

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	無期限（2004年9月30日設定）
運用方針	<p>主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y および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を通じて、世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等に実質的な投資を行います。ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BB-B、円ベース）をベンチマークとします。</p> <p>実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてB-格相当以上の格付を有しているものに限るものとし、ポートフォリオの実質的な平均格付は原則としてB-格相当以上を維持します。</p> <p>ポートフォリオの実質的な平均デュレーションは原則としてベンチマーク±2年以内で調整します。</p> <p>実質的な組入外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。運用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。</p>
主要運用対象	<p>ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）</p> <p>ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y 投資信託証券、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を主要投資対象とします。</p>
	<p>世界各國の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等を主要投資対象とします。</p> <p>原則として為替ヘッジは行いません。</p>
	<p>マネー・マーケット・マザーファンド</p> <p>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。</p>
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	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、経費等を控除後の利子等収益等を中心に、基準価額水準、市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。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。

運用報告書（全体版）

ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド （毎月分配型）

第237期（決算日：2024年7月8日）
 第238期（決算日：2024年8月7日）
 第239期（決算日：2024年9月9日）
 第240期（決算日：2024年10月7日）
 第241期（決算日：2024年11月7日）
 第242期（決算日：2024年12月9日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）」は、去る12月9日に第242期の決算を行いましたので、法令に基づいて第237期～第242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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
フリーダイヤル

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	基準価額			ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数 (B B - B、円ベース)	期中騰落率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
213期(2022年7月7日)	4,152	10	△4.0	47,163.12	△3.9	—	—	99.7	26,577
214期(2022年8月8日)	4,384	10	5.8	49,728.59	5.4	—	—	99.7	27,881
215期(2022年9月7日)	4,420	10	1.0	50,375.94	1.3	—	—	99.7	27,959
216期(2022年10月7日)	4,372	10	△0.9	50,063.54	△0.6	—	—	99.7	27,485
217期(2022年11月7日)	4,466	10	2.4	51,085.66	2.0	—	—	99.7	27,930
218期(2022年12月7日)	4,336	10	△2.7	49,854.09	△2.4	—	—	99.7	27,030
219期(2023年1月10日)	4,252	10	△1.7	49,053.49	△1.6	—	—	99.7	26,313
220期(2023年2月7日)	4,332	10	2.1	50,135.67	2.2	—	—	99.7	26,709
221期(2023年3月7日)	4,364	10	1.0	50,655.81	1.0	—	—	99.7	26,746
222期(2023年4月7日)	4,283	10	△1.6	49,675.62	△1.9	—	—	99.7	26,124
223期(2023年5月8日)	4,400	10	3.0	51,161.44	3.0	—	—	99.7	26,569
224期(2023年6月7日)	4,538	10	3.4	52,939.49	3.5	—	—	99.7	27,060
225期(2023年7月7日)	4,680	10	3.3	54,788.71	3.5	—	—	99.7	27,669
226期(2023年8月7日)	4,670	10	0.0	54,820.26	0.1	—	—	99.7	27,456
227期(2023年9月7日)	4,830	10	3.6	56,791.72	3.6	—	—	99.7	28,163
228期(2023年10月10日)	4,753	10	△1.4	55,998.41	△1.4	—	—	99.7	27,513
229期(2023年11月7日)	4,914	10	3.6	58,080.17	3.7	—	—	99.7	28,243
230期(2023年12月7日)	4,970	10	1.3	58,832.52	1.3	—	—	99.7	28,253
231期(2024年1月9日)	4,962	10	0.0	58,811.43	△0.0	—	—	99.7	28,091
232期(2024年2月7日)	5,115	10	3.3	60,648.77	3.1	—	—	99.7	28,712
233期(2024年3月7日)	5,196	10	1.8	61,824.42	1.9	—	—	99.7	28,894
234期(2024年4月8日)	5,256	10	1.3	62,775.45	1.5	—	—	99.7	29,094
235期(2024年5月7日)	5,351	10	2.0	64,062.34	2.0	—	—	99.7	29,402
236期(2024年6月7日)	5,459	10	2.2	65,551.23	2.3	—	—	99.7	29,816
237期(2024年7月8日)	5,649	10	3.7	67,936.54	3.6	—	—	99.6	30,760
238期(2024年8月7日)	5,106	10	△9.4	61,642.01	△9.3	—	—	99.7	27,608
239期(2024年9月9日)	5,135	10	0.8	62,178.93	0.9	—	—	99.7	27,594
240期(2024年10月7日)	5,367	10	4.7	65,213.59	4.9	—	—	99.7	28,738
241期(2024年11月7日)	5,534	10	3.3	67,388.36	3.3	—	—	98.4	29,399
242期(2024年12月9日)	5,407	10	△2.1	66,009.50	△2.0	—	—	98.4	28,479

(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) ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数 (B B - B、円ベース) とは、ICE Data Indices, LLCが算出する主な先進国のハイイールド債券の値動きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJアセットマネジメントは許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(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		ICE BofA 先進国ハイ・ イールド・コンストレインド指数 (BB-B、円ベース)	債 券 率 組 入 比 率	債 券 率 先 物 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率				
第237期	(期 首) 2024年6月7日	円	%		%	%	%
		5,459	—	65,551.23	—	—	99.7
	6月末	5,611	2.8	67,397.91	2.8	—	99.9
第238期	(期 末) 2024年7月8日	5,659	3.7	67,936.54	3.6	—	99.6
	(期 首) 2024年7月8日	5,649	—	67,936.54	—	—	99.6
	7月末	5,471	△3.2	65,954.83	△2.9	—	99.8
第239期	(期 末) 2024年8月7日	5,116	△9.4	61,642.01	△9.3	—	99.7
	(期 首) 2024年8月7日	5,106	—	61,642.01	—	—	99.7
	8月末	5,247	2.8	63,393.96	2.8	—	99.8
第240期	(期 末) 2024年9月9日	5,145	0.8	62,178.93	0.9	—	99.7
	(期 首) 2024年9月9日	5,135	—	62,178.93	—	—	99.7
	9月末	5,213	1.5	63,138.19	1.5	—	99.6
第241期	(期 末) 2024年10月7日	5,377	4.7	65,213.59	4.9	—	99.7
	(期 首) 2024年10月7日	5,367	—	65,213.59	—	—	99.7
	10月末	5,518	2.8	67,046.02	2.8	—	98.1
第242期	(期 末) 2024年11月7日	5,544	3.3	67,388.36	3.3	—	98.4
	(期 首) 2024年11月7日	5,534	—	67,388.36	—	—	98.4
	11月末	5,426	△2.0	66,311.82	△1.6	—	98.0
	(期 末) 2024年12月9日	5,417	△2.1	66,009.50	△2.0	—	98.4

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

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

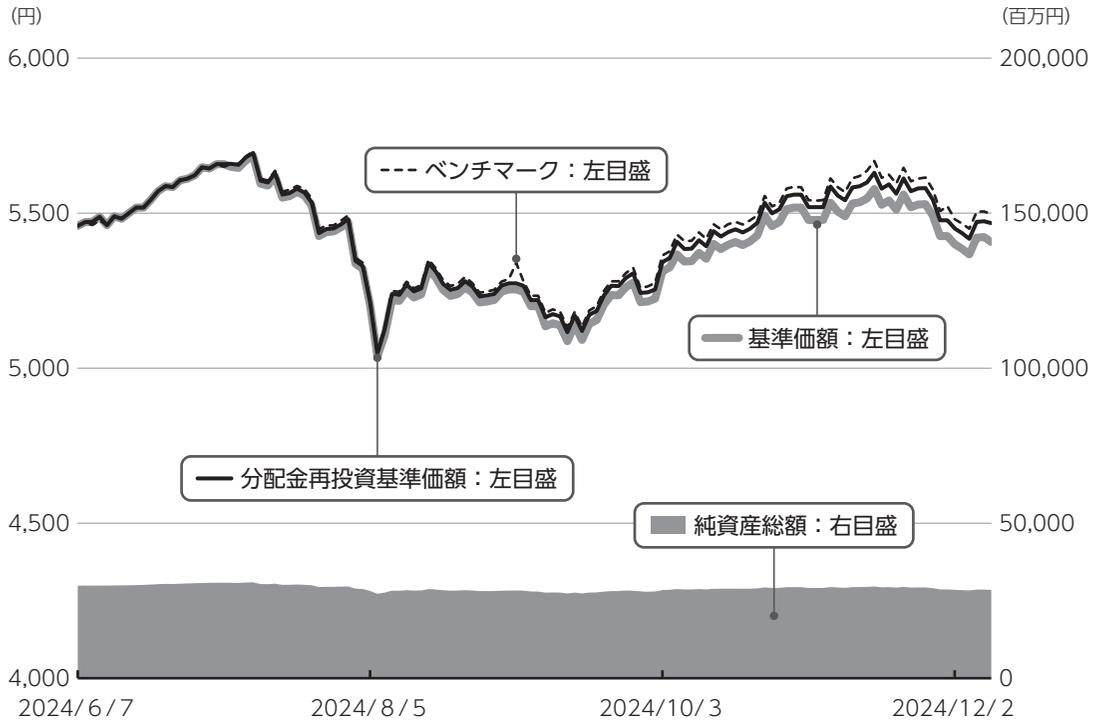
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第237期～第242期：2024年6月8日～2024年12月9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237期首	5,459円
第242期末	5,407円
既払分配金	60円
騰落率	0.2%

(分配金再投資ベース)

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

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

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.2%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.7%）を0.5%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ハイイールド債券市況が上昇したこと等が、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米ドルとユーロが対円で下落したこと等が、基準価額の下落要因となりました。

第237期～第242期：2024年6月8日～2024年12月9日

投資環境について

▶ 債券市況

ハイイールド債券市況は上昇しました。

ハイイールド債券市場では、欧米の中央銀行による利下げ観測の高まり等を背景に投資家のリスク選好姿勢が強まったこと等からスプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小しました。スプレッドが縮小したこと等から、ハイイールド債券市況は上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は、プラス圏での推移となりました。

▶ 為替市況

米ドルとユーロは対円で下落しました。

米ドルは、インフレ鈍化を示唆する経済指標の発表を受けた米国の利下げ観測の高まりや日銀の利上げなどから対円で下落しました。その後、日銀の利上げ観測の後退や米国大統領選挙でトランプ氏が勝利したことなどをを受けて米ドルは対円で上昇したものの、期間を通じてみると対円で下落しました。

ユーロは、欧州景気の減速懸念から欧州中央銀行（ECB）による利下げ観測が高まったことなどを背景に、対円で下落しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）

円建てで外国投資信託への投資を通じて、日本を除く世界のハイイールド債券を高位に組み入れた運用を行いました。同時に、マネー・マーケット・マザーファンドの一部組み入れを行いました。

具体的には、コロナ禍後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空セクター等への投資を積極姿勢としました。一方、長期的な成長が見込みづらい固定通信や、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターへの投資を消極姿勢としました。

▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y

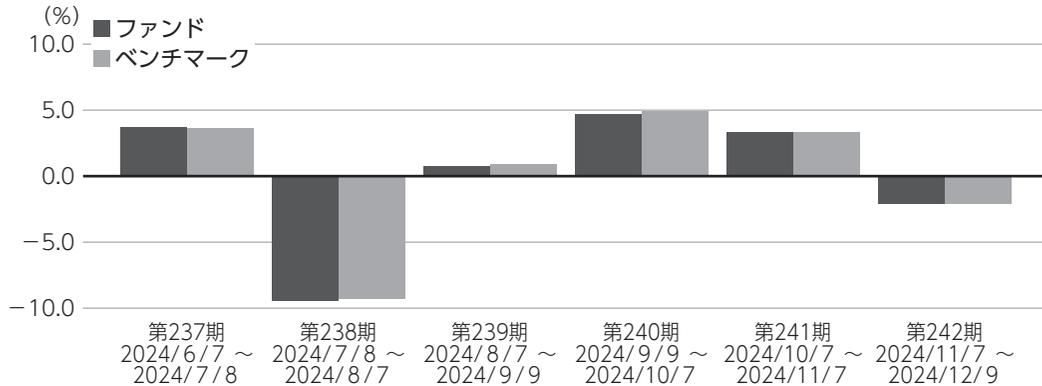
当期間では、デフォルト（債務不履行）率は緩やかな上昇傾向にあるものの、依然として過去平均を下回る低い水準を維持しており、スプレッド（国債に対する上乘せ金利）水準が長期的な平均に比べ縮小しているなかで、インフレの再加速や地政学リスクの高まりなどにより投資家心理が悪化する場合には注視が必要であると考えておりました。しかし、ハイイールド債券を発行する企業の多くは2020年から2021年の低金利環境下で借り換えを行っており、十分な手元流動性を確保していることから、一部の脆弱な企業を除いてファンダメンタルズの健全性は維持されるとみておりました。このような環境下、運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行いました。

▶ 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図りました。

第237期～第242期：2024/6/8～2024/12/9

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額（当ファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

▶ ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）

基準価額（分配金再投資ベース）は、ベンチマークに比べ、0.5%のアンダーパフォーマンスとなりました。

主な要因は以下の通りです。

外国投資信託保有以外の要因

（マイナス要因）

主に信託報酬等のコストによるものです。

外国投資信託保有による要因

（プラス要因）

通信セクターの銘柄選択効果がプラスに寄与したこと。

（マイナス要因）

テクノロジーセクターの銘柄選択効果がマイナスに影響したこと。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。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237期 2024年6月8日~ 2024年7月8日	第238期 2024年7月9日~ 2024年8月7日	第239期 2024年8月8日~ 2024年9月9日	第240期 2024年9月10日~ 2024年10月7日	第241期 2024年10月8日~ 2024年11月7日	第242期 2024年11月8日~ 2024年12月9日
当期分配金 （対基準価額比率）	10 (0.177%)	10 (0.195%)	10 (0.194%)	10 (0.186%)	10 (0.180%)	10 (0.185%)
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	622	638	653	670	687	699

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

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

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）

引き続き円建て外国投資信託への投資を通じて日本を除く世界のハイイールド債券を高位に組み入れた運用を行うとともに、一部、マネー・マーケット・マザーファンドの組み入れを維持し、毎月の安定した分配をめざす方針です。

▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y

運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行う方針です。

具体的には、コロナ禍後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空セクター等への投資を積極姿勢とします。一方、長期的な成長が見込みづらい固定通信や、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターへの投資を消極姿勢とします。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

日銀による金融市場調節方針の下、短期金利は安定した推移を想定しています。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。

2024年6月8日～2024年12月9日

1万口当たりの費用明細

項目	第237期～第242期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	42	0.781	(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）	(24)	(0.446)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(17)	(0.307)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.028)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	42	0.783	

作成期中の平均基準価額は、5,402円です。

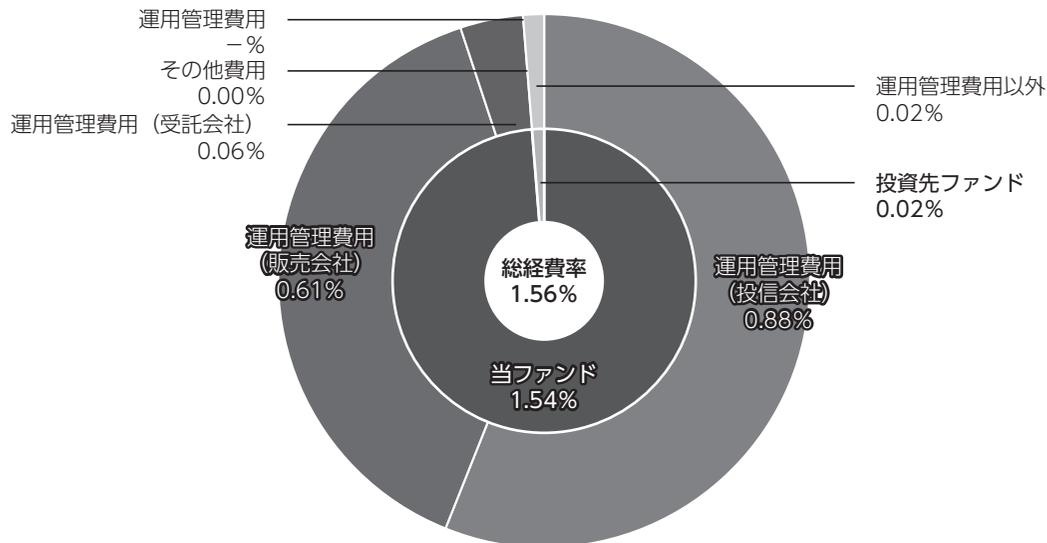
- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

- (注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- (注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成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**総経費率（年率）は1.56%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.56
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.54
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.02

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

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

○売買及び取引の状況

(2024年6月8日～2024年12月9日)

投資信託証券

銘柄		第237期～第242期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	千口 137	千円 1,206,978	千口 250	千円 2,208,400

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第237期～第242期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 11,686	千円 11,903

○利害関係人との取引状況等

(2024年6月8日～2024年12月9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

(2024年12月9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236期末	第242期末		
		口数	口数	評価額	比率
	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	千口 3,317	千口 3,205	千円 28,018,224	% 98.4
合計		3,317	3,205	28,018,224	98.4

(注) 比率はピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（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236期末	第242期末	
		口数	評価額
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 11,784	千口 98	千円 100

○投資信託財産の構成

(2024年12月9日現在)

項目	第242期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 28,018,224	% 98.0
マネー・マーケット・マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	578,967	2.0
投資信託財産総額	28,597,291	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第237期末	第238期末	第239期末	第240期末	第241期末	第242期末
	2024年7月8日現在	2024年8月7日現在	2024年9月9日現在	2024年10月7日現在	2024年11月7日現在	2024年12月9日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	30,863,559,431	27,711,115,809	27,723,055,633	28,827,296,342	29,517,257,782	28,597,291,179
コール・ローン等	128,202,186	106,479,967	145,419,987	89,514,018	582,387,048	578,963,330
投資信託受益証券(評価額)	30,643,358,203	27,522,635,223	27,515,632,440	28,655,778,265	28,934,767,298	28,018,224,420
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	11,998,822	12,000,000	12,002,357	12,003,535	100,019	100,039
未収入金	80,000,000	70,000,000	50,000,000	70,000,000	—	—
未収利息	220	619	849	524	3,417	3,390
(B) 負債	103,365,580	102,747,479	128,932,928	89,200,735	118,035,939	117,556,287
未払収益分配金	54,453,883	54,069,265	53,735,666	53,543,465	53,123,332	52,675,725
未払解約金	9,214,251	10,870,760	35,740,740	2,561,474	26,914,190	25,525,357
未払信託報酬	39,578,721	37,694,383	39,338,516	32,996,816	37,884,772	39,237,503
その他未払費用	118,725	113,071	118,006	98,980	113,645	117,702
(C) 純資産総額(A-B)	30,760,193,851	27,608,368,330	27,594,122,705	28,738,095,607	29,399,221,843	28,479,734,892
元本	54,453,883,789	54,069,265,052	53,735,666,177	53,543,465,854	53,123,332,649	52,675,725,494
次期繰越損益金	△23,693,689,938	△26,460,896,722	△26,141,543,472	△24,805,370,247	△23,724,110,806	△24,195,990,602
(D) 受益権総口数	54,453,883,789口	54,069,265,052口	53,735,666,177口	53,543,465,854口	53,123,332,649口	52,675,725,494口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,649円	5,106円	5,135円	5,367円	5,534円	5,407円

○損益の状況

項 目	第237期	第238期	第239期	第240期	第241期	第242期
	2024年6月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年8月7日	2024年8月8日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年10月7日	2024年10月8日～ 2024年11月7日	2024年11月8日～ 2024年12月9日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	171,876,784	177,882,013	157,769,822	150,965,984	150,262,260	153,819,304
受取配当金	171,871,054	177,873,670	157,752,492	150,951,928	150,218,853	153,716,361
受取利息	5,730	8,343	17,330	14,056	43,407	102,943
(B) 有価証券売買損益	956,290,183	△ 3,020,903,071	90,782,969	1,177,955,781	826,545,060	△ 734,270,430
売買益	958,292,934	5,818,551	94,447,984	1,179,062,011	829,186,040	3,315,382
売買損	△ 2,002,751	△ 3,026,721,622	△ 3,665,015	△ 1,106,230	△ 2,640,980	△ 737,585,812
(C) 信託報酬等	△ 39,697,446	△ 37,807,454	△ 39,456,522	△ 33,095,796	△ 37,998,417	△ 39,355,205
(D) 当期損益金 (A + B + C)	1,088,469,521	△ 2,880,828,512	209,096,269	1,295,825,969	938,808,903	△ 619,806,331
(E) 前期繰越損益金	1,396,728,789	2,412,181,290	△ 518,641,031	△ 361,429,811	873,657,143	1,743,498,448
(F) 追加信託差損益金	△26,124,434,365	△25,938,180,235	△25,778,263,044	△25,686,222,940	△25,483,453,520	△25,267,006,994
(配当等相当額)	(957,396,490)	(952,750,291)	(948,860,454)	(947,229,187)	(942,698,325)	(937,567,767)
(売買損益相当額)	(△27,081,830,855)	(△26,890,930,526)	(△26,727,123,498)	(△26,633,452,127)	(△26,426,151,845)	(△26,204,574,761)
(G) 計 (D + E + F)	△23,639,236,055	△26,406,827,465	△26,087,807,806	△24,751,826,782	△23,670,987,474	△24,143,314,877
(H) 収益分配金	△ 54,453,883	△ 54,069,265	△ 53,735,666	△ 53,543,465	△ 53,123,332	△ 52,675,725
次期繰越損益金 (G + H)	△23,693,689,938	△26,460,896,722	△26,141,543,472	△24,805,370,247	△23,724,110,806	△24,195,990,602
追加信託差損益金	△26,124,434,365	△25,938,180,235	△25,778,263,044	△25,686,222,940	△25,483,453,520	△25,267,006,994
(配当等相当額)	(957,396,490)	(952,750,291)	(948,860,454)	(947,229,187)	(942,698,325)	(937,567,767)
(売買損益相当額)	(△27,081,830,855)	(△26,890,930,526)	(△26,727,123,498)	(△26,633,452,127)	(△26,426,151,845)	(△26,204,574,761)
分配準備積立金	2,430,744,427	2,498,187,463	2,560,259,563	2,643,326,468	2,711,707,960	2,748,664,581
繰越損益金	-	△ 3,020,903,950	△ 2,923,539,991	△ 1,762,473,775	△ 952,365,246	△ 1,677,648,189

(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 54,624,638,317円
 作成期中追加設定元本額 386,000,753円
 作成期中一部解約元本額 2,334,913,576円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.5407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24,195,990,602円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2024年6月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年8月7日	2024年8月8日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年10月7日	2024年10月8日～ 2024年11月7日	2024年11月8日～ 2024年12月9日
費用控除後の配当等収益額	165,827,553円	140,075,438円	132,724,996円	147,208,146円	144,418,115円	114,464,111円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	119,804,946円	-円	-円	-円	-円	-円
収益調整金額	957,396,490円	952,750,291円	948,860,454円	947,229,187円	942,698,325円	937,567,767円
分配準備積立金額	2,199,565,811円	2,412,181,290円	2,481,270,233円	2,549,661,787円	2,620,413,177円	2,686,876,195円
当ファンドの分配対象収益額	3,442,594,800円	3,505,007,019円	3,562,855,683円	3,644,099,120円	3,707,529,617円	3,738,908,073円
1万口当たり収益分配対象額	632円	648円	663円	680円	697円	709円
1万口当たり分配金額	10円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金総額	54,453,883円	54,069,265円	53,735,666円	53,543,465円	53,123,332円	52,675,725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55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237期	第238期	第239期	第240期	第241期	第242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、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。

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

【お知らせ】

東京証券取引所の取引時間の延伸に伴い、申込締切時間の変更を行いました。詳細は、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) から当該ファンドページの目論見書をご覧ください。

(2024年11月5日)

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド J P Y
運用方針	ベンチマークであるICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BBーB、円ベース）を上回る投資成果をめざします。
主要運用対象	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、ファンドの 80%以上をBBBー格相当未満の格付けを取得している公社債に投資します。 ・ 投資する公社債は原則として取得時においてBー格相当以上の格付けを取得しているものに限りませす。 ・ 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ー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、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 ・ 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。 ・ エマージング債への投資は行いません。 ・ 原則として、為替ヘッジは行いません。
決算日	原則として毎年2月28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 Cayman Trust Annual Report February 29, 2024版から抜粋して作成しています。なお、開示情報につきましては、アニュアルレポートがシェアクラス分けされていないため「ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド」で掲載しています。

(1) 運用計算書

ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド

(2023年3月1日～2024年2月29日)

	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド
	千米ドル
投資収入：	
受取利息（外国税額控除後＊）	25,956
雑収入	184
収入合計	26,140
費用：	
支払利息	288
費用合計	288
投資純収入	25,852
実現純利益（損失）：	
投資有価証券	(15,437)
マスターファンド	0
為替取引、中央清算金融派生商品	2,192
店頭金融派生商品	(388)
外貨	(204)
実現純利益（損失）	(13,837)
未実現評価益（評価損）の純変動：	
投資有価証券	37,263
マスターファンド	0
為替取引、中央清算金融派生商品	341
店頭金融派生商品	44
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	72
未実現評価益（評価損）の純変動	37,720
純利益（損失）	23,883
運用による純資産の純増（減）額	49,735
＊外国税	18

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド

(2023年3月1日～2024年2月29日)

	ピムコ グローバル	ケイマン ハイ	インカム ファンド	千米ドル
純資産の増加（減少）：				
運用：				
投資純収入（費用）				25,852
実現純利益（損失）				(13,837)
未実現評価益（評価損）の純変動				37,720
運用による純資産の純増（減）額				49,735
分配：				
JPY				(31,775)
JPY Hedged				(116)
分配金額合計				(31,891)
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				(29,229)
純資産の増（減）額合計				(11,385)
純資産：				
期首				423,089
期末				411,704

(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)

ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド
(2024年2月29日現在)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 101.5%		
AUSTRIA 0.5%		
CONVERTIBLE BONDS & NOTES 0.2%		
ams-OSRAM AG		
2.125% due 11/03/2027 (a)	EUR 900	\$ 725
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
ams-OSRAM AG		
10.500% due 03/30/2029	500	547
12.250% due 03/30/2029	\$ 700	711
		<u>1,258</u>
Total Austria		<u>1,983</u>
(Cost \$2,028)		
BELGIUM 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Ontex Group NV		
3.500% due 07/15/2026	EUR 1,000	1,057
Total Belgium		<u>1,057</u>
(Cost \$1,023)		
BERMUDA 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%		
NCL Corp. Ltd.		
5.875% due 02/15/2027	\$ 100	99
8.125% due 01/15/2029	1,200	1,263
8.375% due 02/01/2028	300	315
Seadrill Finance Ltd.		
8.375% due 08/01/2030	575	591
Valaris Ltd.		
8.375% due 04/30/2030	1,125	1,155
Total Bermuda		<u>3,423</u>
(Cost \$3,308)		
CANADA 4.9%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%		
Garda World Security Corp.		
9.625% due 02/01/2029	985	987
CORPORATE BONDS & NOTES 4.6%		
Air Canada		
3.875% due 08/15/2026	4,400	4,172
Bausch + Lomb Corp.		
8.375% due 10/01/2028	1,225	1,282
Bombardier, Inc.		
7.500% due 02/01/2029	1,200	1,218
7.875% due 04/15/2027	435	436
Garda World Security Corp.		
7.750% due 02/15/2028	100	102
CFL Environmental, Inc.		
6.750% due 01/15/2031	1,150	1,178
goeasy Ltd.		
7.625% due 07/01/2029	625	625
9.250% due 12/01/2028	1,400	1,487
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.		
6.000% due 09/15/2026	700	652
New Red Finance, Inc.		
3.875% due 01/15/2028	4,400	4,108
Northriver Midstream Finance LP		
5.625% due 02/15/2026	3,000	2,944

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
Parkland Corp.		
4.625% due 05/01/2030	\$ 900	\$ 823
		<u>19,027</u>
Total Canada		
(Cost \$20,432)		
CAYMAN ISLANDS 0.5%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.1%		
AAdvantage Loyalty IP Ltd.		
10.329% due 04/20/2028	255	260
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Diamond Foreign Asset Co.		
8.500% due 10/01/2030	100	102
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.		
5.750% due 01/20/2026	300	284
Seagate HDD Cayman		
4.750% due 01/01/2025	325	321
Spirit Loyalty Cayman Ltd.		
8.000% due 09/20/2025	1,275	923
		<u>1,630</u>
Total Cayman Islands		<u>1,890</u>
(Cost \$1,874)		
CZECH REPUBLIC 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
EP Infrastructure AIS		
1.816% due 03/02/2031	EUR 1,800	1,535
Total Czech Republic		<u>1,535</u>
(Cost \$1,461)		
FINLAND 0.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
SBB Treasury OYJ		
0.750% due 12/14/2028	400	270
1.125% due 11/26/2029	100	67
Total Finland		<u>337</u>
(Cost \$348)		
FRANCE 4.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.8%		
Altice France S.A.		
2.125% due 02/15/2025	1,400	1,468
5.125% due 01/15/2029	\$ 2,900	2,195
11.500% due 02/01/2027 (e)	EUR 2,200	2,426
BNP Paribas S.A.		
7.750% due 08/16/2029 (a)(b)	\$ 1,100	1,111
CAB SELAS		
3.375% due 02/01/2028	EUR 1,500	1,479
Cerba Healthcare SACA		
3.500% due 05/31/2028	2,500	2,364
Electricite de France S.A.		
9.125% due 03/15/2033 (b)	\$ 4,800	5,338
Eramet S.A.		
7.000% due 05/22/2028	EUR 1,000	1,078
Vallorec SACA		
8.500% due 06/30/2026	2,300	2,502
Total France		<u>19,961</u>
(Cost \$19,365)		

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
GERMANY 5.1%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.8%		
BK LC Lux SPV Sari		
6.905% due 04/28/2028	EUR 1,000	\$ 1,081
CTEC III GmbH		
7.452% due 03/16/2029	1,000	1,068
Nidda Healthcare Holding GmbH		
7.446% due 08/21/2026	1,000	1,077
		<u>3,226</u>
CORPORATE BONDS & NOTES 4.3%		
Bayer AG		
7.000% due 09/25/2083	3,000	3,266
Chephapharm Arzneimittel GmbH		
3.500% due 02/11/2027	2,800	2,939
7.500% due 05/15/2030	300	344
CT Investment GmbH		
5.500% due 04/15/2026	1,200	1,296
Deutsche Bank AG		
4.000% due 06/24/2032	900	929
6.750% due 10/30/2028 (a)(b)	200	199
IHO Verwaltungs GmbH (c)		
3.750% due 09/15/2026	200	213
8.750% due 05/15/2028	1,400	1,645
Nidda Healthcare Holding GmbH		
7.500% due 08/21/2026	3,243	3,637
Schaeffler AG		
3.375% due 10/12/2028	1,400	1,459
4.500% due 08/14/2026	100	109
4.750% due 08/14/2029	200	219
TUI AG		
5.875% due 03/15/2029	500	537
ZF Finance GmbH		
3.750% due 09/21/2028	800	831
		<u>17,623</u>
Total Germany		<u>20,849</u>
(Cost \$20,749)		
GUERNSEY 0.3%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%		
Al Silk Midco Ltd.		
8.932% due 02/20/2031	1,200	1,265
Total Guernsey		<u>1,265</u>
(Cost \$1,221)		
IRELAND 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Jazz Securities DAC		
4.375% due 01/15/2029	\$ 200	184
Total Ireland		<u>184</u>
(Cost \$185)		
ITALY 5.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 5.8%		
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA		
2.625% due 04/28/2025	EUR 2,200	2,326
6.750% due 03/02/2026	900	992
Cerved Group SpA		
6.000% due 01/15/2029	900	890
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA		
5.625% due 08/01/2027	900	942

額面金額 (単位：千)		時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)		時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)		時価 (単位：千)	
Inter Media & Communication SpA											
6.750% due 02/09/2027	EUR	1,000	\$ 1,057								
Intesa Sanpaolo SpA											
4.198% due 06/01/2032		\$ 2,450	2,011								
7.700% due 09/17/2025 (a)(b)		500	496								
7.750% due 01/11/2027 (a)(b)	EUR	250	278								
Italmatch Chemicals SpA											
9.393% due 02/05/2028		800	869								
10.000% due 02/06/2028		100	114								
Mundys SpA											
4.750% due 01/24/2029		1,600	1,749								
Nexi SpA											
1.625% due 04/30/2026		733	751								
2.125% due 04/30/2029 (g)		4,000	3,838								
Telecom Italia SpA											
1.625% due 01/18/2029		1,200	1,122								
6.875% due 02/15/2028		2,900	3,337								
7.875% due 07/31/2028		500	597								
UniCredit SpA											
5.375% due 04/16/2034		200	219								
5.459% due 06/30/2035	\$	2,400	2,220								
7.296% due 04/02/2034		200	204								
Total Italy			24,012								
(Cost \$23,434)											
JAPAN 0.1%											
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%											
Rakuten Group, Inc.											
11.250% due 02/15/2027		500	532								
Total Japan			532								
(Cost \$489)											
JERSEY, CHANNEL ISLANDS 1.4%											
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%											
Adient Global Holdings Ltd.											
7.000% due 04/15/2028		100	102								
8.250% due 04/15/2031 (g)		500	527								
G City Europe Ltd.											
4.250% due 09/11/2025	EUR	300	306								
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.											
3.250% due 11/12/2025 (g)		4,700	4,765								
Total Jersey, Channel Islands			5,700								
(Cost \$5,586)											
LIBERIA 1.3%											
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%											
Royal Caribbean Cruises Ltd.											
5.500% due 08/31/2026	\$	5,200	5,146								
Total Liberia			5,146								
(Cost \$4,700)											
LUXEMBOURG 5.1%											
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.1%											
Albion Financing 3 Sarl											
9.208% due 08/17/2026		550	595								
CORPORATE BONDS & NOTES 5.0%											
Albion Financing 1 SARL											
6.125% due 10/15/2026		400	396								
Albion Financing 2 Sarl											
8.750% due 04/15/2027	\$	600	603								
Altice Financing S.A.											
2.250% due 01/15/2025	EUR	850	894								
3.000% due 01/15/2028		1,200	1,148								
5.750% due 08/15/2029	\$	550	474								
Camelot Finance S.A.											
4.500% due 11/01/2026		750	717								
Cidron Aida Finco Sarl											
5.000% due 04/01/2028	EUR	2,600	2,732								
6.250% due 04/01/2028	GBP	100	122								
Cirsa Finance International Sarl											
4.500% due 03/15/2027	EUR	2,400	2,543								
6.500% due 03/15/2029		200	220								
8.412% due 07/31/2028		150	166								
CPI Property Group S.A.											
1.750% due 01/14/2030		200	151								
Cullinan Holdco Scsp											
4.625% due 10/15/2026		1,200	1,162								
Ephios Subco 3 Sarl											
7.875% due 01/31/2031		700	809								
Intelsat Jackson Holdings S.A.											
6.500% due 03/15/2030	\$	1,050	979								
Loarre Investments Sarl											
6.500% due 05/15/2029	EUR	2,300	2,492								
Logicor Financing Sarl											
0.625% due 11/17/2025		2,300	2,332								
2.250% due 05/13/2025		1,900	2,004								
Summer BC Holdco B SARL											
5.750% due 10/31/2026		400	428								
Total Luxembourg			20,372								
(Cost \$20,447)											
MULTINATIONAL 1.4%											
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%											
American Airlines, Inc.											
5.500% due 04/20/2026	\$	656	651								
5.750% due 04/20/2029		3,500	3,426								
Ardagh Packaging Finance PLC											
2.125% due 09/15/2026	EUR	700	685								
4.125% due 08/15/2026	\$	1,250	1,155								
Total Multinational			5,917								
(Cost \$6,299)											
NETHERLANDS 4.6%											
CORPORATE BONDS & NOTES 4.6%											
AerCap Holdings NV											
5.675% due 10/10/2079		1,250	1,239								
Ashland Services BV											
2.000% due 01/30/2028	EUR	1,700	1,684								
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV											
7.250% due 02/15/2031	\$	1,400	1,454								
Boels Topholding BV											
6.250% due 02/15/2029	EUR	100	113								
Citycon Treasury BV											
6.500% due 03/06/2029 (d)		200	218								
Dufry One BV											
2.000% due 02/15/2027		2,600	2,627								
Energizer Gamma Acquisition BV											
3.500% due 06/30/2029	EUR	800	770								
GTCR W-2 Merger Sub LLC											
8.500% due 01/15/2031	GBP	200	273								
LeasePlan Corp. BV											
7.375% due 05/29/2024 (a)(b)	EUR	1,000	1,084								
OI European Group BV											
6.250% due 05/15/2028		200	225								
Q Park Holding I BV											
3.500% due 02/01/2025		1,100	1,164								
Sunrise HoldCo IV BV											
3.875% due 06/15/2029		600	627								
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV											
1.875% due 03/31/2027		200	198								
4.375% due 05/09/2030		1,000	1,026								
7.375% due 09/15/2029		700	832								
United Group BV											
3.125% due 02/15/2026		1,200	1,262								
4.000% due 11/15/2027		1,000	1,036								
Wintershall Dea Finance 2 BV											
2.499% due 04/20/2026 (b)		1,600	1,597								
ZF Europe Finance BV											
6.125% due 03/13/2029		1,200	1,365								
Ziggo BV											
4.875% due 01/15/2030	\$	225	201								
Total Netherlands			18,995								
(Cost \$18,452)											
NORWAY 0.1%											
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%											
Variable Energi ASA											
7.862% due 11/15/2083	EUR	300	342								
Total Norway			342								
(Cost \$321)											
PANAMA 0.7%											
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%											
Carnival Corp.											
4.000% due 08/01/2028	\$	3,200	2,954								
Total Panama			2,954								
(Cost \$3,098)											
SPAIN 3.2%											
CORPORATE BONDS & NOTES 3.2%											
Aedas Homes Opco SL											
4.000% due 08/15/2026	EUR	3,200	3,398								
Grifols S.A.											
3.200% due 05/01/2025		1,200	1,253								
Grupo Antolin-Irausa S.A.											
3.375% due 04/30/2026		300	296								
3.500% due 04/30/2028		1,100	918								
Lorca Telecom Bondco S.A.											
4.000% due 09/18/2027		4,400	4,676								
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A.											
5.250% due 04/01/2026		2,400	2,565								
Total Spain			13,106								
(Cost \$13,533)											

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SWEDEN 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Castellum AB		
3.125% due 12/02/2026 (b)	EUR 2,600	\$ 2,408
Sammhallsbyggnadsbolaget i Norden AB		
2.250% due 08/12/2027	300	221
Total Sweden		2,629
(Cost \$2,486)		
SWITZERLAND 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
UBS Group AG		
9.250% due 11/13/2028 (a)(b)	\$ 100	107
Total Switzerland		107
(Cost \$100)		
UNITED KINGDOM 4.8%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%		
BCP V Modular Services Holdings IV Ltd.		
8.350% due 12/15/2028	100	106
Market Bidco Ltd.		
8.651% due 11/04/2027	1,000	1,059
		1,165
CORPORATE BONDS & NOTES 4.5%		
BCP V Modular Services Finance II PLC		
4.750% due 11/30/2028	EUR 1,300	1,333
Bellis Acquisition Co. PLC		
3.250% due 02/18/2026	GBP 1,550	1,860
Deuce Finco PLC		
5.500% due 06/15/2027	1,000	1,191
Heathrow Finance PLC		
3.875% due 03/01/2027	400	478
4.125% due 09/01/2029	1,000	1,187
INEOS Finance PLC		
6.375% due 04/15/2029	EUR 400	433
7.500% due 04/15/2029	\$ 1,200	1,193
INEOS Quattro Finance 2 PLC		
8.500% due 03/15/2029	EUR 200	227
9.625% due 03/15/2029	\$ 800	843
Market Bidco Finco PLC		
5.500% due 11/04/2027	GBP 400	462
Marks & Spencer PLC		
3.750% due 05/19/2026	100	122
Pinnacle Bidco PLC		
8.250% due 10/11/2028	EUR 1,200	1,362
10.000% due 10/11/2028	GBP 800	1,065
Thames Water Kemble Finance PLC		
4.625% due 05/19/2026	400	187
Virgin Media Secured Finance PLC		
5.000% due 04/15/2027	1,000	1,235
Vmed 02 UK Financing I PLC		
3.250% due 01/31/2031	EUR 1,800	1,736
4.000% due 01/31/2029	GBP 1,700	1,871
4.250% due 01/31/2031	\$ 1,500	1,274
Zenith Finco PLC		
6.500% due 09/30/2027	GBP 400	399
		18,458
Total United Kingdom		19,623
(Cost \$19,829)		

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UNITED STATES 52.9%		
BANK LOAN OBLIGATIONS 1.7%		
BK LC Lux SPV Sarl		
8.827% due 04/28/2028	\$ 350	\$ 351
Boost Newco Borrower LLC		
8.326% due 01/31/2031	300	301
Caesars Entertainment, Inc.		
8.040% due 02/06/2031	1,900	1,901
Carnival Corp.		
7.605% due 06/30/2025	EUR 965	1,048
Cotiviti Holdings, Inc.		
7.750% due 02/21/2031	\$ 400	402
8.571% due 02/21/2031	700	698
DIRECTV Financing LLC		
10.830% due 08/02/2029	352	352
Discovery Energy Corp.		
9.083% due 01/30/2031	400	393
Embecka Corp.		
8.326% due 03/30/2029	81	74
LifePoint Health, Inc.		
11.087% due 11/16/2028	200	200
Mauser Packaging Solutions Holding Co.		
9.328% due 08/14/2026	99	100
Polaris Newco LLC		
9.574% due 06/02/2028	98	96
TransDigm, Inc.		
8.598% due 02/22/2027	566	568
Triton Water Holdings, Inc.		
9.320% due 03/31/2028	100	99
United AirLines, Inc.		
8.076% due 02/15/2031	400	400
		6,983
CORPORATE BONDS & NOTES 45.7%		
AAR Escrow Issuer LLC		
6.750% due 03/15/2029 (d)	300	303
ADT Security Corp.		
4.125% due 08/01/2029	2,000	1,809
Albertsons Cos., Inc.		
4.625% due 01/15/2027	400	386
5.875% due 02/15/2028	600	592
Allegiant Travel Co.		
7.250% due 08/15/2027	1,400	1,365
Alliant Holdings Intermediate LLC		
7.000% due 01/15/2031	725	723
Amer Sports Co.		
6.750% due 02/18/2031	325	324
AmWINS Group, Inc.		
6.375% due 02/15/2029	825	826
Antero Midstream Partners LP		
5.750% due 03/01/2027	700	685
AT&T, Inc.		
2.875% due 03/02/2025 (b)	EUR 1,000	1,053
Beacon Roofing Supply, Inc.		
6.500% due 08/01/2030	\$ 225	226
Berry Global, Inc.		
4.500% due 02/15/2026	892	866
Block, Inc.		
2.750% due 06/01/2026	900	841

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Blue Racer Midstream LLC		
7.625% due 12/15/2025	\$ 650	\$ 656
Booz Allen Hamilton, Inc.		
4.000% due 07/01/2029	200	185
Brandywine Operating Partnership LP		
7.800% due 03/15/2028	75	74
Buckeye Partners LP		
4.500% due 03/01/2028	1,100	1,024
Builders FirstSource, Inc.		
4.250% due 02/01/2032	575	506
6.375% due 03/01/2034	125	125
Burford Capital Global Finance LLC		
6.250% due 04/15/2028	400	385
9.250% due 07/01/2031	825	867
Cable One, Inc.		
4.000% due 11/15/2030	1,800	1,362
Caesars Entertainment, Inc.		
6.500% due 02/15/2032	800	807
Calpine Corp.		
3.750% due 03/01/2031	2,900	2,489
4.625% due 02/01/2029	300	276
Cantor Fitzgerald LP		
7.200% due 12/12/2028	300	308
Capstone Borrower, Inc.		
8.000% due 06/15/2030	400	414
Cargo Aircraft Management, Inc.		
4.750% due 02/01/2028	1,300	1,151
Catalent Pharma Solutions, Inc.		
2.375% due 03/01/2028	EUR 1,850	1,928
CCO Holdings LLC		
4.250% due 02/01/2031	\$ 1,500	1,208
4.500% due 08/15/2030	2,000	1,661
4.750% due 03/01/2030	800	681
5.125% due 05/01/2027	900	852
5.375% due 06/01/2029	1,000	905
CD&R Smokey Buyer, Inc.		
6.750% due 07/15/2025	200	199
Central Parent LLC		
8.000% due 06/15/2029	500	513
Champions Financing, Inc.		
8.750% due 02/15/2029	100	102
Chesapeake Energy Corp.		
5.500% due 02/01/2026	100	99
5.875% due 02/01/2029	100	99
6.750% due 04/15/2029	2,700	2,713
Churchill Downs, Inc.		
6.750% due 05/01/2031	1,000	1,002
Cinemark USA, Inc.		
5.875% due 03/15/2026	600	592
CITGO Petroleum Corp.		
8.750% due 01/15/2029	575	604
Civitas Resources, Inc.		
8.750% due 07/01/2031	325	346
Clarivate Science Holdings Corp.		
3.875% due 07/01/2028	300	274
Clearway Energy Operating LLC		
3.750% due 01/15/2032	600	503
Cloud Software Group, Inc.		
6.500% due 03/31/2029	2,175	2,027

額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 6.625% due 04/15/2029	\$ 200	\$ 199	Gray Television, Inc. 7.000% due 05/15/2027	\$ 100	\$ 91
CNX Resources Corp. 7.250% due 03/01/2032	325	324	Greystar Real Estate Partners LLC 7.750% due 09/01/2030	175	182
Coherent Corp. 5.000% due 12/15/2029	200	187	GTCR W-2 Merger Sub LLC 7.500% due 01/15/2031	700	731
Community Health Systems, Inc. 4.750% due 02/15/2031 5.625% due 03/15/2027 6.000% due 01/15/2029 8.000% due 03/15/2026	1,000 1,625 350 223	762 1,489 301 221	GYP Holdings III Corp. 4.625% due 05/01/2029	400	373
Credit Acceptance Corp. 9.250% due 12/15/2028	225	238	HAT Holdings I LLC 3.375% due 06/15/2026 3.750% due 09/15/2030 8.000% due 06/15/2027	650 700 2,025	609 577 2,105
CSC Holdings LLC 11.750% due 01/31/2029	400	418	HealthEquity, Inc. 4.500% due 10/01/2029	300	276
Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8.875% due 09/01/2031	250	261	Hertz Corp. 4.625% due 12/01/2026	300	266
DaVita, Inc. 3.750% due 02/15/2031	1,675	1,377	Hilcorp Energy I LP 5.750% due 02/01/2029 6.000% due 02/01/2031 6.250% due 11/01/2028 6.250% due 04/15/2032 8.375% due 11/01/2033	175 100 300 500 275	169 97 298 484 296
Delek Logistics Partners LP 8.625% due 03/15/2029 (d)	200	200	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5.000% due 06/01/2029	1,400	1,298
Directv Financing LLC 5.875% due 08/15/2027	900	850	Howard Hughes Corp. 4.125% due 02/01/2029 4.375% due 02/01/2031	600 540	533 461
DISH DBS Corp. 5.250% due 12/01/2026 5.750% due 12/01/2028	1,500 1,400	1,201 972	Howard Midstream Energy Partners LLC 8.875% due 07/15/2028	850	897
Embeckta Corp. 5.000% due 02/15/2030 (g)	1,200	958	HUB International Ltd. 7.250% due 06/15/2030	600	612
EMRLD Borrower LP 6.625% due 12/15/2030	875	879	Hudson Pacific Properties LP 5.950% due 02/15/2028	100	90
EnLink Midstream LLC 6.500% due 09/01/2030	1,200	1,231	Icahn Enterprises LP 5.250% due 05/15/2027 6.250% due 05/15/2026	100 500	92 488
EQM Midstream Partners LP 4.500% due 01/15/2029 4.750% due 01/15/2031 6.500% due 07/01/2027 6.500% due 07/15/2048	1,250 2,550 600 100	1,173 2,374 606 102	Imola Merger Corp. 4.750% due 05/15/2029	2,675	2,481
Fiesta Purchaser, Inc. 7.875% due 03/01/2031	225	232	Jefferson Capital Holdings LLC 9.500% due 02/15/2029	300	303
First Student Bidco, Inc. 4.000% due 07/31/2029	2,000	1,743	Kinetik Holdings LP 6.625% due 12/15/2028	600	608
Fortrea Holdings, Inc. 7.500% due 07/01/2030	200	205	Kodiak Gas Services LLC 7.250% due 02/15/2029	300	306
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6.500% due 10/01/2025	573	574	Kronos International, Inc. 3.750% due 09/15/2025 9.500% due 03/15/2029	EUR 284 1,713	305 1,962
Freedom Mortgage Corp. 12.000% due 10/01/2028	1,525	1,654	LABL, Inc. 5.875% due 11/01/2028	\$ 1,725	1,548
Frontier Communications Holdings LLC 6.000% due 01/15/2030	750	642	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.750% due 06/15/2029	2,700	2,427
Gap, Inc. 3.625% due 10/01/2029 3.875% due 10/01/2031	1,700 300	1,438 242	Las Vegas Sands Corp. 3.900% due 08/08/2029	3,000	2,715
Genesis Energy LP 7.750% due 02/01/2028	400	400	Legacy LifePoint Health LLC 4.375% due 02/15/2027	525	488
GN Bondco LLC 9.500% due 10/15/2031	950	942	LFS Topco LLC 5.875% due 10/15/2026	100	93
Graphic Packaging International LLC 3.750% due 02/01/2030	2,500	2,227	Life Time, Inc. 5.750% due 01/15/2026	25	25
			LifePoint Health, Inc. 11.000% due 10/15/2030	\$ 1,200	\$ 1,271
			Light & Wonder International, Inc. 7.500% due 09/01/2031	375	391
			Lindblad Expeditions Holdings, Inc. 9.000% due 05/15/2028	650	686
			Lindblad Expeditions LLC 6.750% due 02/15/2027	500	502
			Live Nation Entertainment, Inc. 3.750% due 01/15/2028	200	185
			Match Group Holdings II LLC 5.000% due 12/15/2027	100	95
			Medline Borrower LP 3.875% due 04/01/2029	3,500	3,141
			Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc. 7.375% due 02/15/2031	700	701
			Midcap Financial Issuer Trust 5.625% due 01/15/2030 6.500% due 05/01/2028	200 400	170 367
			Moog, Inc. 4.250% due 12/15/2027	100	94
			MPH Acquisition Holdings LLC 5.500% due 09/01/2028	2,000	1,747
			Murphy Oil USA, Inc. 3.750% due 02/15/2031	100	85
			Nabors Industries, Inc. 9.125% due 01/31/2030	200	205
			Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 7.125% due 02/01/2032	1,500	1,477
			Navient Corp. 5.000% due 03/15/2027	125	119
			NCR Atleos Corp. 9.500% due 04/01/2029	1,725	1,826
			Neptune Bidco U.S., Inc. 9.290% due 04/15/2029	700	659
			New Fortress Energy, Inc. 6.500% due 09/30/2026 6.750% due 09/15/2025	400 200	387 199
			Newell Brands, Inc. 6.375% due 04/01/2036	150	132
			Newfold Digital Holdings Group, Inc. 11.750% due 10/15/2028	1,275	1,386
			Newmark Group, Inc. 7.500% due 01/12/2029	1,400	1,425
			NextEra Energy Operating Partners LP 3.875% due 10/15/2026 4.500% due 09/15/2027 7.250% due 01/15/2029	50 650 900	47 607 916
			NGL Energy Operating LLC 8.125% due 10/15/2029	400	404
			Noble Finance II LLC 8.000% due 04/15/2030	1,100	1,132
			Novelis Corp. 3.250% due 11/15/2026	1,100	1,021
			NSG Holdings LLC 7.750% due 12/15/2025	82	82

額面金額 (単位: 千)				時価 (単位: 千)				額面金額 (単位: 千)				時価 (単位: 千)															
Olympus Water U.S. Holding Corp.								SCIL IV LLC								Venture Global Calcasieu Pass LLC											
3.875% due 10/01/2028	EUR	2,600	\$	2,634	9.500% due 07/15/2028 (g)	EUR	325	\$	383	3.875% due 08/15/2029	\$	500	\$	449	3.875% due 11/01/2033		1,800		1,511	4.125% due 08/15/2031		350		307			
4.250% due 10/01/2028		\$	350	314	Sealed Air Corp.								Venture Global LNG, Inc.														
7.125% due 10/01/2027			400	398	6.125% due 02/01/2028		\$	800	798	8.125% due 06/01/2028		1,200		1,220	8.375% due 06/01/2031		1,300		1,316	9.500% due 02/01/2029		500		533			
OneMain Finance Corp.								Sirius XM Radio, Inc.								Viavi Solutions, Inc.											
3.500% due 01/15/2027		3,525		3,249	3.875% due 09/01/2031		225		186	3.750% due 10/01/2029		275		239	9.875% due 02/01/2032		350		369	Vistra Operations Co. LLC							
Organon & Co.								Southwestern Energy Co.								Wand NewCo 3, Inc.											
2.875% due 04/30/2028	EUR	4,200		4,220	4.750% due 02/01/2032		200		182	7.625% due 01/30/2032		700		720	6.375% due 03/15/2029		600		601	WESCO Distribution, Inc. (d)							
5.125% due 04/30/2031 (g)		\$	900	772	5.000% due 08/01/2027		600		572	6.625% due 03/15/2032		550		551	Williams Scotsman, Inc.												
Owens-Brockway Glass Container, Inc.								Spirit AeroSystems, Inc.								Wynn Las Vegas LLC											
7.250% due 05/15/2031		450		457	9.750% due 11/15/2030		1,425		1,528	3.75% due 10/01/2031		900		934	Wynn Resorts Finance LLC												
Oxford Finance LLC								Standard Industries, Inc.								XPO, Inc.											
6.375% due 02/01/2027		410		386	2.250% due 11/21/2026	EUR	1,900		1,927	7.125% due 06/01/2031		400		409	ZF North America Capital, Inc.												
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC								Star Parent, Inc.								ZipRecruiter, Inc.											
4.375% due 10/15/2028		600		557	4.375% due 07/15/2030		\$	1,375	1,227	5.000% due 09/15/2029		750		661	188,371												
PBF Holding Co. LLC								Starwood Property Trust, Inc.								U.S. TREASURY OBLIGATIONS 5.5%											
7.875% due 09/15/2030		100		103	3.625% due 07/15/2026		250		233	U.S. Treasury Notes																	
PDC Energy, Inc.								Station Casinos LLC								2.250% due 11/15/2024 (i)											
5.750% due 05/15/2026		1,000		999	4.625% due 12/01/2031		300		267	23,000		22,534	Total United States														
PennyMac Financial Services, Inc.								Tallgrass Energy Partners LP								(Cost \$224,195)											
4.250% due 02/15/2029		2,600		2,347	6.000% due 12/31/2030		800		745	SHORT-TERM INSTRUMENTS 1.8%																	
5.750% due 09/15/2031		900		828	7.375% due 02/15/2029		1,600		1,598	REPURCHASE AGREEMENTS (f) 1.5%																	
Permian Resources Operating LLC								Tapestry, Inc.								6,100											
7.000% due 01/15/2032		1,300		1,336	7.700% due 11/27/2030		625		663	TIME DEPOSITS 0.3%																	
7.750% due 02/15/2026		50		51	TEGNA, Inc.								Bank of Nova Scotia														
PetSmart, Inc.								TerraForm Power Operating LLC								4.080% due 03/01/2024											
4.750% due 02/15/2028		600		563	4.750% due 01/15/2030		500		463	4.830% due 03/01/2024	CAD	1		0	BNP Paribas Bank												
Post Holdings, Inc.								TopBuild Corp.								4.400% due 03/01/2024											
4.625% due 04/15/2030		2,400		2,186	4.125% due 02/15/2032		400		351	4.000% due 03/01/2024	GBP	3		4	Brown Brothers Harriman & Co.												
PRA Group, Inc.								TransDigm, Inc.								(0.420%) due 03/01/2024											
7.375% due 09/01/2025		3,000		2,997	4.625% due 01/15/2029		1,100		1,010	0.520% due 03/01/2024	¥	1		0	Citibank N.A.												
8.375% due 02/01/2028		850		831	6.375% due 03/01/2029		400		402	4.830% due 03/01/2024		98		98	DBS Bank Ltd.												
Prime Healthcare Services, Inc.								U.S. Acute Care Solutions LLC								4.830% due 03/01/2024											
7.250% due 11/01/2025		100		100	6.625% due 03/01/2032		500		504	4.830% due 03/01/2024	\$	20		20	HSBC Bank PLC												
Prime Security Services Borrower LLC								Travel + Leisure Co.								3.070% due 03/01/2024											
3.375% due 08/31/2027		2,000		1,833	4.500% due 12/01/2029 (g)		2,750		2,521	4.400% due 03/01/2024	EUR	243		263	Univision Communications, Inc.												
PTC, Inc.								TriNet Group, Inc.								8.000% due 08/15/2028											
4.000% due 02/15/2028		300		280	7.125% due 12/01/2031		325		334	1,675																	
Raising Cane's Restaurants LLC								Triumph Group, Inc.								1,685											
9.375% due 05/01/2029		125		133	9.000% due 03/15/2028		500		523	1,485																	
Rand Parent LLC								U.S. Acute Care Solutions LLC								1,485											
8.500% due 02/15/2030 (g)		1,500		1,459	6.375% due 03/01/2026		1,375		1,246	1,485																	
Range Resources Corp.								U.S. Foods, Inc.								1,485											
4.750% due 02/15/2030		100		93	4.625% due 06/01/2030		600		550	1,485																	
Resorts World Las Vegas LLC								Uber Technologies, Inc.								1,485											
8.450% due 01/27/2030		300		320	4.750% due 02/15/2029		600		564	1,485																	
Ritchie Bros Holdings, Inc.								UGI International LLC								1,485											
7.750% due 03/15/2031		500		526	2.500% due 12/01/2029	EUR	1,600		1,545	1,485																	
RLJ Lodging Trust LP								UKG, Inc.								1,485											
3.750% due 01/01/2026		300		283	6.875% due 02/01/2031		\$	1,200	1,213	1,485																	
ROBLOX Corp.								United Airlines, Inc.								1,485											
3.875% due 05/01/2030		300		263	4.625% due 04/15/2029		2,500		2,308	1,485																	
Rockcliff Energy II LLC								Univision Communications, Inc.								1,485											
5.500% due 10/15/2029		200		184	8.000% due 08/15/2028		1,675		1,685	1,485																	
Rocket Mortgage LLC								Univision Communications, Inc.								1,485											
3.625% due 03/01/2029		700		622	1,485								1,485														
Sabre Global, Inc.								Univision Communications, Inc.								1,485											
8.625% due 06/01/2027		1,685		1,485	1,485								1,485														

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.830% due 03/01/2024	\$ 58	\$ 58
MUFG Bank Ltd.		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 24	0
Royal Bank of Canada		
3.070% due 03/01/2024	EUR 1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 196	1
3.070% due 03/01/2024	EUR 12	13
4.400% due 03/01/2024	GBP 3	4
4.830% due 03/01/2024	\$ 213	213
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 9	0
3.070% due 03/01/2024	EUR 175	189
4.400% due 03/01/2024	GBP 31	40
4.830% due 03/01/2024	\$ 376	376
	1,349	
Total Short-Term Instruments		7,449
(Cost \$7,449)		
Total Investments in Securities 101.5%	\$ 417,865	
(Cost \$422,412)		
Financial Derivative		
Instruments (h)(j) (0.0%)		(45)
(Cost or Premiums, net \$(15))		
Other Assets and Liabilities, net (1.5%)		(6,116)
Net Assets 100.0%		\$ 411,704

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

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

(e) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Alice France S.A.	11.500%	02/01/2027	12/20/2023	\$ 2,344	\$ 2,426	0.59%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(f) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	担保 受取価値	レポ価値	レポ契約の 受取 ⁽¹⁾
SAL	5.330%	02/29/2024	03/01/2024	\$ 6,100	U.S. Treasury Notes 0.875% due 09/30/2026	\$ (6,249)	\$ 6,100	\$ 6,101
Total Repurchase Agreements						\$ (6,249)	\$ 6,100	\$ 6,101

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽²⁾	リバースレポ の支払
BOS	5.300%	02/02/2024	03/22/2024	\$ (1,899)	\$ (1,907)
BOS	5.100%	02/02/2024	03/22/2024	(589)	(592)
BOS	5.050%	02/02/2024	03/22/2024	(406)	(407)
BOS	4.750%	02/02/2024	03/22/2024	(1,159)	(1,163)

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS (Cont.):

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽²⁾	リバースレポ の支払
BOS	4.750%	02/14/2024	03/06/2024	\$ (642)	\$ (643)
BRC	2.500%	09/22/2023	TBD ⁽³⁾	EUR (507)	(555)
BRC	2.500%	01/11/2024	TBD ⁽³⁾	(436)	(473)
JML	2.750%	08/24/2023	TBD ⁽³⁾	(598)	(657)
JML	2.250%	11/14/2023	TBD ⁽³⁾	(179)	(195)
JML	1.000%	03/01/2024	TBD ⁽³⁾	(275)	(297)
MYI	2.750%	08/02/2023	TBD ⁽³⁾	(333)	(366)
Total Reverse Repurchase Agreements				\$	(7,255)

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

Reverse Repurchase Agreements	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	
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (407)	\$ 0	\$ (1,880)	\$ (2,287)
U.S. Corporate Debt	0	(4,305)	0	(366)	(4,671)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ (2,246)	\$ (6,958)
Total Borrowings	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ (2,246)	\$ (6,958)
Payable for Reverse Repurchase Agreements⁽⁴⁾					\$ (6,958)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of February 29, 2024:

- (g) Securities with an aggregate market value of \$8,390 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 29, 2024.

取引相手	レポ契約 の受取	リバースレポ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの 支払	合計借入 その他金融取引	担保の (受取)/差入れ	ネットエク ス ポージャー ⁽⁵⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 6,072	\$ 1,360
BRC	0	(1,028)	0	0	(1,028)	1,055	27
JML	0	(1,149)	0	0	(1,149)	698	(451)
MYI	0	(366)	0	0	(366)	383	17
SAL	6,101	0	0	0	6,101	(6,249)	(148)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 6,101	\$ (7,255)	\$ 0	\$ 0			

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

⁽²⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 29, 2024 was \$8,425 at a weighted average interest rate of 2.920%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

⁽³⁾ Open maturity repurchase agreement.

⁽⁴⁾ Unsettled reverse repurchase agreements liability of \$(297) is outstanding at period end.

⁽⁵⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

(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-Bobl 5-Year Note March Futures	Short	03/2024	86	\$ 261	\$ 0	(12)
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	06/2024	10	(9)	0	(9)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	1	(3)	0	(2)
Euro-Schatz 2-Year Note June Futures	Short	06/2024	17	0	0	0
Euro-Schatz 2-Year Note March Futures	Short	03/2024	244	139	0	(22)
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Long	06/2024	96	26	5	0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2024	53	14	15	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2024	28	10	4	0

FUTURES CONTRACTS (Cont.):

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	
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note June Futures	Long	06/2024	11	\$ 8	\$ 3	\$ 0	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Long	06/2024	8	3	8	0	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2024	1	(1)	0	(1)	(1)
Total Futures Contracts				\$ 448	\$ 35	\$ (46)	

SWAP AGREEMENTS:

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

リファレンス・エンティティ	固定受取金利	満期日	2024年2月29日時点の インプライド・クレジット スプレッド ⁽²⁾			市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
			想定元本 ⁽³⁾					資産	負債
Cellnex Telecom S.A.	5.000%	12/20/2030	1.716%	EUR	3,600	\$ 796	\$ 229	\$ 19	\$ 0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	06/20/2028	2.256%		300	38	37	0	(1)
Newell Brands, Inc.	1.000%	06/20/2028	0.000%	\$	300	(27)	17	0	0
						\$ 807	\$ 283	\$ 19	\$ (1)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

インデックス/トランシェ	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現評価(損)益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-41 Index	5.000%	12/20/2028	\$ 7,425	\$ 545	\$ 93	\$ 12	\$ 0

INTEREST RATE SWAPS

変動金利 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 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	3.500%	03/20/2026	EUR 900	\$ (6)	\$ (4)	\$ 0	\$ 0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/21/2025	\$ 4,700	(119)	(110)	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.250%	12/20/2025	4,600	(40)	(52)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	06/21/2028	2,000	(92)	(77)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052	500	(178)	(59)	3	0
Pay ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	5.500%	03/20/2026	GBP 2,500	57	2	2	0
					\$ (378)	\$ (300)	\$ 7	\$ 0
Total Swap Agreements					\$ 974	\$ 76	\$ 38	\$ (1)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 29, 2024:

- (I) Securities with an aggregate market value of \$4,889 and cash of \$1,032 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 29, 2024. 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	
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 35	\$ 38	\$ 73	\$ 0	\$ (46)	(1)	\$ (47)	

⁽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 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.

⁽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.

⁽⁴⁾ 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.

⁽⁵⁾ This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

(j) 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	03/2024	\$ 986	EUR 915	\$ 4	\$ 0
BPS	03/2024	EUR 929	\$ 995	0	(10)
BPS	03/2024	GBP 1,663	2,111	7	0
BPS	03/2024	\$ 3,581	EUR 3,303	0	(7)
BPS	03/2024	499	JPY 75,000	2	0
BPS	04/2024	2,111	GBP 1,663	0	(7)
CBK	03/2024	GBP 181	\$ 229	0	0
CBK	03/2024	\$ 316	EUR 294	2	0
DUB	03/2024	36,248	33,390	0	(115)
DUB	04/2024	EUR 33,390	\$ 36,292	115	0
MBC	03/2024	37,961	41,064	0	(16)
MBC	03/2024	\$ 3,801	CAD 5,102	0	(39)
MBC	03/2024	1,064	EUR 988	5	0
MBC	03/2024	3,540	GBP 2,790	0	(10)
MYI	03/2024	CAD 5,103	\$ 3,757	0	(5)
MYI	03/2024	\$ 267	JPY 40,000	0	0
MYI	04/2024	3,757	CAD 5,101	5	0
TOR	03/2024	GBP 459	\$ 585	3	0
UAG	03/2024	GBP 487	\$ 618	3	0
				\$ 146	\$ (209)

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	03/2024	EUR 11	\$ 12	0	0
BOA	04/2024	\$ 30	EUR 28	0	0
BPS	03/2024	EUR 995	\$ 1,080	3	0
BPS	03/2024	GBP 117	148	1	0
BPS	03/2024	\$ 8	EUR 7	0	0
BPS	03/2024	148	GBP 117	0	(1)
BPS	04/2024	GBP 116	\$ 147	0	0
CBK	03/2024	1	1	0	0
CBK	03/2024	\$ 94	JPY 13,913	0	(1)
FAR	03/2024	1,085	EUR 999	0	(4)
FAR	03/2024	328	JPY 48,206	0	(6)
FAR	04/2024	EUR 999	\$ 1,086	4	0
GLM	03/2024	CAD 4	3	0	0
GLM	03/2024	\$ 1	GBP 1	0	0
MYI	03/2024	CAD 53	\$ 40	1	0
MYI	03/2024	JPY 231,597	1,537	0	(10)
MYI	03/2024	\$ 42	CAD 57	0	0
MYI	03/2024	22	EUR 20	0	0
MYI	03/2024	5	GBP 4	0	0
MYI	03/2024	1,425	JPY 209,602	0	(24)
MYI	04/2024	CAD 57	\$ 42	0	0
MYI	04/2024	\$ 1,507	JPY 226,048	10	0
RBC	03/2024	JPY 2,183	\$ 15	0	0
RBC	04/2024	\$ 15	JPY 2,173	0	0
SCX	03/2024	JPY 224,873	\$ 1,502	0	0
SCX	03/2024	\$ 1,418	JPY 206,329	0	(40)
SCX	04/2024	1,502	223,850	0	0
TOR	03/2024	JPY 226,066	\$ 1,506	0	(5)
TOR	03/2024	\$ 1,418	JPY 207,915	0	(28)
TOR	04/2024	1,506	226,033	5	0
				\$ 24	\$ (119)
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 170	\$ (328)

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	リファレンス・エンティティ	固定受取金利	満期日	2024年2月29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 (損)益	スワップの価値		
								資産	負債	
GST	EP Infrastructure A/S	5.000%	06/20/2028	2.294%	EUR 700	\$ (15)	\$ 102	\$ 87	\$ 0	
Total Swap Agreements							\$ (15)	\$ 102	\$ 87	\$ 0

マネー・マーケット・マザーファンド

《第40期》決算日2024年11月20日

[計算期間：2024年5月21日～2024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40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40期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
36期(2022年11月21日)	10,181	△0.0	—	—	2,660
37期(2023年5月22日)	10,181	0.0	—	—	2,921
38期(2023年11月20日)	10,181	0.0	—	—	3,393
39期(2024年5月20日)	10,181	0.0	—	—	4,054
40期(2024年11月20日)	10,189	0.1	—	—	5,470

(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	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	債券率
(期首) 2024年5月20日	10,181	—	—	—	—
5月末	10,182	0.0	—	—	—
6月末	10,182	0.0	—	—	—
7月末	10,183	0.0	—	—	—
8月末	10,184	0.0	—	—	—
9月末	10,186	0.0	—	—	—
10月末	10,188	0.1	—	—	—
(期末) 2024年11月20日	10,189	0.1	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

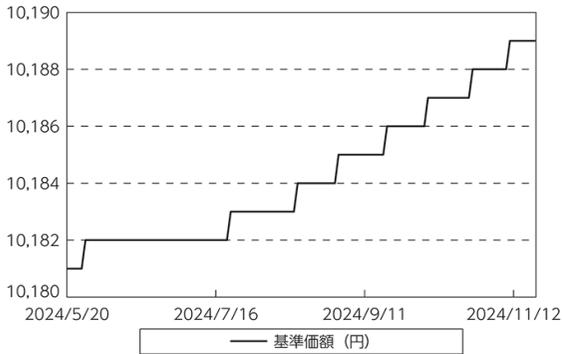
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.1%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

利子等収益が積み上がったことが基準価額の上昇要因となりました。

●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、プラス圏での推移となりました。

●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

・日銀による金融市場調節方針の下、短期金利は低位安定した推移を想定しています。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

(2024年5月21日～2024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

(2024年5月21日～2024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 466,254,326	千円 465,157,496

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2024年5月21日～2024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

(2024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 4,399,627	% 80.4

(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

(2024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 4,399,627	% 80.4
コール・ローン等、その他	1,070,482	19.6
投資信託財産総額	5,470,109	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	5,470,109,222
コール・ローン等	1,070,475,515
その他有価証券(評価額)	4,399,627,443
未収利息	6,264
(B) 負債	993
未払解約金	993
(C) 純資産総額(A-B)	5,470,108,229
元本	5,368,633,626
次期繰越損益金	101,474,603
(D) 受益権総口数	5,368,633,626口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,189円

<注記事項>

- ①期首元本額 3,982,613,790円
 期中追加設定元本額 1,731,487,183円
 期中一部解約元本額 345,467,347円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0189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)	3,128,287,801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	1,208,812,120円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	568,892,871円
マネーボールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	279,191,903円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	101,983,104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>	28,328,278円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドA>	20,064,981円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	12,060,536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
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
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>	1,330,374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)	98,223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)	98,222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)	98,222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)	98,222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)	98,222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)	98,222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)	98,174円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(毎月決算型)	98,174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)	98,174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)	98,174円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	98,174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)	98,174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)	98,174円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	98,174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)	98,174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)	98,174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)	98,174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)	98,174円

○損益の状況 (2024年5月21日~2024年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	3,633,602
受取利息	3,633,602
(B) 当期損益金(A)	3,633,602
(C) 前期繰越損益金	72,251,265
(D) 追加信託差損益金	31,979,396
(E) 解約差損益金	△ 6,389,660
(F) 計(B+C+D+E)	101,474,603
次期繰越損益金(F)	101,474,603

(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/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)	98, 174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> (年1回決算型)	98, 174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)	98, 174円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース> (毎月分配型)	98, 174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)	98, 174円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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> (毎月決算型)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (毎月分配型)	98, 174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)	98, 174円
三菱UFJ/ピムコ 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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 174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)	98, 173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
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
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (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
テンブルトン新興国小型株ファンド	49, 097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)	44, 142円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39, 351円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	30, 651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, 650円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (年2回分配型)	20, 635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
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9, 822円
バリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	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
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9, 821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<安定重視型> (分配コース)	9, 820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<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820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	5,368,633,626円