

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 令和4年4月28日
【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
 (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
 S.A.)
【代表者の役職氏名】 エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス
 (Fabrice Mas)
【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、
 アーロン通り 287 - 289番
 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
 Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
 同 青山 正幸
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】 03(6212)8316
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
 エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・
 セレクション
 (Emerging Bond Fund Currency Selection)
 - 米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ
 (USD (BRL-hedged) Portfolio)
 - 豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ
 (AUD (BRL-hedged) Portfolio)
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】
 - 米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ受益証券:
 100億アメリカ合衆国ドル(約1兆1,377億円)を上限とする。
 - 豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ受益証券:
 110億オーストラリア・ドル(約8,942億円)を上限とする。

(注1)各サブ・ファンドは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各サブ・ファンドの参照通貨は以下の通りである。

米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ:アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)

豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ:オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)

(注2)米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2021年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、1米ドル=113.77円および1豪ドル=81.29円による。以下同じ。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、令和４年１月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、「第二部 ファンド情報」の「第１ ファンドの状況」の「５ 運用状況」および「第３ ファンドの経理状況」ならびに「第三部 特別情報」の「第１ 管理会社の概況」の「１ 管理会社の概況」、「２ 事業の内容及び営業の概況」および「５ その他」を新たな情報により訂正および追加するため、また、「第二部 ファンド情報」の「第１ ファンドの状況」の「１ ファンドの性格、（３）ファンドの仕組み」、「２ 投資方針、（３）運用体制」、「３ 投資リスク、（２）リスクに対する管理体制、（３）リスクに関する参考情報」、「４ 手数料等及び税金、（５）課税上の取扱い」および「５ 運用状況、（２）投資資産」を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

２【訂正の内容】

（１）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容＊と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 第15 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	更新 または 追加
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第31 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第11 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
5 その他	(4) 訴訟事件その他の重要事項		(3) その他	追加

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（「５ 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション（Emerging Bond Fund Currency Selection）（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドである米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ（USD（BRL-hedged）Portfolio）および豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ（AUD（BRL-hedged）Portfolio）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況（資産別および地域別の投資状況）（2022年２月末日現在）

＜米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	7,176,835.27	99.91
現金・その他の資産 （負債控除後）		6,464.50	0.09
合計（純資産総額）		7,183,299.77 （約830百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、各サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（注２）各サブ・ファンドは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各サブ・ファンドの参照通貨は以下の通りである。

米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ：アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）

豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ：オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）

（注３）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2022年２月28日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、１米ドル＝115.55円および１豪ドル＝82.95円による。以下同じ。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

＜豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（豪ドル）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	1,993,721.67	101.84
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 35,996.55	- 1.84
合計（純資産総額）		1,957,725.12 （約162百万円）	100.00

(2) 運用実績

純資産の推移

2022年２月末日までの１年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

<米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2021年３月末日	8,903,289.16	1,028,775	8.35	965
４月末日	9,147,672.51	1,057,014	8.72	1,008
５月末日	9,415,306.57	1,087,939	9.02	1,042
６月末日	9,551,743.38	1,103,704	9.41	1,087
７月末日	9,240,185.82	1,067,703	9.12	1,054
８月末日	9,216,618.69	1,064,980	9.19	1,062
９月末日	8,341,013.86	963,804	8.38	968
10月末日	7,626,663.34	881,261	8.05	930
11月末日	7,304,832.69	844,073	7.80	901
12月末日	7,040,090.04	813,482	7.67	886
2022年１月末日	7,425,743.56	858,045	8.11	937
２月末日	7,183,299.77	830,030	7.86	908

<豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2021年３月末日	2,403,425.06	199,364	10.53	873
４月末日	2,436,333.31	202,094	10.77	893
５月末日	2,494,455.98	206,915	11.14	924
６月末日	2,661,731.76	220,791	12.01	996
７月末日	2,611,565.72	216,629	11.84	982
８月末日	2,620,464.36	217,368	11.96	992
９月末日	2,407,400.63	199,694	11.02	914
10月末日	2,023,760.20	167,871	10.09	837
11月末日	2,063,870.46	171,198	10.35	859
12月末日	1,945,237.01	161,357	9.99	829
2022年１月末日	2,101,741.09	174,339	10.81	897
２月末日	1,957,725.12	162,393	10.19	845

（注）上記に記載された各月末日の数値は、評価および買戻目的のため計算されたものである。そのため、各会計年度末の純資産総額および１口当たり純資産価格は、財務書類中の数値とは一致しないことがある。

< 参考情報 >



- 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各サブ・ファンドの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金(課税前)をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。
- グラフの計算の基礎となる1口当たり純資産価格は、2021年10月12日以降、小数点以下第8位までの数値を使用しています。

分配の推移

2022年２月末日までの１年間の１口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	米ドル	円
2021年３月１日～2022年２月末日	1.12	129

<豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	豪ドル	円
2021年３月１日～2022年２月末日	1.56	129

<参考情報>

米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ		豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ	
単位：米ドル		単位：豪ドル	
第8計算期間 (2016年8月1日～2017年7月31日)	4.80	第8計算期間 (2016年8月1日～2017年7月31日)	6.60
第9計算期間 (2017年8月1日～2018年7月31日)	4.80	第9計算期間 (2017年8月1日～2018年7月31日)	6.60
第10計算期間 (2018年8月1日～2019年7月31日)	4.80	第10計算期間 (2018年8月1日～2019年7月31日)	6.60
第11計算期間 (2019年8月1日～2020年7月31日)	4.00	第11計算期間 (2019年8月1日～2020年7月31日)	5.52
第12計算期間 (2020年8月1日～2021年7月31日)	1.40	第12計算期間 (2020年8月1日～2021年7月31日)	1.96
2021年10月	0.10	2021年10月	0.14
11月	0.08	11月	0.11
12月	0.08	12月	0.11
2022年 1月	0.08	2022年 1月	0.11
2月	0.08	2月	0.11
直近1年間累計	1.12	直近1年間累計	1.56
設定来累計	114.63	設定来累計	115.08

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

収益率の推移

<米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

計算期間	収益率(注)
2021年3月1日～2022年2月末日	4.06%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格(当該期間中の分配金の合計額を加えた額)

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

<豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

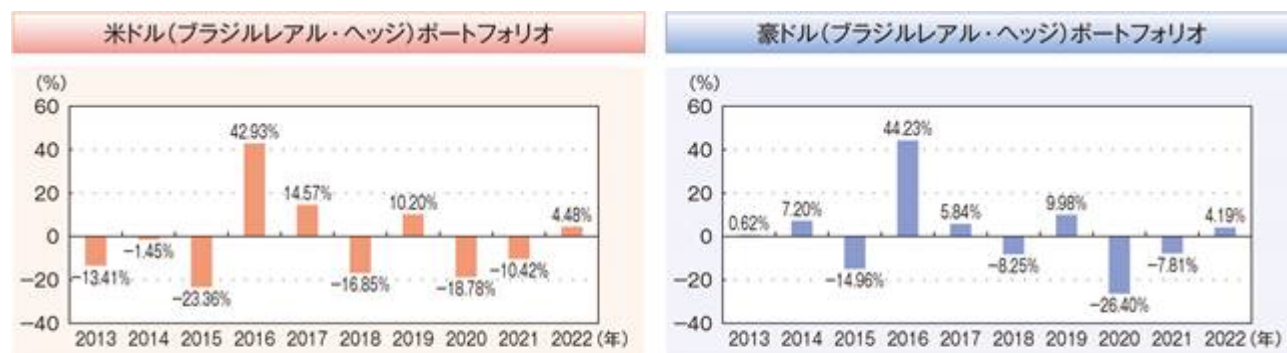
計算期間	収益率(注)
2021年3月1日～2022年2月末日	8.90%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格(当該期間中の分配金の合計額を加えた額)

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格(分配落ちの額)

<参考情報>

● 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

b = 当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格

● 2022年は2月28日までの収益率を表示しています。

● サブ・ファンドにベンチマークはありません。

● グラフの計算の基礎となる1口当たり純資産価格は、2021年10月12日以降、小数点以下第8位までの数値を使用しています。

２ 販売及び買戻しの実績

2022年２月末日までの１年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年２月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

<米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
2,054 (2,054)	173,215 (173,215)	914,166 (914,166)

<豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
2,698 (2,698)	59,180 (59,180)	192,079 (192,079)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

- a．サブ・ファンドの日本文の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第４項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第１条の３第７項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドルおよび豪ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱ＵＦＪ銀行の2022年２月28日現在における対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝115.55円、１豪ドル＝82.95円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

[次へ](#)

（１）資産及び負債の状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

純資産計算書

2022年 1 月31日現在

（米ドルで表示）

	米ドル	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	7,408,787.56	856,085
現金（ロング）		
現金および現金等価物	85,477.14	9,877
未収利息		
未収利息	54.98	6
未収金		
未収金	2,000.00	231
資産合計	7,496,319.68	866,200
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(1,276.28)	(147)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(36,019.39)	(4,162)
未払元本		
未払元本	(1,025.70)	(119)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(3,166.25)	(366)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(12,696.12)	(1,467)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(3,712.09)	(429)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(2,139.00)	(247)
未払金		
未払金	195.56	23
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(4,212.60)	(487)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(633.23)	(73)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(5,891.02)	(681)
負債合計	(70,576.12)	(8,155)
純資産総額	7,425,743.56	858,045
発行済口数	916,060	口
1 口当たり純資産価格	8.11	米ドル

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

純資産計算書
2022年 1 月31日現在
（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	2,135,755.55	177,161
現金（ロング）		
現金および現金等価物	31,356.06	2,601
未収利息		
未収利息	1.73	0
資産合計	2,167,113.34	179,762
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(351.86)	(29)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(42,898.47)	(3,558)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(879.62)	(73)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(3,515.66)	(292)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(1,021.59)	(85)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(588.96)	(49)
未払金		
未払金	(1,797.40)	(149)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(5,889.32)	(489)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(175.99)	(15)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(8,253.38)	(685)
負債合計	(65,372.25)	(5,423)
純資産総額	2,101,741.09	174,339
発行済口数	194,363	口
1 口当たり純資産価格	10.81	豪ドル

[次へ](#)

試算表

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション -
米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

	2021年 8 月 1 日から 2021年10月 7 日までの期間	
	米ドル	千円
収益		
市場に係る実現損失	(414,941.63)	(47,947)
受取配当金	127,428.97	14,724
未実現時価評価損益	(346,215.94)	(40,005)
収益合計：	(633,728.60)	(73,227)
費用		
監査費用	4,527.09	523
保管報酬	2,105.69	243
報告書作成費用	168.63	19
投資運用報酬	5,727.45	662
受託報酬	1,890.60	218
経費	2,041.60	236
副投資顧問報酬	9,938.88	1,148
代行協会員報酬	842.32	97
販売報酬	8,422.79	973
副管理報酬	421.15	49
費用合計：	36,086.20	4,170

**エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション -
米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ**

運用計算書

2021年10月 8 日から2022年 1 月31日までの期間

（米ドルで表示）

	米ドル	千円
収益	291,100.39	33,637
受取配当金	291,100.39	33,637
現金および現金等価物	205,975.41	23,800
ファンド	85,124.98	9,836
費用	(371,677.29)	(42,947)
A I F M D 報酬	(851.10)	(98)
現金および現金等価物	(851.10)	(98)
代行協会員報酬	(1,186.61)	(137)
現金および現金等価物	(1,186.61)	(137)
監査報酬	(7,610.76)	(879)
現金および現金等価物	(7,610.76)	(879)
保管報酬	(2,966.63)	(343)
現金および現金等価物	(2,966.63)	(343)
販売報酬	(11,866.42)	(1,371)
現金および現金等価物	(11,866.42)	(1,371)
配当金	(320,787.06)	(37,067)
現金および現金等価物	(320,787.06)	(37,067)
投資顧問報酬	(14,002.40)	(1,618)
現金および現金等価物	(14,002.40)	(1,618)
管理報酬	(8,069.18)	(932)
現金および現金等価物	(8,069.18)	(932)
報告書作成費用	(565.63)	(65)
現金および現金等価物	(565.63)	(65)
副投資運用報酬	(593.32)	(69)
現金および現金等価物	(593.32)	(69)
受託報酬	(3,178.18)	(367)
現金および現金等価物	(3,178.18)	(367)
投資に係る実現および未実現損益	(80,337.78)	(9,283)
為替に係る未実現損益の変動	117.21	14
現金および現金等価物	117.21	14
価格に係る未実現損益の変動	1,078,279.54	124,595
ファンド	1,078,279.54	124,595
長期価格に係る損益	(1,158,814.07)	(133,901)
ファンド	(1,158,814.07)	(133,901)
短期価格に係る損益	79.54	9
現金および現金等価物	79.15	9
ファンド	0.39	0
純損益	(160,914.68)	(18,594)

[次へ](#)

試算表

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション -
豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

	2021年 8 月 1 日から 2021年10月 7 日までの期間	
	豪ドル	千円
収益		
市場に係る実現損失	(79,164.44)	(6,567)
受取配当金	43,867.72	3,639
未実現時価評価損益	(132,183.31)	(10,965)
収益合計：	(167,480.03)	(13,892)
費用		
監査費用	5,240.55	435
保管報酬	598.81	50
報告書作成費用	523.96	43
投資運用報酬	1,628.82	135
受託報酬	2,736.19	227
経費	2,350.28	195
副投資顧問報酬	2,826.37	234
代行協会員報酬	239.57	20
販売報酬	2,395.27	199
副管理報酬	119.76	10
費用合計：	18,659.58	1,548

**エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション -
豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ**

運用計算書

2021年10月 8 日から2022年 1 月31日までの期間

（豪ドルで表示）

	豪ドル	千円
収益	79,482.42	6,593
受取配当金	79,482.42	6,593
現金および現金等価物	60,484.54	5,017
ファンド	18,997.88	1,576
費用	(121,630.02)	(10,089)
A I F M D 報酬	(1,170.75)	(97)
現金および現金等価物	(1,170.75)	(97)
代行協会員報酬	(329.63)	(27)
現金および現金等価物	(329.63)	(27)
監査報酬	(9,261.16)	(768)
現金および現金等価物	(9,261.16)	(768)
保管報酬	(824.10)	(68)
現金および現金等価物	(824.10)	(68)
販売報酬	(3,296.36)	(273)
現金および現金等価物	(3,296.36)	(273)
配当金	(95,285.41)	(7,904)
現金および現金等価物	(95,285.41)	(7,904)
投資顧問報酬	(3,889.71)	(323)
現金および現金等価物	(3,889.71)	(323)
管理報酬	(2,241.55)	(186)
現金および現金等価物	(2,241.55)	(186)
報告書作成費用	(780.40)	(65)
現金および現金等価物	(780.40)	(65)
副投資運用報酬	(164.85)	(14)
現金および現金等価物	(164.85)	(14)
受託報酬	(4,386.10)	(364)
現金および現金等価物	(4,386.10)	(364)
投資に係る実現および未実現損益	46,107.79	3,825
為替に係る未実現損益の変動	(1,841.63)	(153)
現金および現金等価物	(1,841.63)	(153)
価格に係る未実現損益の変動	401,772.99	33,327
ファンド	401,772.99	33,327
長期価格に係る損益	(353,866.50)	(29,353)
ファンド	(353,866.50)	(29,353)
短期価格に係る損益	42.93	4
現金および現金等価物	42.45	4
ファンド	0.48	0
純損益	3,960.19	328

[次へ](#)

(２) 投資有価証券明細表等

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 米ドル (ブラジルリアル・ヘッジ) ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表

2022年 1 月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					15,505,286.01	-8,011,021.31	0.00	7,494,264.70	100.00%
現金 (ロング)					85,477.14	0.00	0.00	85,477.14	1.14%
現金および現金等価物					85,477.14	0.00	0.00	85,477.14	1.14%
米ドル					85,477.14	0.00	0.00	85,477.14	1.14%
米ドル	USD	85,477.14000	1.0000	85,477.14	85,477.14	0.00	0.00	85,477.14	1.14%
投資有価証券 (ロング)					15,419,808.87	-8,011,021.31	0.00	7,408,787.56	98.86%
ファンド					15,419,808.87	-8,011,021.31	0.00	7,408,787.56	98.86%
米ドル					15,419,808.87	-8,011,021.31	0.00	7,408,787.56	98.86%
ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスD (ブラジルリアル)	844004	2,838,615.92000	2.6100	15,419,808.87	15,419,808.87	-8,011,021.31	0.00	7,408,787.56	98.86%
未収金					2,054.98	0.00	0.00	2,054.98	100.00%
未収利息					54.98	0.00	0.00	54.98	2.68%
現金および現金等価物					54.98	0.00	0.00	54.98	2.68%
米ドル					54.98	0.00	0.00	54.98	2.68%
米ドル	USD	54.98000	1.0000	54.98	54.98	0.00	0.00	54.98	2.68%
未収金					2,000.00	0.00	0.00	2,000.00	97.33%
現金および現金等価物					2,000.00	0.00	0.00	2,000.00	97.33%
米ドル					2,000.00	0.00	0.00	2,000.00	97.33%
米ドル	USD	2,000.00000	1.0000	2,000.00	2,000.00	0.00	0.00	2,000.00	97.33%
未払金					-70,771.68	195.56	0.00	-70,576.12	100.00%
未払代行協会員報酬					-1,276.28	0.00	0.00	-1,276.28	1.81%
現金および現金等価物					-1,276.28	0.00	0.00	-1,276.28	1.81%
米ドル					-1,276.28	0.00	0.00	-1,276.28	1.81%
米ドル	USD	-1,276.28000	1.0000	-1,276.28	-1,276.28	0.00	0.00	-1,276.28	1.81%
未払監査報酬					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	51.04%
現金および現金等価物					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	51.04%
米ドル					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	51.04%
米ドル	USD	-36,019.39000	1.0000	-36,019.39	-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	51.04%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払元本					-1,025.70	0.00	0.00	-1,025.70	1.45%
現金および現金等価物					-1,025.70	0.00	0.00	-1,025.70	1.45%
米ドル					-1,025.70	0.00	0.00	-1,025.70	1.45%
米ドル	USD	-1,025.70000	1.0000	-1,025.70	-1,025.70	0.00	0.00	-1,025.70	1.45%
未払保管報酬					-3,166.25	0.00	0.00	-3,166.25	4.49%
現金および現金等価物					-3,166.25	0.00	0.00	-3,166.25	4.49%
米ドル					-3,166.25	0.00	0.00	-3,166.25	4.49%
米ドル	USD	-3,166.25000	1.0000	-3,166.25	-3,166.25	0.00	0.00	-3,166.25	4.49%
未払販売報酬					-12,696.12	0.00	0.00	-12,696.12	17.99%
現金および現金等価物					-12,696.12	0.00	0.00	-12,696.12	17.99%
米ドル					-12,696.12	0.00	0.00	-12,696.12	17.99%
米ドル	USD	-12,696.12000	1.0000	-12,696.12	-12,696.12	0.00	0.00	-12,696.12	17.99%
未払投資顧問報酬					-3,712.09	0.00	0.00	-3,712.09	5.26%
現金および現金等価物					-3,712.09	0.00	0.00	-3,712.09	5.26%
米ドル					-3,712.09	0.00	0.00	-3,712.09	5.26%
米ドル	USD	-3,712.09000	1.0000	-3,712.09	-3,712.09	0.00	0.00	-3,712.09	5.26%
未払管理報酬					-2,139.00	0.00	0.00	-2,139.00	3.03%
現金および現金等価物					-2,139.00	0.00	0.00	-2,139.00	3.03%
米ドル					-2,139.00	0.00	0.00	-2,139.00	3.03%
米ドル	USD	-2,139.00000	1.0000	-2,139.00	-2,139.00	0.00	0.00	-2,139.00	3.03%
未払金					0.00	195.56	0.00	195.56	-0.28%
現金および現金等価物					0.00	195.56	0.00	195.56	-0.28%
ユーロ					0.00	195.56	0.00	195.56	-0.28%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	195.56	0.00	195.56	-0.28%
未払報告書作成費用					-4,212.60	0.00	0.00	-4,212.60	5.97%
現金および現金等価物					-4,212.60	0.00	0.00	-4,212.60	5.97%
ユーロ					-4,212.60	0.00	0.00	-4,212.60	5.97%
ユーロ	EUR	-3,583.38000	1.0000	-3,583.38	-4,212.60	0.00	0.00	-4,212.60	5.97%
未払副投資運用報酬					-633.23	0.00	0.00	-633.23	0.90%
現金および現金等価物					-633.23	0.00	0.00	-633.23	0.90%
米ドル					-633.23	0.00	0.00	-633.23	0.90%
米ドル	USD	-633.23000	1.0000	-633.23	-633.23	0.00	0.00	-633.23	0.90%
未払受託報酬					-5,891.02	0.00	0.00	-5,891.02	8.35%
現金および現金等価物					-5,891.02	0.00	0.00	-5,891.02	8.35%
米ドル					-5,891.02	0.00	0.00	-5,891.02	8.35%
米ドル	USD	-5,891.02000	1.0000	-5,891.02	-5,891.02	0.00	0.00	-5,891.02	8.35%
報告額合計：					15,436,569.31	-8,010,825.75	0.00	7,425,743.56	100.00%

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表

2022年１月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					3,911,894.77	-1,744,783.16	0.00	2,167,111.61	100.00%
現金（ロング）					31,356.06	0.00	0.00	31,356.06	1.45%
現金および現金等価物					31,356.06	0.00	0.00	31,356.06	1.45%
豪ドル					31,356.06	0.00	0.00	31,356.06	1.45%
豪ドル	AUD	31,356.06000	1.0000	31,356.06	31,356.06	0.00	0.00	31,356.06	1.45%
投資有価証券（ロング）					3,880,538.71	-1,744,783.16	0.00	2,135,755.55	98.55%
ファンド					3,880,538.71	-1,744,783.16	0.00	2,135,755.55	98.55%
豪ドル					3,880,538.71	-1,744,783.16	0.00	2,135,755.55	98.55%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスA （ブラジルリアル）	844008	631,880.34000	3.3800	3,880,538.71	3,880,538.71	-1,744,783.16	0.00	2,135,755.55	98.55%
未収金					1.73	0.00	0.00	1.73	100.00%
未収利息					1.73	0.00	0.00	1.73	100.00%
現金および現金等価物					1.73	0.00	0.00	1.73	100.00%
豪ドル					1.73	0.00	0.00	1.73	100.00%
豪ドル	AUD	1.73000	1.0000	1.73	1.73	0.00	0.00	1.73	100.00%
未払金					-63,574.85	-1,797.40	0.00	-65,372.25	100.00%
未払代行協会員報酬					-351.86	0.00	0.00	-351.86	0.54%
現金および現金等価物					-351.86	0.00	0.00	-351.86	0.54%
豪ドル					-351.86	0.00	0.00	-351.86	0.54%
豪ドル	AUD	-351.86000	1.0000	-351.86	-351.86	0.00	0.00	-351.86	0.54%
未払監査報酬					-42,898.47	0.00	0.00	-42,898.47	65.62%
現金および現金等価物					-42,898.47	0.00	0.00	-42,898.47	65.62%
米ドル					-42,898.47	0.00	0.00	-42,898.47	65.62%
米ドル	USD	-31,342.21000	1.0000	-31,342.21	-42,898.47	0.00	0.00	-42,898.47	65.62%
未払保管報酬					-879.62	0.00	0.00	-879.62	1.35%
現金および現金等価物					-879.62	0.00	0.00	-879.62	1.35%
豪ドル					-879.62	0.00	0.00	-879.62	1.35%
豪ドル	AUD	-879.62000	1.0000	-879.62	-879.62	0.00	0.00	-879.62	1.35%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払販売報酬					-3,515.66	0.00	0.00	-3,515.66	5.38%
現金および現金等価物					-3,515.66	0.00	0.00	-3,515.66	5.38%
豪ドル					-3,515.66	0.00	0.00	-3,515.66	5.38%
豪ドル	AUD	-3,515.66000	1.0000	-3,515.66	-3,515.66	0.00	0.00	-3,515.66	5.38%
未払投資顧問報酬					-1,021.59	0.00	0.00	-1,021.59	1.56%
現金および現金等価物					-1,021.59	0.00	0.00	-1,021.59	1.56%
豪ドル					-1,021.59	0.00	0.00	-1,021.59	1.56%
豪ドル	AUD	-1,021.59000	1.0000	-1,021.59	-1,021.59	0.00	0.00	-1,021.59	1.56%
未払管理報酬					-588.96	0.00	0.00	-588.96	0.90%
現金および現金等価物					-588.96	0.00	0.00	-588.96	0.90%
豪ドル					-588.96	0.00	0.00	-588.96	0.90%
豪ドル	AUD	-588.96000	1.0000	-588.96	-588.96	0.00	0.00	-588.96	0.90%
未払金					0.00	-1,797.40	0.00	-1,797.40	2.75%
現金および現金等価物					0.00	-1,797.40	0.00	-1,797.40	2.75%
ユーロ					0.00	60.00	0.00	60.00	-0.09%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	60.00	0.00	60.00	-0.09%
米ドル					0.00	-1,857.40	0.00	-1,857.40	2.84%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-1,857.40	0.00	-1,857.40	2.84%
未払報告書作成費用					-5,889.32	0.00	0.00	-5,889.32	9.01%
現金および現金等価物					-5,889.32	0.00	0.00	-5,889.32	9.01%
ユーロ					-5,889.32	0.00	0.00	-5,889.32	9.01%
ユーロ	EUR	-3,663.72000	1.0000	-3,663.72	-5,889.32	0.00	0.00	-5,889.32	9.01%
未払副投資運用報酬					-175.99	0.00	0.00	-175.99	0.27%
現金および現金等価物					-175.99	0.00	0.00	-175.99	0.27%
豪ドル					-175.99	0.00	0.00	-175.99	0.27%
豪ドル	AUD	-175.99000	1.0000	-175.99	-175.99	0.00	0.00	-175.99	0.27%
未払受託報酬					-8,253.38	0.00	0.00	-8,253.38	12.63%
現金および現金等価物					-8,253.38	0.00	0.00	-8,253.38	12.63%
米ドル					-8,253.38	0.00	0.00	-8,253.38	12.63%
米ドル	USD	-6,005.36000	1.0000	-6,005.36	-8,253.38	0.00	0.00	-8,253.38	12.63%
報告額合計：					3,848,321.65	-1,746,580.56	0.00	2,101,741.09	100.00%

[次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは、ピムコ・ケイマン・トラストのサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢを通じてピムコ・ケイマン・トラストの別のサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）に投資します。資産負債計算書の資産の部に計上された投資有価証券は、ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢの受益証券です。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）の状況は次の通りです。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）の状況

同投資信託は、ケイマンの法律に基づき設立された外国投資信託です。同投資信託の資産負債計算書および投資有価証券明細表は、ピムコジャパンリミテッドより入手した中間財務書類の原文を管理会社が抜粋したものが翻訳されております。

[次へ](#)

資産負債計算書（未監査）

2021年 8 月31日現在

	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）	
	千米ドル （受益証券１口当 りの金額を除く）	百万円 （受益証券１口当 りの金額を除く）
資産：		
投資、時価評価額		
投資有価証券	463,233	53,527
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	14	2
店頭取引	2,572	297
現金	29	3
取引相手への預け金	1,231	142
外貨、時価評価額	156	18
投資売却未収金	839	97
未収利息および／または未収配当金	5,686	657
	473,760	54,743
負債：		
借入金およびその他の金融取引		
逆現先取引契約に係る未払金	26,024	3,007
空売りに係る未払金	215	25
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	3	0
店頭取引	520	60
投資購入未払金	633	73
取引相手からの預り金	2,807	324
ファンド受益証券買戻未払金	457	53
その他の負債	1	0
	30,660	3,543
純資産	443,100	51,200
投資有価証券原価	462,989	53,498
保有外貨原価	168	19
空売りに係る受領額	217	25
金融デリバティブ商品の原価純額またはプレミアム純額	748	86

ピムコ ケイマン

エマージング ボンド ファンド（Ｍ）

千米ドル	百万円
（受益証券１口当たりの金額を除く）	（受益証券１口当たりの金額を除く）

純資産：	443,100	51,200
発行済受益証券口数：	24,528千口	
発行済受益証券１口当たり純資産価格および買戻価格： （機能通貨による表示）	18.06米ドル	2,087円

千未満の数値は四捨五入により残高が０と表示されることがある。

[次へ](#)

投資有価証券明細表（未監査）

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）

（2021年 8 月31日現在）

	額面金額 （単位：千）	時価 （単位：千）		額面金額 （単位：千）	時価 （単位：千）
INVESTMENTS IN SECURITIES 104.5%			BAHRAIN 1.6%		
ANGOLA 1.6%			SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
SOVEREIGN ISSUES 1.6%			Bahrain Government International Bond		
Angolan Government International Bond			4.250% due 01/25/2028	\$ 1,400	\$ 1,401
8.000% due 11/26/2029	\$ 2,400	\$ 2,535	5.625% due 09/30/2031	2,400	2,407
8.250% due 05/09/2028	1,500	1,603	6.125% due 07/05/2022	3,000	3,112
9.125% due 11/26/2049	900	943	Total Bahrain (Cost \$6,918)		6,920
9.375% due 05/08/2048	200	213			
9.500% due 11/12/2025	1,800	2,015	BELARUS 0.2%		
Total Angola (Cost \$6,065)		7,309	SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
			Republic of Belarus International Bond		
ARGENTINA 1.8%			5.875% due 02/24/2026	200	186
SOVEREIGN ISSUES 1.8%			6.378% due 02/24/2031	700	612
Argentina Government International Bond			7.625% due 06/29/2027	200	196
0.500% due 07/09/2030	330	129	Total Belarus (Cost \$1,070)		994
1.000% due 07/09/2029	629	257			
1.125% due 07/09/2035	10,699	3,743	BRAZIL 2.1%		
1.125% due 07/09/2046	2,415	848	CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
2.000% due 01/09/2038	1,468	603	Centrais Eletricas Brasileiras S.A.		
2.500% due 07/09/2041	2,881	1,131	4.625% due 02/04/2030	500	509
Argentina Treasury Bills			Petrobras Global Finance BV		
36.141% due 04/03/2022	ARS 4,490	27	5.093% due 01/15/2030	2,200	2,410
					2,919
Argentina Bonos del Tesoro			SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
15.500% due 10/17/2026	1,650	4	Brazil Government International Bond		
			4.750% due 01/14/2050	6,400	6,072
Provincia de Entre Rios Argentina			8.250% due 01/20/2034	60	82
5.000% due 08/08/2028 (a)	\$ 829	584			
			Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais		
Provincia de la Rioja			5.333% due 02/15/2028	140	152
9.750% due 02/24/2025	1,000	673			6,306
Total Argentina (Cost \$10,915)		7,999	Total Brazil (Cost \$9,057)		9,225
ARMENIA 0.4%			BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%			SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Armenia Government International Bond			1MDB Global Investments Ltd.		
3.600% due 02/02/2031	900	859	4.400% due 03/09/2023	1,500	1,516
3.950% due 09/26/2029	800	795	Total British Virgin Islands (Cost \$1,511)		1,516
Total Armenia (Cost \$1,667)		1,654			
			CAMEROON 0.2%		
AZERBAIJAN 2.3%			SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.9%			Republic of Cameroon International Bond		
Southern Gas Corridor CJSC			5.950% due 07/07/2032	EUR 700	827
6.875% due 03/24/2026	4,000	4,750	Total Cameroon (Cost \$830)		827
State Oil Company of the Azerbaijan Republic			CAYMAN ISLANDS 2.2%		
4.750% due 03/13/2023	3,340	3,517	CORPORATE BONDS & NOTES 2.0%		
		8,267	Biocanico Sovereign Certificate Ltd.		
			0.000% due 06/05/2034	\$ 1,263	968
SOVEREIGN ISSUES 0.4%					
Republic of Azerbaijan International Bond			Interoceanica IV Finance Ltd.		
3.500% due 09/01/2032	300	313	0.000% due 11/30/2025	465	443
4.750% due 03/18/2024	1,500	1,630			
		1,943	Interoceanica V Finance Ltd.		
Total Azerbaijan (Cost \$9,393)		10,210	0.000% due 05/15/2030	2,369	2,117
BAHAMAS 0.3%			Peru Enhanced Pass-Through		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%			Finance Ltd.		
Bahamas Government International Bond			0.000% due 06/02/2025	2,726	2,614
6.000% due 11/21/2028	1,200	1,180			
Total Bahamas (Cost \$1,200)		1,180			

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
S.A. Global Sukuk Ltd.		
1.602% due 06/17/2026	\$ 700	\$ 702
2.694% due 06/17/2031	1,700	1,742
		<u>8,586</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Dubai DOF Sukuk Ltd.		
2.763% due 09/09/2030	1,000	1,020
Total Cayman Islands (Cost \$8,828)		<u>9,606</u>
CHILE 1.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.8%		
Banco del Estado de Chile		
2.704% due 01/09/2025	500	522
Corp. Nacional del Cobre de Chile		
3.700% due 01/30/2050	200	214
4.250% due 07/17/2042 (d)	3,400	3,927
4.500% due 08/01/2047	300	359
4.875% due 11/04/2044	1,400	1,747
Empresa de los Ferrocarriles del Estado		
3.068% due 08/18/2050	200	184
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.		
3.650% due 05/07/2030	300	329
4.700% due 05/07/2050	600	729
		<u>8,011</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Chile Government International Bond		
3.100% due 05/07/2041	200	204
Total Chile (Cost \$7,000)		<u>8,215</u>
CHINA 2.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.0%		
Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd.		
2.100% due 07/28/2026	2,100	2,093
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.		
4.200% due 07/27/2026	200	221
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.		
2.150% due 05/13/2025	2,900	2,991
2.700% due 05/13/2030	1,000	1,043
3.680% due 08/08/2049	300	333
SPIC MTN Co. Ltd.		
1.625% due 07/27/2025	2,100	2,106
Total China (Cost \$8,618)		<u>8,787</u>
COLOMBIA 1.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Ecopetrol S.A.		
5.875% due 05/28/2045 (d)	2,400	2,577
7.375% due 09/18/2043	100	122
		<u>2,699</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Colombia Government International Bond		
3.875% due 02/15/2061	700	615
4.125% due 02/22/2042	200	192
4.125% due 05/15/2051	700	655
5.625% due 02/26/2044	3,300	3,694
7.375% due 09/18/2037	400	521
		<u>5,677</u>
Total Colombia (Cost \$7,743)		<u>8,376</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
COSTA RICA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Costa Rica Government International Bond		
5.625% due 04/30/2043	\$ 3,500	\$ 3,267
Total Costa Rica (Cost \$2,750)		<u>3,267</u>
DOMINICAN REPUBLIC 3.5%		
SOVEREIGN ISSUES 3.5%		
Dominican Republic International Bond		
4.875% due 09/23/2032	500	526
5.300% due 01/21/2041	1,000	1,023
5.500% due 01/27/2025	500	549
5.875% due 01/30/2060	1,000	1,020
5.950% due 01/25/2027	5,900	6,696
6.000% due 07/19/2028	1,500	1,721
6.400% due 06/05/2049	1,600	1,758
6.875% due 01/29/2026	1,700	1,980
10.750% due 08/11/2028 DOP	2,500	56
Total Dominican Republic (Cost \$14,019)		<u>15,329</u>
ECUADOR 2.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Petroamazonas EP		
4.625% due 12/06/2021	\$ 111	111
SOVEREIGN ISSUES 2.1%		
Ecuador Government International Bond		
0.000% due 07/31/2030	710	404
0.500% due 07/31/2040	3,157	2,028
1.000% due 07/31/2035	6,051	4,380
5.000% due 07/31/2030	2,620	2,354
		<u>9,166</u>
Total Ecuador (Cost \$5,417)		<u>9,277</u>
EGYPT 2.6%		
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Egypt Government International Bond		
4.750% due 04/11/2025	EUR 1,000	1,229
4.750% due 04/16/2026	2,000	2,445
5.625% due 04/16/2030	1,000	1,187
5.875% due 02/16/2031	\$ 300	297
6.125% due 01/31/2022	700	712
6.375% due 04/11/2031	EUR 700	860
7.053% due 01/15/2032	\$ 200	208
7.500% due 02/16/2061	900	856
7.625% due 05/29/2032	1,700	1,828
7.903% due 02/21/2048	200	199
8.500% due 01/31/2047	1,700	1,790
Total Egypt (Cost \$11,362)		<u>11,611</u>
EL SALVADOR 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
El Salvador Government International Bond		
7.125% due 01/20/2050	1,600	1,324
7.625% due 02/01/2041	1,500	1,282
9.500% due 07/15/2052	400	378
Total El Salvador (Cost \$3,744)		<u>2,984</u>
ETHIOPIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Ethiopia Government International Bond		
6.625% due 12/11/2024	600	535
Total Ethiopia (Cost \$600)		<u>535</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
GHANA 2.0%			Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara		
SOVEREIGN ISSUES 2.0%			5.250% due 10/24/2042	\$ 2,800	\$ 3,203
Republic of Ghana International Bond			5.250% due 05/15/2047	200	229
0.000% due 04/07/2025	\$ 300	\$ 237	6.150% due 05/21/2048	400	509
7.625% due 05/16/2029	300	301			16,213
7.750% due 04/07/2029	1,000	1,013	SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
8.125% due 01/18/2026	1,200	1,253	Indonesia Government International Bond		
8.125% due 03/26/2032	1,400	1,408	4.750% due 07/18/2047	200	244
8.625% due 04/07/2034	1,000	1,015	5.125% due 01/15/2045	400	505
8.750% due 03/11/2061	1,700	1,638	5.250% due 01/17/2042	200	253
8.950% due 03/26/2051	2,000	1,969			
Total Ghana (Cost \$8,819)		8,834	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
GUATEMALA 0.8%			2.800% due 06/23/2030 (d)	300	312
SOVEREIGN ISSUES 0.8%					1,314
Guatemala Government Bond			Total Indonesia (Cost \$14,786)		17,527
4.875% due 02/13/2028	800	894	ISRAEL 0.3%		
4.900% due 06/01/2030	600	673	CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
5.750% due 06/06/2022	600	619	Israel Electric Corp. Ltd.		
6.125% due 06/01/2050	1,200	1,444	5.000% due 11/12/2024	300	334
Total Guatemala (Cost \$3,462)		3,630			
HONG KONG 0.7%			SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%			Israel Government International Bond		
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.			2.750% due 07/03/2030	500	539
1.253% due 02/24/2023 (d)	1,300	1,232	3.800% due 05/13/2060	400	464
					1,003
Huarong Finance II Co. Ltd.			Total Israel (Cost \$1,281)		1,337
5.000% due 11/19/2025	200	204	IVORY COAST 1.6%		
		1,436	SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%			Ivory Coast Government International Bond		
Airport Authority (b)			4.875% due 01/30/2032	EUR 800	965
2.100% due 03/08/2026	700	711	5.250% due 03/22/2030	3,000	3,792
2.400% due 03/08/2028	1,000	1,012	5.750% due 12/31/2032	\$ 1,324	1,349
		1,723	5.875% due 10/17/2031	EUR 200	258
Total Hong Kong (Cost \$3,193)		3,159	6.625% due 03/22/2048	500	636
INDIA 1.2%			Total Ivory Coast (Cost \$6,575)		7,000
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%			JAMAICA 0.6%		
Indian Railway Finance Corp. Ltd.			CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
3.249% due 02/13/2030	500	514	TransJamaican Highway Ltd.		
3.950% due 02/13/2050	300	296	5.750% due 10/10/2036	\$ 396	397
State Bank of India			SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
4.000% due 01/24/2022	1,578	1,599	Jamaica Government International Bond		
		2,409	7.875% due 07/28/2045	1,500	2,137
SOVEREIGN ISSUES 0.7%			Total Jamaica (Cost \$1,896)		2,534
Export-Import Bank of India			JORDAN 0.9%		
3.250% due 01/15/2030	3,000	3,099	SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Total India (Cost \$5,340)		5,508	Jordan Government International Bond		
INDONESIA 4.0%			5.750% due 01/31/2027	2,200	2,401
CORPORATE BONDS & NOTES 3.7%			5.850% due 07/07/2030	200	212
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT			7.375% due 10/10/2047	1,200	1,295
3.950% due 03/28/2024	2,200	2,358	Total Jordan (Cost \$3,729)		3,908
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT			KAZAKHSTAN 1.0%		
5.450% due 05/15/2030	800	936	CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Pelabuhan Indonesia III Persero PT			Development Bank of Kazakhstan JSC		
4.875% due 10/01/2024	3,100	3,433	4.125% due 12/10/2022	700	729
Pertamina Persero PT			KazMunayGas National Co. JSC		
6.450% due 05/30/2044 (d)	1,700	2,274	5.375% due 04/24/2030	2,100	2,520
6.500% due 11/07/2048	2,400	3,271	5.750% due 04/19/2047	900	1,120
			Total Kazakhstan (Cost \$3,895)		4,369

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
KENYA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Republic of Kenya Government International Bond		
6.300% due 01/23/2034	\$ 800	\$ 827
8.000% due 05/22/2032	1,300	1,490
Total Kenya (Cost \$2,280)		2,317
LUXEMBOURG 2.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.7%		
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.		
4.375% due 09/19/2022	5,300	5,490
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
4.950% due 03/23/2027	1,700	1,899
5.150% due 02/11/2026 (d)	2,000	2,252
6.510% due 03/07/2022	1,500	1,545
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
6.125% due 02/07/2022	800	819
Total Luxembourg (Cost \$11,323)		12,005
MALAYSIA 1.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
Petronas Capital Ltd.		
3.404% due 04/28/2061	1,400	1,478
3.500% due 04/21/2030	400	441
4.500% due 03/18/2045	300	374
4.550% due 04/21/2050	600	761
4.800% due 04/21/2060	800	1,087
Petronas Energy Canada Ltd.		
2.112% due 03/23/2028	600	606
		4,747
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Malaysia Sukuk Global Bhd		
4.080% due 04/27/2046	1,000	1,242
Total Malaysia (Cost \$6,109)		5,989
MARSHALL ISLANDS 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Nakilat, Inc.		
6.267% due 12/31/2033	70	88
Total Marshall Islands (Cost \$83)		88
MAURITIUS 0.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Greenko Solar Mauritius Ltd.		
5.950% due 07/29/2026	500	535
Total Mauritius (Cost \$499)		535
MEXICO 3.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.5%		
Petroleos Mexicanos		
6.350% due 02/12/2048	936	795
6.500% due 03/13/2027	500	529
6.625% due 06/15/2038	4,400	4,094
6.840% due 01/23/2030	2,514	2,621
6.950% due 01/28/2060	2,760	2,439
7.690% due 01/23/2050	700	670
		11,148
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Mexico Government International Bond		
5.750% due 10/12/2110	4,600	5,628
Total Mexico (Cost \$15,571)		16,776

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
MONGOLIA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Mongolia Government International Bond		
3.500% due 07/07/2027	\$ 1,200	\$ 1,181
4.450% due 07/07/2031	500	493
5.625% due 05/01/2023	400	422
8.750% due 03/09/2024	1,000	1,145
Total Mongolia (Cost \$3,141)		3,241
MOROCCO 1.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
OCP S.A.		
3.750% due 06/23/2031	800	812
5.125% due 06/23/2051	1,000	1,013
		1,825
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Morocco Government International Bond		
2.375% due 12/15/2027	1,500	1,485
4.000% due 12/15/2050	1,400	1,306
4.250% due 12/11/2022	400	417
		3,208
Total Morocco (Cost \$5,069)		5,033
NAMIBIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Namibia Government International Bond		
5.250% due 10/29/2025	1,000	1,079
Total Namibia (Cost \$995)		1,079
NETHERLANDS 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV		
6.950% due 07/10/2042	3,400	4,767
MDGH - GMTN BV		
3.950% due 05/21/2050	900	1,045
		5,812
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Republic of Angola Via Avenir II BV		
4.665% due 12/07/2023	850	837
7.661% due 07/01/2023	526	523
		1,360
Total Netherlands (Cost \$6,326)		7,172
NIGERIA 3.2%		
SOVEREIGN ISSUES 3.2%		
Nigeria Government International Bond		
5.625% due 06/27/2022	800	826
6.375% due 07/12/2023	3,400	3,627
6.500% due 11/28/2027	300	318
7.143% due 02/23/2030	3,700	3,905
7.625% due 11/21/2025	1,600	1,794
7.875% due 02/16/2032	400	432
8.747% due 01/21/2031	2,900	3,296
Total Nigeria (Cost \$13,194)		14,198
OMAN 2.5%		
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
Oman Government International Bond		
5.375% due 03/08/2027	2,300	2,438
6.000% due 08/01/2029	5,600	6,004
6.250% due 01/25/2031	700	765
6.500% due 03/08/2047	400	403
6.750% due 01/17/2048	700	717
7.000% due 01/25/2051	800	837
Total Oman (Cost \$10,313)		11,164

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
PAKISTAN 1.0%			QATAR 2.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%			CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
Pakistan Government International Bond			Qatar Petroleum		
6.875% due 12/05/2027	\$ 600	\$ 616	2.250% due 07/12/2031	\$ 800	\$ 808
8.875% due 04/08/2051	1,500	1,554	3.125% due 07/12/2041	700	722
			3.300% due 07/12/2051	1,500	1,552
					<u>3,082</u>
Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.			SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
5.500% due 10/13/2021	1,500	1,505	Qatar Government International Bond		
5.625% due 12/05/2022	600	613	3.750% due 04/16/2030	2,800	3,196
Total Pakistan (Cost \$4,185)		<u>4,288</u>	4.400% due 04/16/2050	1,000	1,241
			4.817% due 03/14/2049 (d)	1,800	2,357
PANAMA 3.8%			5.103% due 04/23/2048	400	540
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%					<u>7,334</u>
Aeropuerto Internacional de			Total Qatar (Cost \$9,421)		<u>10,416</u>
Tocumen S.A.					
5.125% due 08/11/2061	600	636			
Banco Nacional de Panama			ROMANIA 1.6%		
2.500% due 08/11/2030	600	577	SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
		<u>1,213</u>	Romania Government International Bond		
			1.750% due 07/13/2030	EUR 900	1,069
SOVEREIGN ISSUES 3.5%			2.375% due 04/19/2027	1,000	1,297
Panama Government International Bond			2.625% due 12/02/2040	300	350
4.300% due 04/29/2053	1,600	1,798	2.875% due 04/13/2042	600	703
4.500% due 04/01/2056	1,000	1,147	3.000% due 02/14/2031	\$ 700	732
6.700% due 01/26/2036	1,000	1,376	4.000% due 02/14/2051	2,350	2,501
8.125% due 04/28/2034	4,400	6,413	4.625% due 04/03/2049	EUR 200	298
9.375% due 01/16/2023	4,500	5,058	Total Romania (Cost \$6,786)		<u>6,950</u>
		<u>15,792</u>			
Total Panama (Cost \$14,900)		<u>17,005</u>			
			RUSSIA 2.5%		
PARAGUAY 0.5%			CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%			SCF Capital Designated Activity Co.		
Paraguay Government International Bond			5.375% due 06/16/2023	\$ 2,400	2,567
5.400% due 03/30/2050	400	479			
6.100% due 08/11/2044	1,300	1,648	SOVEREIGN ISSUES 1.9%		
Total Paraguay (Cost \$1,894)		<u>2,127</u>	Russia Government International Bond		
			4.375% due 03/21/2029	2,800	3,206
PERU 2.3%			5.100% due 03/28/2035	4,200	5,129
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%					<u>8,335</u>
Petroleos del Peru S.A.			Total Russia (Cost \$9,591)		<u>10,902</u>
5.625% due 06/19/2047	1,000	1,045			
SOVEREIGN ISSUES 2.1%			RWANDA 0.1%		
Fondo MIVIVIENDA S.A.			SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
3.500% due 01/31/2023	5,300	5,466	Rwanda International Government Bond		
			5.500% due 08/09/2031	400	414
			Total Rwanda (Cost \$400)		<u>414</u>
Peru Government International Bond					
2.392% due 01/23/2026	800	829	SAUDI ARABIA 3.1%		
2.780% due 12/01/2060	500	449	CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
2.783% due 01/23/2031	200	205	Saudi Arabian Oil Co.		
2.844% due 06/20/2030	300	311	3.500% due 11/24/2070	1,200	1,176
3.230% due 07/28/2121	400	352			
5.350% due 08/12/2040	PEN 3,700	755	SOVEREIGN ISSUES 2.8%		
6.550% due 03/14/2037	\$ 705	976	Saudi Government International Bond		
		<u>9,343</u>	2.250% due 02/02/2033	900	889
Total Peru (Cost \$10,474)		<u>10,388</u>	3.450% due 02/02/2061	800	804
			3.750% due 01/21/2055	1,400	1,494
PHILIPPINES 1.4%			4.375% due 04/16/2029 (d)	6,000	6,988
SOVEREIGN ISSUES 1.4%			4.500% due 10/26/2046	2,000	2,356
Philippines Government International Bond					<u>12,531</u>
2.650% due 12/10/2045	200	194	Total Saudi Arabia (Cost \$12,765)		<u>13,707</u>
2.950% due 05/05/2045	2,500	2,524			
3.700% due 03/01/2041	3,000	3,333			
3.950% due 01/20/2040	200	228			
Total Philippines (Cost \$6,365)		<u>6,279</u>			

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SENEGAL 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Senegal Government International Bond		
4.750% due 03/13/2028 EUR	1,600	\$ 2,010
5.375% due 06/08/2037	100	121
6.250% due 05/23/2033	\$ 200	216
6.750% due 03/13/2048	400	417
Total Senegal (Cost \$2,708)		<u>2,764</u>
SERBIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Serbia Government International Bond		
1.500% due 06/26/2029 EUR	200	241
3.125% due 05/15/2027	400	528
Total Serbia (Cost \$676)		<u>769</u>
SINGAPORE 1.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
BOC Aviation Ltd. (d)		
2.750% due 09/18/2022	\$ 2,000	2,035
4.000% due 01/25/2024	2,650	2,823
Total Singapore (Cost \$4,643)		<u>4,858</u>
SOUTH AFRICA 4.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.7%		
Eskom Holdings SOC Ltd.		
4.314% due 07/23/2027	2,800	2,814
6.350% due 08/10/2028	2,800	3,105
6.750% due 08/06/2023	1,400	1,464
Transnet SOC Ltd.		
4.000% due 07/26/2022	200	203
		<u>7,586</u>
SOVEREIGN ISSUES 3.2%		
South Africa Government International Bond		
4.850% due 09/30/2029	1,700	1,802
5.375% due 07/24/2044	1,000	998
5.750% due 09/30/2049	1,200	1,211
6.300% due 06/22/2048 (d)	2,000	2,165
10.500% due 12/21/2026 ZAR	103,000	8,105
		<u>14,281</u>
Total South Africa (Cost \$21,175)		<u>21,867</u>
SRI LANKA 1.4%		
SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
Sri Lanka Government International Bond		
5.750% due 04/18/2023	\$ 1,000	702
5.875% due 07/25/2022	600	459
6.125% due 06/03/2025	1,300	871
6.200% due 05/11/2027	2,700	1,762
6.850% due 11/03/2025	1,300	871
7.550% due 03/28/2030	2,200	1,422
Total Sri Lanka (Cost \$7,166)		<u>6,087</u>
SUPRANATIONAL 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Eastern & Southern African Trade & Development Bank		
4.125% due 06/30/2028	900	920
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
African Export - Import Bank		
2.634% due 05/17/2026	1,000	1,027
Total Supranational (Cost \$1,901)		<u>1,947</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
TRINIDAD AND TOBAGO 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Trinidad Petroleum Holdings Ltd.		
6.000% due 05/08/2022	\$ 143	\$ 145
Total Trinidad and Tobago (Cost \$144)		<u>145</u>
TUNISIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Banque Centrale de Tunisie International Bond		
3.280% due 08/09/2027 /	200,000	1,257
Total Tunisia (Cost \$1,910)		<u>1,257</u>
TURKEY 3.8%		
SOVEREIGN ISSUES 3.8%		
Turkey Government International Bond		
4.750% due 01/26/2026	\$ 200	200
5.125% due 02/17/2028	500	497
5.750% due 05/11/2047	7,200	6,424
5.875% due 06/26/2031	300	299
6.125% due 10/24/2028	1,900	1,978
6.375% due 10/14/2025	1,100	1,165
7.250% due 03/05/2038	500	539
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S		
5.375% due 10/24/2023	2,600	2,699
8.250% due 01/24/2024	2,800	3,068
Total Turkey (Cost \$16,822)		<u>16,869</u>
UKRAINE 3.7%		
SOVEREIGN ISSUES 3.7%		
Ukraine Government International Bond		
1.258% due 05/31/2040	3,600	4,115
6.876% due 05/21/2029	300	318
7.253% due 03/15/2033	500	531
7.750% due 09/01/2021	5,000	5,000
7.750% due 09/01/2022	600	628
7.750% due 09/01/2023	1,900	2,048
7.750% due 09/01/2024	600	660
7.750% due 09/01/2025	1,000	1,106
7.750% due 09/01/2027	1,400	1,561
17.000% due 05/11/2022 UAH	16,000	617
Total Ukraine (Cost \$14,330)		<u>16,584</u>
UNITED ARAB EMIRATES 1.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC		
3.650% due 11/02/2029	\$ 3,000	3,364
Abu Dhabi Ports Co. PJSC		
2.500% due 05/06/2031	900	925
DP World Ltd.		
5.625% due 09/25/2048	1,400	1,765
		<u>6,054</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Dubai Government International Bond		
3.900% due 09/09/2050	800	768
Finance Department Government of Sharjah		
3.625% due 03/10/2033	400	402
4.375% due 03/10/2051	200	191
		<u>1,361</u>
Total United Arab Emirates (Cost \$6,745)		<u>7,415</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UNITED KINGDOM 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC		
9.375% due 03/10/2023	\$ 586	\$ 615
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC		
8.250% due 07/09/2024	1,500	1,575
Ukraine Railways Via Short Line PLC		
9.875% due 09/15/2021	20	20
		<u>2,210</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC		
9.750% due 01/22/2025	350	380
Total United Kingdom (Cost \$2,479)		<u>2,590</u>
UNITED STATES 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
DAE Funding LLC		
2.625% due 03/20/2025	400	409
3.375% due 03/20/2028	200	207
Rutas 2 & 7 Finance Ltd.		
0.000% due 09/30/2036	1,000	733
Total United States (Cost \$1,262)		<u>1,349</u>
URUGUAY 1.7%		
SOVEREIGN ISSUES 1.7%		
Uruguay Government International Bond		
4.975% due 04/20/2055	100	132
7.625% due 03/21/2036	2,290	3,502
7.875% due 01/15/2033	2,440	3,690
Total Uruguay (Cost \$5,909)		<u>7,324</u>
VENEZUELA 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.500% due 04/12/2037 (a)	20,990	976
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Venezuela Government International Bond (a)		
7.000% due 03/31/2038	10,900	1,161
7.650% due 04/21/2025	8,215	842
9.250% due 09/15/2027	4,520	482
11.950% due 08/05/2031	340	36
		<u>2,521</u>
Total Venezuela (Cost \$29,412)		<u>3,497</u>
ZAMBIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Zambia Government International Bond (a)		
5.375% due 09/20/2022	1,200	921
8.970% due 07/30/2027	500	395
Total Zambia (Cost \$1,445)		<u>1,316</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SHORT-TERM INSTRUMENTS 4.7%		
TIME DEPOSITS 0.1%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.005% due 09/01/2021	\$ 103	\$ 103
Bank of Nova Scotia		
0.005% due 09/01/2021	2	2
BNP Paribas Bank		
(0.310%) due 09/01/2021	/ 7,729	70
0.005% due 09/01/2021	\$ 11	11
0.010% due 09/01/2021	CAD 7	5
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.310%) due 09/01/2021	/ 3	0
Citibank N.A.		
0.005% due 09/01/2021	\$ 26	26
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 09/01/2021	109	109
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 09/01/2021	EUR 0	1
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 09/01/2021	\$ 35	35
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.310%) due 09/01/2021	/ 727	7
0.005% due 09/01/2021	GBP 3	4
0.005% due 09/01/2021	\$ 45	45
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.310%) due 09/01/2021	/ 1,444	13
0.005% due 09/01/2021	GBP 15	21
0.005% due 09/01/2021	\$ 145	145
		<u>597</u>
U.S. TREASURY BILLS (c) 4.6%		
0.027% due 10/28/2021	3,200	3,200
0.035% due 09/30/2021	5,600	5,600
0.038% due 12/09/2021	4,400	4,400
0.050% due 02/24/2022	6,200	6,198
0.060% due 09/02/2021 (g)	900	900
		<u>20,298</u>
Total Short-Term Instruments (Cost \$20,895)		<u>20,895</u>
Total Investments in Securities 104.5% (Cost \$462,989)	\$	463,233
Financial Derivative Instruments (e)(f) 0.5% (Cost or Premiums, net \$748)		2,063
Other Assets and Liabilities, net (5.0%)		<u>(22,196)</u>
Net Assets 100.0%	\$	<u>443,100</u>

[次へ](#)

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (AMOUNTS IN THOUSANDS*, EXCEPT NUMBER OF CONTRACTS):

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

(a) Security is in default.

(b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.

(c) Coupon represents a yield to maturity.

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	借入日	満期日	借入額 ⁽²⁾	逆現先取引に係る未払金
BPS	(0.500%)	07/09/2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (556)	\$ (556)
BPS	0.350%	08/06/2021	09/07/2021	(3,675)	(3,676)
BPS	0.370%	06/18/2021	09/16/2021	(1,463)	(1,464)
BPS	0.370%	08/25/2021	09/16/2021	(1,947)	(1,947)
BPS	0.390%	08/06/2021	09/07/2021	(2,238)	(2,238)
BRC	(0.750%)	05/20/2021	09/07/2021	(867)	(866)
BRC	(0.750%)	07/23/2021	TBD ⁽¹⁾	(1,636)	(1,634)
BRC	(0.350%)	04/13/2021	09/30/2021	(307)	(307)
JML	0.300%	08/17/2021	09/17/2021	(2,108)	(2,108)
SCX	0.260%	08/16/2021	10/04/2021	(6,640)	(6,641)
TDM	0.220%	08/09/2021	TBD ⁽¹⁾	(4,586)	(4,587)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (26,024)

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	逆現先取引の契約満期までの残存期間				合計
	翌日物および 継続	30日まで	31日から90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (10,061)	\$ 0	\$ (4,587)	\$ (14,648)
Non - U.S. Government Debt	0	(2,545)	(6,641)	(2,190)	(11,376)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (12,606)	\$ (6,641)	\$ (6,777)	\$ (26,024)
Total Borrowings	\$ 0	\$ (12,606)	\$ (6,641)	\$ (6,777)	\$ (26,024)
Payable for Reverse Repurchase Agreements				\$	(26,024)

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本金額	受領額	空売りに係る 未払金 ⁽³⁾
TDM	U.S. Treasury Bonds	2.250%	05/15/2041	\$ 200	\$ (217)	\$ (215)
Total Short Sales (0.0%)					\$ (217)	\$ (215)

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 August 31, 2021:

(d) Securities with an aggregate market value of \$28,213 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of August 31, 2021.

取引相手	現先取引 に係る未収金	逆現先取引 に係る未払金	買戻し条件付 売買取引に係る 未払金	空売り に係る未払金	借入金および その他の 金融取引合計	差入/ (受入)担保	エクスポ ージャー 純額 ⁽⁴⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 0	\$ (9,881)	\$ 0	\$ 0	\$ (9,881)	10,675	\$ 794
BRC	0	(2,807)	0	0	(2,807)	2,891	84
JML	0	(2,108)	0	0	(2,108)	2,577	469
SCX	0	(6,641)	0	0	(6,641)	6,988	347
TDM	0	(4,587)	0	0	(4,587)	4,805	218
Master Securities Forward Transactions Agreement							
TDM	0	0	0	(215)	(215)	0	(215)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 0	\$ (26,024)	\$ 0	\$ (215)			

(1) Open maturity reverse repurchase agreement.

(2) The average amount of borrowings outstanding during the period ended August 31, 2021 was \$24,839 at a weighted average interest rate of 0.241%.

Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

(3) Includes \$1 of interest payable on short sales.

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

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

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価益/(損)	変動証拠金	
					資産	負債
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Short	12/2021	51	\$ (8)	\$ 0	\$ 0
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2021	140	25	0	(3)
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Short	12/2021	31	5	4	0
U.S. Treasury 30-Year Bond December Futures	Short	12/2021	2	4	2	0
Total Futures Contracts				\$ 26	\$ 6	\$ (3)

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	時価	未実現 評価益/(損)	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2026	\$ 8,700	\$ (130)	\$ 109	\$ 2	\$ 0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2027	22,600	748	2,464	6	0
Total Swap Agreements					\$ 618	\$ 2,573	\$ 8	\$ 0

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 August 31, 2021:

Cash of \$1,231 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of August 31, 2021. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	時価	未収変動証拠金			時価	未払変動証拠金		
	買建 オプション	先物	スワップ 契約	合計	売建 オプション	先物	スワップ 契約	合計
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 6	\$ 8	\$ 14	\$ 0	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)

(f) 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	未実現評価益/(損)	
					資産	負債
BOA	09/2021	RUB	948	\$ 13	\$ 0	\$ 0
BOA	11/2021		114	2	0	0
BPS	09/2021	\$	1,053	ZAR 15,727	33	0
BRC	11/2021	RUB	626	\$ 8	0	0
CBK	09/2021	ZAR	21,608	1,557	66	0
CBK	09/2021		52,859	3,857	210	0
CBK	10/2021	PEN	7,621	1,981	117	0
CBK	10/2021		40,678	11,009	1,051	0
CBK	10/2021	\$	1,874	PEN 7,621	0	(9)
CBK	11/2021	RUB	945	\$ 13	0	0
CBK	01/2022	\$	539	PEN 1,958	0	(61)
CBK	02/2022	PEN	2,412	\$ 628	40	0
CBK	05/2022		7,621	1,864	14	0
CBK	05/2022	\$	9,720	PEN 39,750	0	(68)
DUB	11/2021		800	3,266	0	(1)
GLM	09/2021	RUB	731	\$ 10	0	0
GLM	09/2021	ZAR	36,085	2,622	131	0
GLM	10/2021	DOP	2,151	37	0	0
GLM	11/2021	RUB	658	9	0	0
GLM	11/2021	\$	640	PEN 2,398	0	(54)
GLM	02/2022	ZAR	31,289	\$ 2,001	0	(115)
HUS	09/2021	RUB	499	7	0	0
HUS	11/2021		24	0	0	0
MYI	09/2021	\$	427	ZAR 6,127	0	(5)
SCX	09/2021	EUR	15,983	\$ 18,964	96	0
SCX	09/2021	JPY	164,339	1,498	2	0
SCX	10/2021	EUR	15,983	18,879	0	(1)
SCX	10/2021	JPY	164,339	1,496	0	0
SCX	10/2021	RUB	1,510	20	0	0
UAG	11/2021		474	6	0	0
Total Forward Foreign Currency Contracts					\$ 1,760	\$ (314)

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照債券	固定金利 の(支払)	満期日	2021年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受領額)	未実現評価益/ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
BOA	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	3.540%	\$ 700	\$ 59	\$ 9	\$ 68	\$ 0
CBK	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	3.540%	400	34	6	40	0
DUB	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	3.540%	300	30	(1)	29	0
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	3.337%	4,000	500	(217)	283	0
HUS	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.686%	200	(1)	(2)	0	(3)
JPM	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.686%	700	(1)	(8)	0	(9)
JPM	South Africa Government International Bond	(1.000%)	06/20/2026	1.853%	2,300	108	(22)	86	0
JPM	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	3.540%	300	29	1	30	0
						\$ 758	\$ (234)	\$ 536	\$ (12)

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

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2021年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現評価益/ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.601%	\$ 2,400	\$ (8)	\$ 21	\$ 13	\$ 0
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2031	2.606%	300	(43)	4	0	(39)
BOA	Montenegro Government International Bond	1.000%	06/20/2023	4.524%	EUR 100	(8)	1	0	(7)
BOA	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.852%	\$ 200	2	0	2	0
BOA	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.133%	1,500	6	20	26	0
BOA	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.163%	400	2	7	9	0
BOA	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.395%	900	(21)	28	7	0
BPS	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.852%	1,000	9	0	9	0
BRC	Argentina Government International Bond	5.000%	12/20/2023	15.191%	600	(83)	(28)	0	(111)
BRC	Eskom Holdings SOC Ltd.	1.000%	12/20/2021	2.405%	1,200	(26)	23	0	(3)
BRC	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2031	1.305%	500	(20)	7	0	(13)
BRC	QNB Finance Ltd.	1.000%	06/20/2023	0.562%	100	1	0	1	0
BRC	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.288%	188	2	3	5	0
CBK	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.852%	3,600	25	7	32	0
DUB	Egypt Government International Bond	5.000%	06/20/2022	1.774%	1,100	38	2	40	0
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2021	0.281%	1,400	(8)	14	6	0

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

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2021年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現評価益/ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.666%	\$ 900	\$ (7)	\$ 12	\$ 5	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.601%	500	(2)	4	2	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	12/20/2025	0.771%	6,300	132	(58)	74	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.852%	1,300	13	(1)	12	0
GST	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.288%	112	1	2	3	0
JPM	Israel Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.251%	600	14	0	14	0
JPM	Nigeria Government International Bond	1.000%	06/20/2022	1.580%	1,100	(7)	5	0	(2)
JPM	Nigeria Government International Bond	1.000%	06/20/2023	2.259%	700	(17)	2	0	(15)
JPM	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2023	1.035%	1,000	(16)	17	1	0
MYC	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.601%	500	(2)	5	3	0
MYC	Eskom Holdings SOC Ltd.	1.000%	06/20/2022	2.760%	300	(6)	2	0	(4)
MYC	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2021	0.195%	2,600	19	(7)	12	0
						\$ (10)	\$ 92	\$ 276	\$ (194)
Total Swap Agreements						\$ 748	\$ (142)	\$ 812	\$ (206)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of OTC financial derivative instruments and collateral pledged/(received) as of August 31, 2021:

(g) Securities with an aggregate market value of \$262 have been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as of August 31, 2021.

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバティブの時価純額	差入／ (受入)担保	エクスポージャー純額 ⁽⁵⁾
	先渡為替 契約	買建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計	先渡為替 契約	売建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計			
BOA	\$ 0	\$ 0	\$ 125	\$ 125	\$ 0	\$ 0	\$ (46)	\$ (46)	\$ 79	\$ 0	\$ 79
BPS	33	0	9	42	0	0	0	0	42	0	42
BRC	0	0	6	6	0	0	(127)	(127)	(121)	0	(121)
CBK	1,498	0	72	1,570	(138)	0	0	(138)	1,432	(1,730)	(298)
DUB	0	0	80	80	(1)	0	0	(1)	79	(10)	69
GLM	131	0	0	131	(169)	0	0	(169)	(38)	262	224
GST	0	0	374	374	0	0	0	0	374	(500)	(126)
HUS	0	0	0	0	0	0	(3)	(3)	(3)	0	(3)
JPM	0	0	131	131	0	0	(26)	(26)	105	0	105
MYC	0	0	15	15	0	0	(4)	(4)	11	0	11
MYI	0	0	0	0	(5)	0	0	(5)	(5)	0	(5)
SCX	98	0	0	98	(1)	0	0	(1)	97	(290)	(193)
UAG	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total Over the Counter	\$ 1,760	\$ 0	\$ 812	\$ 2,572	\$ (314)	\$ 0	\$ (206)	\$ (520)			

- (1) If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (2) If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (3) Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- (4) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- (5) Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from OTC financial derivative instruments 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.

FAIR VALUE OF FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS

The following is a summary of the fair valuation of the Fund's derivative instruments categorized by risk exposure. See Note 7, Principal and Other Risks, in the Notes to Financial Statements on risks of the Fund.

Fair Values of Financial Derivative Instruments on the Statement of Assets and Liabilities as of August 31, 2021:

	Derivatives not accounted for as hedging instruments						
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total	
Financial Derivative Instruments - Assets							
Exchange-traded or centrally cleared							
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 6	\$ 6	
Swap Agreements	0	0	0	0	8	8	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 14</u>	<u>\$ 14</u>	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 1,760	\$ 0	\$ 1,760	
Swap Agreements	0	812	0	0	0	812	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 812</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 1,760</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 2,572</u>	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 812</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 1,760</u>	<u>\$ 14</u>	<u>\$ 2,586</u>	
Financial Derivative Instruments - Liabilities							
Exchange-traded or centrally cleared							
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(\$ 3)	(\$ 3)	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(\$ 314)	\$ 0	(\$ 314)	
Swap Agreements	0	(206)	0	0	0	(206)	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (206)</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (314)</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (520)</u>	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (206)</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (314)</u>	<u>(\$ 3)</u>	<u>\$ (523)</u>	

The Effect of Financial Derivative Instruments on the Statement of Operations for the period ended
August 31, 2021:

	Derivatives not accounted for as hedging instruments					
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 142	\$ 142
Swap Agreements	0	0	0	0	145	145
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 287	\$ 287
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (878)	\$ 0	\$ (878)
Swap Agreements	0	75	0	0	0	75
	\$ 0	\$ 75	\$ 0	\$ (878)	\$ 0	\$ (803)
	\$ 0	\$ 75	\$ 0	\$ (878)	\$ 287	\$ (516)
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 39	\$ 39
Swap Agreements	0	0	0	0	255	255
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 294	\$ 294
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 1,267	\$ 0	\$ 1,267
Swap Agreements	0	70	0	0	0	70
	\$ 0	\$ 70	\$ 0	\$ 1,267	\$ 0	\$ 1,337
	\$ 0	\$ 70	\$ 0	\$ 1,267	\$ 294	\$ 1,631

FAIR VALUE MEASUREMENTS

The following is a summary of the fair valuations according to the inputs used as of August 31, 2021 in valuing the Fund's assets and liabilities:

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2021	Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2021
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Angola					Ecuador				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 7,309	\$ 0	\$ 7,309	Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 111	\$ 0	\$ 111
Argentina					Sovereign Issues	0	9,166	0	9,166
Sovereign Issues	0	7,999	0	7,999	Egypt				
Armenia					Sovereign Issues	0	11,611	0	11,611
Sovereign Issues	0	1,654	0	1,654	El Salvador				
Azerbaijan					Sovereign Issues	0	2,984	0	2,984
Corporate Bonds & Notes	0	8,267	0	8,267	Ethiopia				
Sovereign Issues	0	1,943	0	1,943	Sovereign Issues	0	535	0	535
Bahamas					Ghana				
Sovereign Issues	0	1,180	0	1,180	Sovereign Issues	0	8,834	0	8,834
Bahrain					Guatemala				
Sovereign Issues	0	6,920	0	6,920	Sovereign Issues	0	3,630	0	3,630
Belarus					Hong Kong				
Sovereign Issues	0	994	0	994	Corporate Bonds & Notes	0	1,436	0	1,436
Brazil					Sovereign Issues	0	1,723	0	1,723
Corporate Bonds & Notes	0	2,919	0	2,919	India				
Sovereign Issues	0	6,306	0	6,306	Corporate Bonds & Notes	0	2,409	0	2,409
British Virgin Islands					Sovereign Issues	0	3,099	0	3,099
Sovereign Issues	0	1,516	0	1,516	Indonesia				
Cameroon					Corporate Bonds & Notes	0	16,213	0	16,213
Sovereign Issues	0	827	0	827	Sovereign Issues	0	1,314	0	1,314
Cayman Islands					Israel				
Corporate Bonds & Notes	0	8,586	0	8,586	Corporate Bonds & Notes	0	334	0	334
Sovereign Issues	0	1,020	0	1,020	Sovereign Issues	0	1,003	0	1,003
Chile					Ivory Coast				
Corporate Bonds & Notes	0	8,011	0	8,011	Sovereign Issues	0	7,000	0	7,000
Sovereign Issues	0	204	0	204	Jamaica				
China					Corporate Bonds & Notes	0	397	0	397
Corporate Bonds & Notes	0	8,787	0	8,787	Sovereign Issues	0	2,137	0	2,137
Colombia					Jordan				
Corporate Bonds & Notes	0	2,699	0	2,699	Sovereign Issues	0	3,908	0	3,908
Sovereign Issues	0	5,677	0	5,677	Kazakhstan				
Costa Rica					Corporate Bonds & Notes	0	4,369	0	4,369
Sovereign Issues	0	3,267	0	3,267	Kenya				
Dominican Republic					Sovereign Issues	0	2,317	0	2,317
Sovereign Issues	0	15,329	0	15,329	Luxembourg				
					Corporate Bonds & Notes	0	12,005	0	12,005

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2021
Investments in Securities, at Value				
Malaysia				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 4,747	\$ 0	\$ 4,747
Sovereign Issues	0	1,242	0	1,242
Marshall Islands				
Corporate Bonds & Notes	0	88	0	88
Mauritius				
Corporate Bonds & Notes	0	535	0	535
Mexico				
Corporate Bonds & Notes	0	11,148	0	11,148
Sovereign Issues	0	5,628	0	5,628
Mongolia				
Sovereign Issues	0	3,241	0	3,241
Morocco				
Corporate Bonds & Notes	0	1,825	0	1,825
Sovereign Issues	0	3,208	0	3,208
Namibia				
Sovereign Issues	0	1,079	0	1,079
Netherlands				
Corporate Bonds & Notes	0	5,812	0	5,812
Sovereign Issues	0	1,360	0	1,360
Nigeria				
Sovereign Issues	0	14,198	0	14,198
Oman				
Sovereign Issues	0	11,164	0	11,164
Pakistan				
Sovereign Issues	0	4,288	0	4,288
Panama				
Corporate Bonds & Notes	0	1,213	0	1,213
Sovereign Issues	0	15,792	0	15,792
Paraguay				
Sovereign Issues	0	2,127	0	2,127
Peru				
Corporate Bonds & Notes	0	1,045	0	1,045
Sovereign Issues	0	9,343	0	9,343
Philippines				
Sovereign Issues	0	6,279	0	6,279
Qatar				
Corporate Bonds & Notes	0	3,082	0	3,082
Sovereign Issues	0	7,334	0	7,334
Romania				
Sovereign Issues	0	6,950	0	6,950

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2021
Investments in Securities, at Value				
Russia				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 2,567	\$ 0	\$ 2,567
Sovereign Issues	0	8,335	0	8,335
Rwanda				
Sovereign Issues	0	414	0	414
Saudi Arabia				
Corporate Bonds & Notes	0	1,176	0	1,176
Sovereign Issues	0	12,531	0	12,531
Senegal				
Sovereign Issues	0	2,764	0	2,764
Serbia				
Sovereign Issues	0	769	0	769
Singapore				
Corporate Bonds & Notes	0	4,858	0	4,858
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	0	7,586	0	7,586
Sovereign Issues	0	14,281	0	14,281
Sri Lanka				
Sovereign Issues	0	6,087	0	6,087
Supranational				
Corporate Bonds & Notes	0	920	0	920
Sovereign Issues	0	1,027	0	1,027
Trinidad and Tobago				
Corporate Bonds & Notes	0	145	0	145
Tunisia				
Sovereign Issues	0	1,257	0	1,257
Turkey				
Sovereign Issues	0	16,869	0	16,869
Ukraine				
Sovereign Issues	0	16,584	0	16,584
United Arab Emirates				
Corporate Bonds & Notes	0	6,054	0	6,054
Sovereign Issues	0	1,361	0	1,361
United Kingdom				
Corporate Bonds & Notes	0	2,210	0	2,210
Sovereign Issues	0	380	0	380
United States				
Corporate Bonds & Notes	0	1,349	0	1,349
Uruguay				
Sovereign Issues	0	7,324	0	7,324

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2021
Investments in Securities, at Value				
Venezuela				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 976	\$ 0	\$ 976
Sovereign Issues	0	2,521	0	2,521
Zambia				
Sovereign Issues	0	1,316	0	1,316
Short-Term Instruments	0	20,895	0	20,895
Total Investments	\$ 0	\$ 463,233	\$ 0	\$ 463,233
Short Sales, at value	\$ 0	\$ (215)	\$ 0	\$ (215)
Financial Derivative Instruments - Assets				
Exchange-traded or centrally cleared	0	14	0	14
Over the counter	0	2,572	0	2,572
	\$ 0	\$ 2,586	\$ 0	\$ 2,586
Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Exchange-traded or centrally cleared	0	(3)	0	(3)
Over the counter	0	(513)	(7)	(520)
	\$ 0	\$ (516)	\$ (7)	\$ (523)
Totals	\$ 0	\$ 465,088	\$ (7)	\$ 465,081

There were no significant transfers into or out of Level 3 during the period ended August 31, 2021.

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（2022年2月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約216億円）

発行済株式総数 5,051,655株

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命をただちに解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の4分の3以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の4分の3を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不適切な行為、詐欺または重過失の場合を除き、信託証書に基づく職務の遂行について、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、() ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは() 管理会社の行為に関係し、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が実際に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、信託証書に基づく職務の遂行について、かかる行為が故意の不適切な行為、詐欺または重過失を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は2022年1月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産価格の合計（通貨別）
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	27	4,334,765,085.69米ドル

（３）その他

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (2021年11月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約213億円)

発行済株式総数 5,051,655株 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(中略)

() 大株主の状況

(2021年11月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	5,002,575株	99.03%

< 訂正後 >

(前略)

() 資本金の額 (2022年2月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約216億円)

発行済株式総数 5,051,655株 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

(注) 米ドルの円貨換算は、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信相場の仲値である、1米ドル = 115.55円による。

(中略)

() 大株主の状況

(2022年2月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	5,051,655株	100%

2 投資方針

(3) 運用体制

<訂正前>

(イ) サブ・ファンドの運用体制

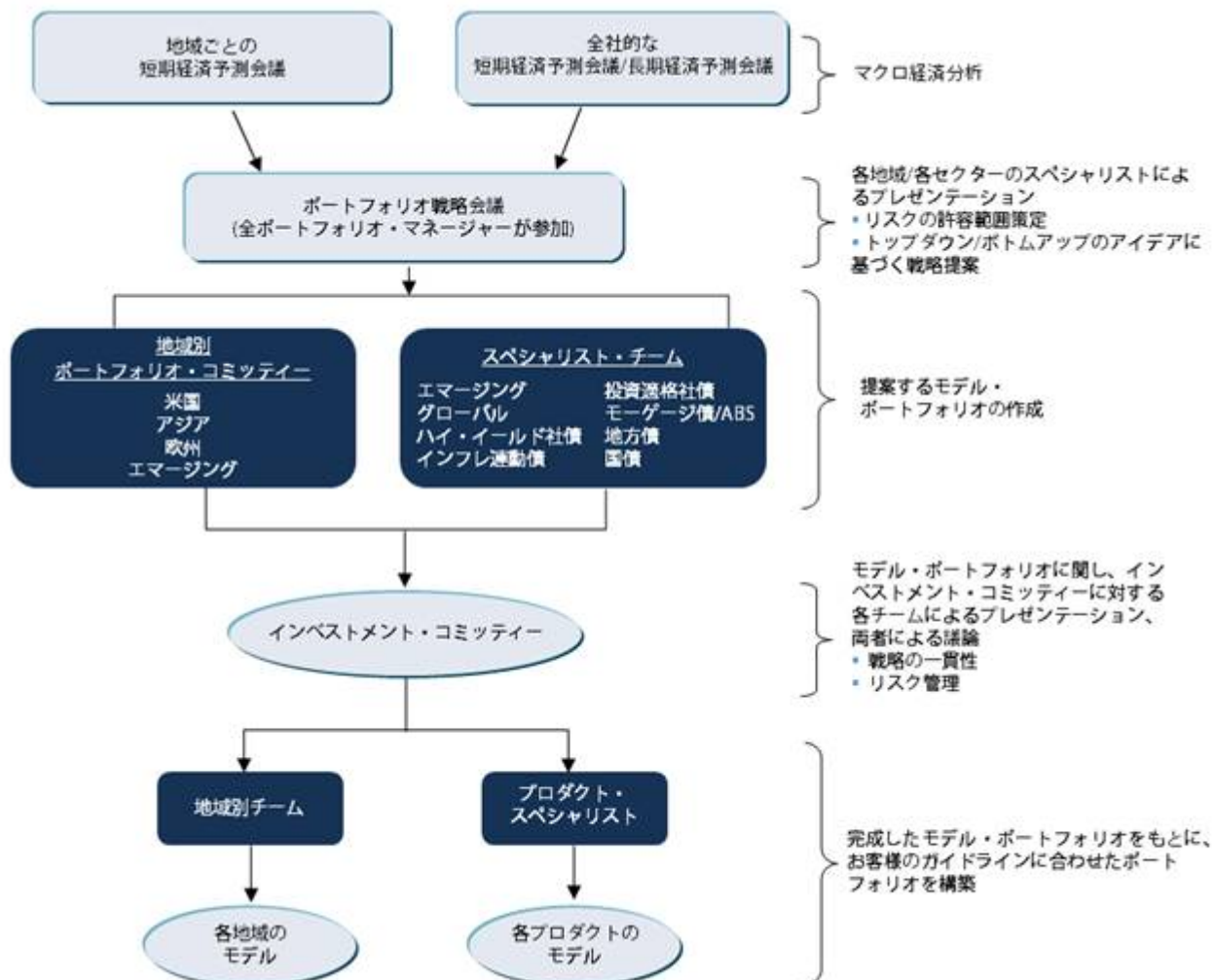
副投資運用会社の運用体制

(中略)

上記運用体制は、2021年12月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

(ロ) 投資先ファンドの運用体制

運用プロセス

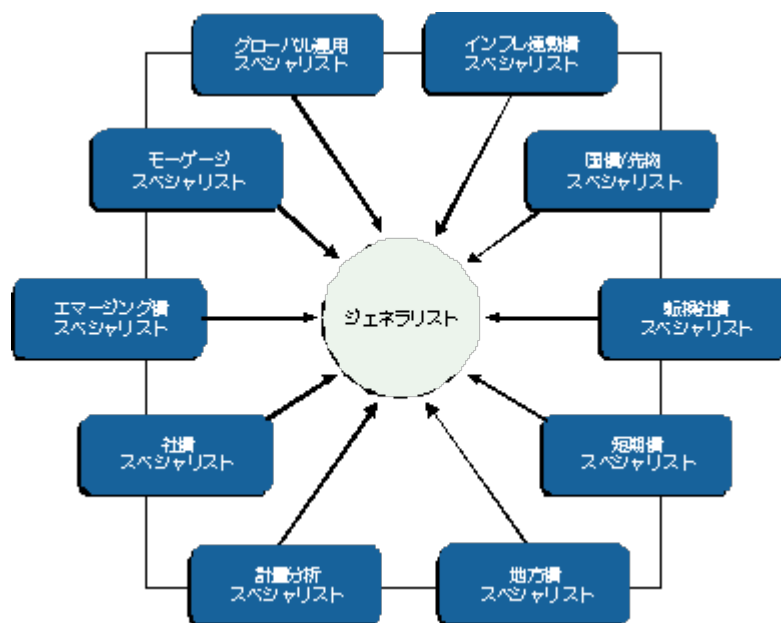


(2021年12月末日現在)

(中略)

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



(2021年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

（イ）サブ・ファンドの運用体制

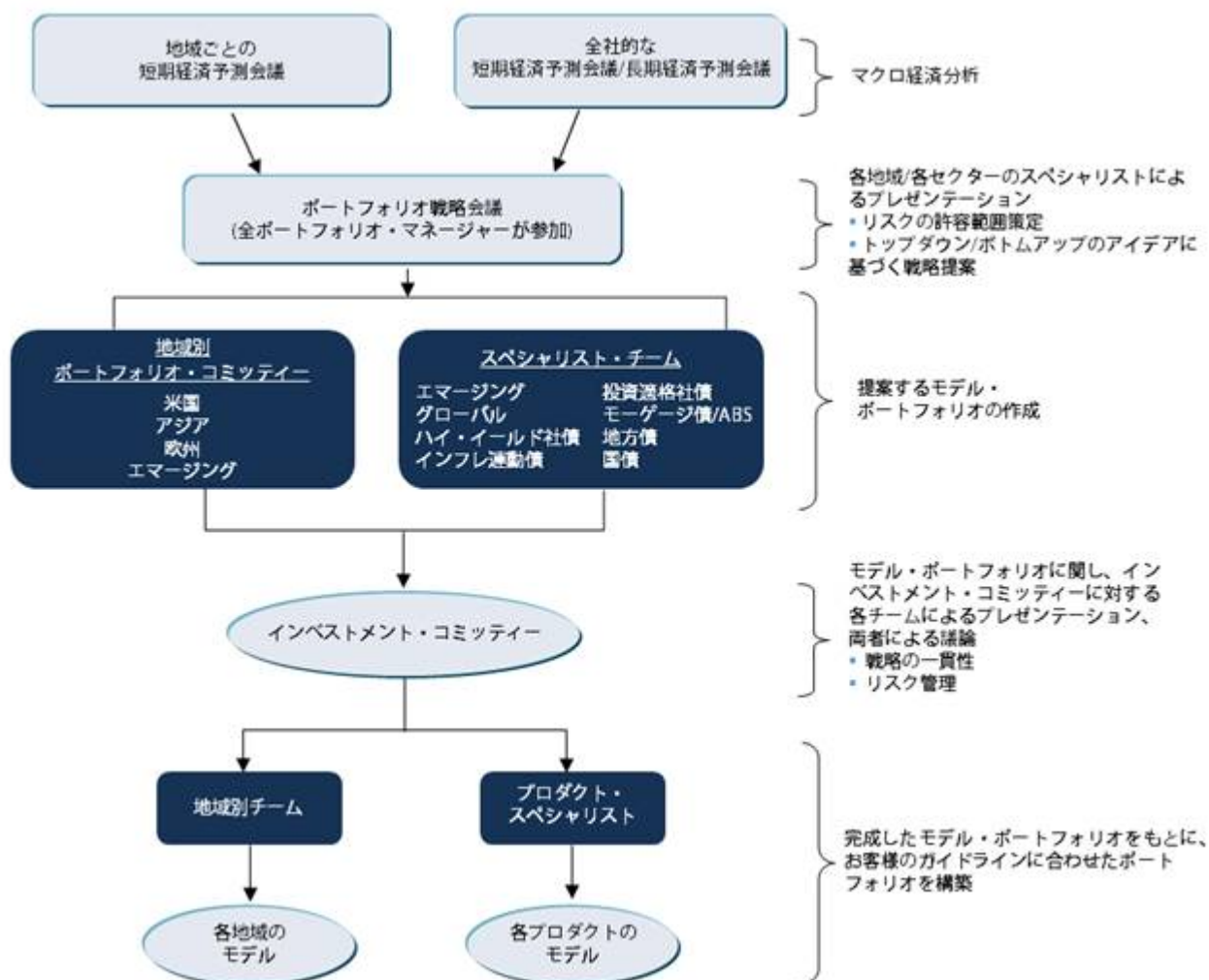
副投資運用会社の運用体制

（中略）

上記運用体制は、2022年2月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

（ロ）投資先ファンドの運用体制

運用プロセス

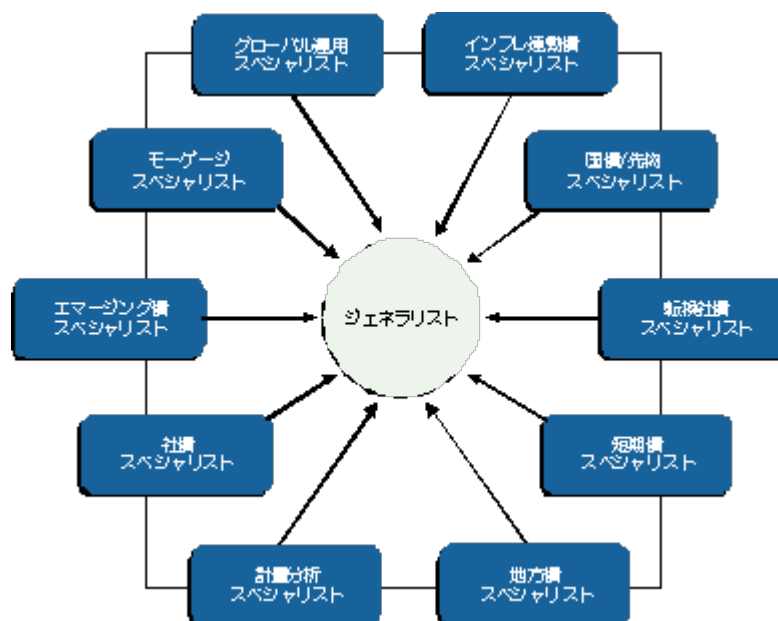


（2022年2月末日現在）

（中略）

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



（2022年2月末日現在）

（後略）

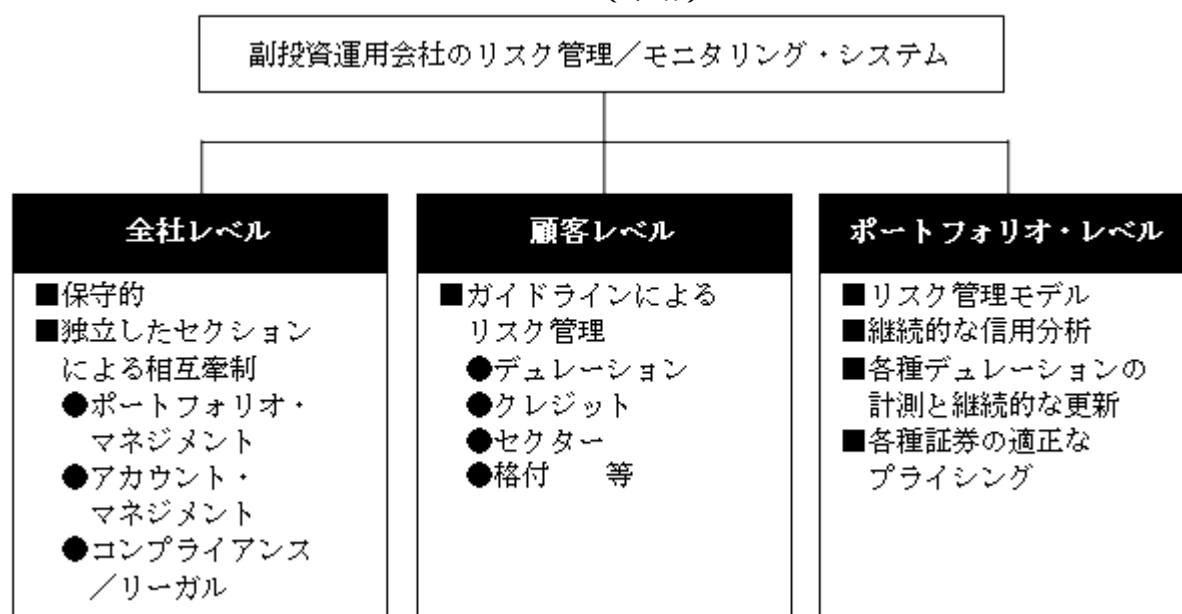
3 投資リスク

（2）リスクに対する管理体制

<訂正前>

（イ）サブ・ファンドのリスク管理体制

（中略）



（2021年12月末日現在）

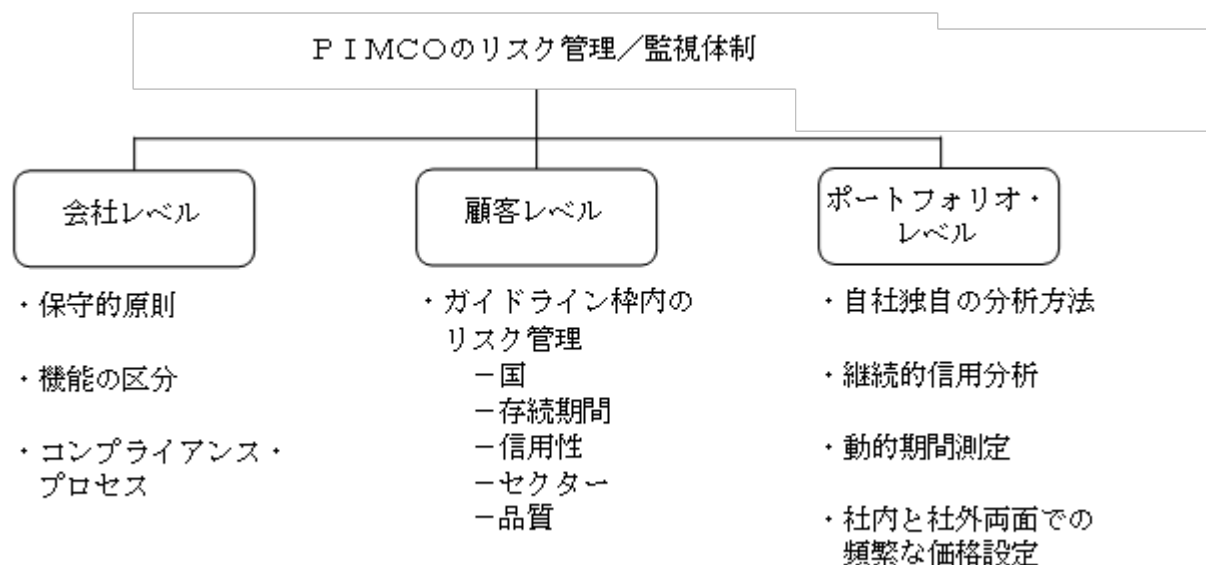
（中略）

（ロ）投資先ファンドのリスク管理体制

PIMCOのリスク管理は、ポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、インベストメント・オペレーションズおよびコンプライアンスの4つの業務分野に及んでいる。各々

は、ポートフォリオ・リスクとコンプライアンスが適正に監視され、管理されていることを目指して個別でありながら、ある程度重複する責務を負っている。

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



PIMCOのインベストメント・コミッティーが多岐にわたるポートフォリオ・リスクを監視する。

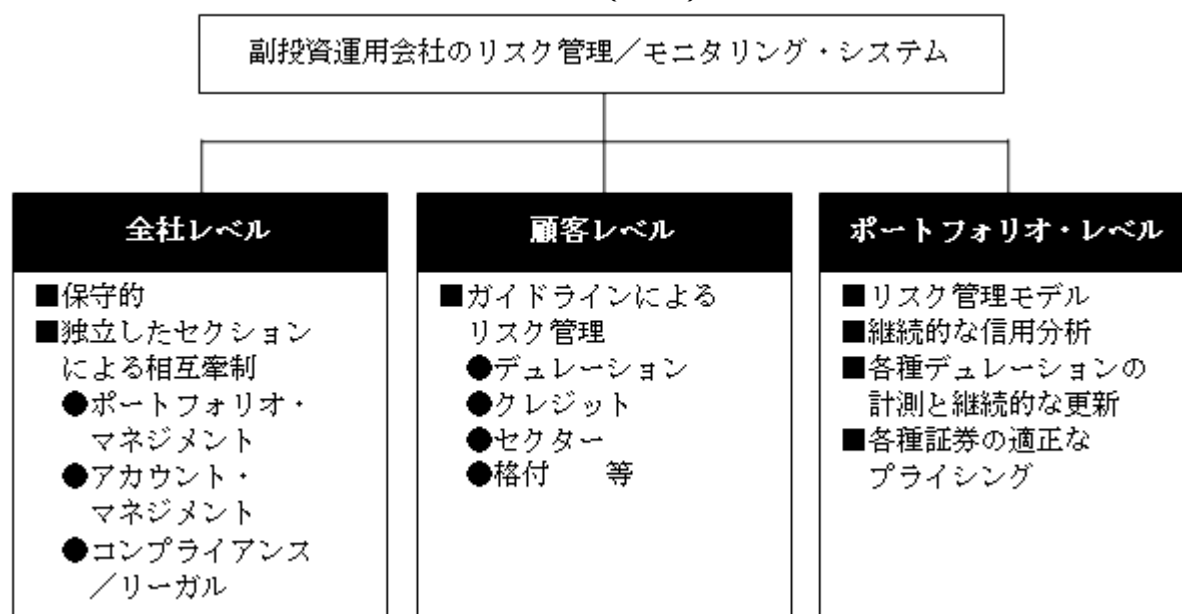
(2021年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

(イ) サブ・ファンドのリスク管理体制

(中略)



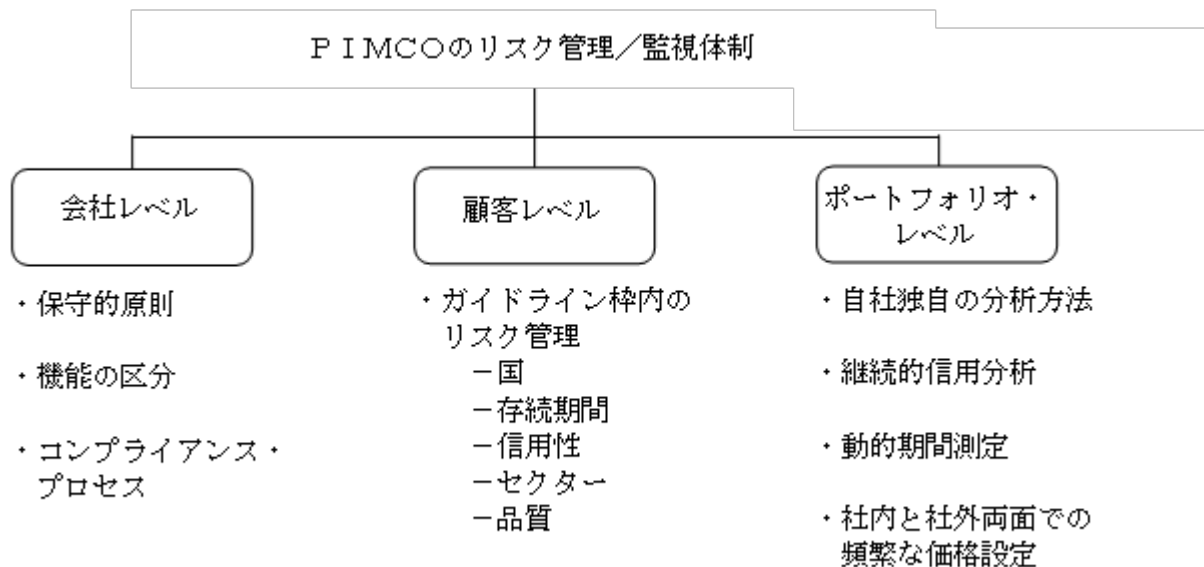
(2022年2月末日現在)

(中略)

(ロ) 投資先ファンドのリスク管理体制

PIMCOのリスク管理は、ポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、インベストメント・オペレーションズおよびコンプライアンスの4つの業務分野に及んでいる。各々は、ポートフォリオ・リスクとコンプライアンスが適正に監視され、管理されていることを目指して個別でありながら、ある程度重複する責務を負っている。

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



PIMCOのインベストメント・コミッティーが多岐にわたるポートフォリオ・リスクを監視する。

(2022年2月末日現在)

(後略)

(3) リスクに関する参考情報

<訂正前>

(前略)

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、サブ・ファンドは、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、サブ・ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)、FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)およびFTSE新興国市場国債指数(円ベース)に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。

<訂正後>

(前略)

TOPIX(東証株価指数)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)、FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)およびFTSE新興国市場国債指数(円ベース)に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

（Ａ）日本

2021年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（Ａ）日本

2022年 3 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

5 運用状況

(2) 投資資産

<訂正前>

投資有価証券の主要銘柄(2021年11月末日現在)

<米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数(口)	取得価格(米ドル)		時価(米ドル)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドB クラ スD(BRL)	ケイマン 諸島	投資信託	2,896,052.28	5.50	15,936,074.22	2.51	7,269,091.23	99.51

<豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数(口)	取得価格(豪ドル)		時価(豪ドル)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドB クラ スA(BRL)	ケイマン 諸島	投資信託	650,776.78	6.20	4,033,358.32	3.21	2,088,993.46	101.22

<参考情報>

(ご参考) ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド(M)の組入上位銘柄

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	PANAMA (REP OF)	8.1250%	2034/04/28	1.6%
2	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.9500%	2027/01/25	1.5%
3	REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC	5.7500%	2047/05/11	1.4%
4	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.7500%	2050/01/14	1.4%
5	GAZPROM (GPN CAPITAL) SR UNSEC REGS	4.3750%	2022/09/19	1.3%
6	EL FONDO MIVIVIENDA SA UNSEC 144A	3.5000%	2023/01/31	1.3%
7	PANAMA (REP OF) GLBL UNSECURED	9.3750%	2023/01/16	1.2%
8	RUSSIA FOREIGN BOND SR UNSEC REGS	5.1000%	2035/03/28	1.2%
9	OMAN GOV INTERNTL BOND SR UNSEC REGS	6.0000%	2029/08/01	1.1%
10	SOUTHERN GAS CORRIDOR GOV GTD UNSEC REGS	6.8750%	2026/03/24	1.1%

- 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。
- 現金同等資産(米国短期国債等)を除いて表示しています。

投資不動産物件(2021年11月末日現在)

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの(2021年11月末日現在)

該当事項なし。

<訂正後>

投資有価証券の主要銘柄(2022年2月末日現在)

<米ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数(口)	取得価格(米ドル)		時価(米ドル)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドB クラ スD(BRL)	ケイマン 諸島	投資信託	2,836,693.78	5.40	15,320,373.18	2.53	7,176,835.27	99.91

<豪ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数(口)	取得価格(豪ドル)		時価(豪ドル)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドB クラ スA(BRL)	ケイマン 諸島	投資信託	624,991.12	6.11	3,817,780.12	3.19	1,993,721.67	101.84

<参考情報>

〔ご参考〕ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド(M)の組入上位銘柄

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	PANAMA (REP OF)	8.1250%	2034/04/28	1.7%
2	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.9500%	2027/01/25	1.7%
3	REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC	5.7500%	2047/05/11	1.5%
4	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.7500%	2050/01/14	1.5%
5	EL FONDO MIVIVIENDA SA UNSEC 144A	3.5000%	2023/01/31	1.5%
6	PANAMA (REP OF) GLBL UNSECURED	9.3750%	2023/01/16	1.3%
7	OMAN GOV INTERNTL BOND SR UNSEC REGS	6.0000%	2029/08/01	1.2%
8	MEXICO GOVT (UMS) GLBL SR NT	5.7500%	2110/10/12	1.1%
9	PEMEX SR UNSEC	6.6250%	2038/06/15	1.1%
10	SOUTHERN GAS CORRIDOR GOV GTD UNSEC REGS	6.8750%	2026/03/24	1.0%

- 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。
- 現金同等資産(米国短期国債等)を除いて表示しています。

投資不動産物件(2022年2月末日現在)

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの(2022年2月末日現在)

該当事項なし。