

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／内外／債券	
信託期間	2028年9月8日まで（2013年10月25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・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	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）	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - 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・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）	ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンドへの投資を通じて、様々な償還期限の債券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の水準等を考慮し、安定した分配を継続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。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。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

運用報告書（全体版）

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）

第131期（決算日：2024年10月8日）
 第132期（決算日：2024年11月8日）
 第133期（決算日：2024年12月9日）
 第134期（決算日：2025年1月8日）
 第135期（決算日：2025年2月10日）
 第136期（決算日：2025年3月10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/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）」は、去る3月10日に第136期の決算を行いましたので、法令に基づいて第131期～第136期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
フリーダイヤル

0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落 中 率				
	円	円	円	%	%	%	%	百万円
107期(2022年10月11日)	9,184		15	△4.0	—	—	99.0	4,702
108期(2022年11月8日)	9,055		15	△1.2	—	—	99.2	4,582
109期(2022年12月8日)	8,969		15	△0.8	—	—	99.2	4,495
110期(2023年1月10日)	8,670		15	△3.2	—	—	98.5	4,334
111期(2023年2月8日)	8,644		15	△0.1	—	—	98.7	4,239
112期(2023年3月8日)	8,797		15	1.9	—	—	99.3	4,303
113期(2023年4月10日)	8,764		15	△0.2	—	—	99.2	4,278
114期(2023年5月8日)	9,013		15	3.0	—	—	99.2	4,356
115期(2023年6月8日)	9,059		15	0.7	—	—	99.0	4,342
116期(2023年7月10日)	9,096		15	0.6	—	—	98.9	4,297
117期(2023年8月8日)	9,160		15	0.9	—	—	99.0	4,278
118期(2023年9月8日)	9,375		15	2.5	—	—	99.4	4,376
119期(2023年10月10日)	9,214		15	△1.6	—	—	99.4	4,263
120期(2023年11月8日)	9,445		15	2.7	—	—	99.2	4,318
121期(2023年12月8日)	9,354		15	△0.8	—	—	99.0	4,178
122期(2024年1月9日)	9,464		15	1.3	—	—	99.3	4,229
123期(2024年2月8日)	9,711		15	2.8	—	—	99.0	4,261
124期(2024年3月8日)	9,758		15	0.6	—	—	99.2	4,258
125期(2024年4月8日)	9,871		15	1.3	—	—	98.8	4,284
126期(2024年5月8日)	10,050		15	2.0	—	—	99.2	4,325
127期(2024年6月10日)	10,236		15	2.0	—	—	99.4	4,391
128期(2024年7月8日)	10,609		15	3.8	—	—	99.3	4,543
129期(2024年8月8日)	9,895		15	△6.6	—	—	99.5	4,168
130期(2024年9月9日)	9,713		15	△1.7	—	—	99.0	4,064
131期(2024年10月8日)	10,002		15	3.1	—	—	99.4	4,117
132期(2024年11月8日)	10,191		15	2.0	—	—	98.4	4,169
133期(2024年12月9日)	10,113		15	△0.6	—	—	98.0	4,097
134期(2025年1月8日)	10,338		15	2.4	—	—	98.4	4,164
135期(2025年2月10日)	10,068		15	△2.5	—	—	98.0	4,037
136期(2025年3月10日)	9,915		15	△1.4	—	—	97.8	3,970

(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131期	(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
	2024年9月9日	9,713	—	—	—	—	—	—	—	99.0
	9月末	9,790	0.8	—	—	—	—	—	—	99.4
第132期	(期 末)									
	2024年10月8日	10,002	—	—	—	—	—	—	—	99.4
	10月末	10,200	2.0	—	—	—	—	—	—	98.0
第133期	(期 首)									
	2024年11月8日	10,206	2.0	—	—	—	—	—	—	98.4
	11月末	10,191	—	—	—	—	—	—	—	98.4
第134期	(期 末)									
	2024年12月9日	10,128	△0.6	—	—	—	—	—	—	98.0
	12月末	10,122	△0.7	—	—	—	—	—	—	98.0
第135期	(期 首)									
	2025年1月8日	10,113	—	—	—	—	—	—	—	98.0
	1月末	10,355	2.4	—	—	—	—	—	—	98.2
第136期	(期 末)									
	2025年2月10日	10,353	2.4	—	—	—	—	—	—	98.4
	2月末	10,338	—	—	—	—	—	—	—	98.4
第137期	(期 首)									
	2025年3月10日	10,222	△1.1	—	—	—	—	—	—	98.2
	3月末	10,083	△2.5	—	—	—	—	—	—	98.0
第138期	(期 首)									
	2025年2月10日	10,068	—	—	—	—	—	—	—	98.0
	2月末	10,117	0.5	—	—	—	—	—	—	98.2
第139期	(期 末)									
	2025年3月10日	9,930	△1.4	—	—	—	—	—	—	97.8

(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。

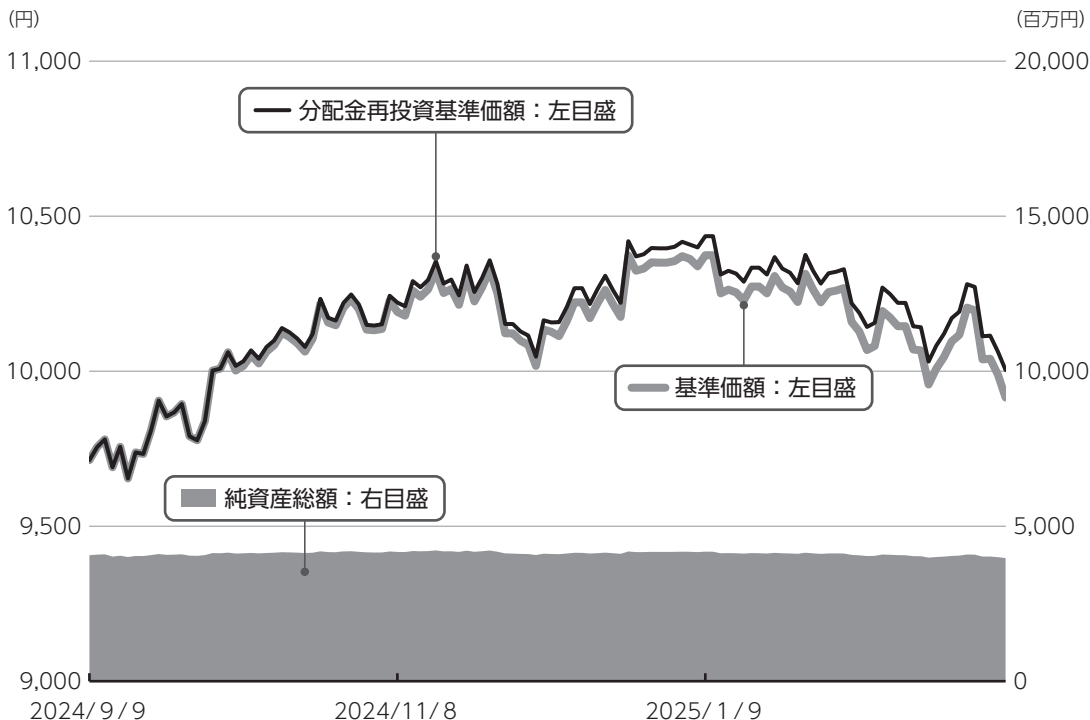
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第131期～第136期：2024年9月10日～2025年3月10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131期首	9,713円
第136期末	9,915円
既払分配金	90円
騰落率	3.0%

(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3.0% (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

米ドルが対円で上昇したことがプラスとなりました。

下落要因

米国債券市況が下落したことがマイナスとなりました。

第131期～第136期：2024年9月10日～2025年3月10日

投資環境について

▶ 債券市況

米国債券市況は下落しました。

期間の初めから2025年1月上旬にかけては2024年12月の米連邦公開市場委員会（FOMC）では利下げが決定されたものの追加利下げには慎重な姿勢が示されたこと等を背景に軟調に推移しました。その後はインフレ鈍化を示唆する米経済指標の結果等を受けて上昇に転じましたが、期間を通じてみると下落しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

期間の初めから2025年1月上旬にかけて

は日米における金利差の拡大や米国の利下げペースが鈍化するとの観測等を背景に、米ドルが円に対して上昇しました。その後は米国長期金利の低下や日銀による利上げ等を受けて米ドルは円に対して下落に転じましたが、期間を通じてみると米ドルは対円で上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は、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

▶ 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)

主として円建ての外国投資信託であるピムコ・トータル・リターン・ファンドⅡ－クラスJ（JPY）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等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。

なお、2025年2月末時点で、円建ての外国投資信託を通じて投資した信用リスク

管理上、政府機関の発行または保証する有価証券と同等と判断した銘柄の実質的な組入比率は、ファニーメイは25.2%、フレディ・マックは13.4%としました。（ネットベース）

▶ ピムコ・トータル・リターン・ファンドⅡ－クラスJ（JPY）

金利戦略およびセクター配分戦略

期間の初めから2024年9月末頃にかけては概ねファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）を市場平均対比で短めとしました。その後は概ね

ファンド全体のデュレーションを市場平均対比で長めとしました。
債券セクターでは、リスクセンチメントの改善等を背景に上昇したエマージング債券の保有等がプラスとなりました。

▶ **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131期 2024年9月10日～ 2024年10月8日	第132期 2024年10月9日～ 2024年11月8日	第133期 2024年11月9日～ 2024年12月9日	第134期 2024年12月10日～ 2025年1月8日	第135期 2025年1月9日～ 2025年2月10日	第136期 2025年2月11日～ 2025年3月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	15 (0.150%)	15 (0.147%)	15 (0.148%)	15 (0.145%)	15 (0.149%)	15 (0.151%)
当期の収益	15	15	15	15	15	15
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,361	2,382	2,394	2,418	2,431	2,444

(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／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）

運用の基本方針にしたがって、引き続き円建て外国投資信託への投資を通じて米ドル建てを中心とする投資適格債券等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・トータル・リターン・ファンドⅡ - クラスJ（JPY）

主要先進国においては、消費や賃金上昇率の正常化が進行していることから、インフレ率は2025年に目標水準に戻っていくと予想されます。先進国の主要中央銀行は、政策金利を中立的な水準に戻すことに焦点を当てており、2025年も引き続き利下げを継続するとみっていますが、トランプ政権の実施する政策や、地政学リスクなど不確実性は複数存在し、金融政策にも影響を与える見通しです。

デュレーション（平均回収期間や金利感応度）は市場平均対比で長めとしていますが、状況に応じて柔軟にコントロールします。

社債については市場全体に対してはやや積極姿勢とし、金融社債等を中心に選択的な保有を継続するほか、バリュエー

ション面で妙味のある政府系モーゲージ債や非政府系モーゲージ債等については組み入れを継続する方針です。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

日銀による金融市場調節方針の下、短期金利は安定した推移を想定しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2024年9月10日～2025年3月10日

1万口当たりの費用明細

項目	第131期～第136期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	78	0.768	(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）	(43)	(0.422)	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）	(33)	(0.329)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.016)	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	78	0.770	

作成期中の平均基準価額は、10,134円です。

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

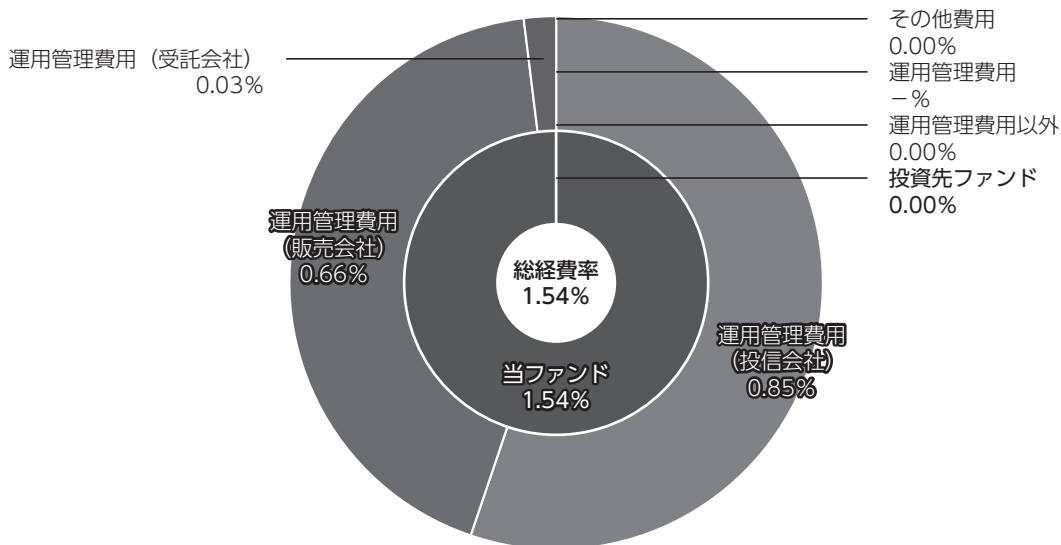
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.54%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.54
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.54
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	－
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.00

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 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9月10日～2025年3月10日)

投資信託証券

銘柄		第131期～第136期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	千口 7	千円 95,534	千口 24	千円 296,600

(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131期～第136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 5,402	千円 5,502

○利害関係人との取引状況等

(2024年9月10日～2025年3月10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

(2025年3月10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130期末	第136期末		
		口数	口数	評価額	比率
	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	千口 349	千口 332	千円 3,883,221	% 97.8
合計		349	332	3,883,221	97.8

(注) 比率は三菱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) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄	第130期末	第136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 5,411	千口 9	千円 10

○投資信託財産の構成

(2025年3月10日現在)

項目	第136期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 3,883,221	% 97.5
マネー・マーケット・マザーファンド	10	0.0
コール・ローン等、その他	98,138	2.5
投資信託財産総額	3,981,369	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第131期末	第132期末	第133期末	第134期末	第135期末	第136期末
	2024年10月8日現在	2024年11月8日現在	2024年12月9日現在	2025年1月8日現在	2025年2月10日現在	2025年3月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,140,298,772	4,185,952,127	4,115,622,905	4,176,151,952	4,049,968,618	3,981,369,418
コール・ローン等	43,324,598	84,616,783	79,136,536	79,435,496	71,791,603	75,937,179
投資信託受益証券(評価額)	4,091,461,432	4,101,234,829	4,015,285,867	4,096,615,934	3,955,766,092	3,883,221,259
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	100,009	100,019	100,039	100,058	10,012	10,015
未収入金	5,412,480	—	21,100,000	—	22,400,000	22,200,000
未収利息	253	496	463	464	911	965
(B) 負債	22,556,549	16,279,090	18,088,245	12,131,108	12,804,159	10,785,278
未払収益分配金	6,175,364	6,137,496	6,077,770	6,041,796	6,014,981	6,006,816
未払解約金	11,384,938	4,700,121	6,558,023	818,315	1,033,950	404
未払信託報酬	4,985,572	5,429,849	5,440,804	5,259,734	5,742,931	4,767,849
その他未払費用	10,675	11,624	11,648	11,263	12,297	10,209
(C) 純資産総額(A-B)	4,117,742,223	4,169,673,037	4,097,534,660	4,164,020,844	4,037,164,459	3,970,584,140
元本	4,116,909,831	4,091,664,326	4,051,846,868	4,027,864,473	4,009,987,979	4,004,544,073
次期繰越損益金	832,392	78,008,711	45,687,792	136,156,371	27,176,480	△ 33,959,933
(D) 受益権総口数	4,116,909.831口	4,091,664.326口	4,051,846.868口	4,027,864.473口	4,009,987.979口	4,004,544.073口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,002円	10,191円	10,113円	10,338円	10,068円	9,915円

○損益の状況

項 目	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
	2024年9月10日～ 2024年10月8日	2024年10月9日～ 2024年11月8日	2024年11月9日～ 2024年12月9日	2024年12月10日～ 2025年1月8日	2025年1月9日～ 2025年2月10日	2025年2月11日～ 2025年3月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	14,139,482	15,557,109	16,429,898	16,366,283	16,996,835	16,003,341
受取配当金	14,133,270	15,547,900	16,415,300	16,352,245	16,974,441	15,975,598
受取利息	6,212	9,209	14,598	14,038	22,394	27,743
(B) 有価証券売買損益	116,054,035	73,202,064	△ 36,459,579	85,683,209	△ 113,585,120	△ 66,332,647
売買益	117,073,598	73,412,209	407,091	85,975,502	168,906	21,793
売買損	△ 1,019,563	△ 210,145	△ 36,866,670	△ 292,293	△ 113,754,026	△ 66,354,440
(C) 信託報酬等	△ 4,996,247	△ 5,441,473	△ 5,452,452	△ 5,270,997	△ 5,755,228	△ 4,778,058
(D) 当期損益金 (A + B + C)	125,197,270	83,317,700	△ 25,482,133	96,778,495	△ 102,343,513	△ 55,107,364
(E) 前期繰越損益金	122,302,744	239,777,187	313,767,525	280,460,004	369,266,962	260,167,061
(F) 追加信託差損益金	△ 240,492,258	△ 238,948,680	△ 236,519,830	△ 235,040,332	△ 233,731,988	△ 233,012,814
(配当等相当額)	(465,477,675)	(462,765,286)	(458,432,737)	(455,859,688)	(454,230,471)	(454,386,483)
(売買損益相当額)	(△ 705,969,933)	(△ 701,713,966)	(△ 694,952,567)	(△ 690,900,020)	(△ 687,962,459)	(△ 687,399,297)
(G) 計 (D + E + F)	7,007,756	84,146,207	51,765,562	142,198,167	33,191,461	△ 27,953,117
(H) 収益分配金	△ 6,175,364	△ 6,137,496	△ 6,077,770	△ 6,041,796	△ 6,014,981	△ 6,006,816
次期繰越損益金 (G + H)	832,392	78,008,711	45,687,792	136,156,371	27,176,480	△ 33,959,933
追加信託差損益金	△ 240,492,258	△ 238,948,680	△ 236,519,830	△ 235,040,332	△ 233,731,988	△ 233,012,814
(配当等相当額)	(465,477,675)	(462,765,286)	(458,432,737)	(455,859,688)	(454,230,471)	(454,386,483)
(売買損益相当額)	(△ 705,969,933)	(△ 701,713,966)	(△ 694,952,567)	(△ 690,900,020)	(△ 687,962,459)	(△ 687,399,297)
分配準備積立金	506,817,182	512,033,017	511,779,595	518,089,347	520,622,581	524,361,626
繰越損益金	△ 265,492,532	△ 195,075,626	△ 229,571,973	△ 146,892,644	△ 259,714,113	△ 325,308,745

(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 4,185,314,478円

 作成期中追加設定元本額 18,766,713円

 作成期中一部解約元本額 199,537,118円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9915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33,959,933円です。

③分配金の計算過程

項 目	2024年9月10日～ 2024年10月8日	2024年10月9日～ 2024年11月8日	2024年11月9日～ 2024年12月9日	2024年12月10日～ 2025年1月8日	2025年1月9日～ 2025年2月10日	2025年2月11日～ 2025年3月10日
費用控除後の配当等収益額	13,597,729円	14,603,231円	10,977,458円	15,520,825円	11,241,607円	11,225,283円
費用控除後・繰越大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	465,477,675円	462,765,286円	458,432,737円	455,859,688円	454,230,471円	454,386,483円
分配準備積立金額	499,394,817円	503,567,282円	506,879,907円	508,610,318円	515,395,955円	519,143,159円
当ファンドの分配対象収益額	978,470,221円	980,935,799円	976,290,102円	979,990,831円	980,868,033円	984,754,925円
1万口当たり収益分配対象額	2,376円	2,397円	2,409円	2,433円	2,446円	2,459円
1万口当たり分配金額	15円	15円	15円	15円	15円	15円
収益分配金金額	6,175,364円	6,137,496円	6,077,770円	6,041,796円	6,014,981円	6,006,816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49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131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
1万口当たり分配金（税込み）	15円	15円	15円	15円	15円	15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)

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Luxembourg Trust IV Annual Report 31 May 2024版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは、「ピムコ・トータル・リターン・ファンドII」で掲載しています。また、「ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド」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・トータル・リターン・ファンドII

(2023年6月1日～2024年5月31日)

	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII
	千米ドル
投資収入：	
マスターファンドからの配当収入	23
収入合計	23
費用：	
管理費	0
税金	0
分配金	0
エージェンシー費	0
支払利息	0
その他費用	0
費用合計	0
投資純収入	23
実現純利益(損失)：	
投資有価証券	821
為替および為替予約取引	(3,001)
実現純利益(損失)	(2,180)
未実現評価益(評価損)の純変動：	
投資有価証券	963
為替および為替予約取引	463
未実現評価益(評価損)の純変動	1,426
運用による純資産の純増(減)額	(731)

(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・トータル・リターン・ファンドII

(2023年6月1日～2024年5月31日)

	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII
	千米ドル
純資産期首	63,544
投資信託証券の発行	0
分配金額	(2,212)
分配金再投資	2,212
投資信託証券の償還	(8,400)
運用による増(減)額	(731)
純資産期末	54,413

(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・トータル・リターン・ファンドII
 (2024年5月31日現在)

銘柄	額	時価	増減率	銘柄	口数	時価	増減率
(単位:千)	(単位:千)	比率(%)	(単位:千)	(単位:千)	比率(%)	(単位:千)	比率(%)
TRANSFERABLE SECURITIES				INVESTMENT FUNDS			
SHORT-TERM INSTRUMENTS				COLLECTIVE INVESTMENT SCHEMES			
U.S. TREASURY BILLS				PIMCO Total Return Strategy Fund (c)			
5.403% due 10/09/2024 (a)(b)	\$ 600	\$ 591	1.09	428,680	\$ 53,729	98.74	
Total Short-Term Instruments		591	1.09	Total Investment Funds		\$ 53,729	98.74
Total Transferable Securities		\$ 591	1.09				

OTC FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*, except number of contracts)

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

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価(損)益	対純資産比率(%)
BPS	06/2024	\$ 64	¥ 10,100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0.00

HEDGED FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

As at 31 May 2024, the Class J (JPY, Hedged) Units had the following forward foreign currency contracts outstanding:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価(損)益	対純資産比率(%)
BPS	06/2024	¥ 659,541	\$ 4,201	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0.01
	06/2024	\$ 3,080	¥ 479,985	0	(25)	(25)	(0.05)
	07/2024	4,149	648,676	0	(4)	(4)	(0.01)
BRC	06/2024	¥ 48,699	\$ 310	0	0	0	0.00
CBK	06/2024	9,155	58	0	0	0	0.00
FAR	06/2024	656,024	4,183	9	0	9	0.02
	06/2024	\$ 2,865	¥ 443,604	0	(42)	(42)	(0.08)
	07/2024	4,183	653,226	0	(8)	(8)	(0.02)
MBC	06/2024	¥ 590,393	\$ 3,760	3	0	3	0.01
	07/2024	\$ 3,732	¥ 583,651	0	(2)	(2)	0.00
MYI	06/2024	4,184	649,067	0	(55)	(55)	(0.10)
SCX	06/2024	¥ 5,186	\$ 33	0	0	0	0.00
SSB	06/2024	13,002	85	2	0	2	0.00
TOR	06/2024	\$ 2,632	¥ 408,297	0	(34)	(34)	(0.06)
UAG	07/2024	¥ 1,036	\$ 7	0	0	0	0.00
				\$ 18	\$ (170)	\$ (152)	(0.28)
Total OTC Financial Derivative Instruments						\$ (152)	(0.28)
Total Investments						\$ 54,168	99.55
Other Current Assets & Liabilities						\$ 245	0.45
Net Assets						\$ 54,413	100.00

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (amounts in thousands*):

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

- (a) Zero coupon security.
- (b) Coupon represents a yield to maturity.
- (c) Affiliated to the Fund.

Collateral (Received)/Pledged for OTC Financial Derivative Instruments

The following is a summary by counterparty of the fair value of OTC financial derivative instruments and collateral (received)/pledged as at 31 May 2024:

取引相手	店頭派生商品の価値	担保(受取)差入れ	ネットエクスポージャー ⁽¹⁾
BPS	\$ (25)	\$ 0	\$ (25)
FAR	(41)	0	(41)
MBC	1	0	1
MYI	(55)	0	(55)
SSB	2	0	2
TOR	(34)	0	(34)

⁽¹⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. See Note 5, Market and Credit Risk, in the Notes to Financial Statements for more information regarding credit and counterparty risk.

(B) ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド
(2024年5月31日現在)

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	
TRANSFERABLE SECURITIES												
AUSTRALIA												
CORPORATE BONDS & NOTES												
Commonwealth Bank of Australia	500	502	0.16	Altera S.C.A.	900	876	0.27	OCP Euro CLO DAC	1,200	1,297	0.40	
5.316% due 13/03/2026				1.875% due 17/01/2028				4.777% due 22/09/2034				
Santos Finance Ltd.	600	628	0.19	BNP Paribas S.A.	1,400	1,248	0.39	Palmer Square European Loan Funding DAC	676	725	0.23	
6.875% due 19/09/2033				1.904% due 30/09/2028	300	298	0.09	4.626% due 15/10/2031	586	631	0.20	
Toyota Finance Australia Ltd.	200	214	0.07	5.125% due 13/01/2029				4.686% due 15/04/2031				
3.386% due 18/03/2030				BPCE S.A.	200	217	0.07	Purple Finance CLO DAC	115	124	0.04	
Total Australia		1,344	0.42	3.875% due 11/01/2029				4.682% due 25/01/2031				
				5.748% due 19/07/2033	800	795	0.25	Rockford Tower Europe CLO DAC	600	648	0.20	
				6.612% due 19/10/2027	600	610	0.19	5.220% due 24/04/2037				
				Credit Agricole S.A.	1,000	944	0.30	Segovia European CLO DAC	1,878	2,040	0.64	
				0.500% due 21/09/2029				4.674% due 18/01/2031	998	1,084	0.34	
				Electricite de France S.A.	600	651	0.20	4.777% due 20/07/2032				
				3.750% due 05/06/2027	600	662	0.21	Toro European CLO DAC	243	264	0.08	
				4.250% due 25/01/2032	300	304	0.09	4.646% due 15/10/2030	1,000	1,081	0.34	
				5.700% due 23/05/2028				4.832% due 12/01/2032				
				RCI Banque S.A.	1,200	1,300	0.41				19,570	6.12
				2.000% due 11/07/2024				CORPORATE BONDS & NOTES				
				Societe Generale S.A.	1,200	1,122	0.35	AerCap Ireland Capital DAC	300	298	0.09	
				1.488% due 14/12/2026	400	409	0.13	2.875% due 14/08/2024	400	406	0.13	
				6.446% due 10/01/2029				6.100% due 15/01/2027				
				Worldline S.A.	300	320	0.10	AIB Group PLC	1,200	1,259	0.39	
				4.125% due 12/09/2028				2.875% due 30/05/2031				
				Total France		9,756	3.05	SMBIC Aviation Capital Finance DAC	500	498	0.16	
								5.450% due 03/05/2028				
											2,461	0.77
				GERMANY								
				CORPORATE BONDS & NOTES								
				Deutsche Bank AG	100	107	0.03	NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES				
				1.750% due 19/11/2030	1,100	1,050	0.33	Primrose Residential DAC	1,021	1,108	0.35	
				3.961% due 26/11/2025	1,300	1,288	0.40	5.147% due 24/03/2061			23,139	7.24
				DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main	400	436	0.14	Total Ireland				
				4.464% due 16/11/2026				ISRAEL				
				Schaeffler AG	600	658	0.21	SOVEREIGN ISSUES				
				4.750% due 14/08/2029				Israel Government International Bond				
				Volkswagen Leasing GmbH	500	542	0.17	5.000% due 30/10/2026				
				3.875% due 11/10/2028		4,081	1.28	700				
				Total Germany				772				
								0.24				
				INDIA								
				CORPORATE BONDS & NOTES								
				ReNew Wind Energy AP2	1,000	902	0.28	ITALY				
				4.500% due 14/07/2028				CORPORATE BONDS & NOTES				
				IRELAND								
				ASSET-BACKED SECURITIES								
				Aqueduct European CLO DAC	667	723	0.23	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	800	908	0.28	
				4.537% due 20/07/2030				6.750% due 05/09/2027				
				Ares European CLO DAC	847	918	0.29	Intesa Sampaolo SpA	700	753	0.24	
				4.686% due 15/10/2031				7.200% due 28/11/2033				
				Aurium CLO DAC	600	650	0.20	Nesi SpA	500	493	0.15	
				4.852% due 22/06/2034				2.125% due 30/04/2029				
				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC	600	649	0.20	Total Italy			2,154	0.67
				4.816% due 15/01/2033				JAPAN				
				Bosphorus CLO DAC	737	800	0.25	CORPORATE BONDS & NOTES				
				4.760% due 15/12/2030				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1,700	1,625	0.51	
				Bridgepoint CLO DAC	1,000	1,088	0.34		5.719% due 20/02/2026	500	500	0.16
				Cumulus Static CLO DAC	600	651	0.20	Mizuho Financial Group, Inc.	1,100	912	0.28	
				5.025% due 15/11/2033				2.201% due 10/07/2031	500	500	0.16	
				CVC Cordatus Loan Fund DAC	1,060	1,149	0.36	Nissan Motor Co. Ltd.	1,400	1,292	0.40	
				4.556% due 15/10/2031				4.810% due 17/09/2030				
				GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC	909	989	0.31	Nomura Holdings, Inc.	100	88	0.03	
				4.797% due 20/01/2032				2.172% due 14/07/2028	600	600	0.19	
				Harvest CLO DAC	1,100	1,190	0.37	5.709% due 09/01/2026	100	104	0.13	
				4.756% due 15/01/2032				5.842% due 18/01/2028	500	506	0.16	
				Invesco Euro CLO DAC	1,100	1,180	0.37	ORIX Corp.				
				4.556% due 15/07/2031				1.919% due 20/04/2026	900	940	0.29	
				Madison Park Euro Funding DAC	800	864	0.27	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
				4.706% due 15/07/2032				1.902% due 17/09/2028	700	610	0.19	
				Marlay Park CLO DAC	760	825	0.26	5.520% due 13/01/2028	400	404	0.13	
				4.646% due 15/10/2030							7,977	2.50
								SOVEREIGN ISSUES				
								Japan Finance Organization for Municipalities				
								2.875% due 23/01/2029				
								€ 600				
								639				
								0.20				
								Total Japan				
								8,616				
								2.70				

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
LUXEMBOURG			
CORPORATE BONDS & NOTES			
CPI Property Group S.A. 2.750% due 12/05/2026	€ 900	\$ 900	0.28
Logicor Financing SARL 2.000% due 17/01/2034 2.750% due 15/01/2030	900	761	0.24
	€ 1,200	1,279	0.40
Total Luxembourg		2,940	0.92
MEXICO			
SOVEREIGN ISSUES			
Mexico Government International Bond 2.750% due 27/11/2031 (b)	MXN 14,669	728	0.23
3.000% due 03/12/2026 (b)	4,401	236	0.08
4.000% due 30/11/2028 (b)	7,660	421	0.13
4.000% due 24/08/2034 (b)	2,608	138	0.04
6.000% due 07/05/2036	\$ 200	197	0.06
7.000% due 03/09/2026	MXN 24,000	1,288	0.40
8.500% due 01/03/2029	10,600	598	0.19
8.500% due 31/05/2029	1,200	67	0.02
Total Mexico		3,663	1.15
NETHERLANDS			
CORPORATE BONDS & NOTES			
ABN AMRO Bank NV 6.339% due 18/09/2027 6.575% due 13/10/2026	\$ 600	607	0.19
	300	303	0.10
Cooperative Rabobank UA 4.375% due 04/08/2025 4.655% due 22/08/2028	1,000	983	0.31
	800	780	0.24
CTP NV 0.500% due 21/06/2025 0.625% due 27/09/2026	€ 283	295	0.09
	1,000	1,002	0.31
Enel Finance International NV 0.625% due 28/05/2029 1.875% due 12/07/2028 3.375% due 23/07/2028	700	655	0.21
	\$ 1,200	1,056	0.33
	€ 600	643	0.20
ING Groep NV 4.000% due 12/02/2035	600	656	0.21
JDE Peet's NV 4.125% due 23/01/2030	1,500	1,635	0.51
JT International Financial Services BV 3.875% due 28/09/2028	\$ 600	568	0.18
OCI NV 6.700% due 16/03/2033	300	297	0.09
Sandoz Finance BV 4.500% due 17/11/2033	€ 400	451	0.14
Total Netherlands		9,931	3.11
PORTUGAL			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Banco Espirito Santo S.A. 4.750% due 15/01/2018 ^	800	252	0.08
ROMANIA			
SOVEREIGN ISSUES			
Romania Government International Bond 5.375% due 22/03/2031	600	650	0.20
SAUDI ARABIA			
SOVEREIGN ISSUES			
Saudi Arabia Government International Bond 4.750% due 16/01/2030	\$ 700	685	0.21
SINGAPORE			
CORPORATE BONDS & NOTES			
DBS Group Holdings Ltd. 5.961% due 12/09/2025	700	702	0.22
SOUTH AFRICA			
SOVEREIGN ISSUES			
South Africa Government International Bond 10.500% due 21/12/2026	ZAR 32,400	1,766	0.55

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
SOUTH KOREA			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Kookmin Bank 4.500% due 01/02/2029 (c)	\$ 1,200	\$ 1,142	0.36
SPAIN			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 1.125% due 18/09/2025	700	661	0.21
Banco Santander S.A. 1.849% due 25/03/2026 5.522% due 14/03/2028	800	749	0.23
	600	597	0.19
EDP Servicios Financieros Espana S.A. 3.500% due 16/07/2030	€ 500	534	0.17
Lorca Telecom Bondco S.A. 5.750% due 30/04/2029	300	334	0.10
Total Spain		2,875	0.90
SUPRANATIONAL			
CORPORATE BONDS & NOTES			
European Investment Bank 0.750% due 15/11/2024	€ 1,500	1,873	0.59
International Development Association 0.750% due 21/09/2028	800	870	0.27
1.750% due 05/05/2037	€ 800	733	0.23
Total		3,476	1.09
SOVEREIGN ISSUES			
European Union 0.000% due 04/10/2028 (a)	1,000	956	0.30
Total Supranational		4,432	1.39
SWEDEN			
CORPORATE BONDS & NOTES			
EQT AB 2.375% due 06/04/2028 2.875% due 06/04/2032	800	813	0.26
	800	780	0.24
Sagax AB 1.125% due 30/01/2027	1,000	999	0.31
Total Sweden		2,592	0.81
SWITZERLAND			
CORPORATE BONDS & NOTES			
UBS Group AG 2.193% due 05/06/2026 4.125% due 09/06/2033 5.699% due 08/02/2035 5.711% due 12/01/2027 6.327% due 22/12/2027	\$ 1,700	1,640	0.51
	€ 800	874	0.28
	\$ 900	899	0.28
	800	800	0.25
	600	609	0.19
Total Switzerland		4,822	1.51
UNITED KINGDOM			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Babcock International Group PLC 1.375% due 13/09/2027	€ 900	899	0.28
Barclays PLC 4.506% due 31/01/2033 5.851% due 21/03/2035 7.325% due 02/11/2026 7.385% due 02/11/2028	600	663	0.21
	€ 500	631	0.20
	\$ 500	510	0.16
	400	421	0.13
BAT International Finance PLC 5.931% due 02/02/2029	700	715	0.22
Berkeley Group PLC 2.500% due 11/08/2031	€ 800	780	0.25
Chanel Ceres PLC 0.500% due 31/07/2026	€ 700	706	0.22
HSBC Holdings PLC 7.390% due 03/11/2028	\$ 1,000	1,056	0.33
Imperial Brands Finance PLC 3.500% due 26/07/2026	1,100	1,052	0.33
Informa PLC 2.125% due 06/10/2025	€ 1,200	1,273	0.40
Lloyds Banking Group PLC 5.750% due 07/03/2025	AUD 1,000	668	0.21

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)			
National Westminster Bank PLC 5.681% due 28/03/2029				€ 700	\$ 892	0.28
Nationwide Building Society 6.557% due 18/10/2027				\$ 600	612	0.19
Rolls-Royce PLC 5.750% due 15/10/2027				800	800	0.25
Santander UK Group Holdings PLC 6.833% due 21/11/2026				700	711	0.22
Standard Chartered PLC 6.301% due 09/01/2029 7.776% due 16/11/2025				700	715	0.22
	500	504	0.16			
Thames Water Utilities Finance PLC 8.250% due 25/04/2040				€ 500	615	0.19
Yorkshire Building Society 3.511% due 11/10/2030				800	921	0.29
		15,144	4.74			
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES						
Alba PLC 5.519% due 17/03/2039				208	259	0.08
Euroail PLC 6.299% due 13/06/2045				338	430	0.13
Great Hall Mortgages PLC 5.744% due 18/06/2039				\$ 207	206	0.06
Ludgate Funding PLC 5.951% due 01/01/2061				€ 538	672	0.21
Newgate Funding PLC 5.522% due 01/12/2050				428	531	0.17
Resloc UK PLC 4.100% due 15/12/2043 5.510% due 15/12/2043				€ 838	885	0.28
	€ 574	714	0.22			
Ripon Mortgages PLC 5.934% due 28/08/2056 6.384% due 28/08/2056				873	1,111	0.35
	1,400	1,777	0.56			
RMAC PLC 6.434% due 15/02/2047				679	869	0.27
Towd Point Mortgage Funding PLC 0.000% due 20/07/2053 6.583% due 20/07/2045				700	893	0.28
	470	599	0.19			
Uroga Securities PLC 5.552% due 10/10/2040				1,015	1,266	0.40
		10,212	3.20			
SOVEREIGN ISSUES						
United Kingdom Gilt 4.375% due 31/07/2054				1,360	1,628	0.51
Total United Kingdom		26,984	8.45			
UNITED STATES						
ASSET-BACKED SECURITIES						
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5.689% due 25/04/2037				\$ 169	267	0.08
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 6.384% due 25/10/2034				472	452	0.14
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 6.219% due 25/01/2036				434	432	0.14
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 5.979% due 25/12/2034 6.399% due 25/03/2047				783	760	0.24
	1,391	1,039	0.33			
CSAA Home Equity Trust 5.799% due 23/07/2037				159	144	0.04
Home Equity Asset Trust 6.219% due 25/10/2034				296	291	0.09
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 6.024% due 25/05/2035				488	479	0.15
Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Authority 5.048% due 01/12/2034				500	493	0.15
MFI LLC 7.470% due 19/06/2037				700	703	0.22
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5.874% due 25/03/2036				204	203	0.06

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				Constellation Energy Generation LLC				Mercedes-Benz Finance North America LLC			
6.129% due 25/11/2035	\$ 622	\$ 584	0.18	5.600% due 01/03/2028	\$ 400	\$ 404	0.13	4.800% due 30/03/2028	\$ 700	\$ 692	0.22
Residential Asset Mortgage Products Trust				Corebridge Global Funding				Morgan Stanley			
6.009% due 25/01/2036	665	646	0.20	5.750% due 02/07/2026	200	200	0.06	5.050% due 28/01/2027	600	596	0.19
Residential Asset Securities Corp. Trust				5.900% due 19/09/2028	400	407	0.13	6.138% due 16/10/2026	600	604	0.19
5.871% due 25/01/2034	157	157	0.05	Crown Castle, Inc.				6.407% due 01/11/2029	400	416	0.13
6.069% due 25/12/2035	153	149	0.05	3.650% due 01/09/2027	600	569	0.18	Morgan Stanley Bank N.A.			
Structured Asset Investment Loan Trust				4.800% due 01/09/2028	600	586	0.18	6.436% due 14/01/2028	700	706	0.22
6.159% due 25/10/2035	225	216	0.07	CVS Health Corp.				National Securities Clearing Corp.			
6.204% due 25/08/2035	621	595	0.19	5.000% due 30/01/2029	500	493	0.15	5.000% due 30/05/2028	550	548	0.17
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.				CVS Pass-Through Trust				5.100% due 2/11/2027	500	500	0.16
5.169% due 01/04/2041	500	496	0.16	6.943% due 10/01/2030	41	42	0.01	Nextera Energy Capital Holdings, Inc.			
		8,106	2.54	DTE Energy Co.				3.550% due 01/05/2025	1,500	1,431	0.45
				5.100% due 01/03/2029	700	691	0.22	6.051% due 01/03/2025	400	401	0.13
				Duke Energy Florida LLC				Niagara Mohawk Power Corp.			
				2.500% due 01/12/2029	700	615	0.19	4.278% due 15/12/2028	1,600	1,517	0.47
				Edison International				Nissan Motor Acceptance Co. LLC			
				3.550% due 15/11/2024	900	891	0.28	2.450% due 15/09/2028	1,360	1,175	0.37
				Emory University				Ohio Power Co.			
				2.143% due 01/09/2030	1,400	1,187	0.37	5.000% due 01/06/2033	500	483	0.15
				Energy Transfer LP				Omega Healthcare Investors, Inc.			
				4.400% due 15/03/2027	600	585	0.18	4.500% due 15/01/2025	1,200	1,189	0.37
				6.050% due 01/12/2026	300	304	0.09	Oncor Electric Delivery Co. LLC			
				EPR Properties				4.300% due 15/05/2028	500	488	0.15
				4.950% due 15/04/2028	1,600	1,529	0.48	ONEOK, Inc.			
				Equinix, Inc.				5.850% due 15/01/2026	600	603	0.19
				2.625% due 18/11/2024	1,300	1,282	0.40	Oracle Corp.			
				Equitable Financial Life Global Funding				4.650% due 06/05/2030	300	292	0.09
				5.450% due 03/03/2028	300	299	0.09	6.150% due 09/11/2029 (d)	300	313	0.10
				Eversource Energy				Pacific Gas & Electric Co.			
				4.750% due 15/05/2026	600	591	0.18	3.150% due 01/01/2026	800	769	0.24
				Exelon Corp.				4.550% due 01/07/2030	700	661	0.21
				5.150% due 15/03/2028	500	498	0.16	6.100% due 15/01/2029	700	715	0.22
				FirstEnergy Pennsylvania Electric Co.				Pacific Life Global Funding			
				5.200% due 01/04/2028	300	299	0.09	4.900% due 04/04/2028	400	395	0.12
				Florida Power & Light Co.				5.500% due 18/07/2028	300	303	0.09
				5.050% due 01/04/2028	500	501	0.16	PacificCorp			
				Ford Motor Credit Co. LLC				5.300% due 15/02/2031	700	692	0.22
				4.125% due 17/08/2027	200	190	0.06	Paramount Global			
				5.800% due 08/03/2029	200	199	0.06	2.900% due 15/01/2027	100	92	0.03
				7.350% due 04/11/2027	300	312	0.10	Penske Truck Leasing Co. LP			
				Georgia Power Co.				3.450% due 01/07/2024	1,200	1,198	0.37
				5.004% due 23/02/2027	700	699	0.22	Pioneer Natural Resources Co.			
				GLP Capital LP				5.100% due 29/03/2026	300	299	0.09
				5.300% due 15/01/2029	1,100	1,077	0.34	Public Service Co. of Colorado			
				Goldman Sachs Group, Inc.				1.900% due 15/01/2031	1,100	891	0.28
				3.272% due 29/09/2025	1,800	1,785	0.56	Republic Services, Inc.			
				5.727% due 25/04/2030	500	507	0.16	3.375% due 15/11/2027	500	474	0.15
				6.484% due 24/10/2029	500	520	0.16	Retail Opportunity Investments Partnership LP			
				Golub Capital BDC, Inc.				6.750% due 15/10/2028	600	618	0.19
				7.050% due 05/12/2028	700	716	0.22	RGA Global Funding			
				Goodman U.S. Finance Four LLC				6.000% due 2/11/2028	600	616	0.19
				4.500% due 15/10/2037	1,400	1,184	0.37	Santander Holdings USA, Inc.			
				Hyundai Capital America				6.499% due 09/03/2029	575	586	0.18
				1.000% due 17/09/2024	550	542	0.17	SBA Tower Trust			
				1.650% due 17/09/2026	1,100	1,007	0.32	2.328% due 15/07/2052	1,100	981	0.31
				5.250% due 08/01/2027	700	696	0.22	Southern California Edison Co.			
				6.510% due 04/08/2025	300	302	0.09	5.850% due 01/11/2027	800	816	0.26
				Intel Corp.				Southern Power Co.			
				5.125% due 10/02/2030	500	500	0.16	0.900% due 15/01/2026	1,000	929	0.29
				Jackson National Life Global Funding				Southwest Airlines Co.			
				6.506% due 28/06/2024	450	450	0.14	5.250% due 04/05/2025	300	299	0.09
				JPMorgan Chase & Co.				Southwest Gas Corp.			
				3.509% due 23/01/2029	600	565	0.18	5.450% due 23/03/2028	500	502	0.16
				3.900% due 29/01/2027	900	878	0.27	Sutter Health			
				4.523% due 26/04/2028	200	195	0.06	5.164% due 15/08/2033	700	698	0.22
				5.299% due 24/07/2029	700	699	0.22	T-Mobile USA, Inc.			
				6.070% due 22/10/2027	600	610	0.19	2.050% due 15/02/2028	200	179	0.06
				6.558% due 23/01/2028	700	710	0.22	4.800% due 15/07/2028	300	295	0.09
				Kilroy Realty LP				4.950% due 15/03/2028	600	594	0.19
				6.250% due 15/01/2036	300	288	0.09	Tapestry, Inc.			
				Marriott International, Inc.				5.350% due 27/11/2025	€ 400	439	0.14
				3.500% due 15/10/2032	1,400	1,210	0.38	Trust Financial Corp.			
				5.450% due 15/09/2026	500	502	0.16	4.873% due 26/01/2029	\$ 300	294	0.09
				MassMutual Global Funding				U.S. Bancorp			
				5.050% due 07/12/2027	600	598	0.19	4.653% due 01/02/2029	500	487	0.15
				6.335% due 10/07/2026	400	404	0.13				

WRITTEN OPTIONS

FUTURE STYLED COMMODITY OPTIONS

銘柄	ストライクプライス	満期日	契約数	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
Put - EUREX Euro-Bund July 2024 Futures	€ 130.000	21/06/2024	3	\$ (1)	\$ (3)	0.00
Call - EUREX Euro-Bund July 2024 Futures	133.000	21/06/2024	3	(1)	0	0.00
				\$ (2)	\$ (3)	0.00

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

銘柄	ストライクプライス	満期日	契約数	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note July 2024 Futures	\$ 108.000	21/06/2024	3	\$ (1)	\$ (1)	0.00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note July 2024 Futures	111.000	21/06/2024	3	(1)	0	0.00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2024 Futures	114.000	21/06/2024	3	(1)	(1)	0.00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August 2024 Futures	118.500	21/06/2024	3	(1)	(1)	0.00
				\$ (4)	\$ (3)	0.00

Total Financial Derivative Instruments Dealt in on a Regulated Market

\$ 61 0.02

CENTRALLY CLEARED FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*)

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

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

参照資産	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
AT&T, Inc.	1.000%	20/06/2024	\$ 1,500	\$ 0	0.00
AT&T, Inc.	1.000	20/12/2027	600	3	0.00
Ford Motor Co.	5.000	20/12/2028	800	23	0.01
General Electric Co.	1.000	20/06/2024	300	0	0.00
General Electric Co.	1.000	20/12/2024	1,300	(1)	0.00
T-Mobile USA, Inc.	5.000	20/06/2028	300	0	0.00
Verizon Communications, Inc.	1.000	20/12/2027	100	1	0.00
Verizon Communications, Inc.	1.000	20/06/2028	1,000	7	0.00
Verizon Communications, Inc.	1.000	20/12/2028	200	1	0.00
				\$ 34	0.01

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - BUY PROTECTION⁽²⁾

インデックス/トランシェ	固定(支払)金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
CDX.HY-38 5-Year Index	(5.000)%	20/06/2027	\$ 7,857	\$ (92)	(0.03)

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

インデックス/トランシェ	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽⁴⁾	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
CDX.LIG-42 5-Year Index	1.000%	20/06/2029	\$ 2,225	\$ 5	0.00

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	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
Receive	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0.900%	15/03/2052	£ 700	\$ 38	0.01
Receive	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3.700	28/03/2034	100	4	0.00
Receive ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3.750	18/09/2054	500	37	0.01
Pay	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.123	22/08/2039	¥ 109,610	(17)	(0.01)
Receive ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.250	17/03/2031	\$ 10,840,000	100	0.03
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1.750	15/08/2032	500	33	0.01
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	1.750	21/12/2052	5,300	360	0.11
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.050	14/12/2052	690	51	0.02
Receive ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.500	18/12/2025	3,100	33	0.01
Receive ⁽⁴⁾	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.500	20/06/2054	5,325	193	0.06
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.585	31/10/2030	4,590	185	0.06
Pay	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.650	10/07/2033	170	(10)	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.689	31/10/2030	2,800	89	0.03
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.717	15/08/2033	2,000	70	0.02
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.722	31/10/2030	200	6	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.727	31/10/2030	500	15	0.01
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.732	31/10/2030	400	12	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.734	15/08/2033	2,700	90	0.03
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.739	31/10/2030	600	17	0.01
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.743	15/08/2033	300	10	0.00

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	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.745%	15/08/2033	\$ 400	\$ 13	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.753	15/08/2033	1,000	32	0.01
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.754	15/08/2033	900	29	0.01
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	3.763	15/08/2033	1,700	53	0.02
Pay	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4.078	29/04/2034	300	0	0.00
Pay	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4.105	24/04/2034	200	0	0.00
Pay	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4.130	03/05/2034	300	1	0.00
Pay	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	4.200	06/05/2034	400	4	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5.160	31/05/2025	6,100	2	0.00
Receive	1-Day USD-SOFR Compounded-OIS	5.388	18/10/2024	5,800	21	0.01
Receive	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3.500	01/06/2032	CAD 3,500	82	0.03
Receive	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3.750	20/12/2033	900	25	0.01
Pay	6-Month AUD-BBR-BBSW	4.500	20/09/2033	AUD 1,900	(18)	(0.01)
Pay	6-Month AUD-BBR-BBSW	4.500	20/03/2034	1,000	(10)	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	1.000	18/05/2027	€ 4,400	(39)	(0.01)
Receive ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2.500	18/09/2034	3,800	212	0.07
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.547	09/03/2033	500	(12)	0.00
Receive ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2.650	08/01/2034	300	8	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.670	03/04/2034	100	2	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.750	05/03/2034	200	(2)	0.00
Pay ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	2.750	18/09/2034	6,600	(140)	(0.04)
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.760	03/01/2029	200	5	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.770	16/04/2029	300	(4)	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.770	29/04/2034	200	(2)	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.780	02/05/2029	300	(3)	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.827	06/05/2029	300	(2)	0.00
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	2.860	24/04/2029	500	(3)	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.880	19/12/2028	400	10	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.890	22/12/2033	300	8	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.910	29/12/2033	200	5	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.920	13/12/2028	400	10	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	2.950	29/12/2028	200	5	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.063	06/12/2033	200	6	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.128	04/12/2033	100	3	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.148	20/11/2033	200	1	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.179	29/11/2028	200	1	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.255	22/11/2028	100	0	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.280	22/11/2033	100	1	0.00
Receive	6-Month EUR-EURIBOR	3.305	27/11/2033	200	(1)	0.00
Pay ⁽⁴⁾	28-Day MXN-TIE	9.430	06/04/2029	MXN 7,000	(1)	0.00
					\$ 1,620	0.51
Total Centrally Cleared Financial Derivative Instruments					\$ 1,567	0.49

- ⁽¹⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery securities of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash, securities or other deliverable obligations 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 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, securities or other deliverable obligations equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- ⁽³⁾ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- ⁽⁴⁾ 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.

OTC FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*, except number of contracts)

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

PURCHASED OPTIONS

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS ON CREDIT INDICES

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	時価	対純資産 比率(%)
BPS	Put - OTC CDX.IG-42 5-Year Index	Buy	0.600%	18/09/2024	6,900	\$ 16	\$ 9	0.00
GST	Put - OTC CDX.IG-42 5-Year Index	Buy	0.600	18/09/2024	1,000	4	1	0.00
						\$ 20	\$ 10	0.00

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

取引相手	銘柄	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	時価	対純資産 比率(%)
BPS	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7.275	06/12/2024	100	\$ 12	\$ 16	0.01
	Call - OTC USD versus CNH	7.325	06/12/2024	100	12	12	0.01
	Call - OTC USD versus CNH	7.400	06/12/2024	100	9	11	0.00

取引相手	銘柄	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	時価	対純資産 比率(%)
DJB	Call - OTC USD versus CNH	CNH 7.400	12/12/2024	300	\$ 28	\$ 31	0.01
MBC	Call - OTC USD versus CNH	7.350	06/12/2024	100	10	11	0.00
	Call - OTC USD versus CNH	7.375	14/02/2025	100	10	9	0.00
					\$ 81	\$ 90	0.03

INTEREST RATE SWAPIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	時価	対純資産 比率(%)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.725%	14/11/2024	3,600	\$ 0	\$ 1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.749	13/11/2024	5,400	0	2	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.754	15/11/2024	2,700	0	1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.765	18/11/2024	1,800	0	1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.800	20/11/2024	2,700	0	1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.820	21/11/2024	2,700	0	1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.850	22/11/2024	1,800	0	1	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.920	25/11/2024	2,700	0	2	0.00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.930	29/11/2024	4,500	0	3	0.00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.920	27/02/2025	600	26	26	0.01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	4.329	29/05/2025	900	31	26	0.01
							\$ 57	\$ 65	0.02

WRITTEN OPTIONS

CREDIT DEFAULT SWAPIONS ON CREDIT INDICES

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
BPS	Put - OTC CDX.IG-42 5-Year Index	Sell	0.800%	18/09/2024	13,800	\$ (16)	\$ (6)	0.00
GST	Put - OTC CDX.IG-42 5-Year Index	Sell	0.800	18/09/2024	2,000	(3)	(1)	0.00
						\$ (19)	\$ (7)	0.00

INTEREST RATE SWAPIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)	
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.800%	08/07/2024	300	\$ (1)	\$ (1)	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.350	08/07/2024	300	(1)	(1)	0.00	
BPS	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	3.070	03/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	3.070	03/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	4.060	28/06/2024	300	(1)	(2)	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.410	28/06/2024	300	(1)	0	0.00	
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.818	24/06/2024	300	0	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	3.109	24/06/2024	300	0	0	0.00	
CKL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.680	21/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	3.030	21/06/2024	300	(1)	(1)	0.00	
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.930	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	3.945	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.280	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.295	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.244	27/02/2025	2,300	(28)	(28)	(0.01)	
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.650	10/06/2024	200	0	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	2.950	10/06/2024	200	0	(1)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.950	10/06/2024	100	0	0	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.994	28/06/2024	400	(1)	(2)	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.300	10/06/2024	100	0	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.344	28/06/2024	400	(1)	(1)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.300	14/11/2024	400	0	(2)	0.00	
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.310	13/11/2024	600	0	(3)	(0.01)	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.310	15/11/2024	300	0	(1)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.310	18/11/2024	200	0	0	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.350	20/11/2024	300	0	(2)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.357	21/11/2024	300	0	(2)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.360	22/11/2024	200	0	(1)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.400	25/11/2024	300	0	(2)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.465	29/11/2024	200	0	(2)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.468	29/11/2024	300	0	(2)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.765	28/06/2024	200	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	3.030	28/06/2024	200	(1)	(1)	0.00	
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Receive	2.700	17/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Pay	3.000	17/06/2024	300	(1)	(1)	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	4.080	03/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.480	03/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.750	29/05/2025	3,500	(31)	(24)	(0.01)
		Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.765	22/02/2025	200	(1)	0	0.00
		Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.900	06/06/2024	300	(1)	0	0.00
Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Pay	4.265	22/07/2024	300	(1)	(2)	0.00	
NGF	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.300	06/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	3.935	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	4.235	10/06/2024	300	(1)	0	0.00	
						\$ (85)	\$ (85)	(0.03)		

OPTIONS ON SECURITIES

取引相手	銘柄	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/06/2054	\$ 96.195	06/06/2024	400	\$ (1)	\$ (1)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	94.266	08/07/2024	300	(1)	(1)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	94.719	08/07/2024	200	(1)	0	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	94.969	08/07/2024	200	(1)	(1)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	97.266	08/07/2024	300	(1)	(1)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	97.719	08/07/2024	200	1	0	0.00
MSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	97.969	08/07/2024	200	(1)	1	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	94.250	08/07/2024	400	(1)	(1)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	97.250	08/07/2024	400	(1)	(1)	0.00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/06/2054	95.656	06/06/2024	400	(1)	0	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	94.969	08/07/2024	200	(1)	(1)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5.000% due 01/07/2054	97.969	08/07/2024	200	(1)	0	0.00
					\$ (10)	\$ (6)	0.00

⁽¹⁾ Notional Amount represents the number of contracts.

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

取引相手	参照資産	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	プレミアム 支払(受取)	未実現評価 (損)益	時価	対純資産 比率(%)
BOA	South Africa Government International Bond	1.000%	20/12/2026	\$ 1,000	\$ (47)	\$ 39	\$ (8)	0.00
GST	Colombia Government International Bond	1.000	20/06/2027	900	(36)	34	(2)	0.00
	Colombia Government International Bond	1.000	20/12/2027	500	(44)	39	(5)	0.00
MYC	Colombia Government International Bond	1.000	20/06/2027	100	(6)	6	0	0.00
	Colombia Government International Bond	1.000	20/12/2027	100	(9)	8	(1)	0.00
	South Africa Government International Bond	1.000	20/12/2026	2,000	(90)	74	(16)	(0.01)
					\$ (232)	\$ 200	\$ (32)	(0.01)

⁽¹⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash, securities or other deliverable obligations 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.

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

取引相手	決済月	受取通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価 (損)益	対純資産 比率(%)
AZD	06/2024	\$ 11	AUD 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0.00
BOA	06/2024	€ 53,933	\$ 57,907	0	(644)	(644)	(0.20)
	06/2024	SGD 1,629	1,205	0	0	0	0.00
	02/2025	CNH 1,122	157	0	0	0	0.00
BPS	06/2024	AUD 40	26	0	0	0	0.00
	06/2024	€ 19,129	23,945	0	(411)	(411)	(0.13)
	06/2024	TWD 2,643	85	4	0	4	0.00
	06/2024	\$ 331	€ 309	4	0	4	0.00
	06/2024	22,691	€ 17,766	0	(71)	(71)	(0.02)
	06/2024	680	INR 56,730	0	(1)	(1)	0.00
BRC	06/2024	22	TWD 673	0	(1)	(1)	0.00
	07/2024	€ 17,766	\$ 22,694	73	0	73	0.02
	12/2024	\$ 286	CNH 2,048	0	0	0	0.00
	06/2024	CAD 337	\$ 246	0	(2)	(2)	0.00
	06/2024	MXN 943	56	1	0	1	0.00
	02/2025	\$ 157	CNH 1,121	0	0	0	0.00
BSH	07/2024	BRL 3,800	\$ 753	32	0	32	0.01
CBK	06/2024	INR 112,810	1,354	2	0	2	0.00
	06/2024	MXN 12,049	715	10	0	10	0.00
	07/2024	\$ 654	BRL 3,287	0	(30)	(30)	(0.01)
DUB	09/2024	1,354	INR 113,197	0	(2)	(2)	0.00
	06/2024	301	MXN 5,117	0	(2)	(2)	0.00
	07/2024	34	BRL 173	0	(2)	(2)	0.00
	12/2024	1,116	CNH 7,964	0	(5)	(5)	0.00
FAR	06/2024	AUD 172	\$ 115	0	0	0	0.00
	06/2024	\$ 58,562	€ 53,835	0	(118)	(118)	(0.04)
	07/2024	€ 53,835	\$ 58,635	121	0	121	0.04
GLM	07/2024	\$ 115	AUD 172	0	0	0	0.00
	06/2024	CAD 526	\$ 386	0	0	0	0.00
	06/2024	ZAR 32,209	1,752	44	0	44	0.02
	07/2024	BRL 2,000	404	24	0	24	0.01
JPM	08/2024	\$ 651	BRL 3,341	0	(19)	(19)	(0.01)
	06/2024	MXN 2,134	\$ 127	3	0	3	0.00
	06/2024	\$ 22	IDR 354,712	0	(1)	(1)	0.00
	06/2024	0	MXN 3,926	0	(4)	(4)	0.00
	06/2024	1,209	SGD 1,629	0	(3)	(3)	0.00
06/2024	87	TWD 2,690	0	(5)	(5)	0.00	
07/2024	BRL 900	\$ 181	10	0	10	0.00	

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価 (損)益	対純資産 比率(%)
	07/2024	SGD 1,627	\$ 1,209	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0.00
	10/2024	CNH 73	10	0	0	0	0.00
	12/2024	2,049	286	0	0	0	0.00
MBC	06/2024	CAD 693	507	0	(1)	(1)	0.00
	06/2024	€ 482	523	0	0	0	0.00
	06/2024	\$ 26	AUD 39	0	0	0	0.00
	06/2024	290	€ 271	5	0	5	0.00
	06/2024	1,734	€ 1,363	2	0	2	0.00
	06/2024	652	¥ 102,439	0	0	0	0.00
	07/2024	¥ 102,001	\$ 652	0	0	0	0.00
	07/2024	\$ 336	¥ 52,500	0	0	0	0.00
	09/2024	TWD 87	\$ 3	0	0	0	0.00
	12/2024	CNH 2,735	383	2	0	2	0.00
	12/2024	\$ 383	CNH 2,734	0	(2)	(2)	0.00
MYI	06/2024	INR 11,977	\$ 144	0	0	0	0.00
	06/2024	¥ 102,256	659	8	0	8	0.00
	06/2024	TWD 24,524	791	37	0	37	0.01
	06/2024	\$ 49	IDR 757,053	0	(2)	(2)	0.00
	09/2024	144	INR 12,019	0	0	0	0.00
NGF	06/2024	9	752	0	0	0	0.00
SCX	06/2024	TWD 26,614	\$ 867	49	0	49	0.02
	06/2024	\$ 2,223	INR 185,324	0	(4)	(4)	0.00
	09/2024	TWD 96	\$ 3	0	0	0	0.00
TOR	06/2024	MXN 27,145	1,608	20	0	20	0.01
	06/2024	\$ 102	AUD 155	2	0	2	0.00
UAG	12/2024	CNH 7,968	\$ 1,116	4	0	4	0.00
				\$ 460	\$ (1,330)	\$ (870)	(0.27)
Total OTC Financial Derivative Instruments						\$ (835)	(0.26)

SECURITIES SOLD SHORT

銘柄	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	対純資産 比率(%)
U.S. GOVERNMENT AGENCIES			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/06/2054	\$ 900	\$ (817)	(0.26)
Total Securities Sold Short		\$ (817)	(0.26)
Total Investments		\$ 454,411	142.21
Other Current Assets & Liabilities		\$ (134,885)	(42.21)
Net Assets		\$ 319,526	100.00

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (amounts in thousands*):

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

^ Security is in default.

(a) Zero coupon security.

(b) Principal amount of security is adjusted for inflation.

(c) Contingent convertible security.

(d) Restricted Securities:

発行体	クーポン	満期日	取得日	コスト	時価	対純資産 比率(%)
Oracle Corp.	6.150%	09/11/2029	07/11/2022	\$ 300	\$ 313	0.10

(e) Securities with an aggregate fair value of \$16,025 have been pledged as collateral under the terms of the Master Repurchase Agreements and/or Global Master Repurchase Agreements as at 31 May 2024.

Securities with an aggregate fair value of \$5 have been received as collateral under the terms of the Master Repurchase Agreements and/or Global Master Repurchase Agreements as at 31 May 2024.

Cash of \$5,306 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as at 31 May 2024.

Cash of \$780 has been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as at 31 May 2024.

Reverse Repurchase Agreements as at 31 May 2024:

取引相手	借入金利	決済日	満期日	借入額	リバースレポの支払	対純資産比率(%)
BOS	5.420%	28/05/2024	11/06/2024	\$ (1,167)	\$ (1,168)	(0.37)
BRC	5.460	31/05/2024	03/06/2024	(679)	(679)	(0.21)
DEU	5.400	23/05/2024	13/06/2024	(11,056)	(11,071)	(3.47)
JFS	5.400	16/05/2024	06/06/2024	(1,848)	(1,853)	(0.58)
	5.400	22/05/2024	05/06/2024	(1,449)	(1,451)	(0.45)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (16,222)	(5.08)

Collateral (Received)/Pledged for OTC Financial Derivative Instruments

The following is a summary by counterparty of the fair value of OTC financial derivative instruments and collateral (received)/pledged as at 31 May 2024:

取引相手	店頭派生商品の 価値	担保の(受取) 差入れ	ネット エクスポージャー ⁽¹⁾
BOA	\$ (654)	\$ 510	\$ (144)
BPS	(363)	270	(93)
BRC	(1)	0	(1)
BSH	32	0	32
CBK	(20)	0	(20)
CKL	(1)	0	(1)
DUB	22	(20)	2
FAR	3	0	3
GLM	36	0	36
GST	(7)	0	(7)
JPM	(1)	0	(1)
MBC	26	(20)	6
MSC	(2)	0	(2)
MYC	(18)	0	(18)
MYI	43	(30)	13
SAL	(1)	0	(1)
SCX	45	0	45
TOR	22	0	22
UAG	4	0	4

⁽¹⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. See Note 6, Market and Credit Risks, in the Notes to Financial Statements for more information regarding credit and counterparty risk.

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)	円 10,181	% △0.0	% —	% —	百万円 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	円 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。

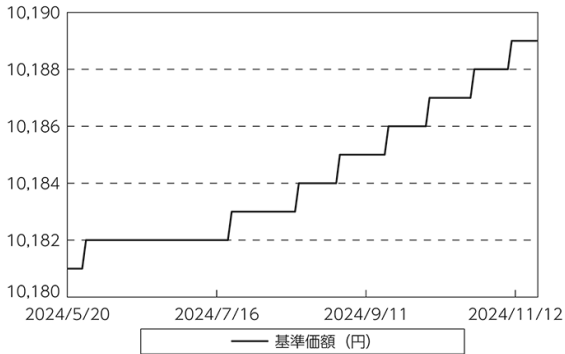
○運用経過

●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/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98, 174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)	98, 174円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース (為替ヘッジあり)	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
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)	98, 174円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (年2回決算型)	98, 174円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (年2回決算型)	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
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース (為替ヘッジなし)	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/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)	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
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98, 174円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	98, 174円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	98, 174円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	98, 173円
三菱UFJ/マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97, 104円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89, 287円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (毎月分配型)	74, 308円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	60, 179円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49, 097円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	44, 142円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39, 351円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	30, 651円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20, 650円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (年2回分配型)	20, 635円
バリュール・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 829円
バリュール・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9, 829円
バリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9, 829円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9, 822円
バリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	9, 822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド (予想分配金提示型)	9, 822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド (予想分配金提示型)	9, 822円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9, 821円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9, 821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9, 821円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9, 820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9, 820円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9, 820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9, 820円

わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
グローバル・インカム・フルコース (為替ヘッジなし)	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替リスク軽減型)	983円
合計	5,368,633,626円