243,696,990円