

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2029年4月20日まで（2009年4月28日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド A - クラス J (JPY) の投資信託証券への投資を通じて、米ドル建ての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、当該外国投資信託への投資を通じて、実質的な保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。	
主要運用対象	三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ <円コース> (毎月分配型)	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド A - クラス J (JPY) およびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	ピムコ ケイマン エマーシング ボンド ファンド (M) への投資を通じて、新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券およびその派生商品等を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、配当等収益や分配対象額的水準等を考慮し、継続的に分配することをめざします。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。	

## 運用報告書（全体版）

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)

第173期（決算日：2023年11月20日）  
第174期（決算日：2023年12月20日）  
第175期（決算日：2024年1月22日）  
第176期（決算日：2024年2月20日）  
第177期（決算日：2024年3月21日）  
第178期（決算日：2024年4月22日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
さて、お手持ちの「三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）」は、去る4月22日に第178期の決算を行いましたので、法令に基づいて第173期～第178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 (分配落)	準 価 額			債 組	券 入	債 先	券 物	投 証	信 託	純 資	産 産
		税 分	込 配	み 金								
	円		円	%		%		%		%		百万円
149期(2021年11月22日)	7,035		25	△0.3		—		—		99.3		3,242
150期(2021年12月20日)	6,960		25	△0.7		—		—		99.8		3,187
151期(2022年1月20日)	6,703		25	△3.3		—		—		99.3		3,041
152期(2022年2月21日)	6,608		25	△1.0		—		—		99.4		2,970
153期(2022年3月22日)	6,200		25	△5.8		—		—		99.3		2,704
154期(2022年4月20日)	6,014		25	△2.6		—		—		99.5		2,602
155期(2022年5月20日)	5,715		25	△4.6		—		—		99.2		2,416
156期(2022年6月20日)	5,539		25	△2.6		—		—		99.8		2,329
157期(2022年7月20日)	5,274		25	△4.3		—		—		99.1		2,160
158期(2022年8月22日)	5,572		25	6.1		—		—		99.3		2,252
159期(2022年9月20日)	5,364		25	△3.3		—		—		99.2		2,161
160期(2022年10月20日)	4,976		25	△6.8		—		—		99.8		1,996
161期(2022年11月21日)	5,277		25	6.6		—		—		99.1		2,114
162期(2022年12月20日)	5,402		25	2.8		—		—		99.1		2,168
163期(2023年1月20日)	5,511		25	2.5		—		—		99.9		2,208
164期(2023年2月20日)	5,311		25	△3.2		—		—		99.1		2,126
165期(2023年3月20日)	5,243		25	△0.8		—		—		99.9		2,074
166期(2023年4月20日)	5,230		25	0.2		—		—		99.9		2,062
167期(2023年5月22日)	5,163		25	△0.8		—		—		99.1		2,013
168期(2023年6月20日)	5,228		25	1.7		—		—		99.9		2,023
169期(2023年7月20日)	5,323		25	2.3		—		—		99.2		2,067
170期(2023年8月21日)	5,131		25	△3.1		—		—		99.1		2,007
171期(2023年9月20日)	5,123		25	0.3		—		—		99.7		1,963
172期(2023年10月20日)	4,904		25	△3.8		—		—		99.1		1,863
173期(2023年11月20日)	5,058		25	3.7		—		—		99.8		1,921
174期(2023年12月20日)	5,326		25	5.8		—		—		99.1		1,998
175期(2024年1月22日)	5,223		25	△1.5		—		—		99.8		1,949
176期(2024年2月20日)	5,194		25	△0.1		—		—		99.1		1,923
177期(2024年3月21日)	5,261		25	1.8		—		—		98.7		1,906
178期(2024年4月22日)	5,160		25	△1.4		—		—		99.8		1,851

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

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	投 資 信 託 券 率
			騰 落 率	率						
第173期	(期 首) 2023年10月20日	円	4,904	%	—	—	—	—	—	99.1
	10月末		4,945	0.8	—	—	—	—	—	99.1
	(期 末) 2023年11月20日		5,083	3.7	—	—	—	—	—	99.8
第174期	(期 首) 2023年11月20日		5,058	—	—	—	—	—	—	99.8
	11月末		5,164	2.1	—	—	—	—	—	99.5
	(期 末) 2023年12月20日		5,351	5.8	—	—	—	—	—	99.1
第175期	(期 首) 2023年12月20日		5,326	—	—	—	—	—	—	99.1
	12月末		5,347	0.4	—	—	—	—	—	99.6
	(期 末) 2024年1月22日		5,248	△1.5	—	—	—	—	—	99.8
第176期	(期 首) 2024年1月22日		5,223	—	—	—	—	—	—	99.8
	1月末		5,241	0.3	—	—	—	—	—	99.4
	(期 末) 2024年2月20日		5,219	△0.1	—	—	—	—	—	99.1
第177期	(期 首) 2024年2月20日		5,194	—	—	—	—	—	—	99.1
	2月末		5,242	0.9	—	—	—	—	—	99.3
	(期 末) 2024年3月21日		5,286	1.8	—	—	—	—	—	98.7
第178期	(期 首) 2024年3月21日		5,261	—	—	—	—	—	—	98.7
	3月末		5,315	1.0	—	—	—	—	—	99.4
	(期 末) 2024年4月22日		5,185	△1.4	—	—	—	—	—	99.8

(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。

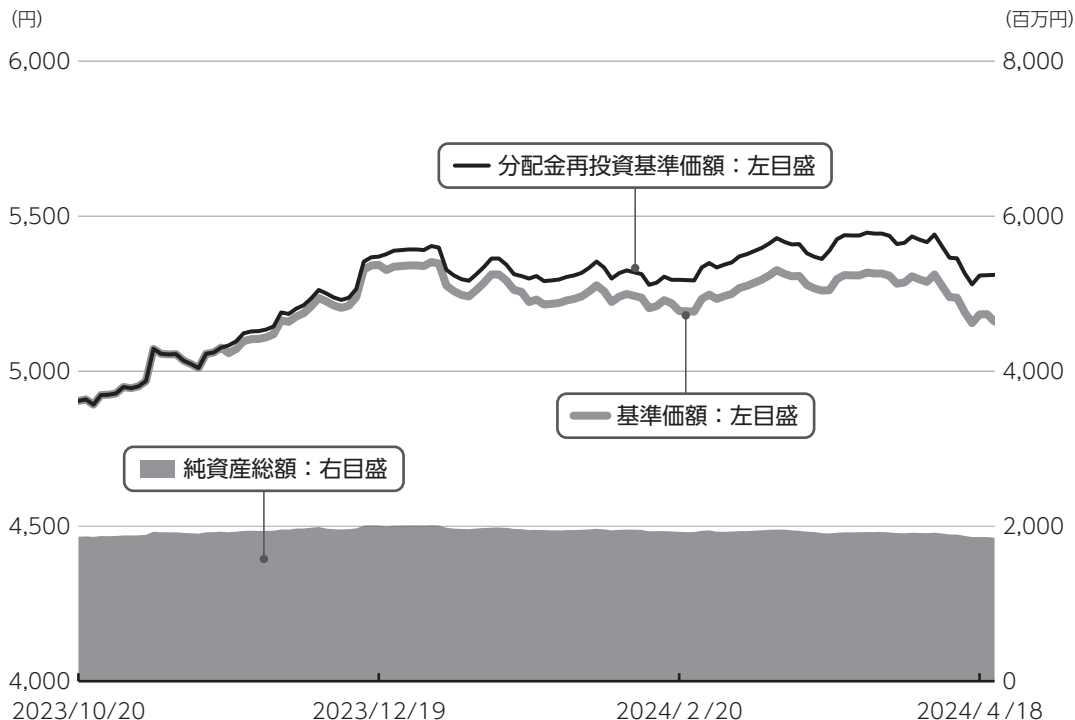
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第173期～第178期：2023年10月21日～2024年4月22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173期首	4,904円
第178期末	5,160円
既払分配金	150円
騰落率	8.3%

(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8.3% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

### > 基準価額の主な変動要因

#### 上昇要因

エマージング (新興経済国) 債券市況が上昇したこと。

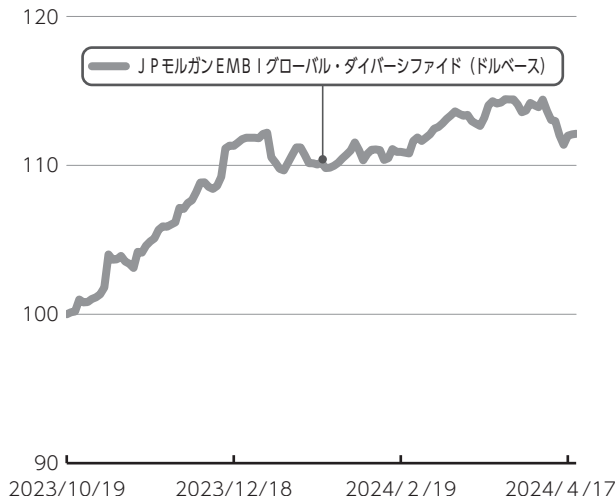
#### 下落要因

為替ヘッジによるコスト (金利差相当分の費用)

第173期～第178期：2023年10月21日～2024年4月22日

## 投資環境について

### 債券市況の推移 (当作成期首を100として指数化)



(注) 現地日付ベースで記載しております。

(注) JPMorgan EMBI Global Diversified とは、J. P. Morgan・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。JPMorgan EMBI Global Diversified は、J. P. Morgan・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. Morgan・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しております。

### 国内短期金融市場

**無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移していたものの、2024年3月に日銀がマイナス金利政策を解除したことにより、期間末には0%を上回りました。**

当期間の短期金融市場をみると、日銀は3月19日まで長短金利を操作目標として金融市場調節を行ってききましたが、3月21日以降は、無担保コール翌日物金利を

### 債券市況

**エマージング債券市況は上昇しました。**

当期間では、米国などで一部企業の好調な決算などを背景に株式市況が堅調に推移し、市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことなどから、エマージング債券市況は上昇しました。

操作目標としました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス金利政策解除によりプラス圏に上昇し、足下のコール・レートは0.077%となりました。

## ▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)

円建て外国投資信託であるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY) への投資を通じて、エマージング債券を高位に組み入れました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

### ▶ ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)

主に米ドル建ての新興国債券に投資を行いました。

### 国別配分戦略

上乘せ利回りの獲得が期待できるルーマニア等への投資を積極姿勢としました。一方、米国との貿易摩擦等が意識される中国や、石油産業への依存度が高いバーレーン等への投資を消極姿勢としました。保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行いました。

### ▶ マネー・マーケット・マザーファンド コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

## 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第173期 2023年10月21日~ 2023年11月20日	第174期 2023年11月21日~ 2023年12月20日	第175期 2023年12月21日~ 2024年1月22日	第176期 2024年1月23日~ 2024年2月20日	第177期 2024年2月21日~ 2024年3月21日	第178期 2024年3月22日~ 2024年4月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	<b>25</b> (0.492%)	<b>25</b> (0.467%)	<b>25</b> (0.476%)	<b>25</b> (0.479%)	<b>25</b> (0.473%)	<b>25</b> (0.482%)
当期の収益	14	11	1	4	10	2
当期の収益以外	10	13	23	20	14	22
翌期繰越分配対象額	1,461	1,448	1,424	1,404	1,390	1,367

(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。)

### ▶ 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)

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 ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)

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) による支援等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や、石油産業への依存度が高いバーレーン等への投資を消極姿勢とします。

なお、保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行います。

### ▶ 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。

2023年10月21日～2024年4月22日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第173期～第178期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	44	0.845	(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 )	(27)	(0.517)	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 )	(16)	(0.306)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	44	0.847	

作成期中の平均基準価額は、5,209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。

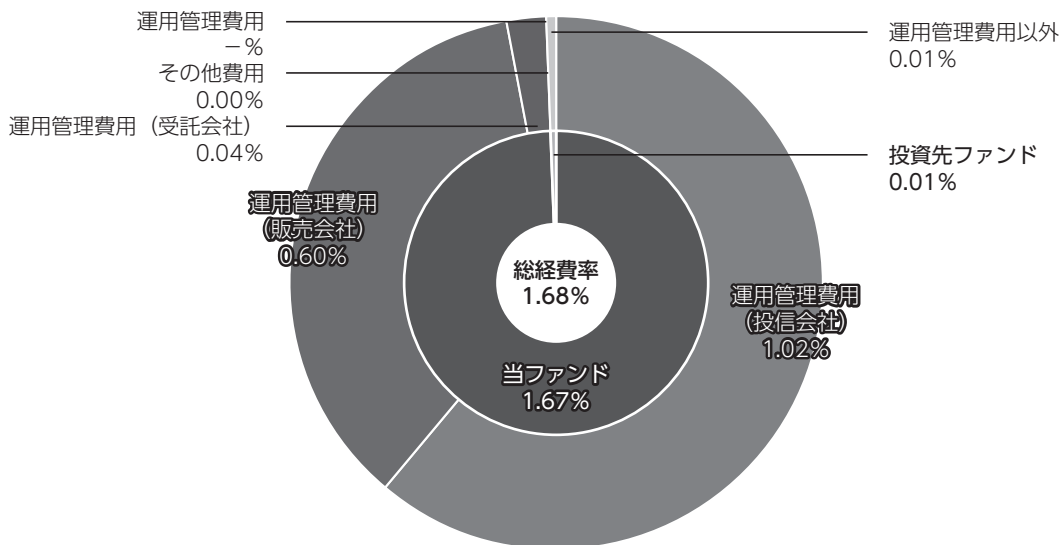
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.68%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.68
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.67
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	(%)	0.01

(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

(2023年10月21日～2024年4月22日)

### 投資信託証券

銘柄		第173期～第178期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	9千口	56,124千円	32千口	200,000千円

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年10月21日～2024年4月22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4月22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172期末	第178期末		
		口数	口数	評価額	比率
	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	324千口	301千口	1,847,531千円	99.8%
合計		324	301	1,847,531	99.8

(注) 比率は三菱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) の純資産総額に対する比率。

### 親投資信託残高

銘柄		第172期末	第178期末	
		口数	口数	評価額
	マネー・マーケット・マザーファンド	2,210千口	2,210千口	2,250千円

## ○投資信託財産の構成

(2024年4月22日現在)

項 目	第178期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 1,847,531	% 99.2
マネー・マーケット・マザーファンド	2,250	0.1
コール・ローン等、その他	13,320	0.7
投資信託財産総額	1,863,101	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第173期末	第174期末	第175期末	第176期末	第177期末	第178期末
	2023年11月20日現在	2023年12月20日現在	2024年1月22日現在	2024年2月20日現在	2024年3月21日現在	2024年4月22日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,934,238,981	2,016,744,807	1,962,732,019	1,935,478,021	1,934,505,114	1,863,101,664
コール・ローン等	14,878,230	13,659,749	15,796,101	7,577,166	29,837,577	13,319,642
投資信託受益証券(評価額)	1,917,110,064	1,980,834,371	1,944,685,231	1,905,650,168	1,882,416,800	1,847,531,312
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	2,250,687	2,250,687	2,250,687	2,250,687	2,250,687	2,250,687
未収入金	—	20,000,000	—	20,000,000	20,000,000	—
未収利息	—	—	—	—	50	23
(B) 負債	12,620,568	17,944,559	13,496,789	11,847,693	28,064,597	11,766,001
未払収益分配金	9,498,670	9,382,433	9,329,947	9,259,449	9,059,107	8,970,258
未払解約金	432,348	5,866,094	1,165,432	8	16,349,255	4
未払信託報酬	2,684,257	2,690,731	2,995,502	2,583,149	2,651,014	2,790,244
未払利息	5	2	6	—	—	—
その他未払費用	5,288	5,299	5,902	5,087	5,221	5,495
(C) 純資産総額(A-B)	1,921,618,413	1,998,800,248	1,949,235,230	1,923,630,328	1,906,440,517	1,851,335,663
元本	3,799,468,102	3,752,973,317	3,731,978,813	3,703,779,910	3,623,642,887	3,588,103,428
次期繰越損益金	△1,877,849,689	△1,754,173,069	△1,782,743,583	△1,780,149,582	△1,717,202,370	△1,736,767,765
(D) 受益権総口数	3,799,468,102口	3,752,973,317口	3,731,978,813口	3,703,779,910口	3,623,642,887口	3,588,103,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,058円	5,326円	5,223円	5,194円	5,261円	5,160円

○損益の状況

項 目	第173期	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期
	2023年10月21日～ 2023年11月20日	2023年11月21日～ 2023年12月20日	2023年12月21日～ 2024年1月22日	2024年1月23日～ 2024年2月20日	2024年2月21日～ 2024年3月21日	2024年3月22日～ 2024年4月22日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,846,849	4,489,576	3,483,925	4,397,149	4,266,069	3,624,913
受取配当金	5,847,025	4,489,671	3,484,086	4,397,179	4,266,064	3,624,160
受取利息	2	4	—	3	50	753
支払利息	△ 178	△ 99	△ 161	△ 33	△ 45	—
(B) 有価証券売買損益	64,618,401	108,080,921	△ 29,514,762	△ 3,429,220	31,861,952	△ 28,334,911
売買益	64,661,573	109,230,081	123,832	51,070	32,494,964	305,604
売買損	△ 43,172	△ 1,149,160	△ 29,638,594	△ 3,480,290	△ 633,012	△ 28,640,515
(C) 信託報酬等	△ 2,689,545	△ 2,696,030	△ 3,001,404	△ 2,588,236	△ 2,656,235	△ 2,795,739
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	67,775,705	109,874,467	△ 29,032,241	△ 1,620,307	33,471,786	△ 27,505,737
(E) 前期繰越損益金	△1,579,181,037	△1,489,035,299	△1,371,979,470	△1,388,341,235	△1,357,507,042	△1,307,595,406
(F) 追加信託差損益金	△ 356,945,687	△ 365,629,804	△ 372,401,925	△ 380,928,591	△ 384,108,007	△ 392,696,364
(配当等相当額)	( 559,141,458)	( 548,471,435)	( 540,431,019)	( 527,566,908)	( 508,863,201)	( 498,815,606)
(売買損益相当額)	(△ 916,087,145)	(△ 914,101,239)	(△ 912,832,944)	(△ 908,495,499)	(△ 892,971,208)	(△ 891,511,970)
(G) 計(D+E+F)	△1,868,351,019	△1,744,790,636	△1,773,413,636	△1,770,890,133	△1,708,143,263	△1,727,797,507
(H) 収益分配金	△ 9,498,670	△ 9,382,433	△ 9,329,947	△ 9,259,449	△ 9,059,107	△ 8,970,258
次期繰越損益金(G+H)	△1,877,849,689	△1,754,173,069	△1,782,743,583	△1,780,149,582	△1,717,202,370	△1,736,767,765
追加信託差損益金	△ 360,820,740	△ 370,630,233	△ 381,249,354	△ 388,379,127	△ 389,214,746	△ 400,837,349
(配当等相当額)	( 555,266,405)	( 543,471,006)	( 531,583,590)	( 520,116,372)	( 503,756,462)	( 490,674,621)
(売買損益相当額)	(△ 916,087,145)	(△ 914,101,239)	(△ 912,832,944)	(△ 908,495,499)	(△ 892,971,208)	(△ 891,511,970)
繰越損益金	△1,517,028,949	△1,383,542,836	△1,401,494,229	△1,391,770,455	△1,327,987,624	△1,335,930,416

(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 3,799,974,506円  
 作成期中追加設定元本額 81,605,139円  
 作成期中一部解約元本額 293,476,217円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.5160円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,736,767,765円です。

③分配金の計算過程

項 目	2023年10月21日～ 2023年11月20日	2023年11月21日～ 2023年12月20日	2023年12月21日～ 2024年1月22日	2024年1月23日～ 2024年2月20日	2024年2月21日～ 2024年3月21日	2024年3月22日～ 2024年4月22日
費用控除後の配当等収益額	5,623,617円	4,382,004円	482,518円	1,808,913円	3,952,368円	829,273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	559,141,458円	548,471,435円	540,431,019円	527,566,908円	508,863,201円	498,815,606円
分配準備積立金額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
当ファンドの分配対象収益額	564,765,075円	552,853,439円	540,913,537円	529,375,821円	512,815,569円	499,644,879円
1万口当たり収益分配対象額	1,486円	1,473円	1,449円	1,429円	1,415円	1,392円
1万口当たり分配金額	25円	25円	25円	25円	25円	25円
収益分配金総額	9,498,670円	9,382,433円	9,329,947円	9,259,449円	9,059,107円	8,970,258円

④信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の59以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○分配金のお知らせ

	第173期	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期
1万口当たり分配金 (税込み)	25円	25円	25円	25円	25円	25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】

三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース><南アフリカランドコース><トルコリラコース><中国元コース><インドネシアルピアコース><資源国バスケット通貨コース>の満期償還に伴い記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2024年4月18日)

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

<b>ファンド名</b>	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A - クラス J (JPY)
<b>運用方針</b>	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M) への投資を通じて、新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券およびその派生商品等にて実質的な投資を行い、信託財産の成長をめざします。
<b>主要運用対象</b>	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米ドル建ての債券およびその派生商品等
<b>主な組入制限</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資を行う新興国債券は、主に新興経済国の政府、政府機関等が発行もしくは信用保証する米ドル建ての債券（ソブリン債券、準ソブリン債券）ですが、新興国債券と同様の投資効果を持つデリバティブ取引を活用する場合があります。また、資金管理目的で、原則として取得時に「BBB格」相当以上の信用格付けを有する米ドル建ての公社債等にも一部投資を行います。</li> <li>・ ポートフォリオの平均デュレーションは原則として3年以上8年以内で調整します。</li> <li>・ 投資する債券は、原則として取得時において「CCC格」相当以上の信用格付けを有しているものに限定し、投資する債券の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則として「B-格」相当以上を維持します。</li> <li>・ 限定的な範囲内で、米ドル建て以外の新興国債券にも投資を行う場合がありますが、この場合においては米ドル以外の通貨売り、米ドル買いの為替取引を行います。</li> <li>・ 保有外貨建て資産に対し、原則として、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行います。</li> </ul>
<b>決算日</b>	原則として毎年2月末日
<b>分配方針</b>	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。



運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Cayman Trust Annual Report February 28, 2023版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは、「ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A」で掲載しています。また、「ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M)」を「マスターファンド」と表示する場合があります。

## (1) 運用計算書

### ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A

(2022年3月1日～2023年2月28日)

	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A
	千米ドル
<b>投資収入：</b>	
受取利息（外国税額控除後）*	15
雑収入	0
収入合計	15
<b>費用：</b>	
支払利息	3
雑費	0
費用合計	3
<b>投資純収入</b>	<b>12</b>
<b>実現純利益（損失）：</b>	
投資有価証券	28
マスターファンド	1,241
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(3,506)
外貨	33
実現純利益（損失）	(2,204)
<b>未実現評価益（評価損）の純変動：</b>	
投資有価証券	27
マスターファンド	(6,985)
為替取引、中央清算金融派生商品	0
店頭金融派生商品	(924)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	0
未実現評価益（評価損）の純変動	(7,882)
純利益（損失）	(10,086)
<b>運用による純資産の純増（減）額</b>	<b>(10,074)</b>
*外国税	0

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A

(2022年3月1日～2023年2月28日)

ピムコ ケイマン  
エマージング ボンド  
ファンド A

千米ドル

純資産の増加（減少）：

運用：

投資純収入（費用）	12
実現純利益（損失）	(2,204)
未実現評価益（評価損）の純変動	(7,882)
運用による純資産の純増（減）額	(10,074)

分配：

分配額

F (EUR)	(155)
F (USD)	(1,497)
J (EUR)	(42)
J (JPY)	(934)
J (USD)	(2,355)
分配金額合計	(4,983)

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	(7,471)
-------------------------	---------

<b>純資産の増（減）額合計</b>	<b>(22,528)</b>
--------------------	-----------------

純資産：

期首	86,190
期末	63,662

(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 ケイマン エマージング ボンド ファンド A  
 (2023年2月28日現在)

	元本 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 6.1%</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 6.1%</b>		
<b>TIME DEPOSITS 1.4%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 2	\$ 2
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
4.070% due 03/01/2023	7	7
<b>Citibank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	73	73
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	24	24
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	272	272
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
4.070% due 03/01/2023	1	1
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	526	526
		<b>905</b>
<b>U.S. TREASURY BILLS (a)(c) 4.7%</b>		
4.231% due 03/09/2023	2,200	2,198
4.449% due 04/06/2023	800	796
		<b>2,994</b>
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<b>3,899</b>
<b>(Cost \$3,872)</b>		
<b>Total Investments in Securities</b>		<b>3,899</b>
<b>(Cost \$3,872)</b>		
	口数 (単位:千)	
<b>INVESTMENTS IN AFFILIATES 95.4%</b>		
<b>OTHER INVESTMENT COMPANIES 95.4%</b>		
<b>PIMCO Cayman Emerging Bond Fund (M)</b>		
<b>(Cost \$64,518)</b>	4,068	60,697
<b>Total Investments in Affiliates</b>		<b>60,697</b>
<b>(Cost \$64,518)</b>		
<b>Total Investments 101.5%</b>		<b>\$ 64,596</b>
<b>(Cost \$68,390)</b>		
<b>Financial Derivative</b>		
<b>Instruments (b) (1.4%)</b>		<b>(906)</b>
<b>(Cost or Premiums, net \$0)</b>		
<b>Other Assets and Liabilities, net (0.1%)</b>		<b>(28)</b>
<b>Net Assets 100.0%</b>		<b>\$ 63,662</b>

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

**J (EUR) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:**

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BOA	03/2023	EUR	10	\$ 11	\$ 0
BOA	03/2023	\$	1,122	EUR 1,031	0 (28)
BPS	03/2023	EUR	49	\$ 52	0 0
CBK	03/2023	\$	109	EUR 100	0 (3)
MBC	03/2023	EUR	985	\$ 1,042	0 (3)
MBC	04/2023	\$	1,044	EUR 985	3 0

J (EUR) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
MYI	03/2023	EUR 1,052	\$ 1,110	\$ 0	\$ (5)
MYI	03/2023	\$ 1,122	EUR 1,028	0	(32)
MYI	04/2023	1,041	985	5	0
SCX	03/2023	EUR 77	\$ 81	0	0
SCX	04/2023	\$ 81	EUR 77	0	0
SOG	03/2023	1,021	935	0	(29)
UAG	03/2023	EUR 988	\$ 1,047	0	(1)
UAG	04/2023	\$ 1,049	EUR 988	1	0
				\$ 9	\$ (10)

J (JPY) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	03/2023	JPY 146,404	\$ 1,077	\$ 3	\$ 0
BOA	03/2023	\$ 5,057	JPY 655,142	0	(247)
BOA	04/2023	926	125,537	0	0
MBC	03/2023	545	70,412	0	(28)
MYI	03/2023	JPY 42,809	\$ 314	0	0
NGF	03/2023	616,551	4,562	36	0
NGF	04/2023	\$ 4,562	JPY 613,688	0	(34)
RBC	03/2023	JPY 704,008	\$ 5,168	0	0
RBC	03/2023	\$ 5,586	JPY 723,684	0	(273)
RBC	04/2023	5,168	700,760	1	0
SCX	03/2023	JPY 704,008	\$ 5,168	0	0
SCX	03/2023	\$ 5,586	JPY 723,684	0	(273)
SCX	04/2023	5,168	700,760	1	0
				\$ 41	\$ (85)
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>				\$ 50	\$ (95)

(B) ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M)

(2023年2月28日現在)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 99.8%</b>		
<b>ALBANIA 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Republic of Albania</b>		
3.500% due 11/23/2031	EUR 300	\$ 261
<b>Total Albania</b>		<b>261</b>
<b>(Cost \$334)</b>		
<b>ANGOLA 1.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.2%</b>		
<b>Angolan Government International Bond</b>		
8.000% due 11/26/2029	\$ 600	541
8.250% due 05/09/2028	1,100	1,017
8.750% due 04/14/2032	1,200	1,082
9.375% due 05/09/2048	600	513
9.500% due 11/12/2025	200	203
<b>Total Angola</b>		<b>3,356</b>
<b>(Cost \$3,444)</b>		
<b>ARGENTINA 1.6%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.6%</b>		
<b>Argentina Government International Bond</b>		
0.500% due 07/09/2030	1,030	336
1.000% due 07/09/2029	629	197
1.500% due 07/09/2035	4,389	1,262
1.500% due 07/09/2046	2,415	703
3.500% due 07/09/2041	1,881	596
3.875% due 01/09/2038	1,468	516
<b>Argentine Bonos del Tesoro</b>		
15.500% due 10/17/2026	ARS 1,650	2
<b>Provincia de Buenos Aires</b>		
3.900% due 09/01/2037	\$ 400	153
<b>Provincia de la Rioja</b>		
6.500% due 02/24/2028	1,062	604
<b>Total Argentina</b>		<b>4,369</b>
<b>(Cost \$6,812)</b>		
<b>ARMENIA 0.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Armenia Government International Bond</b>		
3.600% due 02/02/2031	500	386
3.950% due 09/25/2029	800	660
<b>Total Armenia</b>		<b>1,046</b>
<b>(Cost \$1,279)</b>		
<b>AZERBAIJAN 2.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.1%</b>		
<b>SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding I DAC</b>		
7.230% due 03/17/2026	100	99
<b>Southern Gas Corridor CJSC</b>		
6.875% due 03/24/2026	2,200	2,252
<b>State Oil Company of the Azerbaijan Republic</b>		
4.750% due 03/13/2023	3,340	3,334
		<b>5,685</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Republic of Azerbaijan International Bond</b>		
3.500% due 09/01/2032	300	254
4.750% due 03/18/2024	333	331
		<b>585</b>
<b>Total Azerbaijan</b>		<b>6,270</b>
<b>(Cost \$6,367)</b>		

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>BAHAMAS 0.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Bahamas Government International Bond</b>		
6.000% due 11/21/2028	\$ 1,200	\$ 987
<b>Total Bahamas</b>		<b>987</b>
<b>(Cost \$1,200)</b>		
<b>BAHRAIN 0.8%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.8%</b>		
<b>Bahrain Government International Bond</b>		
4.250% due 01/25/2028	1,400	1,297
5.625% due 09/30/2031	1,000	928
<b>Total Bahrain</b>		<b>2,225</b>
<b>(Cost \$2,424)</b>		
<b>BELARUS 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Republic of Belarus International Bond</b>		
6.378% due 02/24/2031	500	168
<b>Total Belarus</b>		<b>168</b>
<b>(Cost \$488)</b>		
<b>BRAZIL 1.7%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.7%</b>		
<b>Brazil Government International Bond</b>		
4.750% due 01/14/2050	6,400	4,605
8.250% due 01/20/2034	60	68
<b>Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais</b>		
5.333% due 02/15/2028	200	196
<b>Total Brazil</b>		<b>4,869</b>
<b>(Cost \$6,591)</b>		
<b>BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.5%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
<b>1MDB Global Investments Ltd.</b>		
4.400% due 03/09/2023	1,500	1,490
<b>Total British Virgin Islands</b>		<b>1,490</b>
<b>(Cost \$1,500)</b>		
<b>CAMEROON 0.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Republic of Cameroon International Bond</b>		
5.950% due 07/07/2032	EUR 700	559
<b>Total Cameroon</b>		<b>559</b>
<b>(Cost \$830)</b>		
<b>CAYMAN ISLANDS 3.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.8%</b>		
<b>Biocerane Sovereign Certificate Ltd.</b>		
0.000% due 06/05/2034	\$ 1,187	824
<b>Gaci First Investment Co.</b>		
5.000% due 10/13/2027	2,000	1,983
5.125% due 02/14/2053	1,400	1,264
<b>Interoceanica IV Finance Ltd.</b>		
0.000% due 11/30/2025	237	203
<b>Interoceanica V Finance Ltd.</b>		
0.000% due 05/15/2030	1,975	1,526
7.860% due 05/15/2030	169	170
<b>Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.</b>		
0.000% due 06/02/2025	1,215	1,126

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>S.A. Global Sukuk Ltd.</b>		
1.602% due 06/17/2026	\$ 700	\$ 632
		<b>7,728</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
<b>KSA Sukuk Ltd.</b>		
5.268% due 10/25/2028	1,300	1,336
<b>Total Cayman Islands</b>		<b>9,064</b>
<b>(Cost \$9,146)</b>		
<b>CHILE 2.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.1%</b>		
<b>Banco del Estado de Chile</b>		
2.704% due 01/09/2025	500	477
<b>Corp. Nacional del Cobre de Chile</b>		
3.700% due 01/30/2050	200	146
4.250% due 07/17/2042	2,300	1,895
4.500% due 08/01/2047	500	417
4.875% due 11/04/2044	1,600	1,435
5.125% due 02/02/2033	400	390
<b>Empresa de los Ferrocarriles del Estado</b>		
3.068% due 08/18/2050	200	123
3.830% due 09/14/2061	400	272
<b>Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.</b>		
4.700% due 05/07/2050	600	512
<b>Empresa Nacional del Petroleo</b>		
3.450% due 09/16/2031	200	165
		<b>5,832</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.8%</b>		
<b>Chile Government International Bond</b>		
2.750% due 01/31/2027	700	644
3.250% due 09/21/2071	500	310
4.340% due 03/07/2042	700	600
		<b>1,554</b>
<b>Total Chile</b>		<b>7,386</b>
<b>(Cost \$8,720)</b>		
<b>COLOMBIA 2.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.7%</b>		
<b>Ecopetrol S.A.</b>		
4.625% due 11/02/2031	500	373
5.875% due 05/28/2045 (f)	2,500	1,651
7.375% due 09/18/2043	100	82
		<b>2,106</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 2.1%</b>		
<b>Colombia Government International Bond</b>		
2.625% due 03/15/2023	500	499
3.875% due 02/15/2061	700	382
4.125% due 02/22/2042	200	123
4.125% due 05/15/2051	500	293
4.500% due 03/15/2029	600	516
5.200% due 05/15/2049	800	532
5.625% due 02/26/2044	3,300	2,395
7.375% due 09/18/2037	200	186
7.500% due 02/02/2034	900	854
		<b>5,780</b>
<b>Total Colombia</b>		<b>7,886</b>
<b>(Cost \$10,627)</b>		
<b>COSTA RICA 0.3%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.3%</b>		
<b>Costa Rica Government International Bond</b>		
5.625% due 04/30/2043	1,100	918

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Total Costa Rica (Cost \$864)</b>	<b>\$</b>	<b>918</b>
<b>DOMINICAN REPUBLIC 4.5%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 4.5%</b>		
<b>Dominican Republic Central Bank Notes</b>		
13.000% due 01/30/2026	DOP	80,900 1,455
<b>Dominican Republic International Bond</b>		
4.875% due 09/23/2032	\$	500 420
5.300% due 01/21/2041		500 393
5.500% due 01/27/2025		300 296
5.500% due 02/22/2029		700 651
5.875% due 01/30/2060		1,000 754
5.950% due 01/25/2027		3,500 3,443
6.000% due 07/19/2028		1,300 1,260
6.000% due 02/22/2033		300 273
6.400% due 06/05/2049		600 502
6.875% due 01/29/2026		1,700 1,726
7.050% due 02/03/2031		1,300 1,301
<b>Total Dominican Republic (Cost \$13,177)</b>		<b>12,474</b>
<b>ECUADOR 1.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.2%</b>		
<b>Ecuador Government International Bond</b>		
0.000% due 07/31/2030		710 222
1.500% due 07/31/2040		3,857 1,215
2.500% due 07/31/2035		3,851 1,364
5.500% due 07/31/2030		1,320 644
<b>Total Ecuador (Cost \$4,751)</b>		<b>3,445</b>
<b>EGYPT 2.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 2.4%</b>		
<b>Egypt Government International Bond</b>		
4.750% due 04/11/2025	EUR	100 93
5.625% due 04/16/2030		800 569
5.875% due 02/16/2031	\$	1,200 803
6.375% due 04/11/2031	EUR	500 355
7.300% due 09/30/2033	\$	700 478
7.500% due 02/16/2061		900 529
7.625% due 05/29/2032		1,500 1,067
7.903% due 02/21/2048		1,500 910
8.500% due 01/31/2047		1,500 964
8.875% due 05/29/2050		1,100 712
<b>Egyptian Financial Co. for Sovereign Taskseek</b>		
10.875% due 02/28/2026		197
<b>Total Egypt (Cost \$8,997)</b>		<b>6,677</b>
<b>EL SALVADOR 0.5%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
<b>El Salvador Government International Bond</b>		
7.125% due 01/20/2050		1,300 590
7.625% due 09/21/2034		100 47
7.625% due 02/01/2041		1,000 459
9.500% due 07/15/2052		400 204
<b>Total El Salvador (Cost \$2,864)</b>		<b>1,300</b>
<b>ETHIOPIA 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Ethiopia Government International Bond</b>		
6.625% due 12/11/2024		600 416

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Total Ethiopia (Cost \$600)</b>	<b>\$</b>	<b>416</b>
<b>GEORGIA 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Georgia Government International Bond</b>		
2.750% due 04/22/2026	\$	200 182
<b>Total Georgia (Cost \$179)</b>		<b>182</b>
<b>GHANA 1.0%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.0%</b>		
<b>Republic of Ghana International Bond</b>		
0.000% due 04/07/2025		300 103
7.625% due 05/16/2029		300 113
7.750% due 04/07/2029		700 266
8.125% due 03/26/2032		400 151
8.625% due 04/07/2034		1,200 450
8.750% due 03/11/2061		1,900 698
8.875% due 05/07/2042		1,200 444
8.950% due 03/26/2051		1,600 590
<b>Total Ghana (Cost \$6,755)</b>		<b>2,815</b>
<b>GUATEMALA 0.9%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.9%</b>		
<b>Guatemala Government Bond</b>		
4.650% due 10/07/2041		500 407
4.875% due 02/13/2028		800 767
4.900% due 06/01/2030		600 566
6.125% due 06/01/2050		700 686
<b>Total Guatemala (Cost \$2,748)</b>		<b>2,406</b>
<b>HONG KONG 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Huarong Finance 2017 Co. Ltd.</b>		
4.950% due 11/07/2047		400 268
<b>Huarong Finance 2019 Co. Ltd.</b>		
3.875% due 11/13/2029		200 155
<b>Total Hong Kong (Cost \$2,933)</b>		<b>423</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.8%</b>		
<b>Airport Authority</b>		
2.100% due 03/08/2026 (a)		700 633
2.400% due 03/08/2028 (a)		1,000 871
4.875% due 01/12/2030		700 705
<b>Total Hong Kong (Cost \$2,933)</b>		<b>2,209</b>
<b>HUNGARY 1.8%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.8%</b>		
<b>Hungary Government International Bond</b>		
1.625% due 04/28/2032	EUR	100 78
2.125% due 09/22/2031	\$	800 616
3.125% due 09/21/2051		800 489
5.250% due 06/16/2029		1,600 1,565
5.500% due 06/16/2034		1,200 1,157
6.750% due 09/26/2052		1,200 1,233
<b>Total Hungary (Cost \$5,455)</b>		<b>5,138</b>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>INDIA 0.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>		
3.249% due 02/13/2030	\$	500 428
3.950% due 02/13/2050		300 222
<b>Total India (Cost \$2,581)</b>		<b>650</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.6%</b>		
<b>Export-Import Bank of India</b>		
3.250% due 01/15/2030		1,800 1,559
<b>Total India (Cost \$2,581)</b>		<b>2,209</b>
<b>INDONESIA 5.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 4.5%</b>		
<b>Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT</b>		
3.950% due 03/28/2024		2,200 2,161
<b>Indonesia Asahan Aluminium Persero PT</b>		
5.450% due 05/15/2030		800 781
<b>Pelabuhan Indonesia Persero PT</b>		
4.875% due 10/01/2024		3,100 3,061
<b>Pertamina Persero PT</b>		
6.450% due 05/30/2044		1,700 1,730
6.500% due 11/07/2048		1,700 1,730
<b>Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara</b>		
5.250% due 10/24/2042		2,800 2,460
5.250% due 05/15/2047		200 170
6.150% due 05/21/2048		400 382
<b>Total Indonesia (Cost \$15,018)</b>		<b>12,475</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.7%</b>		
<b>Indonesia Government International Bond</b>		
4.850% due 01/11/2033		500 493
5.650% due 01/11/2053		200 204
<b>Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III</b>		
4.700% due 06/06/2032		1,400 1,375
<b>Total Indonesia (Cost \$15,018)</b>		<b>2,072</b>
<b>IRELAND 0.6%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.6%</b>		
<b>Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC</b>		
6.927% due 02/19/2027		1,657 1,569
<b>Total Ireland (Cost \$1,545)</b>		<b>1,569</b>
<b>ISRAEL 0.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>Israel Electric Corp. Ltd.</b>		
3.750% due 02/22/2032		800 691
5.000% due 11/12/2024		300 295
<b>Total Israel (Cost \$1,109)</b>		<b>986</b>
<b>IVORY COAST 0.9%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.9%</b>		
<b>Ivory Coast Government International Bond</b>		
5.250% due 03/22/2030	EUR	1,900 1,689
5.750% due 12/31/2032	\$	597 546
6.625% due 03/22/2048	EUR	300 221

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Total Ivory Coast (Cost \$3,049)</b>	\$	<b>2,456</b>
<b>JAMAICA 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>TransJamaican Highway Ltd.</b>		
5.750% due 10/10/2036	\$ 377	320
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Jamaica Government International Bond</b>		
7.875% due 07/29/2045	1,000	1,169
<b>Total Jamaica (Cost \$1,377)</b>		<b>1,489</b>
<b>JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>Corsair International Ltd.</b>		
7.772% due 01/28/2027	EUR 900	955
8.122% due 01/28/2029	400	424
<b>Total Jersey, Channel Islands (Cost \$1,453)</b>		<b>1,379</b>
<b>JORDAN 1.0%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.0%</b>		
<b>Jordan Government International Bond</b>		
5.750% due 01/31/2027	\$ 1,300	1,268
5.850% due 07/07/2030	200	181
7.375% due 10/10/2047	600	528
7.750% due 01/15/2028	900	926
<b>Total Jordan (Cost \$3,098)</b>		<b>2,903</b>
<b>KAZAKHSTAN 1.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.1%</b>		
<b>KazMunayGas National Co. JSC</b>		
5.375% due 04/24/2030	1,300	1,175
5.750% due 04/19/2047	1,000	801
6.375% due 10/24/2048	1,000	843
<b>KazTransGas JSC</b>		
4.375% due 09/29/2027	200	181
		<b>3,000</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Kazakhstan Government International Bond</b>		
6.500% due 07/21/2045	700	743
<b>Total Kazakhstan (Cost \$3,815)</b>		<b>3,743</b>
<b>KENYA 0.8%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.8%</b>		
<b>Republic of Kenya Government International Bond</b>		
6.300% due 01/23/2034 (H)	800	609
8.000% due 05/22/2032	1,800	1,543
<b>Total Kenya (Cost \$2,646)</b>		<b>2,152</b>
<b>MALAYSIA 0.9%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.7%</b>		
<b>Petronas Capital Ltd.</b>		
3.404% due 04/28/2061	600	423
4.550% due 04/21/2050	200	181
4.800% due 04/21/2060	900	836

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Petronas Energy Canada Ltd.</b>		
2.112% due 03/23/2028	\$ 600	526
		<b>1,966</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Malaysia Sukuk Global Bhd</b>		
4.080% due 04/27/2046	700	636
<b>Total Malaysia (Cost \$3,395)</b>		<b>2,602</b>
<b>MARSHALL ISLANDS 0.0%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.0%</b>		
<b>Nakilat, Inc.</b>		
6.267% due 12/31/2033	64	69
<b>Total Marshall Islands (Cost \$75)</b>		<b>69</b>
<b>MEXICO 4.3%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 2.4%</b>		
<b>Petroleos Mexicanos</b>		
6.625% due 06/15/2038	3,600	2,516
6.700% due 02/16/2032	1,842	1,466
6.950% due 01/28/2060	2,460	1,583
7.690% due 01/23/2050	700	495
10.000% due 02/07/2033	800	771
		<b>6,831</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.9%</b>		
<b>Mexico Government International Bond</b>		
5.400% due 02/09/2028	800	805
5.750% due 10/12/2110	3,400	3,011
6.350% due 02/09/2035	1,400	1,440
		<b>5,256</b>
<b>Total Mexico (Cost \$14,421)</b>		<b>12,087</b>
<b>MONGOLIA 0.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Mongolia Government International Bond</b>		
3.500% due 07/07/2027	900	756
5.625% due 05/01/2023	400	401
<b>Total Mongolia (Cost \$1,291)</b>		<b>1,157</b>
<b>MOROCCO 0.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>DCP S.A.</b>		
3.750% due 06/23/2031	800	644
5.125% due 06/23/2051	1,000	726
		<b>1,370</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Morocco Government International Bond</b>		
4.000% due 12/15/2050	500	322
<b>Total Morocco (Cost \$2,279)</b>		<b>1,692</b>
<b>NAMIBIA 0.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Namibia Government International Bond</b>		
5.250% due 10/29/2025	500	473
<b>Total Namibia (Cost \$498)</b>		<b>473</b>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>NETHERLANDS 0.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Republic of Angola Via Avenir II BV</b>		
9.687% due 12/07/2023	\$ 340	345
12.638% due 07/03/2023	669	674
<b>Total Netherlands (Cost \$1,007)</b>		<b>1,019</b>
<b>NIGERIA 3.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>BDI Finance BV</b>		
7.500% due 02/16/2027	EUR 1,100	936
<b>SOVEREIGN ISSUES 2.9%</b>		
<b>Nigeria Government International Bond</b>		
6.125% due 09/28/2028	\$ 600	478
6.375% due 07/12/2023	1,000	985
6.500% due 11/28/2027	1,300	1,080
7.143% due 02/23/2030	2,400	1,862
7.375% due 09/28/2033	500	365
7.625% due 11/21/2025	400	362
7.875% due 02/16/2032	400	309
8.250% due 09/28/2051	900	626
8.375% due 03/24/2029	500	422
8.747% due 01/21/2031	1,800	1,492
		<b>7,981</b>
<b>Total Nigeria (Cost \$10,736)</b>		<b>8,917</b>
<b>OMAN 2.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 2.2%</b>		
<b>Oman Government International Bond</b>		
6.000% due 08/01/2029	4,000	4,015
6.500% due 03/08/2047	400	374
6.750% due 01/17/2048	1,100	1,056
7.000% due 01/25/2051	400	396
<b>Oman Sovereign Sukuk Co.</b>		
4.397% due 06/01/2024	200	198
<b>Total Oman (Cost \$5,915)</b>		<b>6,039</b>
<b>PAKISTAN 0.6%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.6%</b>		
<b>Pakistan Government International Bond</b>		
6.875% due 12/05/2027	1,200	540
7.375% due 04/08/2031	700	302
8.875% due 04/08/2051	2,000	830
<b>Total Pakistan (Cost \$3,515)</b>		<b>1,672</b>
<b>PANAMA 2.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.</b>		
5.125% due 08/11/2061	600	472
<b>Banco Nacional de Panama</b>		
2.500% due 08/11/2030	600	478
		<b>950</b>





	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Total Sri Lanka</b>	\$	<b>2,474</b>
<b>(Cost \$5,584)</b>		
<b>SUPRANATIONAL 0.7%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>Eastern &amp; Southern African Trade &amp; Development Bank</b>		
4.125% due 08/30/2028	\$ 900	771
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>African Export-Import Bank</b>		
2.634% due 05/17/2026	1,000	901
<b>Republic of Ghana International Bond</b>		
10.750% due 10/14/2030	200	142
		<b>1,043</b>
<b>Total Supranational</b>		<b>1,814</b>
<b>(Cost \$2,044)</b>		
<b>TUNISIA 0.4%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.4%</b>		
<b>Tunisian Republic</b>		
3.280% due 08/09/2027	¥ 200,000	698
5.625% due 02/17/2024	EUR 400	339
<b>Total Tunisia</b>		<b>1,037</b>
<b>(Cost \$2,245)</b>		
<b>TURKEY 4.5%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 4.5%</b>		
<b>Turkey Government International Bond</b>		
5.125% due 02/17/2028	\$ 500	424
5.750% due 05/11/2047	6,800	4,579
5.875% due 06/26/2031	300	239
6.125% due 10/24/2024	1,900	1,652
6.375% due 10/14/2025	200	188
<b>Turkiye Ihtacat Kredi Bankasi A/S</b>		
8.250% due 01/24/2024	2,800	2,784
9.375% due 01/31/2026	2,600	2,565
<b>Total Turkey</b>		<b>12,431</b>
<b>(Cost \$14,617)</b>		
<b>UKRAINE 0.6%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>NPC Ukrenargo</b>		
6.875% due 11/09/2028	1,200	213
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
<b>Ukraine Government International Bond</b>		
6.876% due 05/21/2031	600	106
7.253% due 03/15/2035	900	157
7.375% due 09/25/2034	1,500	268
7.750% due 09/01/2025	1,900	400
7.750% due 09/01/2026	700	132
7.750% due 09/01/2027	1,000	185
7.750% due 09/01/2029	1,400	270
		<b>1,518</b>
<b>Total Ukraine</b>		<b>1,731</b>
<b>(Cost \$8,530)</b>		
<b>UNITED ARAB EMIRATES 1.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 1.1%</b>		
<b>Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC</b>		
3.650% due 11/02/2029	1,600	1,467
<b>Abu Dhabi Ports Co. PJSC</b>		
2.500% due 05/06/2031	900	744

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>DP World Ltd.</b>		
5.625% due 09/25/2048	\$ 700	\$ 678
<b>MDGH GMTN RSC Ltd.</b>		
3.950% due 05/21/2050	200	166
<b>Total United Arab Emirates</b>		<b>3,055</b>
<b>(Cost \$3,462)</b>		
<b>UNITED KINGDOM 0.8%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC</b>		
9.375% due 03/10/2023	147	107
<b>Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC</b>		
8.250% due 07/09/2026	1,500	315
		<b>422</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.7%</b>		
<b>Polaris PLC</b>		
5.233% due 05/23/2059	GBP 927	1,124
<b>Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC</b>		
5.729% due 02/20/2054	569	712
		<b>1,836</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.0%</b>		
<b>Ukreximbank Via Biz Finance PLC</b>		
9.750% due 01/22/2025	\$ 200	69
<b>Total United Kingdom</b>		<b>2,327</b>
<b>(Cost \$3,705)</b>		
<b>UNITED STATES 5.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>DAE Funding LLC</b>		
2.625% due 03/20/2025	400	375
3.375% due 03/20/2028	200	179
<b>Rutas 2 &amp; 7 Finance Ltd.</b>		
0.000% due 09/30/2036	1,307	829
		<b>1,383</b>
<b>U.S. TREASURY OBLIGATIONS 4.7%</b>		
<b>U.S. Treasury Bonds</b>		
1.750% due 08/15/2041	100	69
2.250% due 05/15/2041	200	152
2.375% due 02/15/2042	1,100	847
3.250% due 05/15/2042	5,300	4,686
3.375% due 08/15/2042	2,700	2,432
4.000% due 11/15/2042	400	395
<b>U.S. Treasury Notes</b>		
3.125% due 08/31/2029	4,700	4,439
		<b>13,020</b>
<b>Total United States</b>		<b>14,403</b>
<b>(Cost \$15,439)</b>		
<b>URUGUAY 1.3%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 1.3%</b>		
<b>Uruguay Government International Bond</b>		
4.975% due 04/20/2055	100	96
7.625% due 03/21/2036	1,490	1,858
7.875% due 01/15/2033	1,340	1,648
<b>Total Uruguay</b>		<b>3,602</b>
<b>(Cost \$3,536)</b>		
<b>UZBEKISTAN 0.1%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
<b>Republic of Uzbekistan International Bond</b>		
3.700% due 11/25/2030	300	242

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
<b>Total Uzbekistan</b>	\$	<b>242</b>
<b>(Cost \$261)</b>		
<b>VENEZUELA 1.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>		
5.500% due 04/12/2037 (b)	\$ 20,990	971
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.8%</b>		
<b>Venezuela Government International Bond (b)</b>		
7.000% due 03/31/2038	10,900	1,172
7.650% due 04/21/2025	4,215	464
9.250% due 09/15/2027	4,520	506
11.950% due 08/05/203	340	37
		<b>2,179</b>
<b>Total Venezuela</b>		<b>3,150</b>
<b>(Cost \$25,720)</b>		
<b>ZAMBIA 0.2%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.2%</b>		
<b>Zambia Government International Bond</b>		
5.375% due 12/20/2049 (b)	1,200	521
<b>Total Zambia</b>		<b>521</b>
<b>(Cost \$1,227)</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 5.3%</b>		
<b>REPURCHASE AGREEMENTS (e) 4.9%</b>		
		13,661
<b>TIME DEPOSITS 0.3%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	1	1
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
3.580% due 03/01/2023	CAD 7	5
4.070% due 03/01/2023	\$ 5	5
<b>BNP Paribas Bank</b>		
6.400% due 03/01/2023	ZAR 20	1
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	¥ 1	0
<b>Citibank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 55	55
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	18	18
<b>HSBC Bank PLC</b>		
1.630% due 03/01/2023	EUR 92	98
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 202	202
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	¥ 2,836	21
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	EUR 1	0
1.630% due 03/01/2023	EUR 12	12
3.170% due 03/01/2023	GBP 34	42
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	¥ 451	3
1.630% due 03/01/2023	EUR 2	2
3.170% due 03/01/2023	GBP 20	24
4.070% due 03/01/2023	\$ 391	391
		<b>880</b>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>MALAYSIA TREASURY BILLS 0.1%</b>		
2.823% due 05/18/2023 (c)	MYR 500	\$ 110
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<b>14,651</b>
(Cost \$ 14,651)		
<b>Total Investments in Securities 99.1%</b>		<b>\$ 275,562</b>
(Cost \$ 357,367)		
<b>Financial Derivative</b>		
Instruments (g/h) 0.4%		1,245
(Cost or Premiums, net \$ 407)		
<b>Other Assets and Liabilities, net 0.5%</b>		<b>1,310</b>
<b>Net Assets 100.0%</b>		<b>\$ 278,117</b>

**NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:**

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.  
 (a) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.  
 (b) Security is in default.  
 (c) Coupon represents a yield to maturity.

**(d) RESTRICTED SECURITIES:**

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	\$ 2,753	\$ 2,216	0.80%

**BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS**

**(e) REPURCHASE AGREEMENTS:**

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保債権	担保受取価値	レポ価値	レポ契約の受取 <sup>(1)</sup>
BOS	4.530%	02/28/2023	03/07/2023	\$ 595	U.S. Treasury Notes 3.875% due 12/31/2027	\$ (595)	\$ 595	\$ 595
DEU	4.530%	02/28/2023	03/07/2023	666	U.S. Treasury Notes 4.125% due 11/15/2032	(669)	666	667
DEU	4.540%	02/28/2023	03/01/2023	12,400	U.S. Treasury Notes 2.875% due 05/15/2032	(12,753)	12,400	12,402
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (14,017)</b>	<b>\$ 13,661</b>	<b>\$ 13,664</b>

**REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:**

取引相手	借入金利 <sup>(2)</sup>	決済日	満期日 <sup>(3)</sup>	借入金額 <sup>(2)</sup>	リバースレポの支払
BPS	3.750%	12/16/2022	TBD	\$ (423)	\$ (426)
BRC	(0.350%)	04/08/2022	TBD	(681)	(679)
NOM	4.570%	02/03/2023	TBD	(654)	(656)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (1,761)</b>

**CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS**

	満期までの残存期間				合計
	オーバーナイト取引	30日以内	31-90日	90日超	
<b>Reverse Repurchase Agreements</b>					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (656)	\$ (656)
Non - U.S. Government Debt	0	0	0	(1,105)	(1,105)
<b>Total Reverse Repurchase Agreements</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (1,761)</b>	<b>\$ (1,761)</b>
<b>Total Borrowings</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (1,761)</b>	<b>\$ (1,761)</b>
<b>Payable for Reverse Repurchase Agreements</b>					<b>\$ (1,761)</b>

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	額面金額	収益	空売りの支払 <sup>(4)</sup>
BCY	U.S. Treasury Notes	3.875%	12/31/2027	\$ 600	\$ (605)	\$ (595)
BPS	U.S. Treasury Bonds	4.125%	11/15/2032	650	(678)	(668)
<b>Total Short Sales (0.5%)</b>					<b>\$ (1,283)</b>	<b>\$ (1,263)</b>

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/received as of February 28, 2023:

(f) Securities with an aggregate market value of \$1,665 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 28, 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 (受取)差入れ	ネット エクスポージャー <sup>(5)</sup>
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 595	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 595	\$ (595)	\$ 0
BPS	0	(426)	0	0	(426)	396	(30)
BRC	0	(679)	0	0	(679)	609	(70)
DEU	13,069	0	0	0	13,069	(13,422)	(353)
NOM	0	(656)	0	0	(656)	660	4
Master Securities Forward Transactions Agreement							
BCY	0	0	0	(595)	(595)	0	(595)
BPS	0	0	0	(668)	(668)	0	(668)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 13,664</b>	<b>\$ (1,761)</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ (1,263)</b>			

<sup>(4)</sup> Includes accrued interest.

<sup>(5)</sup> The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 28, 2023 was \$8,700 at a weighted average interest rate of 1.030%. Average borrowings may include sale buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

<sup>(6)</sup> Open maturity reverse repurchase agreement.

<sup>(7)</sup> Includes \$12 of interest payable on short sales.

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

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

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価 (損) 益	変動証拠金	
					資産	負債
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Short	06/2023	26	\$ 11	\$ 0	\$ 0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2023	117	(7)	3	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2023	85	(4)	5	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Short	06/2023	4	(1)	0	(2)
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (1)</b>	<b>\$ 8</b>	<b>\$ (2)</b>

SWAP AGREEMENTS:

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
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2024	\$ 8,500	\$ (435)	\$ (149)	\$ 23	\$ 0
<b>Total Swap Agreements</b>					<b>\$ (435)</b>	<b>\$ (149)</b>	<b>\$ 23</b>	<b>\$ 0</b>

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 28, 2023:

Cash of \$754 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 28, 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
<b>Total Exchange-Traded or Centrally Cleared</b>	\$ 0	\$ 8	\$ 23	\$ 31	\$ 0	\$(2)	\$ 0	\$(2)

(h) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益		
				資産	負債	
BOA	03/2023	EUR	13,117	\$ 14,271	\$ 361	\$ 0
BOA	03/2023	PEN	2,508	657	0	(2)
BOA	03/2023	ZAR	8,934	510	24	0
BOA	05/2023	\$	657	PEN 2,518	2	0
BOA	07/2023	\$	2,931	ILS 10,040	0	(167)
BOA	08/2023	\$	1,206	4,122	0	(69)
BPS	05/2023	ILS	1,383	\$ 429	50	0
BRC	05/2023	GBP	1,506	1,820	0	(6)
CBK	03/2023	EUR	148	162	5	0
CBK	03/2023	PEN	40,678	10,151	0	(517)
CBK	03/2023	\$	653	PEN 2,511	6	0
CBK	04/2023	ILS	169	\$ 50	3	0
CBK	04/2023	PEN	2,412	599	0	(33)
CBK	04/2023	\$	9,938	PEN 39,750	477	0
CBK	05/2023	ILS	17,029	\$ 5,135	463	0
CBK	06/2023	PEN	7,621	1,960	0	(27)
CBK	07/2023	ILS	10,045	3,140	375	0
CBK	08/2023	\$	4,126	1,279	141	0
DUB	03/2023	ZAR	9,935	575	35	0
GLM	05/2023	\$	1,915	PEN 7,621	77	0
MBC	03/2023	EUR	2,737	\$ 2,951	49	0
MBC	03/2023	JPY	147,100	1,139	59	0
MBC	03/2023	\$	3,115	EUR 2,841	0	(102)
MYI	04/2023	JPY	18,109	\$ 133	0	(1)
MYI	05/2023	\$	5,467	ILS 18,600	0	(364)
NGF	03/2023	\$	954	JPY 128,947	0	(7)
NGF	04/2023	JPY	128,350	\$ 954	7	0
SCX	04/2023	ZAR	25,955	1,411	2	0
SCX	05/2023	MYR	491	110	1	0
UAG	03/2023	\$	13,946	EUR 13,161	11	0
UAG	03/2023	ZAR	5,534	\$ 310	9	0
UAG	04/2023	EUR	13,161	13,973	0	(13)
UAG	09/2023	ZAR	3,921	224	13	0
<b>Total Forward Foreign Currency Contracts</b>				\$ 2,170	\$ (1,308)	

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照債券	固定(支払)金利	満期日	2023年2月28日時点の インプライド クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>	想定元本 <sup>(4)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価(損)益	スワップの価値	
								資産	負債
BOA	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	5.173%	\$ 700	\$ 60	\$ 10	\$ 70	\$ 0
BPS	Oman Government International Bond	(1.000%)	12/20/2027	1.502%	100	3	(2)	1	0
CBK	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	5.173%	400	34	6	40	0
DUB	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	5.173%	300	30	0	30	0
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	4.802%	2,500	311	(159)	152	0
HUS	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.286%	200	(1)	(2)	0	(3)
JPM	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.286%	700	(1)	(9)	0	(10)
JPM	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	5.173%	300	29	1	30	0
					\$ 465	\$ (155)	\$ 323	\$ (13)	

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

取引相手	参照債券	固定受取金利	満期日	2023年2月28日時点の インプライド・クレジット スプレッド <sup>(2)</sup>	想定元本 <sup>(4)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価(損)益	スワップの価値 <sup>(5)</sup>	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2031	3.039%	\$ 300	\$ (43)	\$ 6	\$ 0	\$ (37)
BOA	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.361%	100	0	1	1	0
BOA	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.386%	1,100	1	10	11	0
BOA	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.792%	200	2	0	2	0
BPS	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.399%	100	0	1	1	0
BPS	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	0.736%	700	4	4	8	0
BPS	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.429%	600	(2)	9	7	0
BPS	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.792%	1,000	9	(1)	8	0
BPS	Poland Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.410%	100	0	0	0	0
BPS	Poland Government International Bond	1.000%	12/20/2027	0.937%	100	(1)	1	0	0
BPS	Romania Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.649%	200	(1)	2	1	0
BPS	Romania Government International Bond	1.000%	12/20/2027	2.330%	100	(7)	2	0	(5)
BPS	Serbia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	2.560%	200	(18)	5	0	(13)
BRC	Argentina Government International Bond	5.000%	12/20/2023	16.537%	600	(83)	38	0	(45)
BRC	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.361%	400	1	3	4	0
BRC	ONB Finance Ltd.	1.000%	06/20/2023	0.482%	100	1	0	1	0
BRC	Romania Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.649%	100	(1)	1	0	0
BRC	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.379%	188	2	0	2	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.850%	300	(19)	11	0	(8)
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.458%	200	0	1	1	0
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.501%	200	0	2	2	0
CBK	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.792%	3,600	25	5	30	0
GST	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.361%	700	2	5	7	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	0.922%	600	(1)	15	4	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	12/20/2025	0.678%	5,000	105	(53)	52	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.792%	1,300	13	(2)	11	0
GST	Poland Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.410%	100	0	0	0	0
GST	Poland Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.495%	400	2	2	4	0
GST	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.379%	112	1	0	1	0
JPM	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.641%	800	(18)	11	0	(7)
JPM	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	0.736%	200	1	1	2	0
JPM	Nigeria Government International Bond	1.000%	06/20/2023	4.234%	700	(16)	11	0	(5)
MYC	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.399%	300	1	3	4	0
MYC	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.386%	100	0	1	1	0
						\$ (50)	\$ 95	\$ 165	\$ (120)

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

取引相手	参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 <sup>(4)</sup>	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価(損)益	スワップの価値 <sup>(5)</sup>			
							資産	負債		
BOA	Montenegro Government International Bond	1.000%	06/20/2023	EUR 100	\$ (8)	\$ 7	\$ 0	\$ (1)		
<b>Total Swap Agreements</b>							<b>\$ 407</b>	<b>\$ (53)</b>	<b>\$ 488</b>	<b>\$ (134)</b>

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

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

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

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

<sup>(5)</sup> The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

## マネー・マーケット・マザーファンド

### 《第38期》決算日2023年11月20日

[計算期間：2023年5月23日～2023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38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38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
34期(2021年11月22日)	円 10,182	0.0	—	—	百万円 1,637
35期(2022年5月20日)	10,182	0.0	—	—	2,897
36期(2022年11月21日)	10,181	△0.0	—	—	2,660
37期(2023年5月22日)	10,181	0.0	—	—	2,921
38期(2023年11月20日)	10,181	0.0	—	—	3,393

(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) 2023年5月22日	円 10,181	—	—	—	—
5月末	10,181	0.0	—	—	—
6月末	10,181	0.0	—	—	—
7月末	10,181	0.0	—	—	—
8月末	10,181	0.0	—	—	—
9月末	10,181	0.0	—	—	—
10月末	10,181	0.0	—	—	—
(期末) 2023年11月20日	10,181	0.0	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

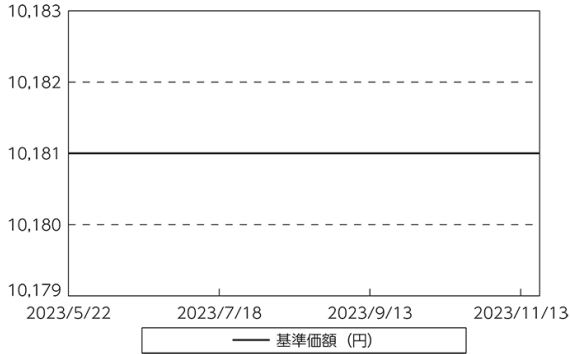
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ横ばいとなりました。

基準価額等の推移



## ●基準価額の変動要因

(上昇要因)

利子等収益が積み上がったことが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.013%となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

## ○今後の運用方針

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

## ○1万口当たりの費用明細

(2023年5月23日～2023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

(2023年5月23日～2023年11月20日)

## その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 322,399,871	千円 321,899,877

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月23日～2023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

(2023年11月20日現在)

## 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,799,997	% 82.5

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

## ○投資信託財産の構成

(2023年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 2,799,997	% 82.5
コール・ローン等、その他	593,717	17.5
投資信託財産総額	3,393,714	100.0



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	3,393,714,808
コール・ローン等	593,717,773
その他有価証券(評価額)	2,799,997,035
(B) 負債	261
未払解約金	43
未払利息	218
(C) 純資産総額(A-B)	3,393,714,547
元本	3,333,531,344
次期繰越損益金	60,183,203
(D) 受益権総口数	3,333,531,344口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,181円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,870,024,150円  
期中追加設定元本額 644,599,674円  
期中一部解約元本額 181,092,480円  
また、1口当たり純資産額は、期末1.0181円です。

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

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	2,228,013,587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	568,143,019円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	110,083,425円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	76,382,303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>	61,991,356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>	38,044,882円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	24,765,135円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	18,468,833円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	13,122,469円
ピムコ・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)	13,053,165円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	10,743,284円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	9,893,887円
マネーボールファンド(FOF用)(適格機関投資家限定)	9,871,149円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(年2回決算型)	9,376,245円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	7,690,306円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)	7,489,236円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	7,196,270円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	6,895,341円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	6,887,212円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)	6,675,966円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	5,812,610円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	5,548,198円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	5,484,593円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,411,821円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(毎月分配型)	4,489,124円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	4,289,171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	3,857,128円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	3,319,056円

## ○損益の状況 (2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 162,931
受取利息	10,911
支払利息	△ 173,842
(B) 当期損益金(A)	△ 162,931
(C) 前期繰越損益金	51,956,485
(D) 追加信託差損益金	11,667,215
(E) 解約差損益金	△ 3,277,566
(F) 計(B+C+D+E)	60,183,203
次期繰越損益金(F)	60,183,203

(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。

ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (毎月決算型)	2,966,566円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	2,724,520円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	2,711,846円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	2,590,474円
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>	2,527,335円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	2,515,903円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,210,674円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	2,119,621円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2,065,331円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,007,890円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	1,628,892円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	1,491,640円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	1,412,860円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	1,339,040円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	1,149,232円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	1,145,161円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	1,074,934円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1,020,693円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (毎月分配型)	907,086円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース> (毎月分配型)	669,935円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	665,580円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	629,892円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	521,457円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型)	416,840円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース> (毎月分配型)	282,290円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	278,281円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	217,015円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	212,322円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	169,198円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (資産成長型)	138,420円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	111,354円
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
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	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
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<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	98,222円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98,222円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	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 /マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97,104円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース> (毎月分配型)	89,620円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89,287円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	74,308円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	60,179円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	50,114円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
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<ブラジルリアルコース> (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> (年1回決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円

バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	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 ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (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
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
合計	3,333,531,344円

## [お 知 ら せ]

- ①新NISA (成長投資枠) の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2023年7月3日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
(2023年10月1日)