

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投資／海外／債券 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 無期限（2005年3月4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 エマーシング ボンド（エン・ヘッジド）インカム ファンドの投資信託証券への投資を通じて、新興経済国の政府および政府機関等の発行する債券等に実質的な投資を行います。また、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。JPモルガンEMBIグローバル・ダイバーシファイド（円ヘッジベース）をベンチマークとします。</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3年以上8年以内で調整します。実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてCCC格相当以上の格付けを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けは原則としてB格相当以上を維持します。</p> <p>実質的な組入外貨建資産については、原則として投資する外国投資信託において為替ヘッジを行います。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・エマーシング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり） | ピムコ エマーシング ボンド（エン・ヘッジド）インカム ファンド投資信託証券、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 エマーシング ボンド（エン・ヘッジド）インカム ファンド | 新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する債券およびその派生商品等を主要投資対象とします。原則として、為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。 |
| | マネー・マーケット・マザーファンド | わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。 |
| 主な組入制限 | 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。 | |
| 分配方針 | 経費等控除後の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・エマーシング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）

第230期（決算日：2024年6月20日）

第231期（決算日：2024年7月22日）

第232期（決算日：2024年8月20日）

第233期（決算日：2024年9月20日）

第234期（決算日：2024年10月21日）

第235期（決算日：2024年11月20日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「ピムコ・エマーシング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）」は、去る11月20日に第235期の決算を行いましたので、法令に基づいて第230期～第235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 | | | J Pモルガン EMB I グローバル・ダイバーシファイド (円ヘッジベース) | | 債権組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|-------------------|-------|------|------|---|------|--------|--------|------------|-------|
| | (分配落) | 税金込み | 期騰落 | 騰落 | 騰落 | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 206期(2022年6月20日) | 4,825 | 20 | △2.5 | 294.75 | △3.0 | — | — | 99.7 | 5,680 |
| 207期(2022年7月20日) | 4,568 | 20 | △4.9 | 284.95 | △3.3 | — | — | 99.4 | 5,324 |
| 208期(2022年8月22日) | 4,816 | 20 | 5.9 | 300.04 | 5.3 | — | — | 99.4 | 5,572 |
| 209期(2022年9月20日) | 4,642 | 20 | △3.2 | 289.98 | △3.4 | — | — | 99.4 | 5,344 |
| 210期(2022年10月20日) | 4,289 | 20 | △7.2 | 268.94 | △7.3 | — | — | 99.6 | 4,896 |
| 211期(2022年11月21日) | 4,544 | 20 | 6.4 | 286.60 | 6.6 | — | — | 99.5 | 5,118 |
| 212期(2022年12月20日) | 4,653 | 20 | 2.8 | 295.12 | 3.0 | — | — | 99.3 | 5,230 |
| 213期(2023年1月20日) | 4,753 | 20 | 2.6 | 302.53 | 2.5 | — | — | 99.7 | 5,325 |
| 214期(2023年2月20日) | 4,585 | 20 | △3.1 | 293.30 | △3.1 | — | — | 99.4 | 5,098 |
| 215期(2023年3月20日) | 4,519 | 20 | △1.0 | 291.04 | △0.8 | — | — | 99.3 | 4,988 |
| 216期(2023年4月20日) | 4,516 | 20 | 0.4 | 291.60 | 0.2 | — | — | 99.5 | 4,953 |
| 217期(2023年5月22日) | 4,461 | 20 | △0.8 | 290.10 | △0.5 | — | — | 99.4 | 4,851 |
| 218期(2023年6月20日) | 4,520 | 20 | 1.8 | 294.68 | 1.6 | — | — | 99.3 | 4,905 |
| 219期(2023年7月20日) | 4,604 | 20 | 2.3 | 300.05 | 1.8 | — | — | 99.6 | 5,024 |
| 220期(2023年8月21日) | 4,442 | 10 | △3.3 | 290.73 | △3.1 | — | — | 99.7 | 4,819 |
| 221期(2023年9月20日) | 4,446 | 10 | 0.3 | 291.19 | 0.2 | — | — | 99.5 | 4,810 |
| 222期(2023年10月20日) | 4,266 | 10 | △3.8 | 276.49 | △5.1 | — | — | 99.4 | 4,563 |
| 223期(2023年11月20日) | 4,414 | 10 | 3.7 | 288.55 | 4.4 | — | — | 99.3 | 4,655 |
| 224期(2023年12月20日) | 4,647 | 10 | 5.5 | 304.88 | 5.7 | — | — | 99.5 | 4,848 |
| 225期(2024年1月22日) | 4,575 | 10 | △1.3 | 298.84 | △2.0 | — | — | 99.0 | 4,732 |
| 226期(2024年2月20日) | 4,563 | 10 | △0.0 | 299.82 | 0.3 | — | — | 99.5 | 4,705 |
| 227期(2024年3月21日) | 4,644 | 10 | 2.0 | 304.65 | 1.6 | — | — | 99.3 | 4,682 |
| 228期(2024年4月22日) | 4,568 | 10 | △1.4 | 300.29 | △1.4 | — | — | 99.4 | 4,561 |
| 229期(2024年5月20日) | 4,649 | 10 | 2.0 | 305.91 | 1.9 | — | — | 99.4 | 4,616 |
| 230期(2024年6月20日) | 4,631 | 10 | △0.2 | 305.94 | 0.0 | — | — | 99.4 | 4,583 |
| 231期(2024年7月22日) | 4,630 | 10 | 0.2 | 306.64 | 0.2 | — | — | 98.9 | 4,436 |
| 232期(2024年8月20日) | 4,714 | 5 | 1.9 | 312.44 | 1.9 | — | — | 99.3 | 4,458 |
| 233期(2024年9月20日) | 4,788 | 5 | 1.7 | 318.09 | 1.8 | — | — | 99.4 | 4,507 |
| 234期(2024年10月21日) | 4,732 | 5 | △1.1 | 314.67 | △1.1 | — | — | 99.7 | 4,422 |
| 235期(2024年11月20日) | 4,663 | 5 | △1.4 | 309.46 | △1.7 | — | — | 98.5 | 4,300 |

(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) J Pモルガン EMB I グローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している米ドル建ての新興国債および国債に準じる債券のパフォーマンスを表す指数で、指数構成国の組入比率に調整を加えた指数です。組入比率の調整を行わない指数として J Pモルガン EMB I グローバルがあります。J Pモルガン EMB I グローバル・ダイバーシファイド (円ヘッジベース) は、J Pモルガン EMB I グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが計算したものです。当指数は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、著作権は J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しております。

(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 | | J Pモルガン EMB I グローバル・ダイバー シ フ ァ イ ド (円ヘッジベース) | | 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 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| 第230期 | (期 首) 2024年 5月20日 | 円 4,649 | % — | 305.91 | % — | % — | % — | % 99.4 |
| | 5月末 | 4,601 | △1.0 | 303.02 | △0.9 | — | — | 99.5 |
| | (期 末) 2024年 6月20日 | 4,641 | △0.2 | 305.94 | 0.0 | — | — | 99.4 |
| 第231期 | (期 首) 2024年 6月20日 | 4,631 | — | 305.94 | — | — | — | 99.4 |
| | 6月末 | 4,615 | △0.3 | 305.00 | △0.3 | — | — | 99.5 |
| | (期 末) 2024年 7月22日 | 4,640 | 0.2 | 306.64 | 0.2 | — | — | 98.9 |
| 第232期 | (期 首) 2024年 7月22日 | 4,630 | — | 306.64 | — | — | — | 98.9 |
| | 7月末 | 4,646 | 0.3 | 307.37 | 0.2 | — | — | 99.3 |
| | (期 末) 2024年 8月20日 | 4,719 | 1.9 | 312.44 | 1.9 | — | — | 99.3 |
| 第233期 | (期 首) 2024年 8月20日 | 4,714 | — | 312.44 | — | — | — | 99.3 |
| | 8月末 | 4,724 | 0.2 | 313.60 | 0.4 | — | — | 99.7 |
| | (期 末) 2024年 9月20日 | 4,793 | 1.7 | 318.09 | 1.8 | — | — | 99.4 |
| 第234期 | (期 首) 2024年 9月20日 | 4,788 | — | 318.09 | — | — | — | 99.4 |
| | 9月末 | 4,783 | △0.1 | 317.78 | △0.1 | — | — | 99.5 |
| | (期 末) 2024年10月21日 | 4,737 | △1.1 | 314.67 | △1.1 | — | — | 99.7 |
| 第235期 | (期 首) 2024年10月21日 | 4,732 | — | 314.67 | — | — | — | 99.7 |
| | 10月末 | 4,690 | △0.9 | 311.49 | △1.0 | — | — | 98.2 |
| | (期 末) 2024年11月20日 | 4,668 | △1.4 | 309.46 | △1.7 | — | — | 98.5 |

(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230期～第235期：2024年5月21日～2024年11月20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230期首 | 4,649円 |
| 第235期末 | 4,663円 |
| 既払分配金 | 40円 |
| 騰落率 | 1.2% |

(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はありません。

※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1.2%（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（1.2%）と同程度となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

エマージング（新興経済国）債券市況が上昇したこと。

下落要因

為替ヘッジによるコストがかかったこと。

第230期～第235期：2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境について

▶ 債券市況

エマージング債券市況は上昇しました。

当期間は、景気後退を示唆する米経済指標などを受けて、米国の利下げ観測が高まったことなどから、米国金利が低下し、エマージング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。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 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）

円建て外国投資信託であるピムコ エマージング ボンド（エン・ヘッジド）インカム ファンドへの投資を行い、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を継続しました。

▶ ピムコ エマージング ボンド（エン・ヘッジド）インカム ファンド

新興経済国の政府および政府機関等の発行する債券等に投資を行いました。

為替

組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

国別配分戦略

国別配分戦略については、国際通貨基金（IMF）による支援が期待されるコートジボワール等を積極姿勢としました。

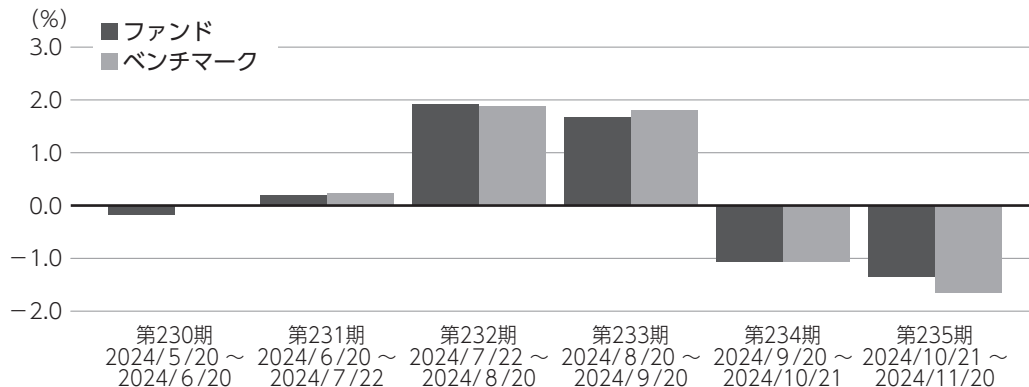
▶ マネー・マーケット・マザーファンド

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230期～第235期：2024/5/21～2024/11/20

▶ 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・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）

ファンドの騰落率は、ベンチマークであるJPモルガンEMBIグローバル・ダイバーシファイド（円ヘッジベース）の騰落率と同程度となりました。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

信託報酬等の運用上の費用を計上したこと等がマイナス要因となりました。

外国投資信託保有による要因

プラス要因

国別配分戦略において、エルサルバドルに対して積極姿勢としたこと。

マイナス要因

国別配分戦略において、コロンビアに対して積極姿勢としたこと。

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230期 2024年5月21日~ 2024年6月20日 | 第231期 2024年6月21日~ 2024年7月22日 | 第232期 2024年7月23日~ 2024年8月20日 | 第233期 2024年8月21日~ 2024年9月20日 | 第234期 2024年9月21日~ 2024年10月21日 | 第235期 2024年10月22日~ 2024年11月20日 |
|--------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 10 (0.215%) | 10 (0.216%) | 5 (0.106%) | 5 (0.104%) | 5 (0.106%) | 5 (0.107%) |
| 当期の収益 | 5 | 6 | 5 | 5 | 3 | 5 |
| 当期の収益以外 | 4 | 3 | - | - | 1 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 218 | 214 | 219 | 224 | 222 | 223 |

（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・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）

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

▶ ピムコ エマージング ボンド（エン・ヘッジド） インカム ファンド

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

エマージング諸国への投資に関しては、各国の財務状況の健全性を重視しつつ、一部割安となった国々への投資も行います。

具体的には、国際通貨基金（IMF）による支援などが期待されるコートジボワール等への投資を積極姿勢とします。一方、米国との貿易摩擦等が意識される中国等を消極姿勢とします。

なお、保有外貨建資産に対し、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

▶ 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。

2024年5月21日～2024年11月20日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第230期～第235期 | | 項目の概要 |
|-----------|-------------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 39 | 0.832 | (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） | (21) | (0.444) | 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) | (0.360) | 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) | (0.028) | 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 | 39 | 0.834 | |

作成期中の平均基準価額は、4,680円です。

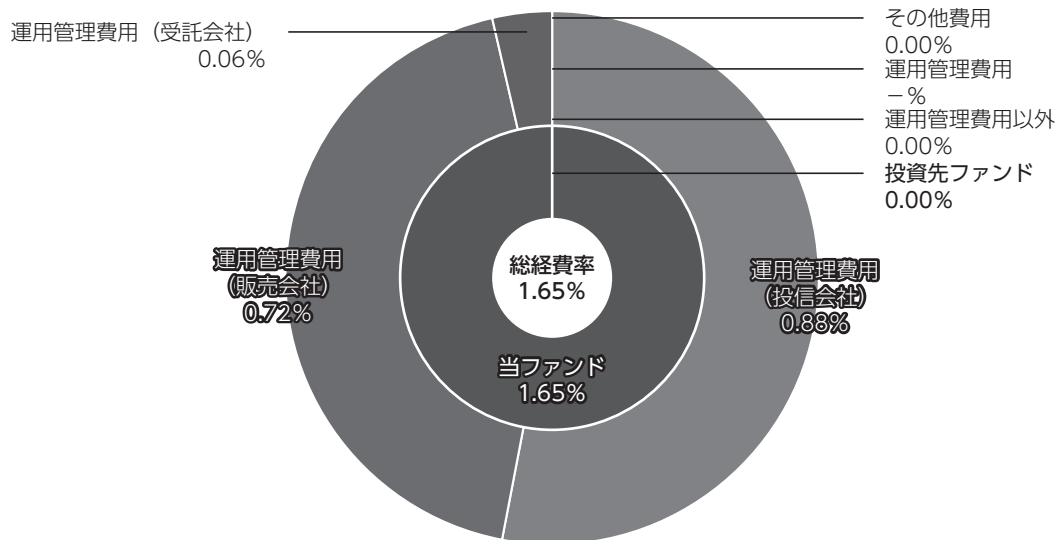
- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

- (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1.65%**です。



| | | |
|----------------------|-----|------|
| 総経費率 (①+②+③) | (%) | 1.65 |
| ①当ファンドの費用の比率 | (%) | 1.65 |
| 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) 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5月21日～2024年11月20日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 第230期～第235期 | | | |
|----|-----------------------------------|-------------|--------------|----------|---------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | ピムコ エマージング ボンド(エン・ヘッジド) インカム ファンド | 千口 13 | 千円 82,888 | 千口 77 | 千円 462,200 |

(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230期～第235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 5,386 | 千円 5,486 |

○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)

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229期末 | | 第235期末 | | |
|----|-----------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | ピムコ エマージング ボンド(エン・ヘッジド) インカム ファンド | 千口 774 | 千円 711 | 千口 711 | 千円 4,236,334 | % 98.5 |
| 合計 | | 774 | 711 | 711 | 4,236,334 | 98.5 |

(注) 比率はピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

| 銘柄 | 第229期末 | 第235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 5,484 | 千口 98 | 千円 100 |

○投資信託財産の構成

(2024年11月20日現在)

| 項目 | 第235期末 | |
|-------------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 4,236,334 | % 98.3 |
| 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 | 74,644 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 4,311,078 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項目 | 第230期末 | 第231期末 | 第232期末 | 第233期末 | 第234期末 | 第235期末 |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2024年6月20日現在 | 2024年7月22日現在 | 2024年8月20日現在 | 2024年9月20日現在 | 2024年10月21日現在 | 2024年11月20日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 4,604,531,732 | 4,526,908,113 | 4,480,969,473 | 4,521,929,989 | 4,439,294,846 | 4,311,078,414 |
| コール・ローン等 | 21,781,566 | 28,820,758 | 16,751,934 | 16,986,716 | 30,705,974 | 74,643,277 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 4,557,165,717 | 4,388,302,344 | 4,428,631,933 | 4,479,356,569 | 4,408,488,682 | 4,236,334,672 |
| マネー・マーケット・マザーファンド(評価額) | 5,584,412 | 5,584,961 | 5,585,509 | 5,586,606 | 100,009 | 100,029 |
| 未収入金 | 20,000,000 | 104,200,000 | 30,000,000 | 20,000,000 | — | — |
| 未収利息 | 37 | 50 | 97 | 98 | 181 | 436 |
| (B) 負債 | 20,958,793 | 90,441,896 | 22,045,463 | 13,970,689 | 17,242,455 | 10,667,072 |
| 未払収益分配金 | 9,897,563 | 9,582,427 | 4,729,791 | 4,707,905 | 4,672,075 | 4,611,260 |
| 未払解約金 | 4,609,420 | 74,251,681 | 11,480,292 | 2,988,462 | 6,295,294 | 147,112 |
| 未払信託報酬 | 6,433,806 | 6,589,349 | 5,819,096 | 6,256,813 | 6,257,576 | 5,892,214 |
| その他未払費用 | 18,004 | 18,439 | 16,284 | 17,509 | 17,510 | 16,486 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 4,583,572,939 | 4,436,466,217 | 4,458,924,010 | 4,507,959,300 | 4,422,052,391 | 4,300,411,342 |
| 元本 | 9,897,563,313 | 9,582,427,252 | 9,459,583,095 | 9,415,811,038 | 9,344,150,423 | 9,222,520,103 |
| 次期繰越損益金 | △5,313,990,374 | △5,145,961,035 | △5,000,659,085 | △4,907,851,738 | △4,922,098,032 | △4,922,108,761 |
| (D) 受益権総口数 | 9,897,563,313口 | 9,582,427,252口 | 9,459,583,095口 | 9,415,811,038口 | 9,344,150,423口 | 9,222,520,103口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 4,631円 | 4,630円 | 4,714円 | 4,788円 | 4,732円 | 4,663円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第230期 | 第231期 | 第232期 | 第233期 | 第234期 | 第235期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| | 2024年5月21日～ 2024年6月20日 | 2024年6月21日～ 2024年7月22日 | 2024年7月23日～ 2024年8月20日 | 2024年8月21日～ 2024年9月20日 | 2024年9月21日～ 2024年10月21日 | 2024年10月22日～ 2024年11月20日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 11,594,913 | 10,532,995 | 10,334,265 | 9,541,273 | 9,453,389 | 11,357,823 |
| 受取配当金 | 11,593,631 | 10,531,343 | 10,330,750 | 9,537,921 | 9,448,619 | 11,345,819 |
| 受取利息 | 1,282 | 1,652 | 3,515 | 3,352 | 4,770 | 12,004 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 12,983,856 | 4,500,693 | 79,535,475 | 71,040,560 | △ 50,020,344 | △ 64,716,353 |
| 売買益 | 132,443 | 5,139,991 | 79,989,090 | 71,184,767 | 274,508 | 727,886 |
| 売買損 | △ 13,116,299 | △ 639,298 | △ 453,615 | △ 144,207 | △ 50,294,852 | △ 65,444,239 |
| (C) 信託報酬等 | △ 6,451,810 | △ 6,607,788 | △ 5,835,380 | △ 6,274,322 | △ 6,275,086 | △ 5,908,700 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 7,840,753 | 8,425,900 | 84,034,360 | 74,307,511 | △ 46,842,041 | △ 59,267,230 |
| (E) 前期繰越損益金 | △2,317,819,942 | △2,254,114,416 | △2,220,857,168 | △2,127,408,318 | △2,036,505,987 | △2,053,289,454 |
| (F) 追加信託差損益金 | △2,978,432,116 | △2,890,690,092 | △2,859,106,486 | △2,850,043,026 | △2,834,077,929 | △2,804,940,817 |
| (配当等相当額) | (175,481,334) | (170,017,840) | (167,925,312) | (167,229,694) | (166,082,420) | (164,072,387) |
| (売買損益相当額) | (△3,153,913,450) | (△3,060,707,932) | (△3,027,031,798) | (△3,017,272,720) | (△3,000,160,349) | (△2,969,013,204) |
| (G) 計(D+E+F) | △5,304,092,811 | △5,136,378,608 | △4,995,929,294 | △4,903,143,833 | △4,917,425,957 | △4,917,497,501 |
| (H) 収益分配金 | △ 9,897,563 | △ 9,582,427 | △ 4,729,791 | △ 4,707,905 | △ 4,672,075 | △ 4,611,260 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △5,313,990,374 | △5,145,961,035 | △5,000,659,085 | △4,907,851,738 | △4,922,098,032 | △4,922,108,761 |
| 追加信託差損益金 | △2,978,432,116 | △2,890,690,092 | △2,859,106,486 | △2,850,043,026 | △2,834,077,929 | △2,804,940,817 |
| (配当等相当額) | (175,481,334) | (170,017,840) | (167,925,312) | (167,229,694) | (166,082,420) | (164,072,387) |
| (売買損益相当額) | (△3,153,913,450) | (△3,060,707,932) | (△3,027,031,798) | (△3,017,272,720) | (△3,000,160,349) | (△2,969,013,204) |
| 分配準備積立金 | 40,791,178 | 35,690,196 | 40,079,662 | 43,906,382 | 41,958,614 | 42,098,580 |
| 繰越損益金 | △2,376,349,436 | △2,290,961,139 | △2,181,632,261 | △2,101,715,094 | △2,129,978,717 | △2,159,266,524 |

(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 9,929,351,408円
 作成期中追加設定元本額 175,113,678円
 作成期中一部解約元本額 881,944,983円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.4663円です。

② 純資産総額が元本額を下回っており、その差総額は4,922,108,761円です。

③ 分配金の計算過程

| 項 目 | 2024年5月21日～ 2024年6月20日 | 2024年6月21日～ 2024年7月22日 | 2024年7月23日～ 2024年8月20日 | 2024年8月21日～ 2024年9月20日 | 2024年9月21日～ 2024年10月21日 | 2024年10月22日～ 2024年11月20日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 5,143,390円 | 5,903,886円 | 9,663,865円 | 8,799,337円 | 3,178,833円 | 5,449,135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 | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 |
| 収益調整金額 | 175,481,334円 | 170,017,840円 | 167,925,312円 | 167,229,694円 | 166,082,420円 | 164,072,387円 |
| 分配準備積立金額 | 45,545,351円 | 39,368,737円 | 35,145,588円 | 39,814,950円 | 43,451,856円 | 41,260,705円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 226,170,075円 | 215,290,463円 | 212,734,765円 | 215,843,981円 | 212,713,109円 | 210,782,227円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 228円 | 224円 | 224円 | 229円 | 227円 | 228円 |
| 1万口当たり分配金額 | 10円 | 10円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 |
| 収益分配金総額 | 9,897,563円 | 9,582,427円 | 4,729,791円 | 4,707,905円 | 4,672,075円 | 4,611,260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60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230期 | 第231期 | 第232期 | 第233期 | 第234期 | 第235期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 10円 | 10円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5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 エマーゼィング ボンド (エン・ヘッジド) インカム ファンド |
| 運用方針 | ベンチマークであるJPモルガンEMBIグローバル・ダイバーシファイド(円ヘッジベース)を上回る投資成果をめざします。 |
| 主要運用対象 | 新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する債券およびその派生商品等 |
| 主な組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・通常、ファンドの純資産総額の80%以上を新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する債券およびその派生商品に投資します。 ・投資する債券は原則として取得時においてCCC一格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。 ・投資する債券の平均格付けは、原則としてB一格相当以上に維持します。 ・投資する債券の平均デュレーションは、原則として3年以上8年以内で調整します。 ・米ドル建ておよび米ドル建て以外の資産に投資を行います。 ・資金管理目的で、米国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等にも投資を行います。 ・原則として、為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。 |
| 決算日 | 原則として毎年10月31日 |
| 分配方針 | 原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。 |

(※) ピムコ エマーゼィング ボンド (エン・ヘッジド) インカム ファンドに関して、「主要運用対象」への投資は、原則として「ピムコ エマーゼィング ボンド インカム ファンド (M)」の投資信託証券への投資を通じて行います。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Bermuda Trust II Annual Report October 31, 2023版から抜粋して作成しています。また、「ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド (M)」を「マスターファンド」と表示する場合があります。

(1) 運用計算書

ピムコ エマージング ボンド (エン・ヘッジド) インカム ファンド

(2022年11月1日～2023年10月31日)

| | ピムコ エマージング ボンド (エン・ヘッジド) 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)* | 199 |
| 雑収入 | 292 |
| 収入合計 | 491 |
| 費用： | |
| 支払利息 | 0 |
| 費用合計 | 0 |
| 投資純収入 | 491 |
| 実現純利益 (損失)： | |
| 投資有価証券 | 0 |
| マスターファンド | 954 |
| 市場取引、中央清算金融派生商品 | 0 |
| 店頭金融派生商品 | (6,348) |
| 外貨 | 363 |
| 実現純利益 (損失) | (5,031) |
| 未実現評価益 (評価損) の純変動： | |
| 投資有価証券 | 0 |
| マスターファンド | 7,671 |
| 市場取引、中央清算金融派生商品 | 0 |
| 店頭金融派生商品 | 888 |
| 外貨建資産および負債の換算に係る外貨 | 63 |
| 未実現評価益 (評価損) の純変動 | 8,622 |
| 純利益 (損失) | 3,591 |
| 運用による純資産の純増 (減) 額 | 4,082 |
| *外国税源泉徴収 | 0 |

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ エマージング ボンド (エン・ヘッジド) インカム ファンド

(2022年11月1日～2023年10月31日)

| | ピムコ エマージング ボンド (エン・ヘッジド) 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) | 491 |
| 実現純利益 (損失) | (5,031) |
| 未実現評価益 (評価損) の純変動 | 8,622 |
| 運用による純資産の純増 (減) 額 | 4,082 |
| 分配 : | |
| 分配金額合計 | (2,878) |
| 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 | (11,615) |
| 純資産の増 (減) 額合計 | (10,411) |
| 純資産 : | |
| 期首 | 75,959 |
| 期末 | 65,548 |

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

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

(A) ピムコ エマージング ボンド (エン・ヘッジド) インカム ファンド
(2023年10月31日現在)

| | 額面金額 (単位: 千) | 時価 (単位: 千) |
|---|-----------------|------------------|
| INVESTMENTS IN SECURITIES 4.7% | | |
| SHORT-TERM INSTRUMENTS 4.7% | | |
| TIME DEPOSITS 0.9% | | |
| Bank of Nova Scotia | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 22 | \$ 22 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 2 | 2 |
| Citibank N.A. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 93 | 93 |
| DBS Bank Ltd. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 80 | 80 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 170 | 170 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 9 | 9 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 216 | 216 |
| | | 592 |
| U.S. TREASURY BILLS 3.8% | | |
| 5.379% due 12/14/2023 (a) | 1,000 | 994 |
| 5.405% due 01/11/2024 (b) | 1,500 | 1,484 |
| | | 2,478 |
| Total Short-Term Instruments | | 3,070 |
| (Cost \$3,070) | | |
| Total Investments in Securities | | 3,070 |
| (Cost \$3,070) | | |
| | 口数 (単位: 千) | |
| INVESTMENTS IN AFFILIATES 97.5% | | |
| OTHER INVESTMENT COMPANIES 97.5% | | |
| PIMCO Emerging Bond Income Fund (M) | | |
| (Cost \$65,135) | 4,190 | 63,902 |
| Total Investments in Affiliates | | 63,902 |
| (Cost \$65,135) | | |
| Total Investments 102.2% | | \$ 66,972 |
| (Cost \$68,205) | | |
| Financial Derivative | | |
| Instruments (c) (2.3%) | | (1,491) |
| (Cost or Premiums, net \$0) | | |
| Other Assets and Liabilities, net 0.1% | | 67 |
| Net Assets 100.0% | | \$ 65,548 |

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

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

(a) Coupon represents a yield to maturity.

(b) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(c) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

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 | |
| B0A | 11/2023 | JPY | 10,179 | \$ 68 | \$ 1 | \$ 0 |
| BPS | 11/2023 | | 3,649,269 | 24,396 | 300 | 0 |
| BPS | 12/2023 | \$ | 22,141 | JPY 3,296,377 | 0 | (257) |
| CBK | 11/2023 | JPY | 40,738 | 272 | 3 | 0 |
| CBK | 11/2023 | \$ | 779 | JPY 116,669 | 0 | (9) |
| CBK | 12/2023 | | 12,076 | 1,809,833 | 0 | (61) |
| DUB | 11/2023 | | 14,199 | 2,101,022 | 0 | (325) |

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

| 取引相手 | 決済月 | 受渡し通貨 | | 受取通貨 | | 未実現評価(損)益 | | | |
|---|---------|-------|-----------|------|-----------|-----------|---------------|----|-------------------|
| | | | | | | 資産 | 負債 | | |
| GLM | 11/2023 | JPY | 30,531 | \$ | 206 | \$ | 4 | \$ | 0 |
| MBC | 11/2023 | | 3,333,480 | | 22,276 | | 265 | | 0 |
| MBC | 12/2023 | \$ | 22,141 | JPY | 3,296,608 | | 0 | | (255) |
| MYI | 11/2023 | JPY | 50,431 | \$ | 338 | | 5 | | 0 |
| NGF | 11/2023 | \$ | 16,000 | JPY | 2,367,077 | | 0 | | (370) |
| TDR | 11/2023 | JPY | 940,997 | \$ | 6,271 | | 58 | | 0 |
| TDR | 11/2023 | \$ | 40,437 | JPY | 6,003,507 | | 0 | | (796) |
| TDR | 12/2023 | | 6,271 | | 936,230 | | 0 | | (56) |
| UAG | 11/2023 | JPY | 716,033 | \$ | 4,786 | | 58 | | 0 |
| UAG | 12/2023 | \$ | 4,786 | JPY | 712,406 | | 0 | | (56) |
| Total Forward Foreign Currency Contracts | | | | | | | \$ 694 | | \$ (2,185) |

(B) ピムコ エマージング ボンド インカム ファンド (M)
(2023年10月31日現在)

| | 額面金額 (単位:千) | 時価 (単位:千) |
|---|----------------|--------------|
| INVESTMENTS IN SECURITIES 101.9% | | |
| ALBANIA 0.1% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Republic of Albania | | |
| 3.500% due 11/23/2031 | EUR 200 | \$ 173 |
| Total Albania | | 173 |
| (Cost \$223) | | |
| ANGOLA 1.0% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.0% | | |
| Angolan Government International Bond | | |
| 8.000% due 11/26/2029 | \$ 700 | 560 |
| 8.250% due 05/09/2028 | 600 | 510 |
| 8.750% due 04/14/2032 | 900 | 703 |
| Total Angola | | 1,773 |
| (Cost \$1,990) | | |
| ARGENTINA 1.4% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.4% | | |
| Argentina Government International Bond | | |
| 0.750% due 07/09/2030 | 400 | 112 |
| 1.000% due 07/09/2029 | 849 | 228 |
| 3.500% due 07/09/2041 | 2,400 | 631 |
| 3.625% due 07/09/2035 | 1,100 | 272 |
| 3.625% due 07/09/2046 | 1,725 | 430 |
| 4.250% due 01/09/2038 | 2,121 | 642 |
| Provincia de Buenos Aires | | |
| 6.375% due 09/01/2037 | 300 | 98 |
| Provincia de la Rioja | | |
| 6.500% due 02/24/2028 | 390 | 215 |
| Total Argentina | | 2,628 |
| (Cost \$4,743) | | |
| ARMENIA 0.5% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| Armenia Government International Bond | | |
| 3.600% due 02/02/2031 | 500 | 370 |
| 3.950% due 09/28/2029 | 600 | 483 |
| Total Armenia | | 853 |
| (Cost \$1,084) | | |
| AZERBAIJAN 1.9% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.8% | | |
| SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC | | |
| 7.230% due 03/17/2026 | 1,600 | 1,536 |
| Southern Gas Corridor CJSC | | |
| 6.875% due 03/24/2026 | 1,700 | 1,679 |
| | | 3,215 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Republic of Azerbaijan International Bond | | |
| 4.750% due 03/18/2024 | 266 | 263 |
| Total Azerbaijan | | 3,478 |
| (Cost \$3,627) | | |
| BAHAMAS 0.1% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Bahamas Government International Bond | | |
| 6.000% due 11/21/2028 | 200 | 166 |
| Total Bahamas | | 166 |
| (Cost \$200) | | |

| | 額面金額 (単位:千) | 時価 (単位:千) |
|---|----------------|--------------|
| BAHRAIN 0.6% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | |
| Bahrain Government International Bond | | |
| 4.250% due 01/25/2028 | \$ 1,000 | 900 |
| 5.625% due 09/30/2031 | 200 | 175 |
| Total Bahrain | | 1,075 |
| (Cost \$1,208) | | |
| BRAZIL 2.5% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.7% | | |
| Banco do Brasil S.A. | | |
| 3.250% due 09/30/2026 | 500 | 457 |
| 8.500% due 07/29/2026 | MXN 16,000 | 805 |
| | | 1,262 |
| SOVEREIGN ISSUES 1.8% | | |
| Brazil Government International Bond | | |
| 4.750% due 01/14/2050 | \$ 1,900 | 1,275 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais | | |
| 5.333% due 02/15/2028 | 2,100 | 2,042 |
| | | 3,317 |
| Total Brazil | | 4,579 |
| (Cost \$5,305) | | |
| CAMEROON 0.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | |
| Republic of Cameroon International Bond | | |
| 9.500% due 07/07/2032 | EUR 500 | 345 |
| 9.500% due 11/19/2025 | \$ 200 | 193 |
| Total Cameroon | | 538 |
| (Cost \$753) | | |
| CAYMAN ISLANDS 4.3% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 3.8% | | |
| Bioceanico Sovereign Certificate Ltd. | | |
| 0.000% due 06/05/2034 | 1,870 | 1,294 |
| Gaci First Investment Co. | | |
| 4.875% due 02/14/2035 | 1,700 | 1,504 |
| 5.000% due 10/13/2027 | 1,400 | 1,361 |
| 5.125% due 02/14/2053 | 800 | 619 |
| Interoceanica IV Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 11/30/2025 | 42 | 38 |
| Interoceanica V Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 05/15/2030 | 1,475 | 980 |
| 7.860% due 05/15/2030 | 161 | 160 |
| Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 06/02/2025 | 37 | 35 |
| Suci Second Investment Co. | | |
| 6.000% due 10/25/2028 | 900 | 907 |
| | | 6,898 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| KSA Sukuk Ltd. | | |
| 5.268% due 10/25/2028 | 1,000 | 991 |
| Total Cayman Islands | | 7,889 |
| (Cost \$8,408) | | |
| CHILE 2.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 2.2% | | |
| Banco del Estado de Chile | | |
| 2.704% due 01/09/2025 | 400 | 384 |

| | 額面金額 (単位:千) | 時価 (単位:千) |
|--|----------------|--------------|
| Corp. Nacional del Cobre de Chile | | |
| 4.875% due 11/04/2044 | \$ 2,000 | \$ 1,479 |
| 5.950% due 01/08/2034 | 300 | 279 |
| 6.300% due 09/08/2053 | 300 | 260 |
| Empresa de los Ferrocarriles del Estado | | |
| 3.068% due 08/18/2050 | 200 | 109 |
| 3.830% due 09/14/2061 | 300 | 177 |
| Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. | | |
| 3.650% due 05/07/2030 | 200 | 174 |
| 4.700% due 05/07/2050 | 300 | 217 |
| Empresa Nacional del Petroleo | | |
| 3.450% due 09/16/2031 | 800 | 623 |
| 6.150% due 05/10/2033 | 400 | 372 |
| | | 4,074 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| Chile Government International Bond | | |
| 3.100% due 05/07/2041 | 200 | 131 |
| 3.250% due 09/21/2071 | 200 | 107 |
| 3.500% due 01/25/2050 | 300 | 190 |
| 4.340% due 03/07/2042 | 500 | 389 |
| | | 817 |
| Total Chile | | 4,891 |
| (Cost \$6,330) | | |
| COLOMBIA 2.3% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.5% | | |
| Ecopetrol S.A. | | |
| 5.875% due 05/28/2045 | 1,000 | 653 |
| 7.375% due 09/18/2043 | 375 | 298 |
| | | 951 |
| SOVEREIGN ISSUES 1.8% | | |
| Colombia Government International Bond | | |
| 4.500% due 03/15/2029 | 500 | 437 |
| 5.200% due 05/15/2049 | 600 | 386 |
| 5.625% due 02/26/2044 | 2,600 | 1,828 |
| 7.500% due 02/02/2034 | 700 | 657 |
| | | 3,308 |
| Total Colombia | | 4,259 |
| (Cost \$5,784) | | |
| COSTA RICA 0.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Instituto Costarricense de Electricidad | | |
| 6.375% due 05/15/2043 | 500 | 390 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| Costa Rica Government International Bond | | |
| 5.625% due 04/30/2043 | 600 | 480 |
| 6.550% due 04/03/2034 | 200 | 191 |
| 7.000% due 04/04/2044 | 200 | 184 |
| | | 855 |
| Total Costa Rica | | 1,245 |
| (Cost \$1,320) | | |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.8% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 4.6% | | |
| Dominican Republic Central Bank Notes | | |
| 12.000% due 10/03/2025 | DOP 3,400 | 62 |
| 13.000% due 12/05/2025 | 53,500 | 1,001 |
| 13.000% due 01/30/2026 | 12,800 | 240 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Dominican Republic International Bond | | |
| 5.300% due 01/21/2041 | \$ 450 | \$ 329 |
| 5.500% due 02/22/2029 | 500 | 457 |
| 5.875% due 01/30/2060 | 350 | 250 |
| 5.950% due 01/25/2027 | 200 | 193 |
| 6.000% due 07/19/2028 | 650 | 618 |
| 6.000% due 02/22/2033 | 500 | 443 |
| 6.400% due 06/05/2049 | 900 | 710 |
| 6.850% due 01/27/2045 | 1,500 | 1,256 |
| 6.875% due 01/28/2026 | 1,500 | 1,500 |
| 9.750% due 08/05/2026 | DOP 9,400 | 165 |
| 11.250% due 09/15/2035 | 10,000 | 178 |
| 13.625% due 02/03/2033 | 34,000 | 681 |
| 13.625% due 02/10/2034 | 29,500 | 614 |
| Total Dominican Republic | | 8,697 |

(Cost \$9,358)

ECUADOR 1.8%

| SOVEREIGN ISSUES 1.8% | | |
|--|--------|-------|
| Ecuador Government International Bond | | |
| 0.000% due 07/31/2030 | \$ 473 | 142 |
| 2.500% due 07/31/2040 | 1,440 | 487 |
| 3.500% due 07/31/2035 | 3,474 | 1,331 |
| 6.000% due 07/31/2030 | 2,432 | 1,242 |

Ecuador Social Bond Sarl

| | | |
|-----------------------|-----|-----|
| 0.000% due 01/30/2035 | 207 | 157 |
|-----------------------|-----|-----|

Total Ecuador
(Cost \$3,580)

EGYPT 2.5%

| SOVEREIGN ISSUES 2.5% | | |
|--|----------|-------|
| Egypt Government International Bond | | |
| 4.750% due 04/11/2025 | EUR 200 | 169 |
| 6.375% due 04/11/2031 | 4,100 | 2,351 |
| 7.300% due 09/30/2033 | \$ 1,100 | 610 |
| 7.625% due 05/29/2032 | 300 | 172 |
| 7.903% due 02/21/2048 | 1,600 | 818 |
| 8.500% due 01/31/2047 | 300 | 157 |
| 8.875% due 05/29/2050 | 400 | 214 |

Total Egypt
(Cost \$7,003)

EL SALVADOR 0.7%

| SOVEREIGN ISSUES 0.7% | | |
|--|-------|-------|
| El Salvador Government International Bond | | |
| 7.625% due 09/21/2034 | 1,800 | 1,233 |

Total El Salvador
(Cost \$1,847)

GABON 0.1%

| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
|--|-----|-----|
| Gabon Government International Bond | | |
| 6.625% due 02/06/2031 | 200 | 142 |

Total Gabon
(Cost \$147)

GEORGIA 0.1%

| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
|--|-----|-----|
| Georgia Government International Bond | | |
| 2.750% due 04/22/2026 | 200 | 178 |

Total Georgia
(Cost \$183)

GHANA 1.4%

| SOVEREIGN ISSUES 1.4% | | | |
|---|--------|--------|--|
| Republic of Ghana International Bond (a) | | | |
| 0.000% due 04/07/2025 | \$ 300 | \$ 115 | |
| 6.375% due 02/11/2027 | 200 | 86 | |
| 7.625% due 05/16/2029 | 500 | 214 | |
| 7.750% due 04/07/2029 | 600 | 258 | |
| 8.125% due 03/26/2032 | 900 | 382 | |
| 8.750% due 03/11/2061 | 1,700 | 712 | |
| 8.875% due 05/07/2042 | 1,400 | 587 | |
| 8.950% due 03/26/2051 | 300 | 126 | |

Total Ghana
(Cost \$5,010)

GUATEMALA 1.4%

| SOVEREIGN ISSUES 1.4% | | | |
|----------------------------------|-------|-------|--|
| Guatemala Government Bond | | | |
| 4.375% due 06/05/2027 | 200 | 184 | |
| 4.500% due 05/03/2026 | 200 | 189 | |
| 4.875% due 02/13/2028 | 1,600 | 1,471 | |
| 4.900% due 06/01/2030 | 500 | 447 | |
| 6.600% due 06/13/2036 | 400 | 371 | |

Total Guatemala
(Cost \$2,954)

HONG KONG 0.9%

| SOVEREIGN ISSUES 0.9% | | | |
|------------------------------|-----|-----|--|
| Airport Authority | | | |
| 2.400% due 03/08/2028 (b) | 800 | 685 | |
| 4.875% due 01/12/2030 | 400 | 384 | |

| | | | |
|--|---------|-----|--|
| Hong Kong Government International Bond | | | |
| 3.750% due 06/07/2032 | EUR 500 | 523 | |

Total Hong Kong
(Cost \$1,731)

HUNGARY 2.5%

| SOVEREIGN ISSUES 2.5% | | | |
|--|--------|-----|--|
| Hungary Government International Bond | | | |
| 1.625% due 04/28/2032 | 100 | 79 | |
| 1.750% due 06/05/2035 | 1,000 | 722 | |
| 2.125% due 09/22/2031 | \$ 400 | 289 | |
| 3.125% due 09/21/2051 | 200 | 108 | |
| 5.250% due 06/16/2029 | 900 | 850 | |
| 6.250% due 09/22/2032 | 500 | 482 | |
| 6.750% due 09/25/2052 | 1,000 | 927 | |

Magyar Export-Import Bank Zrt

| | | | |
|-----------------------|-----|-----|--|
| 6.125% due 12/04/2027 | 300 | 294 | |
|-----------------------|-----|-----|--|

MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt

| | | | |
|-----------------------|-----|-----|--|
| 6.500% due 06/29/2028 | 900 | 887 | |
|-----------------------|-----|-----|--|

Total Hungary
(Cost \$5,213)

INDIA 1.8%

| CORPORATE BONDS & NOTES 0.7% | | | |
|--|-----|-----|--|
| Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | | |
| 3.249% due 02/13/2030 | 200 | 169 | |
| 3.950% due 02/13/2050 | 200 | 137 | |

| | | | |
|-----------------------|-------|-----|--|
| NTPC Ltd. | | | |
| 3.750% due 04/03/2024 | 1,000 | 990 | |

Total India
(Cost \$3,598)

SOVEREIGN ISSUES 1.1%

| | | | |
|------------------------------------|--------|--------|--------------|
| Export-Import Bank of India | | | |
| 3.250% due 01/15/2030 | \$ 200 | \$ 169 | |
| 3.375% due 08/05/2026 | 2,000 | 1,884 | |
| | | | 2,053 |

Total India
(Cost \$3,598)

INDONESIA 3.0%

CORPORATE BONDS & NOTES 2.8%

| | | | |
|---|-------|-------|--|
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | | | |
| 3.950% due 03/28/2024 (g) | 1,700 | 1,685 | |

Indonesia Asahan Aluminium PT

| | | | |
|---------------------------|-------|-----|--|
| 5.450% due 05/15/2030 (g) | 1,000 | 929 | |
|---------------------------|-------|-----|--|

Pelabuhan Indonesia Persero PT

| | | | |
|-----------------------|-------|-------|--|
| 4.875% due 10/01/2024 | 1,100 | 1,087 | |
|-----------------------|-------|-------|--|

Pertamina Persero PT

| | | | |
|---------------------------|-------|-----|--|
| 6.450% due 05/30/2044 (g) | 1,000 | 925 | |
|---------------------------|-------|-----|--|

Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara

| | | | |
|-----------------------|-----|-----|--|
| 4.000% due 06/30/2050 | 200 | 122 | |
| 4.375% due 02/05/2050 | 300 | 195 | |
| 5.250% due 05/15/2047 | 200 | 153 | |

Total Indonesia
(Cost \$5,998)

SOVEREIGN ISSUES 0.2%

| | | | |
|--|---------|-----|--|
| Indonesia Government International Bond | | | |
| 1.100% due 03/12/2033 | EUR 200 | 152 | |
| 5.650% due 01/11/2053 | \$ 200 | 184 | |

Total Indonesia
(Cost \$5,998)

IRELAND 0.5%

| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | | |
|--|-------|-------|--|
| Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC | | | |
| 6.927% due 02/19/2027 | 1,100 | 1,001 | |

Total Ireland
(Cost \$1,036)

ISRAEL 2.0%

| CORPORATE BONDS & NOTES 0.3% | | | |
|---|-----|-----|--|
| Israel Electric Corp. Ltd. | | | |
| 3.750% due 02/22/2032 | 600 | 460 | |

Total Israel
(Cost \$3,851)

SOVEREIGN ISSUES 1.7%

| | | | |
|-------------------------------|-----------|-----|--|
| Israel Government Bond | | | |
| 1.500% due 11/30/2023 | ILS 3,600 | 900 | |

Israel Government International Bond

| | | | |
|-----------------------|-----------|-------|--|
| 5.000% due 10/30/2026 | EUR 2,100 | 2,217 | |
|-----------------------|-----------|-------|--|

Total Israel
(Cost \$3,851)

IVORY COAST 0.9%

| SOVEREIGN ISSUES 0.9% | | | |
|--|---------|-------|--|
| Ivory Coast Government International Bond | | | |
| 5.250% due 03/22/2030 | 1,300 | 1,139 | |
| 5.750% due 12/31/2032 | \$ 397 | 355 | |
| 5.875% due 10/17/2031 | EUR 200 | 173 | |

Total Ivory Coast
(Cost \$3,851)

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|--------------|
| Total Ivory Coast (Cost \$2,089) | \$ | 1,667 |
| JAMAICA 0.3% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.1% | | |
| TransJamaican Highway Ltd. | | |
| 5.750% due 10/10/2036 | \$ 138 | 114 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.2% | | |
| Jamaica Government International Bond | | |
| 7.875% due 07/28/2045 | 400 | 434 |
| Total Jamaica (Cost \$597) | | 548 |
| JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.4% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.4% | | |
| Corsair International Ltd. | | |
| 8.802% due 01/28/2027 | EUR 500 | 521 |
| 9.152% due 01/28/2029 | 200 | 207 |
| Total Jersey, Channel Islands (Cost \$784) | | 728 |
| JORDAN 0.7% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.7% | | |
| Jordan Government International Bond | | |
| 5.850% due 07/07/2030 | \$ 200 | 170 |
| 7.375% due 10/10/2047 | 800 | 607 |
| 7.500% due 01/13/2029 | 500 | 467 |
| Total Jordan (Cost \$1,516) | | 1,244 |
| KAZAKHSTAN 1.4% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.4% | | |
| Development Bank of Kazakhstan JSC | | |
| 5.750% due 05/12/2025 | 900 | 895 |
| KazMunayGas National Co. JSC | | |
| 5.375% due 04/24/2030 | 1,600 | 1,435 |
| 5.750% due 04/19/2047 | 200 | 149 |
| 6.375% due 10/24/2048 | 200 | 157 |
| Total Kazakhstan (Cost \$2,817) | | 2,636 |
| KENYA 0.9% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.9% | | |
| Republic of Kenya Government International Bond | | |
| 7.000% due 05/22/2027 | 500 | 434 |
| 7.250% due 02/28/2028 | 200 | 163 |
| 8.000% due 05/22/2032 (g) | 1,300 | 1,021 |
| Total Kenya (Cost \$1,890) | | 1,618 |
| MALAYSIA 1.2% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.2% | | |
| Khazanah Capital Ltd. | | |
| 4.876% due 08/01/2033 | 400 | 370 |
| Khazanah Global Sukuk Bhd | | |
| 4.687% due 06/01/2028 | 500 | 481 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|--------------|
| Petronas Capital Ltd. | | |
| 3.404% due 04/28/2061 | \$ 500 | 295 |
| 4.500% due 03/18/2045 | 300 | 238 |
| 4.550% due 04/21/2050 | 200 | 156 |
| 4.800% due 04/21/2060 | 400 | 316 |
| Petronas Energy Canada Ltd. | | |
| 2.112% due 03/23/2028 | 500 | 433 |
| Total Malaysia (Cost \$3,036) | | 2,289 |
| MARSHALL ISLANDS 0.0% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.0% | | |
| Nakilat, Inc. | | |
| 6.267% due 12/31/2033 | 62 | 63 |
| Total Marshall Islands (Cost \$72) | | 63 |
| MEXICO 4.4% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.9% | | |
| Petroleos Mexicanos | | |
| 6.950% due 01/28/2060 | 2,300 | 1,304 |
| 7.690% due 01/23/2050 | 3,200 | 1,978 |
| 10.000% due 02/07/2033 | 200 | 177 |
| | | 3,459 |
| SOVEREIGN ISSUES 2.5% | | |
| Mexico Government International Bond | | |
| 2.750% due 11/27/2031 (c) | MXN 11,855 | 546 |
| 3.000% due 12/03/2026 (c) | 27,662 | 1,388 |
| 3.771% due 05/24/2061 | \$ 300 | 170 |
| 4.000% due 03/15/2115 | EUR 900 | 636 |
| 5.750% due 10/12/2110 | \$ 1,200 | 925 |
| 6.350% due 02/09/2035 | 1,000 | 959 |
| | | 4,624 |
| Total Mexico (Cost \$11,798) | | 8,083 |
| MONGOLIA 0.2% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.2% | | |
| Mongolia Government International Bond | | |
| 3.500% due 07/07/2027 | 500 | 420 |
| Total Mongolia (Cost \$496) | | 420 |
| MOROCCO 0.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.6% | | |
| OCP S.A. | | |
| 3.750% due 06/23/2031 | 700 | 553 |
| 5.125% due 06/23/2051 | 800 | 516 |
| | | 1,069 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Morocco Government International Bond | | |
| 4.000% due 12/15/2050 | 300 | 179 |
| Total Morocco (Cost \$1,783) | | 1,248 |
| NAMBIA 0.4% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.4% | | |
| Namibia Government International Bond | | |
| 5.250% due 10/29/2025 | 800 | 761 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Total Namibia (Cost \$798) | \$ | 761 |
| NETHERLANDS 0.1% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Republic of Angola Via Avenir II BV | | |
| 10.163% due 12/07/2023 | \$ 140 | 139 |
| Total Netherlands (Cost \$140) | | 139 |
| NIGERIA 2.8% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.4% | | |
| BOI Finance BV | | |
| 7.500% due 02/16/2027 | EUR 900 | 808 |
| SOVEREIGN ISSUES 2.4% | | |
| Nigeria Government International Bond | | |
| 6.125% due 09/28/2028 | \$ 600 | 492 |
| 6.500% due 11/28/2027 | 2,900 | 2,500 |
| 7.143% due 02/23/2030 | 300 | 242 |
| 7.375% due 09/28/2033 | 200 | 151 |
| 7.625% due 11/28/2047 | 300 | 203 |
| 7.875% due 02/16/2032 | 200 | 161 |
| 8.375% due 03/24/2029 | 500 | 440 |
| 8.747% due 01/21/2031 | 250 | 216 |
| | | 4,405 |
| Total Nigeria (Cost \$5,754) | | 5,213 |
| NORTH MACEDONIA 0.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | |
| North Macedonia Government International Bond | | |
| 6.960% due 03/13/2027 | EUR 500 | 536 |
| Total North Macedonia (Cost \$529) | | 536 |
| OMAN 1.5% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.5% | | |
| Oman Government International Bond | | |
| 6.000% due 08/01/2029 | \$ 1,000 | 971 |
| 6.250% due 01/25/2031 | 200 | 195 |
| 6.500% due 03/08/2047 | 1,000 | 876 |
| 6.750% due 01/17/2048 | 200 | 180 |
| 7.000% due 01/25/2051 | 500 | 461 |
| Total Oman (Cost \$2,775) | | 2,683 |
| PAKISTAN 0.9% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.9% | | |
| Pakistan Government International Bond | | |
| 6.000% due 04/08/2026 | 200 | 110 |
| 6.875% due 12/05/2027 | 1,100 | 587 |
| 7.375% due 04/08/2031 | 600 | 298 |
| 8.875% due 04/08/2051 | 1,200 | 587 |
| Total Pakistan (Cost \$2,767) | | 1,582 |
| PANAMA 2.3% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.6% | | |
| Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. | | |
| 5.125% due 08/11/2061 | 200 | 134 |
| Autoridad del Canal de Panama | | |
| 4.950% due 07/29/2035 | 300 | 264 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Banco Nacional de Panama | | |
| 2.500% due 08/11/2030 | \$ 1,100 | \$ 819 |
| | 1,217 | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.7% | | |
| Panama Government International Bond | | |
| 2.252% due 09/29/2032 | 1,000 | 685 |
| 4.300% due 04/29/2053 | 600 | 363 |
| 4.500% due 04/01/2056 | 1,000 | 610 |
| 4.500% due 01/19/2063 | 200 | 119 |
| 6.400% due 02/14/2035 | 800 | 736 |
| 6.700% due 01/26/2036 | 600 | 564 |
| | 3,077 | |
| Total Panama | | 4,294 |
| (Cost \$6,017) | | |
| PARAGUAY 0.4% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.4% | | |
| Paraguay Government International Bond | | |
| 4.700% due 03/21/2027 | 200 | 191 |
| 5.400% due 03/30/2050 | 300 | 225 |
| 5.600% due 03/13/2048 | 200 | 155 |
| 5.850% due 08/21/2033 | 200 | 185 |
| | 756 | |
| Total Paraguay | | 756 |
| (Cost \$952) | | |
| PERU 0.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.4% | | |
| Petroleos del Peru S.A. | | |
| 5.625% due 06/19/2047 | 1,300 | 717 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | |
| Peru Government International Bond | | |
| 3.230% due 07/28/2121 | 200 | 102 |
| 3.600% due 01/15/2072 | 800 | 457 |
| | 559 | |
| Total Peru | | 1,276 |
| (Cost \$2,280) | | |
| PHILIPPINES 1.6% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.6% | | |
| Philippines Government International Bond | | |
| 2.650% due 12/10/2045 | 200 | 117 |
| 2.950% due 05/05/2045 | 1,500 | 922 |
| 3.700% due 03/01/2041 | 2,000 | 1,442 |
| 5.000% due 07/17/2033 | 500 | 472 |
| | 2,953 | |
| Total Philippines | | 2,953 |
| (Cost \$4,476) | | |
| POLAND 2.0% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 2.0% | | |
| Bank Gospodarstwa Krajowego | | |
| 6.250% due 10/31/2028 | 400 | 404 |
| Poland Government International Bond | | |
| 4.875% due 10/04/2033 | 1,250 | 1,161 |
| 5.500% due 11/16/2027 | 1,200 | 1,208 |
| 5.500% due 04/04/2053 | 950 | 841 |
| | 3,614 | |
| Total Poland | | 3,614 |
| (Cost \$3,787) | | |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| QATAR 1.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.3% | | |
| Qatar Energy | | |
| 2.250% due 07/12/2031 | \$ 1,200 | \$ 940 |
| 3.125% due 07/12/2041 | 1,100 | 725 |
| 3.300% due 07/12/2051 | 1,300 | 796 |
| | 2,461 | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.4% | | |
| Qatar Government International Bond | | |
| 4.400% due 04/16/2050 | 200 | 155 |
| 5.103% due 04/23/2048 | 600 | 515 |
| | 670 | |
| Total Qatar | | 3,131 |
| (Cost \$4,297) | | |
| ROMANIA 1.9% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.9% | | |
| Romania Government International Bond | | |
| 1.750% due 07/13/2030 | EUR 300 | 242 |
| 2.875% due 04/13/2042 | 800 | 499 |
| 3.500% due 04/03/2034 | 100 | 83 |
| 3.750% due 02/07/2034 | 400 | 336 |
| 4.000% due 02/14/2051 | \$ 400 | 247 |
| 4.625% due 04/03/2049 | EUR 1,100 | 862 |
| 6.125% due 01/22/2044 | \$ 100 | 87 |
| 6.375% due 09/18/2033 | EUR 400 | 417 |
| 7.625% due 01/17/2053 | \$ 700 | 690 |
| | 3,463 | |
| Total Romania | | 3,463 |
| (Cost \$4,632) | | |
| RUSSIA 0.0% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.0% | | |
| Russia Government International Bond | | |
| 7.500% due 03/31/2030 | 99 | 65 |
| | 65 | |
| Total Russia | | 65 |
| (Cost \$17) | | |
| RWANDA 0.2% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.2% | | |
| Rwanda International Government Bond | | |
| 5.500% due 08/09/2031 | 400 | 305 |
| | 305 | |
| Total Rwanda | | 305 |
| (Cost \$400) | | |
| SAUDI ARABIA 3.7% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.6% | | |
| Saudi Arabian Oil Co. | | |
| 1.625% due 11/24/2025 | 400 | 367 |
| 2.250% due 11/24/2030 | 400 | 315 |
| 2.875% due 04/16/2024 | 200 | 197 |
| 3.500% due 11/24/2070 | 400 | 226 |
| | 1,105 | |
| SOVEREIGN ISSUES 3.1% | | |
| Saudi Government International Bond | | |
| 3.250% due 10/26/2026 | 4,000 | 3,750 |
| 3.250% due 10/22/2030 | 500 | 430 |
| 3.750% due 01/21/2055 | 200 | 127 |
| 4.500% due 10/26/2046 | 1,000 | 752 |
| 4.750% due 01/18/2028 | 700 | 679 |
| | 5,738 | |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|-----------------|
| Total Saudi Arabia | | \$ 6,843 |
| (Cost \$7,617) | | |
| SENEGAL 0.9% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.9% | | |
| Senegal Government International Bond | | |
| 4.750% due 03/13/2028 | EUR 1,400 | 1,282 |
| 6.250% due 05/23/2033 (g) | \$ 500 | 396 |
| | 1,678 | |
| Total Senegal | | 1,678 |
| (Cost \$2,237) | | |
| SERBIA 1.1% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.1% | | |
| Serbia Government International Bond | | |
| 1.900% due 06/26/2029 | EUR 600 | 492 |
| 2.050% due 09/23/2036 | 200 | 127 |
| 3.125% due 05/15/2027 | 500 | 480 |
| 6.500% due 09/26/2033 | \$ 900 | 851 |
| | 1,950 | |
| Total Serbia | | 1,950 |
| (Cost \$2,112) | | |
| SINGAPORE 0.2% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Singapore Airlines Ltd. | | |
| 3.375% due 01/19/2029 | 400 | 360 |
| | 360 | |
| Total Singapore | | 360 |
| (Cost \$398) | | |
| SLOVENIA 0.4% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.4% | | |
| Slovenia Government International Bond | | |
| 5.000% due 09/19/2033 | 700 | 667 |
| | 667 | |
| Total Slovenia | | 667 |
| (Cost \$695) | | |
| SOUTH AFRICA 5.9% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 3.0% | | |
| Development Bank of Southern Africa Ltd. | | |
| 8.600% due 10/21/2024 (H) | ZAR 34,900 | 1,843 |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | |
| 4.314% due 07/23/2027 | \$ 1,400 | 1,230 |
| 6.350% due 08/10/2028 | 1,600 | 1,452 |
| 8.450% due 08/10/2028 | 900 | 855 |
| | 5,380 | |
| SOVEREIGN ISSUES 2.9% | | |
| South Africa Government International Bond | | |
| 4.300% due 10/12/2028 | 200 | 173 |
| 4.850% due 09/30/2029 | 600 | 512 |
| 4.875% due 04/14/2026 | 1,400 | 1,337 |
| 5.750% due 09/30/2049 | 1,800 | 1,176 |
| 10.500% due 12/21/2026 | ZAR 39,400 | 2,166 |
| | 5,364 | |
| Total South Africa | | 10,744 |
| (Cost \$12,633) | | |
| SOUTH KOREA 0.1% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.1% | | |
| Kodit Global Co. Ltd. | | |
| 4.954% due 05/25/2026 | \$ 200 | 196 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Total South Korea (Cost \$200) | \$ | 196 |
| SRI LANKA 1.3% SOVEREIGN ISSUES 1.3% | | |
| Sri Lanka Government International Bond (a) | | |
| 5.750% due 04/18/2049 | \$ 500 | 263 |
| 5.875% due 07/25/2049 | 200 | 106 |
| 6.125% due 06/03/2025 | 600 | 313 |
| 6.200% due 05/11/2027 | 600 | 302 |
| 6.750% due 04/18/2028 | 1,000 | 503 |
| 6.850% due 11/03/2025 | 800 | 418 |
| 7.550% due 03/28/2030 | 1,100 | 554 |
| Total Sri Lanka (Cost \$4,187) | | 2,459 |
| SUPRANATIONAL 0.5% CORPORATE BONDS & NOTES 0.5% | | |
| Banque Ouest Africaine de Developpement | | |
| 5.000% due 07/27/2027 | 900 | 803 |
| Eastern & Southern African Trade & Development Bank | | |
| 4.125% due 06/30/2028 | 200 | 163 |
| Total Supranational (Cost \$1,093) | | 966 |
| TRINIDAD AND TOBAGO 0.2% SOVEREIGN ISSUES 0.2% | | |
| Trinidad & Tobago Government International Bond | | |
| 5.950% due 01/14/2031 | 300 | 290 |
| Total Trinidad and Tobago (Cost \$298) | | 290 |
| TUNISIA 0.6% SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | |
| Tunisian Republic | | |
| 3.280% due 08/09/2027 | ¥ 200,000 | 634 |
| 5.625% due 02/17/2024 | EUR 420 | 417 |
| Total Tunisia (Cost \$2,480) | | 1,051 |
| TURKEY 3.0% SOVEREIGN ISSUES 3.0% | | |
| Turkey Government International Bond | | |
| 4.875% due 04/16/2043 | \$ 3,800 | 2,325 |
| 5.250% due 03/13/2030 | 1,400 | 1,160 |
| 5.750% due 05/11/2047 | 1,900 | 1,245 |
| 5.875% due 06/26/2031 | 300 | 250 |
| 9.125% due 07/13/2030 | 500 | 501 |
| Total Turkey (Cost \$7,346) | | 5,481 |
| UKRAINE 1.1% SOVEREIGN ISSUES 1.1% | | |
| Ukraine Government International Bond | | |
| 6.876% due 05/21/2031 | 400 | 100 |
| 7.253% due 03/15/2035 | 400 | 102 |
| 7.375% due 09/25/2034 | 1,000 | 255 |
| 7.750% due 09/01/2025 | 300 | 93 |
| 7.750% due 09/01/2026 | 2,900 | 844 |
| 7.750% due 09/01/2029 | 600 | 169 |
| 7.750% due 08/01/2041 | 200 | 84 |
| 8.994% due 02/01/2026 | 500 | 154 |
| 9.750% due 11/01/2030 | 900 | 265 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|--------------|
| Total Ukraine (Cost \$5,680) | \$ | 2,066 |
| UNITED ARAB EMIRATES 2.6% CORPORATE BONDS & NOTES 2.2% | | |
| Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC | | |
| 3.650% due 11/02/2029 | \$ 400 | 359 |
| 4.600% due 11/02/2047 | 800 | 656 |
| Abu Dhabi National Energy Co. PJSC | | |
| 4.375% due 01/24/2029 | 400 | 376 |
| 4.696% due 04/24/2033 | 400 | 369 |
| Abu Dhabi Ports Co. PJSC | | |
| 2.500% due 05/06/2031 | 800 | 639 |
| DP World Ltd. | | |
| 5.625% due 09/25/2048 | 400 | 330 |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | |
| 4.875% due 07/25/2033 | 800 | 732 |
| MDGH GMTN RSC Ltd. | | |
| 5.084% due 05/22/2053 | 200 | 167 |
| 5.875% due 05/01/2034 (d) | 300 | 297 |
| | | 3,925 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.4% | | |
| Abu Dhabi Government International Bond | | |
| 3.000% due 09/15/2051 | 200 | 119 |
| 3.875% due 04/16/2050 | 200 | 142 |
| Finance Department Government of Sharjah | | |
| 3.625% due 03/10/2033 | 200 | 155 |
| 4.000% due 07/28/2050 | 200 | 114 |
| 4.375% due 03/10/2051 | 400 | 243 |
| | | 773 |
| Total United Arab Emirates (Cost \$5,442) | | 4,698 |
| UNITED KINGDOM 1.0% CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC | | |
| 8.250% due 07/09/2026 | 600 | 318 |
| MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.7% | | |
| Canada Square Funding 6 PLC | | |
| 6.070% due 01/17/2059 | GBP 165 | 199 |
| Rochester Financing No.3 PLC | | |
| 5.902% due 12/18/2044 | 186 | 223 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | |
| 6.104% due 03/12/2052 | 60 | 73 |
| Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC | | |
| 7.011% due 02/20/2054 | 532 | 646 |
| Tower Bridge Funding PLC | | |
| 5.940% due 12/20/2063 | 153 | 185 |
| | | 1,326 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Ukreximbank Via Biz Finance PLC | | |
| 9.750% due 01/22/2025 | \$ 131 | 122 |
| Total United Kingdom (Cost \$1,999) | | 1,766 |
| UNITED STATES 5.1% CORPORATE BONDS & NOTES 0.7% | | |
| DAE Funding LLC | | |
| 2.625% due 03/20/2025 | 600 | 565 |
| 3.375% due 03/20/2028 | 400 | 351 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Rutas 2 & 7 Finance Ltd. | \$ 520 | \$ 331 |
| 0.000% due 09/30/2036 | | 1,247 |
| U.S. TREASURY OBLIGATIONS 4.4% | | |
| U.S. Treasury Bonds | | |
| 1.750% due 08/15/2041 | 1,100 | 654 |
| 2.000% due 11/15/2041 | 1,300 | 805 |
| 3.250% due 05/15/2042 | 400 | 305 |
| 3.375% due 08/15/2042 | 2,200 | 1,703 |
| U.S. Treasury Notes (g) | | |
| 2.375% due 05/15/2029 | 2,400 | 2,109 |
| 3.125% due 08/31/2029 | 2,700 | 2,456 |
| | | 8,032 |
| Total United States (Cost \$11,195) | | 9,279 |
| URUGUAY 0.5% SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| Uruguay Government International Bond | | |
| 5.100% due 06/18/2050 | 1,000 | 869 |
| Total Uruguay (Cost \$1,025) | | 869 |
| UZBEKISTAN 0.1% SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Republic of Uzbekistan International Bond | | |
| 3.700% due 11/25/2030 | 200 | 153 |
| Total Uzbekistan (Cost \$176) | | 153 |
| VENEZUELA 2.6% CORPORATE BONDS & NOTES 1.0% | | |
| Petroleos de Venezuela S.A. (a) | | |
| 5.375% due 04/12/2027 | 3,130 | 432 |
| 5.500% due 04/12/2037 | 11,131 | 1,465 |
| | | 1,897 |
| SOVEREIGN ISSUES 1.6% | | |
| Venezuela Government International Bond (a) | | |
| 6.000% due 12/09/2049 | 1,310 | 203 |
| 7.000% due 03/31/2038 | 9,550 | 1,643 |
| 7.650% due 04/21/2025 | 595 | 106 |
| 8.250% due 10/13/2024 | 1,730 | 304 |
| 9.250% due 09/15/2027 | 2,880 | 548 |
| 11.950% due 08/05/2031 | 160 | 31 |
| | | 2,835 |
| Total Venezuela (Cost \$18,248) | | 4,732 |
| ZAMBIA 0.3% SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | |
| Zambia Government International Bond | | |
| 5.375% due 12/20/2049 (a) | 1,100 | 605 |
| Total Zambia (Cost \$1,249) | | 605 |
| SHORT-TERM INSTRUMENTS 0.8% TIME DEPOSITS 0.7% | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | | |
| 3.000% due 11/01/2023 | AUD 34 | 22 |
| 3.850% due 11/01/2023 | NZD 92 | 53 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|-------------------|--------------------------|
| Bank of Nova Scotia | | |
| 4.080% due 11/01/2023 | CAD 50 \$ | 36 |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 33 | 33 |
| BNP Paribas Bank | | |
| 2.820% due 11/01/2023 | SGD 59 | 43 |
| 3.000% due 11/01/2023 | AUD 23 | 14 |
| 3.330% due 11/01/2023 | NOK 611 | 55 |
| 3.850% due 11/01/2023 | NZD 33 | 20 |
| 6.430% due 11/01/2023 | ZAR 97 | 5 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | | |
| (0.370%) due 11/01/2023 | ¥ 25 | 0 |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 2 | 2 |
| Citibank N.A. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 140 | 140 |
| DBS Bank Ltd. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | 119 | 119 |
| DnB Bank ASA | | |
| 2.990% due 11/01/2023 | SEK 415 | 37 |
| HSBC Bank PLC | | |
| 3.100% due 11/01/2023 | EUR 5 | 5 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 254 | 254 |
| MUFG Bank Ltd. | | |
| (0.370%) due 11/01/2023 | ¥ 262 | 2 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| (0.370%) due 11/01/2023 | 1,616 | 11 |
| 3.100% due 11/01/2023 | EUR 49 | 52 |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 14 | 14 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | |
| (0.370%) due 11/01/2023 | ¥ 6,398 | 42 |
| 3.100% due 11/01/2023 | EUR 18 | 20 |
| 4.420% due 11/01/2023 | GBP 1 | 2 |
| 4.830% due 11/01/2023 | \$ 325 | 325 |
| The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd. | | |
| 2.820% due 11/01/2023 | SGD 37 | 27 |
| | | <u>1,333</u> |
| U.S. TREASURY BILLS 0.2% | | |
| 5.365% due 12/12/2023 (e)(j) | \$ 263 | 261 |
| Total Short-Term Instruments | | <u>1,594</u> |
| (Cost \$1,594) | | |
| Total Investments in Securities 101.9% | \$ 186,139 | |
| (Cost \$246,887) | | |
| Financial Derivative | | |
| Instruments (h)(i) 0.2% | | 325 |
| (Cost or Premiums, net \$418) | | |
| Other Assets and Liabilities, net (2.1%) | | (3,712) |
| Net Assets 100.0% | | <u>\$ 182,752</u> |

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Security is in default.
- (b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (c) Principal amount of security is adjusted for inflation.
- (d) When-Issued security.
- (e) Coupon represents a yield to maturity.

(f) 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 |
|--|--------|------------|------------|----------|----------|--------|
| Development Bank of Southern Africa Ltd. | 8.600% | 10/21/2024 | 10/07/2021 | \$ 2,344 | \$ 1,843 | 1.01% |

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

| 取引相手 | 借入利率 ⁽¹⁾ | 借入日 | 満期日 | 借入元本 ⁽¹⁾ | リバースレポの支払 |
|--|---------------------|------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| BPS | 5.870% | 10/13/2023 | 01/12/2024 | \$ (3,255) | \$ (3,257) |
| BRC | 4.750% | 09/19/2023 | TBD ⁽²⁾ | (256) | (257) |
| BRC | 5.000% | 10/24/2023 | TBD ⁽²⁾ | (634) | (635) |
| DEU | 5.420% | 10/26/2023 | 11/09/2023 | (2,464) | (2,466) |
| Total Reverse Repurchase Agreements | | | | | \$ (6,815) |

SALE-BUYBACK TRANSACTIONS:

| 取引相手 | 借入利率 ⁽¹⁾ | 借入日 | 満期日 | 借入元本 ⁽¹⁾ | 売付買戻取引の支払 ⁽²⁾ |
|--|---------------------|------------|------------|---------------------|--------------------------|
| MSC | 5.483% | 10/30/2023 | 11/02/2023 | \$ (2,137) | \$ (2,137) |
| Total Sale-Buyback Transactions | | | | | \$ (2,137) |

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

| | オーバーナイト/ 継続 | | 残存期間 | | | 合計 |
|--|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----|
| | 30日迄 | 31-90日 | 90日以上 | | | |
| Reverse Repurchase Agreements | | | | | | |
| Non - U.S. Corporate Debt | \$ 0 | \$ 0 | \$ (3,257) | \$ 0 | \$ (3,257) | |
| Non - U.S. Government Debt | 0 | 0 | 0 | (1,092) | (1,092) | |
| U.S. Government Debt | 0 | (2,466) | 0 | 0 | (2,466) | |
| Total Reverse Repurchase Agreements | \$ 0 | \$ (2,466) | \$ (3,257) | \$ (1,092) | \$ (6,815) | |
| Sale-Buyback Transactions | | | | | | |
| U.S. Government Debt | \$ 0 | \$ (2,137) | \$ 0 | \$ 0 | \$ (2,137) | |
| Total Sale-Buyback Transactions | \$ 0 | \$ (2,137) | \$ 0 | \$ 0 | \$ (2,137) | |
| Total Borrowings | \$ 0 | \$ (4,603) | \$ (3,257) | \$ (1,092) | \$ (8,952) | |
| Payable for Reverse Repurchase Agreements and Sale-Buyback Transactions | | | | | \$ (8,952) | |

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of October 31, 2023:

(g) Securities with an aggregate market value of \$9,128 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of October 31, 2023.

| 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 | 担保の差入 (受取) | ネットエク ス ポージャー ⁽⁴⁾ |
|--|-------------|-------------------|-------------------|-------------|-----------------|---------------|------------------------------------|
| Global Master Repurchase Agreement | | | | | | | |
| BPS | \$ 0 | \$ (3,257) | \$ 0 | \$ 0 | \$ (3,257) | \$ 3,539 | \$ 282 |
| BRC | 0 | (1,092) | 0 | 0 | (1,092) | 1,024 | (68) |
| DEU | 0 | (2,466) | 0 | 0 | (2,466) | 2,456 | (10) |
| Master Securities Forward Transactions Agreement | | | | | | | |
| MSC | 0 | 0 | (2,137) | 0 | (2,137) | 2,109 | (28) |
| Total Borrowings and Other Financing Transactions | \$ 0 | \$ (6,815) | \$ (2,137) | \$ 0 | | | |

⁽¹⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2023 was \$11,893 at a weighted average interest rate of 3.604%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

⁽²⁾ Open maturity reverse repurchase agreement.

⁽³⁾ Payable for sale buyback transactions includes \$0 of deferred price drop.

⁽⁴⁾ 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 December Futures | Short | 12/2023 | 69 | \$ 83 | \$ 0 | \$ (15) |
| Euro-Bund 10-Year Bond December Futures | Short | 12/2023 | 21 | 64 | 0 | (8) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond December Futures | Short | 12/2023 | 4 | 54 | 0 | (3) |
| Euro-Schatz 2-Year Note December Futures | Short | 12/2023 | 37 | 8 | 0 | (2) |
| U.S. Treasury 2-Year Note December Futures | Long | 12/2023 | 39 | (29) | 0 | (4) |
| U.S. Treasury 5-Year Note December Futures | Short | 12/2023 | 105 | 128 | 11 | 0 |
| U.S. Treasury 10-Year Note December Futures | Long | 12/2023 | 285 | (1,075) | 0 | (49) |
| U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures | Long | 12/2023 | 5 | (74) | 0 | (4) |
| Total Futures Contracts | | | | \$ (841) | \$ 11 | \$ (85) |

SWAP AGREEMENTS:

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

| インデックス/トランシェ | 固定 (支払) 金利 | 満期日 | 想定元本 ⁽²⁾ | 市場価格 ⁽³⁾ | 未実現評価 (損) 益 | 変動証拠金 | |
|-----------------|---------------|------------|---------------------|---------------------|----------------|-------|--------|
| | | | | | | 資産 | 負債 |
| CDX-EM-38 Index | (1.000%) | 12/20/2027 | \$ 2,000 | \$ 74 | \$ (34) | \$ 0 | \$ (4) |

INTEREST RATE SWAPS

| 変動金利の 支払/受取 | 変動金利 インデックス | 固定金利 | 満期日 | 想定元本 | 市場価格 | 未実現評価 (損) 益 | 変動証拠金 | |
|--------------------|----------------------------------|---------|------------|------------|-------|----------------|-------|--------|
| | | | | | | | 資産 | 負債 |
| Receive | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 5.950% | 11/30/2024 | ZAR 38,000 | \$ 59 | \$ 59 | \$ 0 | \$(52) |
| Pay | 6-Month CZK-PRIBOR | 4.611% | 06/06/2028 | CZK 47,500 | (9) | (29) | 4 | 0 |
| Pay | 6-Month EURIBOR | 3.370% | 10/09/2028 | EUR 400 | 2 | 2 | 1 | 0 |
| Pay | 6-Month EURIBOR | 3.450% | 10/20/2028 | 500 | 4 | 4 | 1 | 0 |
| Pay ⁽⁴⁾ | 6-Month EURIBOR | 3.250% | 03/20/2029 | 4,000 | 15 | 29 | 9 | 0 |
| Pay | 6-Month EURIBOR | 3.300% | 10/03/2033 | 200 | (1) | (1) | 0 | 0 |
| Receive | 6-Month PLN-WIBOR | 5.455% | 01/10/2028 | PLN 1,500 | (18) | (18) | 0 | 0 |
| Receive | 6-Month PLN-WIBOR | 5.490% | 01/10/2028 | 1,500 | (18) | (18) | 0 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 12.225% | 12/01/2023 | BRL 21,800 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 12.270% | 12/01/2023 | 15,900 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Pay | BRL-CDI-Compounded | 11.828% | 01/02/2025 | 15,300 | (18) | (18) | 2 | 0 |
| Pay | BRL-CDI-Compounded | 12.220% | 01/02/2025 | 15,000 | (9) | (17) | 2 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 13.190% | 01/02/2025 | 2,600 | (9) | (9) | 0 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 13.215% | 01/02/2025 | 2,700 | (10) | (10) | 0 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 13.400% | 01/02/2025 | 6,200 | (26) | (26) | 0 | (1) |
| Pay | BRL-CDI-Compounded | 11.415% | 01/04/2027 | 7,400 | (11) | (11) | 0 | 0 |
| Pay | BRL-CDI-Compounded | 11.453% | 01/04/2027 | 4,100 | (5) | (5) | 0 | 0 |
| Pay | BRL-CDI-Compounded | 11.620% | 01/04/2027 | 1,700 | (1) | (1) | 0 | 0 |
| Receive | BRL-CDI-Compounded | 13.015% | 01/04/2027 | 7,800 | (54) | (54) | 0 | 0 |
| Receive | IBMXID | 8.900% | 05/21/2027 | MXN 10,800 | 20 | 20 | 0 | (1) |
| Receive | IBMXID | 8.780% | 05/19/2028 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Pay | IBMXID | 9.250% | 08/31/2028 | 27,200 | (31) | (31) | 34 | 0 |
| Pay | IBMXID | 9.210% | 09/05/2028 | 9,500 | (12) | (12) | 1 | 0 |
| Receive | IBMXID | 9.769% | 09/27/2028 | 13,800 | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Receive | IBMXID | 9.778% | 09/27/2028 | 13,800 | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 1.750% | 06/15/2024 | \$ 6,400 | (231) | (16) | 15 | 0 |
| Receive | Secured Overnight Financing Rate | 1.410% | 02/06/2025 | 4,500 | 333 | 88 | 0 | (9) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 3.730% | 08/03/2033 | 200 | (14) | (14) | 0 | 0 |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 3.735% | 08/07/2033 | 200 | (13) | (13) | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.165% | 09/27/2033 | 400 | (12) | (12) | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.155% | 10/02/2033 | 400 | (13) | (13) | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.170% | 10/03/2033 | 500 | (15) | (15) | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.030% | 10/04/2033 | 100 | (4) | (4) | 0 | 0 |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.175% | 10/10/2033 | 300 | (9) | (9) | 0 | (1) |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.150% | 10/12/2033 | 300 | (10) | (10) | 0 | (1) |

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

| 変動金利の 支払/受取 | 変動金利 インデックス | 固定金利 | 満期日 | 想定元本 | 市場価格 | 未実現評価 (損) 益 | 変動証拠金 | | |
|------------------------------|--|--------|------------|---------|--------|----------------|-----------------|--------------|----------------|
| | | | | | | | 資産 | 負債 | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.220% | 10/20/2033 | \$ 200 | \$ (5) | \$ (5) | \$ 0 | \$ 0 | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.230% | 10/23/2033 | 100 | (3) | (3) | 0 | 0 | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.255% | 10/23/2033 | 100 | (2) | (2) | 0 | 0 | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 4.450% | 10/31/2033 | 100 | (1) | (1) | 0 | 0 | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 3.830% | 10/12/2053 | 100 | (9) | (9) | 0 | (1) | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 3.880% | 10/16/2053 | 100 | (8) | (8) | 0 | (1) | |
| Pay | Secured Overnight Financing Rate | 3.870% | 10/17/2053 | 100 | (8) | (8) | 0 | (1) | |
| Pay | Sterling Overnight Interbank Average Rate | 4.320% | 10/20/2033 | GBP 100 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| | | | | | | \$ (156) | \$ (200) | \$ 69 | \$ (74) |
| Total Swap Agreements | | | | | | \$ (82) | \$ (234) | \$ 69 | \$ (78) |

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of October 31, 2023:

Cash of \$1,719 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of October 31, 2023. 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 | \$ 11 | \$ 69 | \$ 80 | \$ 0 | \$ (85) | \$ (78) | \$ (163) |

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

⁽²⁾ 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.

⁽³⁾ 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.

⁽⁴⁾ 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 |
| BDA | 11/2023 | CAD 54 | \$ 40 | \$ 1 | \$ 0 |
| BDA | 11/2023 | PEN 732 | 190 | 0 | (1) |
| BDA | 11/2023 | \$ 148 | EUR 140 | 0 | 0 |
| BDA | 11/2023 | 533 | ILS 2,100 | 0 | (13) |
| BDA | 11/2023 | 197 | PEN 732 | 0 | (6) |
| BDA | 11/2023 | ZAR 17,123 | \$ 895 | 0 | (17) |
| BDA | 12/2023 | MXN 5,065 | 292 | 13 | 0 |
| BDA | 12/2023 | \$ 272 | INR 22,653 | 0 | (1) |
| BDA | 12/2023 | 55 | KRW 73,809 | 0 | 0 |
| BDA | 12/2023 | 190 | PEN 732 | 1 | 0 |
| BDA | 12/2023 | 36 | PHP 2,054 | 0 | 0 |
| BDA | 01/2024 | DOP 4,925 | \$ 86 | 0 | (1) |
| BDA | 01/2024 | \$ 1,172 | HUF 433,551 | 10 | 0 |
| BDA | 01/2024 | 109 | PLN 466 | 1 | 0 |
| BDA | 02/2024 | DOP 24,110 | \$ 417 | 0 | (6) |
| BDA | 03/2024 | EGP 2,844 | 81 | 7 | 0 |
| BDA | 03/2024 | IDR 579,431 | 37 | 1 | 0 |
| BDA | 04/2024 | \$ 55 | EGP 2,170 | 0 | (1) |
| BPS | 11/2023 | BRL 1,112 | \$ 215 | 0 | (5) |
| BPS | 11/2023 | CAD 282 | 208 | 5 | 0 |
| BPS | 11/2023 | 76 | 55 | 0 | 0 |
| BPS | 11/2023 | CHF 100 | 110 | 0 | 0 |
| BPS | 11/2023 | CZK 13,316 | 568 | 0 | (4) |
| BPS | 11/2023 | EUR 15,771 | 16,732 | 62 | 0 |

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

| 取引相手 | 決済月 | 受渡し通貨 | | 受取通貨 | | 未実現評価 (損) 益 | |
|------|---------|-------|---------|------|---------|-------------|-----|
| | | | | | | 資産 | 負債 |
| BPS | 11/2023 | GBP | 264 | \$ | 322 | \$ | 0 |
| BPS | 11/2023 | ILS | 1,296 | | 374 | | 54 |
| BPS | 11/2023 | NOK | 400 | | 37 | | 1 |
| BPS | 11/2023 | NZD | 477 | | 283 | | 6 |
| BPS | 11/2023 | \$ | 220 | BRL | 1,112 | | 1 |
| BPS | 11/2023 | | 199 | CHF | 178 | | 0 |
| BPS | 11/2023 | | 172 | COP | 731,428 | | 4 |
| BPS | 11/2023 | | 368 | EUR | 351 | | 3 |
| BPS | 11/2023 | | 203 | JPY | 30,400 | | 0 |
| BPS | 11/2023 | | 183 | TRY | 5,181 | | 0 |
| BPS | 11/2023 | | 40 | | 1,121 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | CLP | 280,747 | \$ | 298 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | COP | 156,173 | | 37 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | INR | 11,977 | | 144 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | NGN | 3,240 | | 4 | | 1 |
| BPS | 12/2023 | PEN | 252 | | 65 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | SGD | 72 | | 53 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | THB | 2,452 | | 68 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | \$ | 37 | COP | 160,323 | | 1 |
| BPS | 12/2023 | | 357 | INR | 29,838 | | 1 |
| BPS | 12/2023 | | 55 | PHP | 3,118 | | 0 |
| BPS | 12/2023 | | 36 | THB | 1,302 | | 0 |
| BPS | 01/2024 | PLN | 829 | \$ | 188 | | 0 |
| BPS | 01/2024 | \$ | 38 | PLN | 164 | | 1 |
| BPS | 02/2024 | EGP | 1,260 | \$ | 36 | | 3 |
| BPS | 02/2024 | \$ | 76 | EGP | 2,736 | | 0 |
| BPS | 03/2024 | IDR | 602,201 | \$ | 39 | | 1 |
| BPS | 03/2024 | \$ | 36 | IDR | 572,671 | | 0 |
| BRC | 11/2023 | EUR | 117 | \$ | 124 | | 0 |
| BRC | 11/2023 | TRY | 2,979 | | 105 | | 0 |
| BRC | 11/2023 | \$ | 16,057 | EUR | 15,240 | | 52 |
| BRC | 11/2023 | | 2,139 | GBP | 1,764 | | 1 |
| BRC | 12/2023 | CLP | 34,022 | \$ | 37 | | 0 |
| BRC | 12/2023 | EUR | 15,240 | | 16,078 | | 0 |
| BRC | 12/2023 | GBP | 1,764 | | 2,140 | | 0 |
| BRC | 01/2024 | PLN | 722 | | 165 | | 0 |
| BRC | 03/2024 | \$ | 105 | TRY | 3,298 | | 0 |
| CBK | 11/2023 | BRL | 2,071 | \$ | 414 | | 3 |
| CBK | 11/2023 | CAD | 108 | | 79 | | 1 |
| CBK | 11/2023 | CHF | 105 | | 117 | | 2 |
| CBK | 11/2023 | EUR | 197 | | 209 | | 1 |
| CBK | 11/2023 | ILS | 3,544 | | 1,059 | | 182 |
| CBK | 11/2023 | MXN | 12,901 | | 713 | | 0 |
| CBK | 11/2023 | SEK | 635 | | 58 | | 1 |
| CBK | 11/2023 | \$ | 409 | BRL | 2,071 | | 1 |
| CBK | 11/2023 | | 137 | EGP | 4,431 | | 5 |
| CBK | 11/2023 | | 246 | EUR | 234 | | 1 |
| CBK | 11/2023 | | 136 | NOK | 1,450 | | 0 |
| CBK | 11/2023 | | 149 | ZAR | 2,862 | | 3 |
| CBK | 12/2023 | CLP | 33,558 | \$ | 37 | | 0 |
| CBK | 12/2023 | ILS | 162 | | 43 | | 3 |
| CBK | 12/2023 | JPY | 38,240 | | 255 | | 1 |
| CBK | 12/2023 | MXN | 34,838 | | 1,931 | | 15 |
| CBK | 12/2023 | PEN | 145 | | 39 | | 1 |
| CBK | 12/2023 | \$ | 282 | BRL | 1,425 | | 0 |
| CBK | 12/2023 | | 561 | MXN | 10,382 | | 11 |
| CBK | 12/2023 | | 43 | | 780 | | 0 |
| CBK | 01/2024 | MXN | 13,113 | \$ | 714 | | 0 |
| CBK | 01/2024 | PLN | 535 | | 126 | | 0 |
| CBK | 01/2024 | \$ | 97 | PLN | 413 | | 1 |
| CBK | 01/2024 | ZAR | 3,199 | \$ | 168 | | 0 |
| CBK | 02/2024 | \$ | 414 | BRL | 2,094 | | 0 |
| CBK | 04/2024 | | 259 | TRY | 8,706 | | 2 |
| DUB | 11/2023 | EGP | 11,816 | \$ | 416 | | 36 |
| DUB | 02/2024 | \$ | 0 | EGP | 0 | | 0 |
| DUB | 04/2024 | EGP | 3,110 | \$ | 82 | | 5 |
| DUB | 04/2024 | \$ | 71 | EGP | 2,820 | | 0 |

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

| 取引相手 | 決済月 | 受渡し通貨 | | 受取通貨 | | 未実現評価 (損) 益 | | |
|------|---------|-------|---------|------|---------|-------------|----|------|
| | | | | | | 資産 | 負債 | |
| FAR | 11/2023 | BRL | 3,547 | \$ | 701 | \$ | 0 | (2) |
| FAR | 11/2023 | \$ | 726 | BRL | 3,547 | | 0 | (23) |
| GLM | 11/2023 | BRL | 2,364 | \$ | 484 | | 15 | 0 |
| GLM | 11/2023 | DOP | 8,042 | | 141 | | 0 | (1) |
| GLM | 11/2023 | | 4,891 | | 88 | | 1 | 0 |
| GLM | 11/2023 | | 7,728 | | 139 | | 2 | 0 |
| GLM | 11/2023 | EGP | 2,439 | | 86 | | 8 | 0 |
| GLM | 11/2023 | MXN | 1,042 | | 58 | | 0 | 0 |
| GLM | 11/2023 | MYR | 205 | | 43 | | 0 | 0 |
| GLM | 11/2023 | \$ | 469 | BRL | 2,364 | | 0 | 0 |
| GLM | 11/2023 | | 142 | DOP | 8,042 | | 0 | 0 |
| GLM | 11/2023 | | 401 | EGP | 12,177 | | 0 | (9) |
| GLM | 11/2023 | | 250 | MXN | 4,280 | | 0 | (14) |
| GLM | 11/2023 | | 233 | TRY | 6,513 | | 0 | (5) |
| GLM | 12/2023 | DOP | 6,912 | \$ | 121 | | 0 | (1) |
| GLM | 12/2023 | | 4,610 | | 81 | | 0 | (1) |
| GLM | 12/2023 | | 7,634 | | 134 | | 0 | (1) |
| GLM | 12/2023 | | 10,190 | | 183 | | 3 | 0 |
| GLM | 12/2023 | KRW | 51,188 | | 38 | | 0 | 0 |
| GLM | 12/2023 | MXN | 9,047 | | 521 | | 24 | 0 |
| GLM | 12/2023 | PEN | 283 | | 74 | | 0 | 0 |
| GLM | 12/2023 | PHP | 6,524 | | 114 | | 0 | (1) |
| GLM | 12/2023 | \$ | 116 | CLP | 108,763 | | 5 | 0 |
| GLM | 12/2023 | | 112 | PEN | 428 | | 0 | (1) |
| GLM | 01/2024 | DOP | 25,683 | \$ | 450 | | 0 | (2) |
| GLM | 01/2024 | | 16,375 | | 289 | | 0 | 0 |
| GLM | 01/2024 | | 14,095 | | 247 | | 0 | (1) |
| GLM | 01/2024 | | 5,000 | | 88 | | 0 | (1) |
| GLM | 01/2024 | HUF | 69,320 | | 185 | | 0 | (4) |
| GLM | 01/2024 | \$ | 242 | HUF | 88,485 | | 0 | (1) |
| GLM | 01/2024 | | 1 | MXN | 11 | | 0 | 0 |
| GLM | 02/2024 | | 158 | EGP | 5,721 | | 0 | (8) |
| GLM | 04/2024 | | 137 | | 5,405 | | 0 | (3) |
| JPM | 11/2023 | CHF | 484 | \$ | 536 | | 4 | 0 |
| JPM | 11/2023 | MXN | 984 | | 56 | | 1 | 0 |
| JPM | 11/2023 | NZD | 525 | | 312 | | 6 | 0 |
| JPM | 11/2023 | SEK | 1,250 | | 114 | | 2 | 0 |
| JPM | 11/2023 | \$ | 182 | AUD | 288 | | 1 | 0 |
| JPM | 11/2023 | | 148 | CHF | 135 | | 1 | 0 |
| JPM | 11/2023 | | 153 | NOK | 1,640 | | 0 | (6) |
| JPM | 11/2023 | ZAR | 3,326 | \$ | 174 | | 0 | (3) |
| JPM | 12/2023 | NGN | 14,904 | | 24 | | 8 | 0 |
| JPM | 12/2023 | TWO | 3,702 | | 117 | | 3 | 0 |
| JPM | 12/2023 | \$ | 378 | INR | 31,548 | | 0 | 0 |
| JPM | 12/2023 | | 29 | NGN | 18,202 | | 0 | (9) |
| JPM | 02/2024 | EGP | 3,200 | \$ | 92 | | 8 | 0 |
| JPM | 02/2024 | \$ | 38 | EGP | 1,370 | | 0 | (2) |
| JPM | 04/2024 | | 131 | | 5,253 | | 0 | (1) |
| MBC | 11/2023 | EUR | 2,228 | \$ | 2,358 | | 3 | 0 |
| MBC | 11/2023 | GBP | 105 | | 128 | | 1 | 0 |
| MBC | 11/2023 | \$ | 127 | EUR | 120 | | 0 | 0 |
| MBC | 11/2023 | ZAR | 21,621 | \$ | 1,126 | | 0 | (25) |
| MBC | 12/2023 | THB | 6,468 | | 179 | | 0 | (2) |
| MBC | 01/2024 | HUF | 56,970 | | 155 | | 0 | 0 |
| MBC | 01/2024 | ZAR | 19,035 | | 996 | | 0 | (13) |
| MBC | 02/2024 | \$ | 68 | EGP | 2,448 | | 0 | (4) |
| MBC | 04/2024 | | 241 | | 9,688 | | 0 | (1) |
| MYI | 11/2023 | CHF | 50 | \$ | 56 | | 1 | 0 |
| MYI | 11/2023 | EGP | 2,441 | | 87 | | 8 | 0 |
| MYI | 11/2023 | GBP | 30 | | 36 | | 0 | 0 |
| MYI | 11/2023 | MYR | 332 | | 70 | | 1 | 0 |
| MYI | 11/2023 | ZAR | 8,906 | | 468 | | 0 | (6) |
| MYI | 12/2023 | EUR | 2,228 | | 2,364 | | 6 | 0 |
| MYI | 12/2023 | INR | 69,984 | | 837 | | 0 | (2) |
| MYI | 01/2024 | NGN | 28,905 | | 47 | | 18 | 0 |
| MYI | 02/2024 | EGP | 7,805 | | 223 | | 18 | 0 |
| MYI | 03/2024 | IDR | 600,864 | | 39 | | 1 | 0 |

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

| 取引相手 | 決済月 | 受渡し通貨 | | 受取通貨 | | 未実現評価 (損) 益 | | | |
|---|---------|-------|-----------|------|---------|-------------|---------------|----|-----------------|
| | | 金額 | 通貨 | 金額 | 通貨 | 資産 | 負債 | | |
| MYI | 03/2024 | \$ | 40 | EGP | 1,421 | \$ | 0 | \$ | (3) |
| MYI | 04/2024 | EGP | 3,635 | \$ | 95 | | 5 | | 0 |
| MYI | 04/2024 | \$ | 57 | EGP | 2,252 | | 0 | | (1) |
| RBC | 11/2023 | CAD | 113 | \$ | 83 | | 2 | | 0 |
| RBC | 12/2023 | COP | 155,054 | | 36 | | 0 | | (1) |
| RBC | 12/2023 | PEN | 501 | | 131 | | 1 | | 0 |
| RBC | 12/2023 | \$ | 209 | PEN | 793 | | 0 | | (3) |
| RYL | 03/2024 | | 38 | IDR | 598,047 | | 0 | | (1) |
| SCX | 12/2023 | PHP | 6,605 | \$ | 116 | | 0 | | 0 |
| SCX | 12/2023 | \$ | 404 | INR | 33,698 | | 0 | | 0 |
| SCX | 01/2024 | | 35 | NGN | 28,770 | | 0 | | (6) |
| SCX | 01/2024 | ZAR | 2,205 | \$ | 116 | | 0 | | (1) |
| SCX | 03/2024 | \$ | 40 | EGP | 1,422 | | 0 | | (3) |
| SCX | 04/2024 | | 216 | | 8,501 | | 0 | | (5) |
| SOG | 12/2023 | | 37 | PEN | 142 | | 0 | | 0 |
| SSB | 11/2023 | BRL | 762 | \$ | 151 | | 0 | | 0 |
| SSB | 11/2023 | \$ | 150 | BRL | 762 | | 1 | | 0 |
| SSB | 12/2023 | COP | 450,071 | \$ | 102 | | 0 | | (6) |
| SSB | 12/2023 | INR | 4,677 | | 56 | | 0 | | 0 |
| SSB | 12/2023 | KRW | 74,075 | | 55 | | 0 | | 0 |
| SSB | 12/2023 | TWD | 2,440 | | 76 | | 1 | | 0 |
| SSB | 12/2023 | \$ | 206 | COP | 857,556 | | 0 | | (1) |
| SSB | 12/2023 | | 76 | KRW | 102,388 | | 0 | | 0 |
| SSB | 03/2024 | IDR | 1,769,678 | \$ | 114 | | 3 | | 0 |
| SSB | 03/2024 | \$ | 38 | IDR | 591,790 | | 0 | | (1) |
| TDR | 11/2023 | GBP | 1,365 | \$ | 1,658 | | 2 | | 0 |
| TDR | 11/2023 | JPY | 68,784 | | 464 | | 9 | | 0 |
| TDR | 12/2023 | \$ | 249 | INR | 20,807 | | 0 | | 0 |
| UAG | 11/2023 | BRL | 180 | \$ | 36 | | 0 | | 0 |
| UAG | 11/2023 | CHF | 52 | | 58 | | 1 | | 0 |
| UAG | 11/2023 | ILS | 797 | | 230 | | 33 | | 0 |
| UAG | 11/2023 | \$ | 36 | BRL | 180 | | 0 | | 0 |
| UAG | 01/2024 | ZAR | 7,413 | \$ | 388 | | 0 | | (4) |
| Total Forward Foreign Currency Contracts | | | | | | | \$ 714 | | \$ (354) |

SWAP AGREEMENTS:

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

| 取引相手 | 参照エンティティ | 固定 (支払) | | 2023年10月31日時点のインプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾ | | 想定元本 ⁽⁴⁾ | プレミアム 支払 (受取) | 未実現評価 (損) 益 | スワップの価値 | | |
|------|--|----------|------------|---|----------------------|---------------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|------|
| | | 金利 | 満期日 | スプレッド ⁽²⁾ | スプレッド ⁽²⁾ | | | | 資産 | 負債 | |
| BOA | Oman Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2027 | 1.299% | \$ 100 | \$ | 3 | \$ | (2) | \$ 1 | \$ 0 |
| BOA | Turkey Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2026 | 3.302% | 700 | | 117 | | (73) | 44 | 0 |
| BPS | Oman Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2027 | 1.299% | 100 | | 3 | | (2) | 1 | 0 |
| BPS | South Africa Government International Bond | (1.000%) | 06/20/2024 | 0.808% | 6,900 | | 291 | | (307) | 0 | (16) |
| DUB | Turkey Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2025 | 2.810% | 1,100 | | 110 | | (72) | 38 | 0 |
| GST | Korea International Bond | (1.000%) | 12/20/2028 | 0.430% | 1,100 | | (33) | | 3 | 0 | (30) |
| HUS | Dubai Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2024 | 0.339% | 100 | | 0 | | (1) | 0 | (1) |
| JPM | Dubai Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2024 | 0.339% | 600 | | (1) | | (4) | 0 | (5) |
| JPM | South Africa Government International Bond | (1.000%) | 06/20/2026 | 1.787% | 3,200 | | 150 | | (92) | 58 | 0 |
| JPM | Turkey Government International Bond | (1.000%) | 12/20/2025 | 2.810% | 400 | | 39 | | (25) | 14 | 0 |
| | | | | | | | \$ 679 | \$ (575) | \$ 156 | \$ (52) | |

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽²⁾

| 取引相手 | 参照エンティティ | 固定受取 金利 | 満期日 | 2023年10月31日時点のインプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾ | | 想定元本 ⁽⁴⁾ | プレミアム 支払 (受取) | 未実現評価 (損) 益 | スワップの価値 | | |
|------|---|---------|------------|---|----------------------|---------------------|---------------|-------------|---------|------|------|
| | | | | スプレッド ⁽²⁾ | スプレッド ⁽²⁾ | | | | 資産 | 負債 | |
| BOA | Chile Government International Bond | 1.000% | 06/20/2024 | 0.131% | \$ 600 | \$ | 2 | \$ | 2 | \$ 4 | \$ 0 |
| BOA | Chile Government International Bond | 1.000% | 12/20/2026 | 0.443% | 800 | | 5 | | 9 | 14 | 0 |
| BOA | Indonesia Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.981% | 1,500 | | (2) | | 5 | 3 | 0 |
| BOA | Mexico Government International Bond | 1.000% | 06/20/2024 | 0.254% | 1,100 | | 0 | | 7 | 7 | 0 |
| BOA | Qatar Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.574% | 300 | | 5 | | 1 | 6 | 0 |
| BPS | Chile Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.100% | 100 | | 0 | | 0 | 0 | 0 |
| BPS | Chile Government International Bond | 1.000% | 06/20/2024 | 0.131% | 300 | | 1 | | 1 | 2 | 0 |

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

| 取引相手 | 参照エンティティ | 固定受取 金利 | 満期日 | 2023年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾ | 想定元本 ⁽⁴⁾ | 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 |
| BPS | Chile Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.185% | \$ 400 | \$ 1 | \$ 4 | \$ 5 | \$ 0 |
| BPS | China Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.811% | 2,400 | 29 | (6) | 23 | 0 |
| BPS | Mexico Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.187% | 100 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| BPS | Mexico Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.354% | 400 | (1) | 5 | 4 | 0 |
| BPS | Peru Government International Bond | 1.000% | 06/20/2026 | 0.537% | 900 | 7 | 4 | 11 | 0 |
| BPS | Poland Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.137% | 100 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| BPS | Serbia Government International Bond | 1.000% | 12/20/2027 | 1.942% | 200 | (18) | 11 | 0 | (7) |
| BPS | South Africa Government International Bond | 1.000% | 06/20/2028 | 2.583% | 3,300 | (285) | 81 | 0 | (204) |
| BRC | Argentina Government International Bond | 5.000% | 12/20/2023 | 67.227% | 350 | (42) | 16 | 0 | (26) |
| BRC | Hungary Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.385% | 400 | (3) | 4 | 1 | 0 |
| BRC | Indonesia Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.981% | 1,100 | 0 | 2 | 2 | 0 |
| BRC | Philippines Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.234% | 4,700 | 43 | (33) | 10 | 0 |
| BRC | Romania Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.338% | 100 | (1) | 1 | 0 | 0 |
| BRC | Saudi Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.346% | 188 | 2 | 0 | 2 | 0 |
| CBK | China Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.811% | 500 | 3 | 2 | 5 | 0 |
| CBK | Panama Government International Bond | 1.000% | 06/20/2024 | 0.522% | 200 | 0 | 1 | 1 | 0 |
| CBK | Panama Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.685% | 300 | 0 | 1 | 1 | 0 |
| CBK | Peru Government International Bond | 1.000% | 12/20/2025 | 0.434% | 2,800 | 51 | (16) | 35 | 0 |
| CBK | Peru Government International Bond | 1.000% | 06/20/2026 | 0.537% | 3,200 | 22 | 18 | 40 | 0 |
| DUB | Egypt Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 15.907% | 400 | (54) | (6) | 0 | (60) |
| DUB | Qatar Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.574% | 600 | 9 | 3 | 12 | 0 |
| GLM | Romania Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.338% | 200 | (1) | 1 | 0 | 0 |
| GST | Indonesia Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.981% | 1,600 | 0 | 3 | 3 | 0 |
| GST | Mexico Government International Bond | 1.000% | 06/20/2027 | 0.855% | 600 | (2) | 6 | 4 | 0 |
| GST | Peru Government International Bond | 1.000% | 06/20/2026 | 0.537% | 1,200 | 12 | 4 | 16 | 0 |
| GST | Poland Government International Bond | 1.000% | 12/20/2023 | 0.137% | 100 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| GST | Qatar Government International Bond | 1.000% | 12/20/2028 | 0.574% | 400 | 7 | 1 | 8 | 0 |
| GST | Saudi Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.346% | 112 | 1 | 0 | 1 | 0 |
| JPM | Brazil Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 1.608% | 700 | (16) | 12 | 0 | (4) |
| JPM | Hungary Government International Bond | 1.000% | 06/20/2027 | 1.339% | 200 | (10) | 8 | 0 | (2) |
| JPM | Peru Government International Bond | 1.000% | 06/20/2026 | 0.537% | 100 | 1 | 0 | 1 | 0 |
| JPM | Poland Government International Bond | 1.000% | 06/20/2028 | 0.623% | 200 | 0 | 4 | 4 | 0 |
| JPM | State Oil Co. of the Azerbaijan Republic | 1.000% | 12/20/2023 | 1.495% | 1,000 | (35) | 35 | 0 | 0 |
| MYC | Chile Government International Bond | 1.000% | 12/20/2024 | 0.185% | 200 | 1 | 2 | 3 | 0 |
| MYC | Chile Government International Bond | 1.000% | 12/20/2026 | 0.443% | 400 | 2 | 5 | 7 | 0 |
| MYC | Mexico Government International Bond | 1.000% | 06/20/2024 | 0.254% | 100 | 0 | 1 | 1 | 0 |
| MYC | Peru Government International Bond | 1.000% | 06/20/2026 | 0.537% | 500 | 1 | 5 | 6 | 0 |
| MYC | Qatar Government International Bond | 1.000% | 12/20/2026 | 0.409% | 300 | 4 | 1 | 5 | 0 |
| | | | | | | | | \$ | (261) |
| | | | | | | | | \$ | 205 |
| | | | | | | | | \$ | 247 |
| | | | | | | | | \$ | (303) |
| Total Swap Agreements | | | | | | | | \$ | 418 |
| | | | | | | | | \$ | (370) |
| | | | | | | | | \$ | 403 |
| | | | | | | | | \$ | (355) |

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

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

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

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

マネー・マーケット・マザーファンド

《第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。

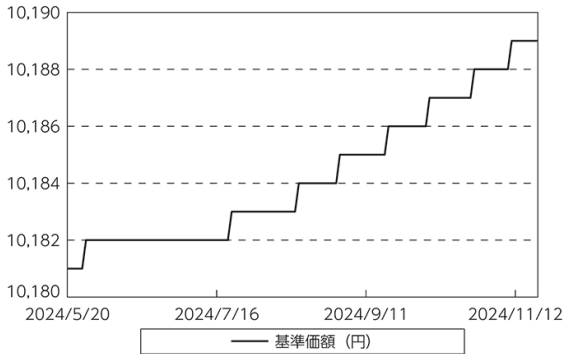
○運用経過

●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 |
|----|-------------|-------------|-------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | コマーシャル・ペーパー | 466,254,326 | 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 |
| | 千円 | % |
| コマーシャル・ペーパー | 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 |
| | 千円 | % |
| その他有価証券 | 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<為替ヘッジなし> (年1回決算型) | 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 |
| <DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド | 9, 822円 |
| バリュース・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 |