

## 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）等を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	ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）	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。
	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	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）等を主要投資対象とします。原則として為替ヘッジは行いません。
	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。	

※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）

# ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）

第219期（決算日：2023年1月10日）  
 第220期（決算日：2023年2月7日）  
 第221期（決算日：2023年3月7日）  
 第222期（決算日：2023年4月7日）  
 第223期（決算日：2023年5月8日）  
 第224期（決算日：2023年6月7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6月7日に第224期の決算を行いましたので、法令に基づいて第219期～第224期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			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
195期(2021年1月7日)	4,013	20	0.1	41,832.83	0.3	—	—	99.6	29,537
196期(2021年2月8日)	4,078	20	2.1	42,776.98	2.3	—	—	99.7	29,700
197期(2021年3月8日)	4,125	20	1.6	43,555.38	1.8	—	—	99.7	29,828
198期(2021年4月7日)	4,182	20	1.9	44,469.80	2.1	—	—	99.7	29,924
199期(2021年5月7日)	4,175	20	0.3	44,644.40	0.4	—	—	99.7	29,683
200期(2021年6月7日)	4,205	20	1.2	45,117.08	1.1	—	—	99.7	29,623
201期(2021年7月7日)	4,221	20	0.9	45,678.51	1.2	—	—	99.6	29,524
202期(2021年8月10日)	4,176	20	△0.6	45,519.27	△0.3	—	—	99.7	29,000
203期(2021年9月7日)	4,176	20	0.5	45,794.47	0.6	—	—	99.7	28,846
204期(2021年10月7日)	4,151	20	△0.1	45,723.20	△0.2	—	—	99.7	28,470
205期(2021年11月8日)	4,241	20	2.6	46,959.30	2.7	—	—	99.7	28,885
206期(2021年12月7日)	4,160	20	△1.4	46,279.84	△1.4	—	—	99.7	28,107
207期(2022年1月7日)	4,243	20	2.5	47,502.95	2.6	—	—	99.7	28,526
208期(2022年2月7日)	4,115	10	△2.8	46,216.97	△2.7	—	—	99.7	27,535
209期(2022年3月7日)	4,007	10	△2.4	44,984.30	△2.7	—	—	99.7	26,578
210期(2022年4月7日)	4,244	10	6.2	47,926.07	6.5	—	—	99.7	27,815
211期(2022年5月9日)	4,250	10	0.4	48,102.33	0.4	—	—	99.7	27,595
212期(2022年6月7日)	4,334	10	2.2	49,083.78	2.0	—	—	99.7	27,927
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

(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国際投信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 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率					
第219期	(期首) 2022年12月7日	円 4,336	% —	% 49,854.09	% —	% —	% —	% 99.7
	12月末	4,192	△3.3	48,226.45	△3.3	—	—	99.6
	(期末) 2023年1月10日	4,262	△1.7	49,053.49	△1.6	—	—	99.7
第220期	(期首) 2023年1月10日	4,252	—	49,053.49	—	—	—	99.7
	1月末	4,252	0.0	49,060.44	0.0	—	—	99.8
	(期末) 2023年2月7日	4,342	2.1	50,135.67	2.2	—	—	99.7
第221期	(期首) 2023年2月7日	4,332	—	50,135.67	—	—	—	99.7
	2月末	4,351	0.4	50,384.50	0.5	—	—	99.7
	(期末) 2023年3月7日	4,374	1.0	50,655.81	1.0	—	—	99.7
第222期	(期首) 2023年3月7日	4,364	—	50,655.81	—	—	—	99.7
	3月末	4,291	△1.7	49,667.29	△2.0	—	—	99.7
	(期末) 2023年4月7日	4,293	△1.6	49,675.62	△1.9	—	—	99.7
第223期	(期首) 2023年4月7日	4,283	—	49,675.62	—	—	—	99.7
	4月末	4,378	2.2	50,886.63	2.4	—	—	99.7
	(期末) 2023年5月8日	4,410	3.0	51,161.44	3.0	—	—	99.7
第224期	(期首) 2023年5月8日	4,400	—	51,161.44	—	—	—	99.7
	5月末	4,518	2.7	52,602.46	2.8	—	—	99.6
	(期末) 2023年6月7日	4,548	3.4	52,939.49	3.5	—	—	99.7

(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。

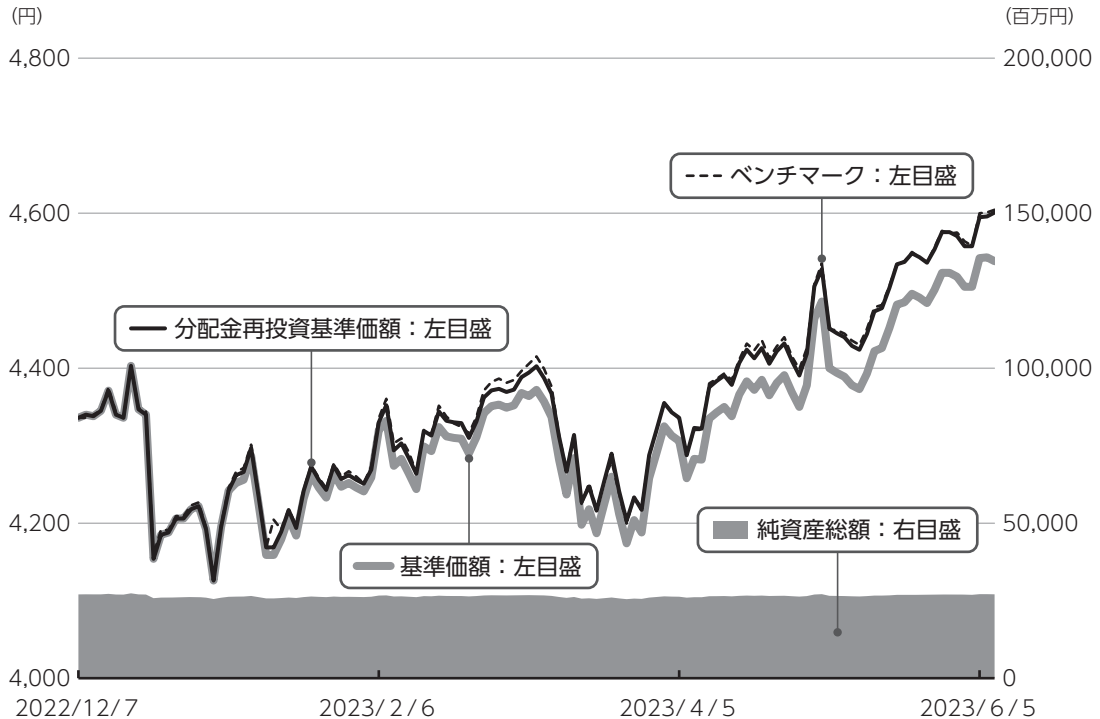
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第219期～第224期：2022年12月8日～2023年6月7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219期首	4,336円
第224期末	4,538円
既払分配金	60円
騰落率	6.1%

(分配金再投資ベース)

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

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

### 基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ6.1%（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（6.2%）を0.1%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や、米ドルとユーロが対円で上昇したこと等が、基準価額の上昇要因となりました。

第219期～第224期：2022年12月8日～2023年6月7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、2023年3月以降発生した欧米での金融システム不安の高まり等がスプレッド（国債に対する上乗せ金利）の拡大要因となったものの、欧米で消費者物価指数（CPI）の伸びが鈍化した局面において、インフレの減速が意識されたこと等がスプレッドの縮小要因となりました。期間を通じてみると、スプレッドは縮小しハイイールド債券市況は上昇しました。

### ▶ 為替市況

**米ドルとユーロは対円で上昇しました。**

米ドルは、米国のインフレ率の伸びが鈍化し、米国の利上げペースの減速期待が高まった局面等においては対円で下落したものの、日銀による金融緩和策の継続期待が強まったこと等を背景に、期間を通じてみると対円で上昇しました。ユーロは、欧州中央銀行（ECB）による積極的な金融引き締め姿勢や中国のゼロコロナ政策撤廃等がプラス要因となり、期間を通じてみると対円で上昇しました。

### ▶ 国内短期金融市場

**無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。**

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.047%となりました。

## ▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 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。

▶ 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。

### ▶ 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

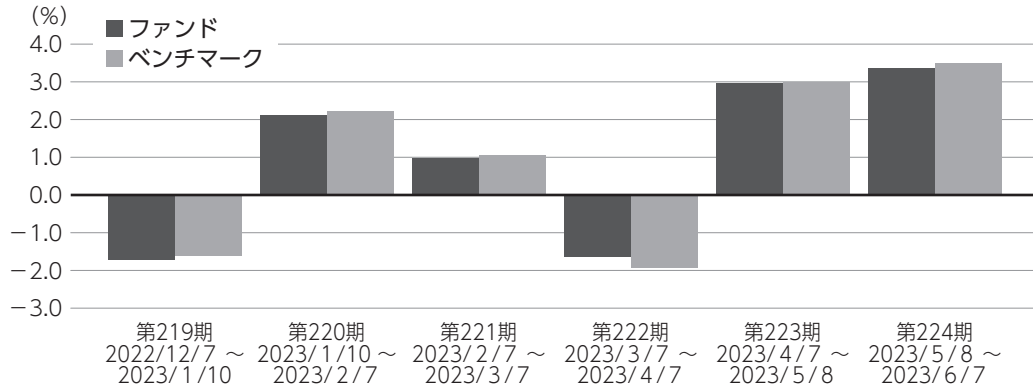
当期間では、多くの企業が手元資金の確保に努めてきている一方で、欧米の中央銀行による積極的な金融引き締め等を受けて、景気後退のリスクが高まっていることから、デフォルト率は緩やかに上昇するとみておりました。このような環境下、運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行いました。

具体的には、経済活動の再開以降に個人消費が持ち直していることなどから消費財等のセクターに対して積極姿勢としました。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進む中で構造的な変化に直面している電力、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に対して消極姿勢としました。

第219期～第224期：2022/12/8～2023/6/7

## ▶ 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、0.1%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）

通信セクターに対して積極姿勢としたこと。

##### （マイナス要因）

メディアセクターや消費財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219期 2022年12月8日～ 2023年1月10日	第220期 2023年1月11日～ 2023年2月7日	第221期 2023年2月8日～ 2023年3月7日	第222期 2023年3月8日～ 2023年4月7日	第223期 2023年4月8日～ 2023年5月8日	第224期 2023年5月9日～ 2023年6月7日
当期分配金 （対基準価額比率）	<b>10</b> (0.235%)	<b>10</b> (0.230%)	<b>10</b> (0.229%)	<b>10</b> (0.233%)	<b>10</b> (0.227%)	<b>10</b> (0.220%)
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	284	299	313	325	343	360

（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 JPY

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、経済活動の再開以降に個人消費が持ち直していることなどから消費者サービス等のセクターに対して積極姿勢とします。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進む中で構造的な変化に直面している電力、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に対して消極姿勢とします。

### ▶ マネー・マーケット・マザーファンド

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2022年12月8日～2023年6月7日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第219期～第224期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	33	0.766	(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）	(19)	(0.438)	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）	(13)	(0.301)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.027)	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	33	0.768	

作成期中の平均基準価額は、4,321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。

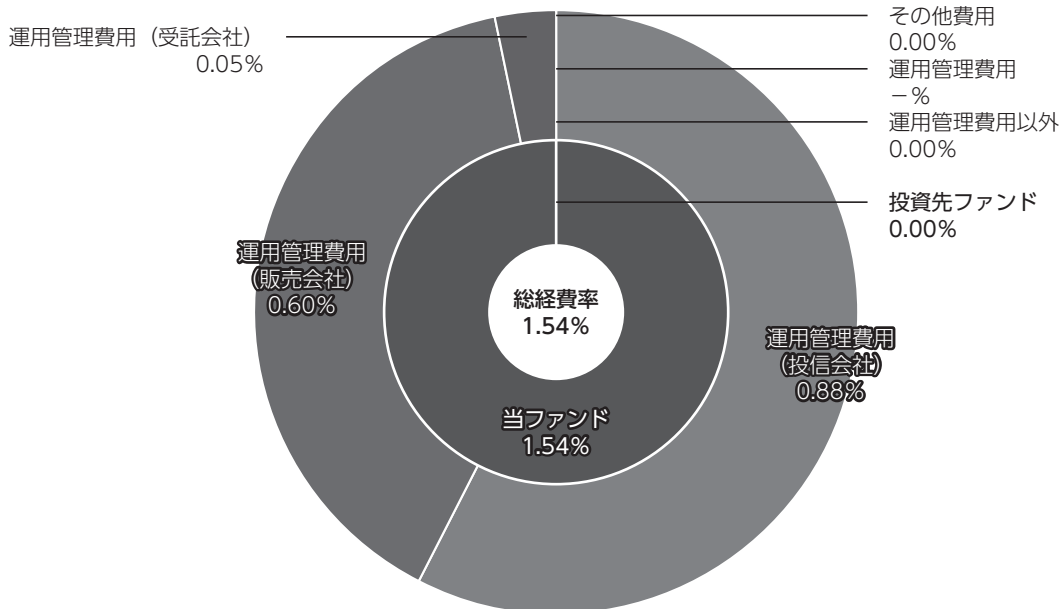
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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1.54%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.54
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	(%)	0.00

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

○売買及び取引の状況

(2022年12月8日～2023年6月7日)

投資信託証券

銘柄		第219期～第224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 138	千円 1,017,805	千口 234	千円 1,740,000

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月8日～2023年6月7日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<マネー・マーケット・マザーファンド>

種類	第219期～第224期		
	買付額	売付額	第224期末保有額
その他有価証券	百万円 1,999	百万円 2,000	百万円 -

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはアコムです。

○組入資産の明細

(2023年6月7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218期末	第224期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY	3,590	3,494	26,982,576	99.7
	合計	3,590	3,494	26,982,576	99.7

(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218期末	第224期末	
	口数	口数	評価額
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 11,784	千口 11,784	千円 11,997

○投資信託財産の構成

(2023年6月7日現在)

項目	第224期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 26,982,576	% 99.3
マネー・マーケット・マザーファンド	11,997	0.0
コール・ローン等、その他	188,665	0.7
投資信託財産総額	27,183,238	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第219期末	第220期末	第221期末	第222期末	第223期末	第224期末
	2023年1月10日現在	2023年2月7日現在	2023年3月7日現在	2023年4月7日現在	2023年5月8日現在	2023年6月7日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	26,419,569,709	26,819,980,907	26,870,947,439	26,235,333,092	26,702,364,725	27,183,238,065
コール・ローン等	92,731,372	91,358,805	99,404,507	78,515,139	87,455,833	118,664,089
投資信託受益証券(評価額)	26,234,840,694	26,636,624,459	26,669,545,289	26,044,820,310	26,492,911,249	26,982,576,333
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	11,997,643	11,997,643	11,997,643	11,997,643	11,997,643	11,997,643
未収入金	80,000,000	80,000,000	90,000,000	100,000,000	110,000,000	70,000,000
(B) 負債	105,907,937	110,071,796	124,031,295	111,322,846	133,053,128	123,053,943
未払収益分配金	61,881,909	61,662,312	61,283,255	60,994,728	60,381,629	59,627,306
未払解約金	5,925,557	17,397,007	31,322,869	16,238,872	37,890,800	29,514,758
未払信託報酬	37,986,461	30,919,628	31,331,144	33,987,286	34,676,454	33,810,248
未払利息	62	100	41	10	225	215
その他未払費用	113,948	92,749	93,986	101,950	104,020	101,416
(C) 純資産総額(A-B)	26,313,661,772	26,709,909,111	26,746,916,144	26,124,010,246	26,569,311,597	27,060,184,122
元本	61,881,909,625	61,662,312,717	61,283,255,543	60,994,728,918	60,381,629,321	59,627,306,995
次期繰越損益金	△35,568,247,853	△34,952,403,606	△34,536,339,399	△34,870,718,672	△33,812,317,724	△32,567,122,873
(D) 受益権総口数	61,881,909,625口	61,662,312,717口	61,283,255,543口	60,994,728,918口	60,381,629,321口	59,627,306,995口
1万口当たり基準価額(C/D)	4,252円	4,332円	4,364円	4,283円	4,400円	4,538円

○損益の状況

項 目	第219期	第220期	第221期	第222期	第223期	第224期
	2022年12月8日～ 2023年1月10日	2023年1月11日～ 2023年2月7日	2023年2月8日～ 2023年3月7日	2023年3月8日～ 2023年4月7日	2023年4月8日～ 2023年5月8日	2023年5月9日～ 2023年6月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	174,791,566	167,427,258	159,873,694	170,070,344	172,713,977	167,410,985
受取配当金	174,795,911	167,428,396	159,874,820	170,071,570	172,717,189	167,416,059
受取利息	299	73	46	62	-	-
支払利息	△ 4,644	△ 1,211	△ 1,172	△ 1,288	△ 3,212	△ 5,074
(B) 有価証券売買損益	△ 594,974,310	414,693,652	133,642,950	△ 571,680,460	629,691,987	748,040,457
売買益	4,839,278	416,007,415	135,444,686	3,620,196	633,965,581	751,854,690
売買損	△ 599,813,588	△ 1,313,763	△ 1,801,736	△ 575,300,656	△ 4,273,594	△ 3,814,233
(C) 信託報酬等	△ 38,100,409	△ 31,012,377	△ 31,425,130	△ 34,089,236	△ 34,780,474	△ 33,911,664
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 458,283,153	551,108,533	262,091,514	△ 435,699,352	767,625,490	881,539,778
(E) 前期繰越損益金	△ 5,397,665,192	△ 5,891,819,600	△ 5,364,504,651	△ 5,131,784,003	△ 5,568,258,312	△ 4,796,572,482
(F) 追加信託差損益金	△29,650,417,599	△29,550,030,227	△29,372,643,007	△29,242,240,589	△28,951,303,273	△28,592,462,863
(配当等相当額)	( 1,043,794,497)	( 1,040,726,745)	( 1,034,983,302)	( 1,031,478,401)	( 1,021,662,732)	( 1,009,563,212)
(売買損益相当額)	(△30,694,212,096)	(△30,590,756,972)	(△30,407,626,309)	(△30,273,718,990)	(△29,972,966,005)	(△29,602,026,075)
(G) 計(D+E+F)	△35,506,365,944	△34,890,741,294	△34,475,056,144	△34,809,723,944	△33,751,936,095	△32,507,495,567
(H) 収益分配金	△ 61,881,909	△ 61,662,312	△ 61,283,255	△ 60,994,728	△ 60,381,629	△ 59,627,306
次期繰越損益金(G+H)	△35,568,247,853	△34,952,403,606	△34,536,339,399	△34,870,718,672	△33,812,317,724	△32,567,122,873
追加信託差損益金	△29,650,417,599	△29,550,030,227	△29,372,643,007	△29,242,240,589	△28,951,303,273	△28,592,462,863
(配当等相当額)	( 1,043,794,497)	( 1,040,726,745)	( 1,034,983,302)	( 1,031,478,401)	( 1,021,662,732)	( 1,009,563,212)
(売買損益相当額)	(△30,694,212,096)	(△30,590,756,972)	(△30,407,626,309)	(△30,273,718,990)	(△29,972,966,005)	(△29,602,026,075)
分配準備積立金	714,176,823	808,171,167	884,509,396	954,513,249	1,049,773,806	1,138,386,313
繰越損益金	△ 6,632,007,077	△ 6,210,544,546	△ 6,048,205,788	△ 6,582,991,332	△ 5,910,788,257	△ 5,113,046,323

(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 62,336,655,198円  
 作成期中追加設定元本額 325,904,233円  
 作成期中一部解約元本額 3,035,252,436円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.4538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32,567,122,873円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2022年12月8日～ 2023年1月10日	2023年1月11日～ 2023年2月7日	2023年2月8日～ 2023年3月7日	2023年3月8日～ 2023年4月7日	2023年4月8日～ 2023年5月8日	2023年5月9日～ 2023年6月7日
費用控除後の配当等収益額	136,691,055円	158,508,078円	142,756,402円	135,981,081円	165,229,143円	161,208,432円
費用控除後・繰越欠損金繰戻後の有価証券売買等損益額	-円	-円	-円	-円	-円	-円
収益調整金額	1,043,794,497円	1,040,726,745円	1,034,983,302円	1,031,478,401円	1,021,662,732円	1,009,563,212円
分配準備積立金額	639,367,677円	711,325,401円	803,036,249円	879,526,896円	944,926,292円	1,036,805,187円
当ファンドの分配対象収益額	1,819,853,229円	1,910,560,224円	1,980,775,953円	2,046,986,378円	2,131,818,167円	2,207,576,831円
1万口当たり収益分配対象額	294円	309円	323円	335円	353円	370円
1万口当たり分配金額	10円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金金額	61,881,909円	61,662,312円	61,283,255円	60,994,728円	60,381,629円	59,627,306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219期	第220期	第221期	第222期	第223期	第224期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

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

◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほか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】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。



<参考>投資する投資信託証券およびその概要

<b>ファンド名</b>	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPY
<b>運用方針</b>	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（BBB-、円ベース）を上回る投資成果をめざします。
<b>主要運用対象</b>	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
<b>主な組入制限</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 通常、ファンドの 80%以上をBBB-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。</li> <li>・ 投資する公社債は原則として取得時においてB-格相当以上の格付けを取得しているものに限りません。</li> <li>・ 投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB-格相当以上に維持します。</li> <li>・ ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。</li> <li>・ 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、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。）。</li> <li>・ エマージング債への投資は行いません。</li> <li>・ 原則として、為替ヘッジは行いません。</li> </ul>
<b>決算日</b>	原則として毎年2月28日
<b>分配方針</b>	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Cayman Trust Annual Report February 28, 2022版から抜粋して作成しています。なお、開示情報につきましては、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

(2021年3月1日～2022年2月28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
<b>投資収入：</b>	
受取利息（外国税額控除後＊）	22,873
雑収入	0
収入合計	22,873
<b>費用：</b>	
支払利息	4
法務費用	0
費用合計	4
<b>投資純収入</b>	<b>22,869</b>
<b>実現純利益（損失）：</b>	
投資有価証券	17,265
マスターファンド	0
為替取引、中央清算金融派生商品	3,418
店頭金融派生商品	1,083
外貨	(32)
実現純利益（損失）	21,734
<b>未実現評価益（評価損）の純変動：</b>	
投資有価証券	(52,183)
マスターファンド	0
為替取引、中央清算金融派生商品	(584)
店頭金融派生商品	564
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	(105)
未実現評価益（評価損）の純変動	(52,308)
純利益（損失）	(30,574)
<b>運用による純資産の純増（減）額</b>	<b>(7,705)</b>
＊外国税控除後	14

(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

(2021年3月1日～2022年2月28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
<b>純資産の増加（減少）：</b>				
<b>運用：</b>				
投資純収入（費用）				22,869
実現純利益（損失）				21,734
未実現評価益（評価損）の純変動				(52,308)
運用による純資産の純増（減）額				(7,705)
<b>分配：</b>				
JPY				(29,626)
JPY Hedged				(468)
分配金額合計				(30,094)
<b>ファンドユニット取引：</b>				
ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額				(53,219)
<b>純資産の増（減）額合計</b>				<b>(91,018)</b>
<b>純資産：</b>				
期首				604,182
期末				513,164

(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  
(2022年2月28日現在)

	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)				
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 99.6%</b>			<b>FRANCE 5.8%</b>			<b>ITALY 4.3%</b>						
<b>BERMUDA 0.5%</b>			<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.4%</b>			<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 4.3%</b>						
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>			<b>Casino, Guichard-Perrachon S.A.</b>			<b>Atlantia SpA</b>						
<b>NCL Corp. Ltd.</b>			4.000% due 08/31/2025	EUR	2,100	\$	2,297	1.625% due 02/03/2025	EUR	400	\$	440
5.875% due 02/15/2027	\$	100	\$	100	<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 5.4%</b>			1.875% due 07/13/2027		400	428	
<b>Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.</b>			<b>Accor S.A.</b>			<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>						
5.625% due 02/15/2029	100	94	2.375% due 11/29/2028	500	541	2.625% due 04/28/2025	7,600	8,074				
<b>VOC Escrow Ltd.</b>			<b>Air France-KLM</b>			<b>Castor SpA</b>						
5.000% due 02/15/2028	2,700	2,575	1.875% due 01/16/2025	500	520	6.000% due 02/15/2029	300	332				
<b>Total Bermuda</b>		<b>2,769</b>	<b>Altice France S.A.</b>			<b>FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA</b>						
<b>(Cost \$2,900)</b>			2.125% due 02/15/2025	4,700	4,996	5.625% due 08/01/2027	1,000	1,102				
<b>BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.1%</b>			<b>CAB SELAS</b>			<b>Inter Media &amp; Communication SpA</b>						
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>			3.375% due 02/01/2028	3,800	3,935	6.750% due 02/09/2027	2,100	2,335				
<b>Studio City Finance Ltd.</b>			<b>CGG S.A.</b>			<b>Intesa Sanpaolo SpA (a/b)</b>						
5.000% due 01/15/2029	500	399	7.750% due 04/01/2027	3,800	4,228	7.700% due 09/17/2025	\$	1,000	1,055			
<b>Total British Virgin Islands</b>		<b>399</b>	<b>Electricite de France S.A. (a)</b>			7.750% due 01/11/2027			EUR	500	626	
<b>(Cost \$503)</b>			2.625% due 12/01/2027	1,200	1,173	<b>UniCredit SpA</b>						
<b>CANADA 4.1%</b>			5.375% due 01/29/2025	2,200	2,509	4.875% due 02/20/2029			3,800	4,471		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.2%</b>			<b>Faurecia SE</b>			<b>Total Italy</b>						
<b>Garda World Security Corp.</b>			2.750% due 02/15/2027	800	863	<b>(Cost \$23,748)</b>						
4.750% due 02/01/2029	1,000	991	<b>liad Holding SASU</b>			<b>JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.9%</b>						
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 3.9%</b>			6.500% due 10/15/2026	\$	3,175	<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>						
<b>Air Canada</b>			<b>La Financiere Atalian SASU</b>			<b>AA Bond Co. Ltd.</b>						
3.875% due 08/15/2026	4,400	4,278	4.000% due 05/15/2024	EUR	2,800	2,905	3.250% due 07/31/2028	GBP	100	126		
<b>Bausch Health Cos., Inc.</b>			<b>Loxam SAS</b>			4.875% due 07/31/2024			2,000	2,754		
5.000% due 02/15/2029	2,600	2,109	3.250% due 01/14/2025	600	650	<b>Adient Global Holdings Ltd.</b>						
<b>Bombardier, Inc.</b>			<b>Renault S.A.</b>			3.500% due 08/15/2024			EUR	1,700	1,892	
7.500% due 12/01/2024	500	518	2.500% due 04/01/2028	1,900	1,953	<b>Total Jersey, Channel Islands</b>						
7.500% due 03/15/2025	1,300	1,314	<b>Societe Generale S.A.</b>			<b>(Cost \$5,150)</b>						
7.875% due 04/15/2027	500	508	7.875% due 12/18/2023 (a/b)	\$	200	210	<b>LUXEMBOURG 3.0%</b>					
<b>GFL Environmental, Inc.</b>			<b>Total France</b>			<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%</b>						
4.000% due 08/01/2028	1,600	1,488	<b>(Cost \$31,890)</b>			<b>Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.</b>						
<b>New Red Finance, Inc.</b>			<b>GERMANY 2.3%</b>			3.500% due 06/30/2025			1,315	1,468		
3.875% due 01/15/2028	4,400	4,286	<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.8%</b>			<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.7%</b>						
<b>Northriver Midstream Finance LP</b>			<b>BK LC Lux SPV Sarl</b>			<b>Albion Financing 1 Sarl</b>						
5.625% due 02/15/2026	3,000	3,019	3.000% due 04/28/2028	1,000	1,101	6.125% due 10/15/2026	\$	400	389			
<b>Parkland Corp.</b>			<b>CTEC III GmbH</b>			<b>Altice Financing S.A.</b>						
4.625% due 05/01/2030	900	853	3.760% due 01/19/2029	1,000	1,114	2.250% due 01/15/2025	EUR	850	896			
5.875% due 07/15/2027	1,500	1,520	<b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b>			5.750% due 08/15/2029			\$	550	502	
<b>Precision Drilling Corp.</b>			3.500% due 08/21/2026	2,000	2,142	<b>BK LC Lux Finco1 Sarl</b>						
6.875% due 01/15/2029	200	201	<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.5%</b>			5.250% due 04/30/2029			EUR	200	219	
		<b>20,094</b>	<b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b>			<b>Camelot Finance S.A.</b>						
<b>Total Canada</b>		<b>21,085</b>	3.500% due 09/30/2024	EUR	800	838	4.500% due 11/01/2026	\$	750	752		
<b>(Cost \$21,672)</b>			<b>Schaeffler AG</b>			<b>Cirsa Finance International Sarl</b>						
<b>CAYMAN ISLANDS 0.3%</b>			3.375% due 10/12/2028	1,400	1,596	4.500% due 03/15/2027	EUR	100	106			
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.1%</b>			<b>Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH</b>			6.250% due 12/20/2023			1,613	1,819		
<b>AAdvantage Loyalty IP Ltd.</b>			2.000% due 07/15/2025	3,150	3,395	<b>Herens Holdco Sarl</b>						
5.500% due 04/20/2028	300	306	<b>ZF Finance GmbH</b>			4.750% due 05/15/2028			\$	400	374	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>			3.750% due 09/21/2028	1,700	1,856	<b>Lincoln Financing Sarl</b>						
<b>Sitka Holdings LLC</b>			<b>Total Germany</b>			3.625% due 04/01/2024			EUR	1,500	1,685	
5.250% due 07/06/2026	800	802	<b>(Cost \$13,278)</b>			<b>Matterhorn Telecom S.A.</b>						
<b>Transocean Pontus Ltd.</b>			<b>ITALY 4.3%</b>			3.125% due 09/15/2026			2,750	2,938		
6.125% due 08/01/2025	461	456	<b>GERMANY 2.3%</b>			<b>Signa Development Finance SCS</b>						
		<b>1,258</b>	<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%</b>			5.500% due 07/23/2026			1,300	1,298		
<b>Total Cayman Islands</b>		<b>1,564</b>	<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>			<b>(Cost \$1,563)</b>						

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Summer BC Holdco B SARL</b>		
5.750% due 10/31/2026	EUR 2,600	\$ 2,849
		<b>13,927</b>
<b>Total Luxembourg (Cost \$15,969)</b>		<b>15,395</b>
<b>MULTINATIONAL 2.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.6%</b>		
<b>Allied Universal Holdco LLC</b>		
3.625% due 06/01/2028	1,100	1,157
4.625% due 06/01/2028	\$ 1,200	1,134
4.875% due 06/01/2028	GBP 1,000	1,240
<b>American Airlines, Inc.</b>		
5.500% due 04/20/2026	\$ 875	897
5.750% due 04/20/2029	5,200	5,325
<b>Ardagh Packaging Finance PLC</b>		
4.125% due 08/15/2026	1,250	1,212
5.250% due 08/15/2027	750	714
<b>Clarios Global LP</b>		
4.375% due 05/15/2026	EUR 500	562
<b>Delta Air Lines, Inc.</b>		
4.750% due 10/20/2028	\$ 900	939
<b>Total Multinational (Cost \$13,861)</b>		<b>13,170</b>
<b>NETHERLANDS 2.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.4%</b>		
<b>AerCap Holdings NV</b>		
5.875% due 10/10/2029	1,250	1,233
<b>Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV</b>		
3.750% due 01/15/2025	EUR 2,000	2,211
<b>Dufry One BV</b>		
2.000% due 02/15/2027	2,600	2,633
<b>LeasePlan Corp. NV</b>		
7.375% due 05/29/2024 (a)(b)	2,100	2,519
<b>Schoeller Packaging BV</b>		
6.375% due 11/01/2024	625	687
<b>Sensata Technologies BV</b>		
5.000% due 10/01/2025	\$ 1,000	1,035
<b>WP/AP Telecom Holdings IV BV</b>		
3.750% due 01/15/2029	EUR 300	319
<b>Ziggo Bond Co. BV</b>		
6.000% due 01/15/2027	\$ 1,750	1,774
<b>Total Netherlands (Cost \$12,571)</b>		<b>12,411</b>
<b>PANAMA 0.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.8%</b>		
<b>Carnival Corp.</b>		
4.000% due 08/01/2028	2,100	2,015
10.500% due 02/01/2026	1,700	1,911
<b>Total Panama (Cost \$4,012)</b>		<b>3,926</b>
<b>SPAIN 2.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.9%</b>		
<b>Aedas Homes Opco SLU</b>		
4.000% due 08/15/2026	EUR 3,200	3,557
<b>CaixaBank S.A.</b>		
6.750% due 06/13/2024 (a)(b)	200	239

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Cellnex Finance Co. S.A.</b>		
1.500% due 06/08/2028	EUR 1,800	\$ 1,850
<b>Grifols Escrow Issuer S.A.</b>		
3.875% due 10/15/2028	1,200	1,240
<b>International Consolidated Airlines Group S.A.</b>		
3.750% due 03/25/2029	2,400	2,572
<b>Neinor Homes S.A.</b>		
4.500% due 10/15/2026	2,500	2,754
<b>Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A.</b>		
5.250% due 04/01/2026	2,400	2,696
<b>Total Spain (Cost \$16,586)</b>		<b>14,908</b>
<b>SWEDEN 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
<b>Intrum AB</b>		
3.125% due 07/15/2024	2,900	3,219
<b>Verisure Holding AB</b>		
3.250% due 02/15/2027	1,100	1,164
<b>Total Sweden (Cost \$4,717)</b>		<b>4,383</b>
<b>SWITZERLAND 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>Credit Suisse Group AG (a)(b)</b>		
7.500% due 07/17/2023	\$ 800	816
7.500% due 12/11/2023	1,800	1,891
<b>Total Switzerland (Cost \$2,791)</b>		<b>2,707</b>
<b>UNITED KINGDOM 6.8%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 0.4%</b>		
<b>BCP V Modular Services Holdings IV Ltd.</b>		
4.500% due 12/15/2028	100	109
<b>Ineos Finance PLC</b>		
2.500% due 04/01/2024	1,661	1,836
		<b>1,945</b>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 6.4%</b>		
<b>Arqiva Broadcast Finance PLC</b>		
6.750% due 09/30/2023	GBP 750	1,011
<b>Barclays PLC (a)(b)</b>		
7.250% due 03/15/2023	1,200	1,646
7.750% due 09/15/2023	\$ 800	838
7.875% due 09/15/2022	GBP 600	822
<b>BCP V Modular Services Finance II PLC</b>		
4.750% due 11/30/2028	EUR 1,300	1,393
<b>Harbour Energy PLC</b>		
5.500% due 10/15/2026	\$ 2,800	2,768
<b>HSBC Holdings PLC (a)(b)</b>		
5.250% due 09/16/2022	EUR 800	910
6.250% due 03/23/2023	\$ 200	204
<b>INEOS Quattro Finance 2 PLC</b>		
3.375% due 01/15/2026	2,500	2,390
<b>Ithaca Energy North Sea PLC</b>		
9.000% due 07/15/2026	1,600	1,615
<b>Jaguar Land Rover Automotive PLC</b>		
7.750% due 10/15/2025	6,000	6,326
<b>Miller Homes Group Holdings PLC</b>		
5.500% due 10/15/2024	GBP 1,600	2,171

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Rolls-Royce PLC</b>		
5.750% due 10/15/2027	\$ 1,350	\$ 1,393
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>		
7.375% due 06/24/2022 (a)(b)	GBP 800	1,080
<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>		
5.000% due 04/15/2027	1,000	1,354
<b>Vmed O2 UK Financing I PLC</b>		
3.250% due 01/31/2031	EUR 1,000	1,029
4.000% due 01/31/2029	GBP 1,000	1,216
4.250% due 01/31/2031	\$ 1,500	1,382
<b>Vodafone Group PLC</b>		
6.250% due 10/03/2028	2,700	2,803
<b>Zenith Finco PLC</b>		
6.500% due 06/30/2027	GBP 400	495
		<b>32,846</b>
<b>Total United Kingdom (Cost \$36,011)</b>		<b>34,791</b>
<b>UNITED STATES 58.0%</b>		
<b>BANK LOAN OBLIGATIONS 1.7%</b>		
<b>BK LC Lux SPV Sarl</b>		
3.750% due 04/28/2028	\$ 896	889
<b>Carnival Corp.</b>		
3.750% due 06/30/2025	EUR 985	1,099
3.750% due 06/30/2025	\$ 1,182	1,171
<b>Embecta Corp.</b>		
3.500% due 01/27/2029	100	99
<b>GIP II Blue Holding LP</b>		
5.500% due 09/29/2028	399	398
<b>Instant Brands Holdings, Inc.</b>		
5.750% due 04/12/2028	866	814
<b>LifePoint Health, Inc.</b>		
3.959% due 11/16/2025	2,849	2,823
<b>Polaris Newco LLC</b>		
4.500% due 06/02/2028	100	99
<b>SCH Salt Holdings, Inc.</b>		
4.750% due 03/16/2027	205	202
<b>Team Health Holdings, Inc.</b>		
3.750% due 02/06/2024	1,484	1,416
		<b>9,010</b>
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 51.7%</b>		
<b>180 Medical, Inc.</b>		
3.875% due 10/15/2029	300	289
<b>ADT Security Corp.</b>		
4.125% due 08/01/2029	2,000	1,889
<b>Advantage Sales &amp; Marketing, Inc.</b>		
6.500% due 11/15/2028	3,100	3,125
<b>AMC Networks, Inc.</b>		
4.250% due 02/15/2029	3,200	3,001
5.000% due 04/01/2024	596	596
<b>AmWINS Group, Inc.</b>		
4.875% due 06/30/2029	400	382
<b>ASP Unifrax Holdings, Inc.</b>		
5.250% due 09/30/2028	200	192
<b>Avantor Funding, Inc.</b>		
3.875% due 11/01/2029	2,650	2,554
4.625% due 07/15/2028	1,600	1,626
<b>Berry Global, Inc.</b>		
4.500% due 02/15/2026	892	895

	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)
<b>Block, Inc.</b>			<b>DCP Midstream Operating LP</b>			<b>LABL, Inc.</b>		
2.750% due 06/01/2026	\$ 900	\$ 874	3.250% due 02/15/2032	\$ 950	\$ 887	5.875% due 11/01/2028	\$ 200	\$ 192
<b>Booz Allen Hamilton, Inc.</b>			5.625% due 07/15/2027	1,000	1,076	<b>Ladder Capital Finance Holdings LLLP</b>		
4.000% due 07/01/2029	200	198	<b>Diamond Sports Group LLC</b>			4.750% due 06/15/2029	2,700	2,620
<b>British Airways 2021-1 Class A Pass-Through Trust</b>			5.375% due 08/15/2026	2,275	937	<b>Leeward Renewable Energy Operations LLC</b>		
2.900% due 03/15/2035	100	98	<b>Directv Financing LLC</b>			4.250% due 07/01/2029	2,700	2,619
<b>Builders FirstSource, Inc.</b>			5.875% due 08/15/2027	1,400	1,402	<b>Legacy LifePoint Health LLC</b>		
4.250% due 02/01/2032	575	553	<b>DISH DBS Corp.</b>			4.375% due 02/15/2027	500	474
<b>Burford Capital Global Finance LLC</b>			5.250% due 12/01/2026	3,000	2,947	<b>LFS Topco LLC</b>		
6.250% due 04/15/2028	400	415	5.750% due 12/01/2028	1,400	1,341	5.875% due 10/15/2026	100	100
<b>Calpine Corp.</b>			<b>Encino Acquisition Partners Holdings LLC</b>			<b>Lindblad Expeditions LLC</b>		
3.750% due 03/01/2031	2,900	2,644	8.500% due 05/01/2028	1,675	1,699	6.750% due 02/15/2027	100	101
<b>CCO Holdings LLC</b>			<b>Endeavor Energy Resources LP</b>			<b>Live Nation Entertainment, Inc.</b>		
4.250% due 02/01/2031	2,000	1,877	5.750% due 01/30/2028	1,250	1,296	3.750% due 01/15/2028	200	192
4.500% due 08/15/2030	1,000	965	<b>EQM Midstream Partners LP</b>			4.750% due 10/15/2027	750	738
4.500% due 06/01/2033	1,050	986	4.750% due 01/15/2031	2,350	2,206	<b>Lumen Technologies, Inc.</b>		
4.750% due 03/01/2030	1,000	984	<b>EQT Corp.</b>			4.000% due 02/15/2027	100	95
5.125% due 05/01/2027	2,500	2,528	3.125% due 05/15/2026	200	197	<b>Mauser Packaging Solutions Holding Co.</b>		
5.375% due 06/01/2029	1,000	1,017	3.625% due 05/15/2031	200	195	5.500% due 04/15/2024	2,000	1,992
<b>Cheniere Energy Partners LP</b>			<b>First Student Bidco, Inc.</b>			<b>Midas OpCo Holdings LLC</b>		
3.250% due 01/31/2032	3,725	3,508	4.000% due 07/31/2029	2,000	1,894	5.625% due 08/15/2029	2,725	2,674
<b>Cheniere Energy, Inc.</b>			<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>			<b>Midcap Financial Issuer Trust</b>		
4.625% due 10/15/2028	2,800	2,864	3.625% due 06/17/2031	13,900	13,388	5.625% due 01/15/2030	200	183
<b>Chesapeake Energy Corp.</b>			<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>			6.500% due 05/01/2028	400	391
5.500% due 02/01/2026	100	103	5.500% due 05/01/2028	2,500	2,392	<b>Mazart Debt Merger Sub, Inc.</b>		
5.875% due 02/01/2029	100	104	6.500% due 10/01/2025	750	760	3.875% due 04/01/2029	2,725	2,590
6.750% due 04/15/2029	2,700	2,858	<b>Freedom Mortgage Corp.</b>			<b>MPH Acquisition Holdings LLC</b>		
<b>Cinemark USA, Inc.</b>			6.625% due 01/15/2027	3,000	2,773	5.500% due 09/01/2028	2,000	1,944
5.250% due 07/15/2028 (f)	1,600	1,528	<b>Frontier Communications Holdings LLC</b>			<b>Netflix, Inc.</b>		
<b>Clarivate Science Holdings Corp.</b>			6.000% due 01/15/2030	750	700	3.625% due 06/15/2030	EUR 1,900	2,292
3.875% due 07/01/2028	300	284	<b>Full House Resorts, Inc.</b>			<b>Nielsen Finance LLC</b>		
<b>Clearway Energy Operating LLC</b>			8.250% due 02/15/2028	1,000	1,004	4.750% due 07/15/2031	\$ 1,025	914
3.750% due 01/15/2032	900	843	<b>GCP Applied Technologies, Inc.</b>			<b>Novelis Corp.</b>		
<b>Collfax Corp.</b>			5.500% due 04/15/2026	1,250	1,275	3.250% due 11/15/2026	1,100	1,045
3.250% due 05/15/2025	EUR 500	557	<b>Genesis Energy LP</b>			<b>NSG Holdings LLC</b>		
<b>CommScope, Inc.</b>			7.750% due 02/01/2028	2,200	2,176	7.750% due 12/15/2025	845	894
4.750% due 09/01/2029	\$ 3,700	3,456	<b>Genworth Holdings, Inc.</b>			<b>Occidental Petroleum Corp.</b>		
<b>Community Health Systems, Inc.</b>			4.800% due 02/15/2024	300	308	5.875% due 09/01/2025	1,825	1,960
4.750% due 02/15/2031	3,600	3,393	<b>Graphic Packaging International LLC</b>			6.125% due 01/01/2031 (d1lf)	1,600	1,822
<b>Comstock Resources, Inc.</b>			3.750% due 02/01/2030	5,175	4,938	6.375% due 09/01/2028	2,750	3,112
5.875% due 01/15/2030	200	194	<b>GYP Holdings III Corp.</b>			6.625% due 09/01/2030	4,650	5,418
6.750% due 03/01/2029	1,600	1,630	4.625% due 05/01/2029	400	374	<b>Olympus Water U.S. Holding Corp.</b>		
7.500% due 05/15/2025	600	614	<b>Harvest Midstream I LP</b>			3.875% due 10/01/2028	EUR 3,000	3,148
<b>Conduent Business Services LLC</b>			7.500% due 09/01/2028	1,725	1,743	<b>OneMain Finance Corp.</b>		
6.000% due 11/01/2029	2,275	2,171	<b>HAT Holdings I LLC</b>			3.500% due 01/15/2027	\$ 4,625	4,382
<b>Coty, Inc.</b>			3.375% due 06/15/2026	1,775	1,685	<b>Option Care Health, Inc.</b>		
3.875% due 04/15/2026	EUR 1,400	1,537	<b>HealthEquity, Inc.</b>			4.375% due 10/31/2029	300	290
5.000% due 04/15/2026	\$ 2,225	2,241	4.500% due 10/01/2029	300	286	<b>Organon &amp; Co.</b>		
<b>Crestwood Midstream Partners LP</b>			<b>Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC</b>			2.875% due 04/30/2028	EUR 4,200	4,420
6.000% due 02/01/2029	600	606	5.000% due 06/01/2029	1,400	1,374	5.125% due 04/30/2031	\$ 900	900
<b>Crocs, Inc.</b>			<b>Howard Hughes Corp.</b>			<b>Oxford Finance LLC</b>		
4.125% due 08/15/2031	3,700	3,159	4.125% due 02/01/2029	600	569	6.375% due 02/01/2027	410	420
<b>CrownRock LP</b>			4.375% due 02/01/2031	540	510	<b>Pactiv Evergreen Group Issuer LLC</b>		
5.000% due 05/01/2029	100	102	5.375% due 08/01/2028	1,900	1,923	4.375% due 10/15/2028	600	555
5.625% due 10/15/2025	2,150	2,177	<b>II-VI, Inc.</b>			<b>Papa John's International, Inc.</b>		
<b>Curo Group Holdings Corp.</b>			5.000% due 12/15/2029	200	200	3.875% due 09/15/2029	200	186
7.500% due 08/01/2028	2,650	2,357	<b>Imola Merger Corp.</b>			<b>Par Pharmaceutical, Inc.</b>		
<b>DaVita, Inc.</b>			4.750% due 05/15/2029	2,650	2,574	7.500% due 04/01/2027	1,000	1,003
3.750% due 02/15/2031	1,675	1,533						



	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)
<b>Park Intermediate Holdings LLC</b>			<b>Sunnova Energy Corp.</b>			<b>Zayo Group Holdings, Inc.</b>		
4.875% due 05/15/2029	\$ 600	\$ 579	5.875% due 09/01/2026	\$ 100	\$ 92	4.000% due 03/01/2027	\$ 1,900	\$ 1,808
<b>PDC Energy, Inc.</b>			<b>Switch Ltd.</b>			<b>ZipRecruiter, Inc.</b>		
5.750% due 05/15/2026	1,000	1,016	4.125% due 06/15/2029	1,100	1,056	5.000% due 01/15/2030	400	394
<b>PennyMac Financial Services, Inc.</b>			<b>Tallgrass Energy Partners LP</b>					<u>265,229</u>
4.250% due 02/15/2029	2,600	2,331	6.000% due 12/31/2030	800	772	<b>U.S. TREASURY OBLIGATIONS 4.6%</b>		
5.750% due 09/15/2031	900	849	<b>Targa Resources Partners LP</b>			<b>U.S. Treasury Notes</b>		
<b>Performance Food Group, Inc.</b>			4.000% due 01/15/2032	275	271	2.250% due 11/15/2024	23,000	23,393
5.500% due 10/15/2027	3,300	3,362	4.875% due 02/01/2031	1,800	1,853	<b>Total United States</b>		<u>297,632</u>
<b>PetSmart, Inc.</b>			5.875% due 04/15/2026	750	775	<b>(Cost \$305,675)</b>		
4.750% due 02/15/2028	600	599	6.875% due 01/15/2029	625	681	<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 3.4%</b>		
<b>PGT Innovations, Inc.</b>			<b>TEGNA, Inc.</b>			<b>REPURCHASE AGREEMENTS (e) 0.5%</b>		
4.375% due 10/01/2029	700	659	5.000% due 09/15/2029	750	749			<u>2,528</u>
<b>Post Holdings, Inc.</b>			<b>Tenet Healthcare Corp.</b>			<b>TIME DEPOSITS 0.5%</b>		
4.500% due 09/15/2031	1,300	1,206	4.875% due 01/01/2026	7,100	7,158	<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
4.625% due 04/15/2030	1,000	943	<b>Terminix Co. LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	6	6
5.750% due 03/01/2027	2,400	2,428	7.450% due 08/15/2027	100	117	<b>Bank of Nova Scotia</b>		
<b>PRA Group, Inc.</b>			<b>TerraForm Power Operating LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	1	1
7.375% due 09/01/2025	3,000	3,154	4.250% due 01/31/2023	1,000	1,002	<b>BNP Paribas Bank</b>		
<b>Prime Healthcare Services, Inc.</b>			4.750% due 01/15/2030	500	492	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 2	2
7.250% due 11/01/2025	100	102	5.000% due 01/31/2028	1,500	1,506	0.005% due 03/01/2022	\$ 235	235
<b>Prime Security Services Borrower LLC</b>			<b>Thor Industries, Inc.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 1	1
3.375% due 08/31/2027	2,000	1,853	4.000% due 10/15/2029	3,100	2,833	<b>Citibank N.A.</b>		
<b>Range Resources Corp.</b>			<b>TopBuild Corp.</b>			0.005% due 02/01/2022	\$ 302	302
4.750% due 02/15/2030	100	98	4.125% due 02/15/2032	400	381	<b>Credit Suisse AG</b>		
<b>Revlon Consumer Products Corp.</b>			<b>TransDigm, Inc.</b>			(1.450%) due 03/01/2022	CHF 1	1
6.250% due 09/01/2024	25	11	4.625% due 01/15/2029	1,400	1,323	<b>DBS Bank Ltd.</b>		
<b>RHP Hotel Properties LP</b>			5.500% due 11/15/2027	1,500	1,496	0.005% due 03/01/2022	\$ 60	60
4.500% due 02/15/2029	1,500	1,419	6.250% due 03/15/2026	500	515	<b>HSBC Bank PLC</b>		
<b>Ritchie Bros Holdings, Inc.</b>			6.375% due 06/15/2026	2,900	2,960	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 131	147
4.750% due 12/15/2031	200	199	<b>Travel + Leisure Co.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 1	2
<b>RLJ Lodging Trust LP</b>			4.500% due 12/01/2029	2,750	2,631	<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
3.750% due 07/01/2026	300	293	<b>Triumph Group, Inc.</b>			0.005% due 03/01/2022	\$ 69	69
4.000% due 09/15/2029	300	282	8.875% due 06/01/2024	726	776	<b>Royal Bank of Canada</b>		
<b>ROBLOX Corp.</b>			<b>U.S. Acute Care Solutions LLC</b>			0.005% due 03/01/2022	603	603
3.875% due 05/01/2030	300	286	6.375% due 03/01/2026	1,375	1,356	<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
<b>Rockcliff Energy II LLC</b>			<b>Uber Technologies, Inc.</b>			(0.780%) due 03/01/2022	EUR 273	307
5.500% due 10/15/2029	200	199	4.500% due 08/15/2029	4,575	4,388	0.005% due 03/01/2022	\$ 945	945
<b>Sabre GLBL, Inc.</b>			<b>United Airlines, Inc.</b>			0.090% due 03/01/2022	GBP 3	4
7.375% due 09/01/2025	1,800	1,867	4.375% due 04/15/2026	400	400	<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
9.250% due 04/15/2025	700	790	4.625% due 04/15/2029	500	489	(0.780%) due 03/01/2022	EUR 5	6
<b>Scientific Games International, Inc.</b>			<b>Univision Communications, Inc.</b>			0.005% due 03/01/2022	\$ 45	45
3.375% due 02/15/2026	EUR 2,900	3,241	4.500% due 05/01/2029	3,600	3,451	0.090% due 03/01/2022	GBP 15	20
<b>Select Medical Corp.</b>			<b>Uber Technologies, Inc.</b>					<u>2,756</u>
6.250% due 08/15/2026	\$ 1,500	1,521	4.500% due 08/15/2029	400	392	<b>U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS 2.4%</b>		
<b>Southwestern Energy Co.</b>			3.875% due 11/01/2033	1,800	1,736	0.200% due 05/17/2022 (c/lh)	\$ 12,000	11,993
4.750% due 02/01/2032	200	199	4.125% due 08/15/2031	300	297	<b>Total Short-Term Instruments</b>		<u>17,277</u>
5.375% due 02/01/2029	3,320	3,420	<b>Viasat, Inc.</b>			<b>(Cost \$17,313)</b>		
<b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>			5.625% due 09/15/2025	750	717	<b>Total Investments in Securities 99.6%</b>		<u>\$ 511,198</u>
5.500% due 01/15/2025	3,400	3,498	5.625% due 04/15/2027	500	500	<b>(Cost \$530,210)</b>		
<b>Standard Industries, Inc.</b>			<b>Viavi Solutions, Inc.</b>			<b>Financial Derivative</b>		
4.375% due 07/15/2030	1,375	1,304	3.750% due 10/01/2029	200	190	<b>Instruments (g)(i) 0.1%</b>		<u>613</u>
<b>Staples, Inc.</b>			<b>Vistra Operations Co. LLC</b>			<b>(Cost or Premiums, net \$0)</b>		
7.500% due 04/15/2026	3,050	3,019	5.625% due 02/15/2027	1,250	1,282	<b>Other Assets and Liabilities, net 0.3%</b>		<u>1,353</u>
<b>Starwood Property Trust, Inc.</b>			<b>WMG Acquisition Corp.</b>			<b>Net Assets 100.0%</b>		<u>\$ 513,164</u>
3.750% due 12/31/2024	500	490	3.000% due 02/15/2031	2,400	2,174			
<b>Station Casinos LLC</b>			<b>Wynn Las Vegas LLC</b>					
4.625% due 12/01/2031	300	283	5.250% due 05/15/2027	1,000	991			
			5.500% due 03/01/2025	1,500	1,523			

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) Contingent convertible security.  
 (c) Coupon represents a yield to maturity.

(d) 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
Occidental Petroleum Corp.	6.125%	01/01/2031	12/08/2020	\$ 1,600	\$ 1,822	0.36%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(e) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	相保 受取価値	レボ価値	レボ契約の 受取 <sup>(2)</sup>
BPS	0.150%	02/24/2022	TBD <sup>(1)</sup>	GBP 1,884	Kane Bidco Ltd 6.500% due 02/15/2027	\$ (2,535)	\$ 2,528	\$ 2,536
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (2,535)</b>	<b>\$ 2,528</b>	<b>\$ 2,536</b>

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 <sup>(2)</sup>	決済日	満期日	借入金額 <sup>(2)</sup>	リバースレボ の支払
JML	(0.070%)	02/09/2022	04/12/2022	\$ (2,704)	\$ (2,704)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (2,704)</b>

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	残存期間				合計
	オーバーナイト/ 継続	30日迄	31-90日	90日以上	
<b>Reverse Repurchase Agreements</b>					
U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ (2,704)	\$ 0	\$ (2,704)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>
<b>Total Borrowings</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,704)</b>
<b>Payable for Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (2,704)</b>

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	額面金額	収益	ショートに よる支払
FBF	Kane Bidco Ltd.	6.500%	02/15/2027	\$ 1,900	\$ (2,557)	\$ (2,523)
<b>Total Short Sales (0.5%)</b>					<b>\$ (2,557)</b>	<b>\$ (2,523)</b>

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of February 28, 2022:

- (f) Securities with an aggregate market value of \$3,350 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 28, 2022.

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 受取/差入れ	ネットエク スボージャー <sup>(4)</sup>
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 2,536	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,536	\$ (2,535)	\$ 1
JML	0	(2,704)	0	0	(2,704)	3,350	646
Master Securities Forward Transactions Agreement							
FBF	0	0	0	(2,523)	(2,523)	0	(2,523)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 2,536</b>	<b>\$ (2,704)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (2,523)</b>			



<sup>(1)</sup> Open maturity repurchase agreement.

<sup>(2)</sup> Includes accrued interest.

<sup>(3)</sup> The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 28, 2022 was \$1,035 at a weighted average interest rate of 10.256%. Average borrowings may include sale buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

<sup>(4)</sup> Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

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

**FUTURES CONTRACTS:**

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Euro-Bobl 5-Year Note March Futures	Long	03/2022	32	\$ (88)	\$ 14	\$ 0
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03/2022	19	(157)	2	0
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03/2022	2	(39)	0	0
Euro-Schatz 2-Year Note June Futures	Short	06/2022	66	(20)	0	(15)
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2022	10	3	0	(13)
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Short	06/2022	1	(1)	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Long	06/2022	33	78	147	0
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (224)</b>	<b>\$ 163</b>	<b>\$ (29)</b>

**SWAP AGREEMENTS:**

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

参照債券	固定受取金利	満期日	2022年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>		想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格 <sup>(4)</sup>	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
			EUR	600				資産	負債
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	06/20/2026	4.315%	EUR	600	\$ 24	\$ (16)	\$ 3	\$ 0

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

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(3)</sup>	市場価格 <sup>(4)</sup>	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
						資産	負債
iTraxx Europe Crossover Series 36 Index	5.000%	12/20/2026	EUR 9,700	\$ 821	\$ 222	\$ 411	\$ 0

**INTEREST RATE SWAPS**

変動金利の 支払/受取 <sup>(3)</sup>	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	6-Month EURIBOR	0.250%	03/16/2032	EUR 2,900	\$ 191	\$ 245	\$ 10	\$ 0
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.500%	03/16/2027	GBP 2,800	(190)	(176)	14	0
					\$ 1	\$ 69	\$ 24	\$ 0
<b>Total Swap Agreements</b>					<b>\$ 846</b>	<b>\$ 275</b>	<b>\$ 438</b>	<b>\$ 0</b>

**FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY**

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 28, 2022:

(h) Securities with an aggregate market value of \$1,614 and cash of \$1,669 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 28, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	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
	\$ 0	\$ 163	\$ 438	\$ 601	\$ 0	\$ (29)	\$ 0	\$ (29)

- <sup>101</sup> If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- <sup>102</sup> Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- <sup>103</sup> The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- <sup>104</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- <sup>105</sup> 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.

**(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER**

**FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:**

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益			
				資産	負債		
BOA	05/2022	EUR	376	\$	4	\$	0
BOA	05/2022	\$	1,969	GBP	1,453	0	(19)
BPS	05/2022	EUR	1,516	\$	1,728	20	0
BPS	05/2022	\$	4,243	CAD	5,384	2	0
BRC	05/2022	EUR	956	\$	1,072	0	(5)
BRC	05/2022	\$	424	EUR	378	2	0
CBK	05/2022	EUR	861	\$	982	12	0
GLM	05/2022		1,343		1,531	18	0
MBC	03/2022	\$	173	JPY	20,000	1	0
MYI	05/2022	EUR	424	\$	483	5	0
MYI	05/2022	\$	370	EUR	330	1	0
				\$	65	\$	(24)

**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	03/2022	CAD	0	\$	0	\$	0
BPS	03/2022	\$	12	EUR	11	0	0
BRC	03/2022	JPY	263,359	\$	2,287	0	0
BRC	03/2022	\$	2,690	JPY	309,834	0	0
BRC	04/2022		2,287		263,182	0	0
CBK	03/2022	JPY	5,549	\$	48	0	0
MYI	03/2022		57,284		499	2	0
MYI	03/2022	\$	65	EUR	58	0	0
MYI	03/2022		14	GBP	10	0	0
MYI	04/2022		190	JPY	21,801	0	(1)
NAB	03/2022	JPY	326,531	\$	2,835	0	0
NAB	03/2022	\$	2,895	JPY	333,546	1	0
NAB	04/2022		2,835		326,310	0	0
SCX	03/2022	EUR	1,783	\$	2,000	0	(3)
SCX	03/2022	GBP	197		265	0	0
SCX	03/2022	JPY	326,531		2,835	0	0
SCX	03/2022	\$	1,991	EUR	1,772	0	0
SCX	03/2022		265	GBP	197	0	0
SCX	03/2022		2,895	JPY	333,546	1	0
SCX	04/2022	EUR	1,772	\$	1,993	0	0
SCX	04/2022	GBP	197		265	0	0
SCX	04/2022	\$	2,835	JPY	326,310	0	0
TOR	03/2022	CAD	80	\$	63	0	0
TOR	03/2022	JPY	5,356		47	0	0
TOR	04/2022	\$	47	JPY	5,353	0	0
				\$	4	\$	(4)
				\$	69	\$	(28)

**Total Forward Foreign Currency Contracts**

## マネー・マーケット・マザーファンド

### 《第37期》決算日2023年5月22日

[計算期間：2022年11月22日～2023年5月22日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、5月22日に第37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37期の運用状況をご報告申し上げます。

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

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		騰 落	率					
33期(2021年5月20日)	10,182		0.0		—		—	百万円 1,245
34期(2021年11月22日)	10,182		0.0		—		—	1,637
35期(2022年5月20日)	10,182		0.0		—		—	2,897
36期(2022年11月21日)	10,181		△0.0		—		—	2,660
37期(2023年5月22日)	10,181		0.0		—		—	2,921

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落	率				
(期首) 2022年11月21日	10,181		—		—		—
11月末	10,181		0.0		—		—
12月末	10,181		0.0		—		—
2023年1月末	10,181		0.0		—		—
2月末	10,181		0.0		—		—
3月末	10,181		0.0		—		—
4月末	10,181		0.0		—		—
(期末) 2023年5月22日	10,181		0.0		—		—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

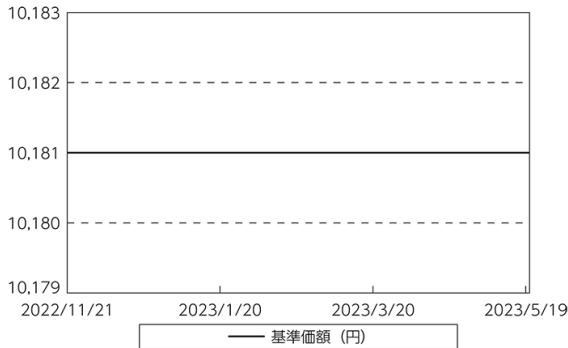
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ横ばいとなりました。

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。

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.034%となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

## ○今後の運用方針

- ・今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年11月22日～2023年5月22日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2022年11月22日～2023年5月22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 269,599,882	千円 269,499,890

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年11月22日～2023年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
その他有価証券	百万円 1,999	百万円 2,000	百万円 -

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはアコムです。

## ○組入資産の明細

(2023年5月22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 2,299,997	% 78.7

(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

(2023年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 2,299,997	% 78.7
コール・ローン等、その他	621,984	21.3
投資信託財産総額	2,921,981	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	2,921,981,522
コール・ローン等	621,984,405
その他有価証券(評価額)	2,299,997,117
(B) 負債	887
未払解約金	67
未払利息	820
(C) 純資産総額(A-B)	2,921,980,635
元本	2,870,024,150
次期繰越損益金	51,956,485
(D) 受益権総口数	2,870,024,150口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,181円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,613,319,906円  
 期中追加設定元本額 285,598,635円  
 期中一部解約元本額 28,894,391円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0181円です。

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

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,799,691,123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	545,437,984円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	71,485,526円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	66,609,195円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	61,994,892円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	41,204,097円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	24,765,135円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	13,122,469円
ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347円
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)	10,743,284円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	9,893,887円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,872,782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
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)	9,376,245円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,124,755円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	8,067,104円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)	7,489,236円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	7,196,270円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	6,895,341円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	6,887,212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)	6,675,966円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	6,609,861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
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,990,990円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	5,812,610円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	5,548,198円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	5,484,593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)	5,411,821円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(毎月分配型)	4,489,124円

## ○損益の状況 (2022年11月22日~2023年5月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 93,141
受取利息	8,257
支払利息	△ 101,398
(B) 当期損益金(A)	△ 93,141
(C) 前期繰越損益金	47,403,125
(D) 追加信託差損益金	5,169,295
(E) 解約差損益金	△ 522,794
(F) 計(B+C+D+E)	51,956,485
次期繰越損益金(F)	51,956,485

(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。

欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジなし）	4,289,171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	3,857,128円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	3,545,187円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	3,319,056円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型>（3ヵ月決算型）	3,063,931円
米国バンクロン・オープン<為替ヘッジあり>（年1回決算型）	2,990,177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）	2,966,566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）	2,895,129円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 米ドル円プレミアム（毎月分配型）	2,724,520円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>（年2回分配型）	2,711,846円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	2,590,474円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）	2,515,903円
三菱UFJ 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）	2,299,085円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,210,674円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）	2,178,993円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	2,119,621円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	2,065,331円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,007,890円
バリュエ・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>（毎月決算型）	1,936,118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）	1,721,384円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジあり>（毎月分配型）	1,628,892円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>（年2回分配型）	1,616,484円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,491,640円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マナーブルファンドB>	1,355,166円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	1,339,040円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 米ドル円プレミアム（年2回分配型）	1,171,788円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,149,232円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,145,161円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,074,934円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（年1回決算型）	1,020,693円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,016,827円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド（毎月分配型）	907,086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）	870,254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）	845,131円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>（毎月分配型）	669,935円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（毎月分配型）	665,580円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	629,892円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース（為替ヘッジなし）（年1回決算型）	521,457円
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 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>（毎月分配型）	416,840円
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）	382,241円
PIMCO 米国バンクロンファンド<米ドルインカム>（毎月分配型）	334,809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）	323,246円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカドルコース>（毎月分配型）	282,290円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>（年2回分配型）	278,281円
PIMCO 米国バンクロンファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	230,764円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	217,015円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	212,322円
三菱UFJ 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（年2回分配型）	208,430円
PIMCO 米国バンクロンファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	177,761円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	169,198円
米国バンクロンファンド<為替ヘッジなし>（資産成長型）	138,420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）	136,856円



三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	125,118円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	111,354円
三菱UFJ/マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97,104円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース> (毎月分配型)	89,620円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89,287円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (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
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	50,114円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
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 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)	30,437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
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10,795円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10,787円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (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
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
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	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
グローバル・インカム・フルコース (為替リスク軽減型)	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替ヘッジなし)	983円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
合計	2,870,024,150円

## [お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。