

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和4年4月28日
【計算期間】	第13期中(自 令和3年8月1日 至 令和4年1月31日)
【ファンド名】	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・ポートフォリオ(USD Portfolio) - ユーロ・ポートフォリオ(EUR Portfolio) - 豪ドル・ポートフォリオ(AUD Portfolio) - 南アフリカランド・ポートフォリオ(ZAR Portfolio)
【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
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

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・ポートフォリオ（USD Portfolio）、ユーロ・ポートフォリオ（EUR Portfolio）、豪ドル・ポートフォリオ（AUD Portfolio）および南アフリカランド・ポートフォリオ（ZAR 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・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	25,463,152.12	106.52
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 1,559,661.29	- 6.52
合計（純資産総額）		23,903,490.83 (約2,762百万円)	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・ポートフォリオ：アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）

ユーロ・ポートフォリオ：ユーロ

豪ドル・ポートフォリオ：オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）

南アフリカランド・ポートフォリオ：南アフリカランド

（注３）別途定める場合を除き、米ドル、ユーロ、豪ドルおよび南アフリカランドの円貨換算は、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、１ユーロ＝129.34円、１豪ドル＝82.95円および１南アフリカランド＝7.51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。従って、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。従って、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。

<ユーロ・ポートフォリオ>

資産の種類	地域名	時価合計（ユーロ）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	3,248,782.46	108.46
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 253,490.05	- 8.46
合計（純資産総額）		2,995,292.41 (約387百万円)	100.00

<豪ドル・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	11,640,939.21	106.96
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 757,447.36	- 6.96
合計（純資産総額）		10,883,491.85 (約903百万円)	100.00

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

資産の種類	地域名	時価合計 （南アフリカランド）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	213,678,233.59	106.80
現金・その他の資産 （負債控除後）		- 13,596,180.31	- 6.80
合計（純資産総額）		200,082,053.28 (約1,503百万円)	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・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	28,259,864.57	3,265,427	86.18	9,958
４月末日	28,475,162.80	3,290,305	87.75	10,140
５月末日	28,617,573.51	3,306,761	88.17	10,188
６月末日	28,740,561.43	3,320,972	88.37	10,211
７月末日	28,672,695.68	3,313,130	88.26	10,198
８月末日	28,782,775.43	3,325,850	88.69	10,248
９月末日	27,934,823.33	3,227,869	86.34	9,977
10月末日	27,449,511.74	3,171,791	85.91	9,927
11月末日	26,642,138.50	3,078,499	83.48	9,646
12月末日	26,500,203.83	3,062,099	83.41	9,638
2022年１月末日	25,551,125.93	2,952,433	81.22	9,385
２月末日	23,903,490.83	2,762,048	76.07	8,790

<ユーロ・ポートフォリオ>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	ユーロ	千円	ユーロ	円
2021年３月末日	3,314,768.67	428,732	57.42	7,427
４月末日	3,363,513.86	435,037	58.45	7,560
５月末日	3,378,317.28	436,952	58.71	7,594
６月末日	3,376,169.25	436,674	58.86	7,613
７月末日	3,360,809.32	434,687	58.86	7,613
８月末日	3,371,233.12	436,035	59.12	7,647
９月末日	3,612,892.14	467,291	57.54	7,442
10月末日	3,594,526.63	464,916	57.25	7,405
11月末日	3,493,575.98	451,859	55.64	7,196
12月末日	3,330,382.15	430,752	55.68	7,202
2022年１月末日	3,233,119.80	418,172	54.14	7,002
２月末日	2,995,292.41	387,411	50.67	6,554

< 豪ドル・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	13,123,638.19	1,088,606	40.61	3,369
４月末日	13,066,413.97	1,083,859	41.17	3,415
５月末日	13,116,785.01	1,088,037	41.29	3,425
６月末日	12,983,788.98	1,077,005	41.27	3,423
７月末日	12,795,378.42	1,061,377	41.16	3,414
８月末日	12,740,545.84	1,056,828	41.23	3,420
９月末日	12,356,138.49	1,024,942	40.09	3,325
10月末日	12,108,000.69	1,004,359	39.78	3,300
11月末日	11,652,752.25	966,596	38.67	3,208
12月末日	11,569,794.45	959,714	38.62	3,204
2022年１月末日	11,639,977.11	965,536	37.62	3,121
２月末日	10,883,491.85	902,786	35.40	2,936

< 南アフリカランド・ポートフォリオ >

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	南アフリカランド	千円	南アフリカランド	円
2021年３月末日	243,970,012.19	1,832,215	676.17	5,078
４月末日	246,628,200.78	1,852,178	686.27	5,154
５月末日	247,093,344.82	1,855,671	688.90	5,174
６月末日	246,045,955.70	1,847,805	689.99	5,182
７月末日	241,483,543.17	1,813,541	689.00	5,174
８月末日	241,449,571.56	1,813,286	690.86	5,188
９月末日	234,059,963.39	1,757,790	672.97	5,054
10月末日	231,786,481.69	1,740,716	668.66	5,022
11月末日	223,434,311.40	1,677,992	649.38	4,877
12月末日	219,564,749.98	1,648,931	646.31	4,854
2022年１月末日	214,080,755.18	1,607,746	632.36	4,749
２月末日	200,082,053.28	1,502,616	593.24	4,455

< 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・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	4.68	541

<ユーロ・ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	ユーロ	円
2021年３月１日～2022年２月末日	2.04	264

<豪ドル・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	2.72	226

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	南アフリカランド	円
2021年３月１日～2022年２月末日	74.40	559

< 参考情報 >

米ドル・ポートフォリオ	
(単位: 米ドル)	
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)	6.60
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)	5.96
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	4.68
2021年10月	0.39
2021年11月	0.39
2021年12月	0.39
2022年1月	0.39
2022年2月	0.39
直近1年間累計	4.68
設定来累計	79.37

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

豪ドル・ポートフォリオ	
(単位: 豪ドル)	
第8計算期間(2016年8月1日~2017年7月31日)	11.88
第9計算期間(2017年8月1日~2018年7月31日)	11.88
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	11.88
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	9.92
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	3.50
2021年10月	0.25
2021年11月	0.18
2021年12月	0.18
2022年1月	0.18
2022年2月	0.18
直近1年間累計	2.72
設定来累計	129.53

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

ユーロ・ポートフォリオ	
(単位: ユーロ)	
第8計算期間(2016年8月1日~2017年7月31日)	7.80
第9計算期間(2017年8月1日~2018年7月31日)	7.80
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	7.80
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	6.52
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	2.36
2021年10月	0.17
2021年11月	0.17
2021年12月	0.17
2022年1月	0.17
2022年2月	0.17
直近1年間累計	2.04
設定来累計	86.39

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

南アフリカランド・ポートフォリオ	
(単位: 南アフリカランド)	
第8計算期間(2016年8月1日~2017年7月31日)	128.40
第9計算期間(2017年8月1日~2018年7月31日)	128.40
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	128.40
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	110.40
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	74.40
2021年10月	6.20
2021年11月	6.20
2021年12月	6.20
2022年1月	6.20
2022年2月	6.20
直近1年間累計	74.40
設定来累計	1,512.20

● 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・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	- 7.76%

（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一口当たり純資産価格（分配落の額）

以下同じ。

<ユーロ・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	- 9.73%

<豪ドル・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	- 7.77%

<南アフリカランド・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	- 2.78%

< 参考情報 >



- 収益率(%)=100×(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・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
4,970 (4,970)	20,020 (20,020)	314,238 (314,238)

（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。以下同じ。

<ユーロ・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
5,900 (5,900)	4,562 (4,562)	59,117 (59,117)

<豪ドル・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
18,326 (18,326)	36,648 (36,648)	307,439 (307,439)

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
30,542 (30,542)	54,803 (54,803)	337,271 (337,271)

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、ユーロ、豪ドルおよび南アフリカランドで表示されている。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ユーロ＝129.34円、１豪ドル＝82.95円および１南アフリカランド＝7.51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。

（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・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	25,463,152.12	2,942,267
現金（ロング）		
現金および現金等価物	218,366.88	25,232
未収利息		
未収利息	79.99	9
資産合計	25,681,598.99	2,967,509
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(4,543.08)	(525)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(36,019.39)	(4,162)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(11,355.78)	(1,312)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(45,433.83)	(5,250)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(13,219.49)	(1,528)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(7,618.06)	(880)
未払金		
未払金	199.50	23
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(4,289.13)	(496)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(2,271.20)	(262)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(5,922.60)	(684)
負債合計	(130,473.06)	(15,076)
純資産総額	25,551,125.93	2,952,433
発行済口数	314,588	口
1 口当たり純資産価格	81.22	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 - ユーロ・ポートフォリオ

純資産計算書
2022年 1 月31日現在
(ユーロで表示)

	ユーロ	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	3,248,782.46	420,198
現金（ロング）		
現金および現金等価物	28,692.50	3,711
未収金		
未収金	6,000.02	776
資産合計	3,283,474.98	424,685
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(582.66)	(75)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(24,224.47)	(3,133)
未払元本		
未払元本	(5,396.00)	(698)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(1,456.61)	(188)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(5,832.88)	(754)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(1,640.05)	(212)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(945.44)	(122)
未払金		
未払金	(1,245.33)	(161)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(3,702.22)	(479)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(291.81)	(38)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(5,037.71)	(652)
負債合計	(50,355.18)	(6,513)
純資産総額	3,233,119.80	418,172
発行済口数	59,717	口
1 口当たり純資産価格	54.14	ユーロ

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・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	11,640,939.21	965,616
現金（ロング）		
現金および現金等価物	102,676.41	8,517
未収利息		
未収利息	3.77	0
資産合計	11,743,619.39	974,133
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(2,000.81)	(166)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(50,218.05)	(4,166)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(5,001.76)	(415)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(20,005.19)	(1,659)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(5,837.85)	(484)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(3,364.41)	(279)
未払金		
未払金	(2,072.59)	(172)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(5,888.07)	(488)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(1,000.36)	(83)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(8,253.19)	(685)
負債合計	(103,642.28)	(8,597)
純資産総額	11,639,977.11	965,536
発行済口数	309,432	口
1 口当たり純資産価格	37.62	豪ドル

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 南アフリカランド・ポートフォリオ

純資産計算書

2022年 1 月31日現在

（南アフリカランドで表示）

	南アフリカランド	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	213,678,233.59	1,604,724
現金（ロング）		
現金および現金等価物	1,827,007.89	13,721
資産合計	215,505,241.48	1,618,444
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(37,996.12)	(285)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(529,263.39)	(3,975)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(95,024.95)	(714)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(379,961.28)	(2,854)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(113,327.85)	(851)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(65,307.98)	(490)
未払金		
未払金	(31,769.52)	(239)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(63,163.84)	(474)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(19,005.07)	(143)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(89,666.30)	(673)
負債合計	(1,424,486.30)	(10,698)
純資産総額	214,080,755.18	1,607,746
発行済口数	338,542	口
1 口当たり純資産価格	632.36	南アフリカランド

[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・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		
市場に係る実現利益	19,194.68	2,218
受取配当金	238,360.82	27,543
未実現時価評価損益	(657,637.71)	(75,990)
収益合計：	(400,082.21)	(46,229)
費用		
監査費用	4,527.09	523
保管報酬	6,739.52	779
報告書作成費用	309.12	36
投資運用報酬	18,331.46	2,118
受託報酬	1,890.60	218
経費	1,731.60	200
副投資顧問報酬	31,810.42	3,676
代行協会員報酬	2,695.75	311
販売報酬	26,957.98	3,115
副管理報酬	1,347.90	156
費用合計：	96,341.44	11,132

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・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	463,742.50	53,585
受取配当金	463,742.50	53,585
現金および現金等価物	349,315.46	40,363
ファンド	114,427.04	13,222
費用	(647,190.19)	(74,783)
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	(4,261.46)	(492)
現金および現金等価物	(4,261.46)	(492)
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	(10,653.65)	(1,231)
現金および現金等価物	(10,653.65)	(1,231)
販売報酬	(42,614.61)	(4,924)
現金および現金等価物	(42,614.61)	(4,924)
配当金	(496,060.89)	(57,320)
現金および現金等価物	(496,060.89)	(57,320)
投資顧問報酬	(50,285.26)	(5,810)
現金および現金等価物	(50,285.26)	(5,810)
管理報酬	(28,977.96)	(3,348)
現金および現金等価物	(28,977.96)	(3,348)
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	(2,130.69)	(246)
現金および現金等価物	(2,130.69)	(246)
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	(1,317,637.16)	(152,253)
為替に係る未実現損益の変動	119.47	14
現金および現金等価物	119.47	14
価格に係る未実現損益の変動	(1,306,069.52)	(150,916)
ファンド	(1,306,069.52)	(150,916)
長期価格に係る損益	(11,767.15)	(1,360)
ファンド	(11,767.15)	(1,360)
短期価格に係る損益	80.04	9
現金および現金等価物	79.99	9
ファンド	0.05	0
純損益	(1,501,084.85)	(173,450)

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 - ユーロ・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	
	ユーロ	千円
収益		
市場に係る実現損失	(592.67)	(77)
受取配当金	24,902.91	3,221
未実現時価評価損益	(86,582.90)	(11,199)
収益合計：	(62,272.66)	(8,054)
費用		
監査費用	3,782.11	489
保管報酬	825.60	107
報告書作成費用	295.32	38
投資運用報酬	2,245.75	290
受託報酬	1,575.82	204
経費	1,096.01	142
副投資顧問報酬	3,896.99	504
代行協会員報酬	330.27	43
販売報酬	3,302.55	427
副管理報酬	165.07	21
費用合計：	17,515.49	2,265

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - ユーロ・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

（ユーロで表示）

	ユーロ	千円
収益	50,608.16	6,546
受取配当金	50,608.16	6,546
現金および現金等価物	38,264.26	4,949
ファンド	12,343.90	1,597
費用	(68,781.45)	(8,896)
A I F M D 報酬	(750.00)	(97)
現金および現金等価物	(750.00)	(97)
代行協会員報酬	(548.66)	(71)
現金および現金等価物	(548.66)	(71)
監査報酬	(5,172.21)	(669)
現金および現金等価物	(5,172.21)	(669)
保管報酬	(1,371.71)	(177)
現金および現金等価物	(1,371.71)	(177)
販売報酬	(5,486.82)	(710)
現金および現金等価物	(5,486.82)	(710)
配当金	(41,685.70)	(5,392)
現金および現金等価物	(41,685.70)	(5,392)
投資顧問報酬	(6,474.43)	(837)
現金および現金等価物	(6,474.43)	(837)
管理報酬	(3,731.02)	(483)
現金および現金等価物	(3,731.02)	(483)
報告書作成費用	(496.48)	(64)
現金および現金等価物	(496.48)	(64)
副投資運用報酬	(274.34)	(35)
現金および現金等価物	(274.34)	(35)
受託報酬	(2,790.08)	(361)
現金および現金等価物	(2,790.08)	(361)
投資に係る実現および未実現損益	(173,457.02)	(22,435)
為替に係る未実現損益の変動	(808.18)	(105)
現金および現金等価物	(808.18)	(105)
価格に係る未実現損益の変動	(160,620.36)	(20,775)
ファンド	(160,620.36)	(20,775)
長期価格に係る損益	(11,590.76)	(1,499)
ファンド	(11,590.76)	(1,499)
短期価格に係る損益	(437.72)	(57)
現金および現金等価物	(437.72)	(57)
純損益	(191,630.31)	(24,785)

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・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		
市場に係る実現利益	647.90	54
市場に係る実現損失	(273.72)	(23)
受取配当金	92,630.72	7,684
未実現時価評価損益	(263,723.64)	(21,876)
収益合計：	(170,718.74)	(14,161)
費用		
監査費用	8,581.60	712
保管報酬	2,990.54	248
報告書作成費用	523.97	43
投資運用報酬	8,134.42	675
受託報酬	2,736.19	227
経費	2,391.79	198
副投資顧問報酬	14,115.56	1,171
代行協会員報酬	1,196.26	99
販売報酬	11,962.36	992
副管理報酬	598.09	50
費用合計：	53,230.78	4,415

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・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	179,683.35	14,905
受取配当金	179,683.35	14,905
現金および現金等価物	134,170.91	11,129
ファンド	45,512.44	3,775
費用	(318,659.87)	(26,433)
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	(1,880.67)	(156)
現金および現金等価物	(1,880.67)	(156)
監査報酬	(10,503.33)	(871)
現金および現金等価物	(10,503.33)	(871)
保管報酬	(4,701.71)	(390)
現金および現金等価物	(4,701.71)	(390)
販売報酬	(18,806.83)	(1,560)
現金および現金等価物	(18,806.83)	(1,560)
配当金	(240,509.06)	(19,950)
現金および現金等価物	(240,509.06)	(19,950)
投資顧問報酬	(22,192.06)	(1,841)
現金および現金等価物	(22,192.06)	(1,841)
管理報酬	(12,788.63)	(1,061)
現金および現金等価物	(12,788.63)	(1,061)
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	(940.33)	(78)
現金および現金等価物	(940.33)	(78)
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	(560,877.90)	(46,525)
為替に係る未実現損益の変動	(2,105.83)	(175)
現金および現金等価物	(2,105.83)	(175)
価格に係る未実現損益の変動	(528,840.90)	(43,867)
ファンド	(528,840.90)	(43,867)
長期価格に係る損益	(29,906.05)	(2,481)
ファンド	(29,906.05)	(2,481)
短期価格に係る損益	(25.12)	(2)
現金および現金等価物	34.72	3
ファンド	(59.84)	(5)
純損益	(699,854.42)	(58,053)

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 - 南アフリカランド・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

	南アフリカランド	千円
収益		
市場に係る実現利益	135,909.42	1,021
市場に係る実現損失	(95.57)	(1)
受取配当金	3,370,702.88	25,314
未実現時価評価損益	(4,547,218.50)	(34,150)
収益合計：	(1,040,701.77)	(7,816)
費用		
監査費用	72,471.22	544
保管報酬	56,653.65	425
報告書作成費用	5,010.09	38
投資運用報酬	154,097.76	1,157
受託報酬	27,935.65	210
経費	27,797.34	209
副投資顧問報酬	267,404.78	2,008
代行協会員報酬	22,661.45	170
販売報酬	226,614.25	1,702
副管理報酬	11,330.71	85
費用合計：	871,976.90	6,549

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 南アフリカランド・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

（南アフリカランドで表示）

	南アフリカランド	千円
収益	6,530,015.29	49,040
受取配当金	6,530,015.29	49,040
現金および現金等価物	4,924,981.94	36,987
ファンド	1,605,033.35	12,054
費用	(9,861,132.35)	(74,057)
A I F M D 報酬	(13,357.50)	(100)
現金および現金等価物	(13,357.50)	(100)
代行協会員報酬	(35,733.48)	(268)
現金および現金等価物	(35,733.48)	(268)
監査報酬	(117,995.17)	(886)
現金および現金等価物	(117,995.17)	(886)
保管報酬	(89,333.73)	(671)
現金および現金等価物	(89,333.73)	(671)
販売報酬	(357,334.86)	(2,684)
現金および現金等価物	(357,334.86)	(2,684)
配当金	(8,506,827.80)	(63,886)
現金および現金等価物	(8,506,827.80)	(63,886)
投資顧問報酬	(421,655.14)	(3,167)
現金および現金等価物	(421,655.14)	(3,167)
管理報酬	(242,987.71)	(1,825)
現金および現金等価物	(242,987.71)	(1,825)
報告書作成費用	(8,766.57)	(66)
現金および現金等価物	(8,766.57)	(66)
副投資運用報酬	(17,866.74)	(134)
現金および現金等価物	(17,866.74)	(134)
受託報酬	(49,273.65)	(370)
現金および現金等価物	(49,273.65)	(370)
投資に係る実現および未実現損益	(9,910,693.24)	(74,429)
為替に係る未実現損益の変動	(17,955.93)	(135)
現金および現金等価物	(17,955.93)	(135)
価格に係る未実現損益の変動	(9,596,015.40)	(72,066)
ファンド	(9,596,015.40)	(72,066)
長期価格に係る損益	(282,905.68)	(2,125)
ファンド	(282,905.68)	(2,125)
短期価格に係る損益	(13,816.23)	(104)
現金および現金等価物	(13,810.82)	(104)
ファンド	(5.41)	(0)
純損益	(13,241,810.30)	(99,446)

（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・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					26,701,627.85	-1,020,108.85	0.00	25,681,519.00	100.00%
現金（ロング）					218,366.88	0.00	0.00	218,366.88	0.85%
現金および現金等価物					218,366.88	0.00	0.00	218,366.88	0.85%
米ドル					218,366.88	0.00	0.00	218,366.88	0.85%
米ドル	USD	218,366.88000	1.0000	218,366.88	218,366.88	0.00	0.00	218,366.88	0.85%
投資有価証券（ロング）					26,483,260.97	-1,020,108.85	0.00	25,463,152.12	99.15%
ファンド					26,483,260.97	-1,020,108.85	0.00	25,463,152.12	99.15%
米ドル					26,483,260.97	-1,020,108.85	0.00	25,463,152.12	99.15%
ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A クラスF（米ドル）	618337	2,287,794.44000	11.1300	26,483,260.97	26,483,260.97	-1,020,108.85	0.00	25,463,152.12	99.15%
未収金					79.99	0.00	0.00	79.99	100.00%
未収利息					79.99	0.00	0.00	79.99	100.00%
現金および現金等価物					79.99	0.00	0.00	79.99	100.00%
米ドル					79.99	0.00	0.00	79.99	100.00%
米ドル	USD	79.99000	1.0000	79.99	79.99	0.00	0.00	79.99	100.00%
未払金					-130,672.56	199.50	0.00	-130,473.06	100.00%
未払代行協会員報酬					-4,543.08	0.00	0.00	-4,543.08	3.48%
現金および現金等価物					-4,543.08	0.00	0.00	-4,543.08	3.48%
米ドル					-4,543.08	0.00	0.00	-4,543.08	3.48%
米ドル	USD	-4,543.08000	1.0000	-4,543.08	-4,543.08	0.00	0.00	-4,543.08	3.48%
未払監査報酬					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	27.61%
現金および現金等価物					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	27.61%
米ドル					-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	27.61%
米ドル	USD	-36,019.39000	1.0000	-36,019.39	-36,019.39	0.00	0.00	-36,019.39	27.61%
未払保管報酬					-11,355.78	0.00	0.00	-11,355.78	8.70%
現金および現金等価物					-11,355.78	0.00	0.00	-11,355.78	8.70%
米ドル					-11,355.78	0.00	0.00	-11,355.78	8.70%
米ドル	USD	-11,355.78000	1.0000	-11,355.78	-11,355.78	0.00	0.00	-11,355.78	8.70%

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					-45,433.83	0.00	0.00	-45,433.83	34.82%
現金および現金等価物					-45,433.83	0.00	0.00	-45,433.83	34.82%
米ドル					-45,433.83	0.00	0.00	-45,433.83	34.82%
米ドル	USD	-45,433.83000	1.0000	-45,433.83	-45,433.83	0.00	0.00	-45,433.83	34.82%
未払投資顧問報酬					-13,219.49	0.00	0.00	-13,219.49	10.13%
現金および現金等価物					-13,219.49	0.00	0.00	-13,219.49	10.13%
米ドル					-13,219.49	0.00	0.00	-13,219.49	10.13%
米ドル	USD	-13,219.49000	1.0000	-13,219.49	-13,219.49	0.00	0.00	-13,219.49	10.13%
未払管理報酬					-7,618.06	0.00	0.00	-7,618.06	5.84%
現金および現金等価物					-7,618.06	0.00	0.00	-7,618.06	5.84%
米ドル					-7,618.06	0.00	0.00	-7,618.06	5.84%
米ドル	USD	-7,618.06000	1.0000	-7,618.06	-7,618.06	0.00	0.00	-7,618.06	5.84%
未払金					0.00	199.50	0.00	199.50	-0.15%
現金および現金等価物					0.00	199.50	0.00	199.50	-0.15%
ユーロ					0.00	199.50	0.00	199.50	-0.15%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	199.50	0.00	199.50	-0.15%
未払報告書作成費用					-4,289.13	0.00	0.00	-4,289.13	3.29%
現金および現金等価物					-4,289.13	0.00	0.00	-4,289.13	3.29%
ユーロ					-4,289.13	0.00	0.00	-4,289.13	3.29%
ユーロ	EUR	-3,648.13000	1.0000	-3,648.13	-4,289.13	0.00	0.00	-4,289.13	3.29%
未払副投資運用報酬					-2,271.20	0.00	0.00	-2,271.20	1.74%
現金および現金等価物					-2,271.20	0.00	0.00	-2,271.20	1.74%
米ドル					-2,271.20	0.00	0.00	-2,271.20	1.74%
米ドル	USD	-2,271.20000	1.0000	-2,271.20	-2,271.20	0.00	0.00	-2,271.20	1.74%
未払受託報酬					-5,922.60	0.00	0.00	-5,922.60	4.54%
現金および現金等価物					-5,922.60	0.00	0.00	-5,922.60	4.54%
米ドル					-5,922.60	0.00	0.00	-5,922.60	4.54%
米ドル	USD	-5,922.60000	1.0000	-5,922.60	-5,922.60	0.00	0.00	-5,922.60	4.54%
報告額合計：					26,571,035.28	-1,019,909.35	0.00	25,551,125.93	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 - ユーロ・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					3,559,849.69	-282,374.73	0.00	3,277,474.96	100.00%
現金（ロング）					28,692.50	0.00	0.00	28,692.50	0.875%
現金および現金等価物					28,692.50	0.00	0.00	28,692.50	0.875%
ユーロ					28,692.50	0.00	0.00	28,692.50	0.875%
ユーロ	EUR	28,692.50000	1.0000	28,692.50	28,692.50	0.00	0.00	28,692.50	0.875%
投資有価証券（ロング）					3,531,157.19	-282,374.73	0.00	3,248,782.46	99.125%
ファンド					3,531,157.19	-282,374.73	0.00	3,248,782.46	99.125%
ユーロ					3,531,157.19	-282,374.73	0.00	3,248,782.46	99.125%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A クラスF（ユーロ）	618338	308,233.63000	10.5400	3,531,157.19	3,531,157.19	-282,374.73	0.00	3,248,782.46	99.125%
未収金					6,000.02	0.00	0.00	6,000.02	100.00%
未収金					6,000.02	0.00	0.00	6,000.02	100.00%
現金および現金等価物					6,000.02	0.00	0.00	6,000.02	100.00%
ユーロ					6,000.02	0.00	0.00	6,000.02	100.00%
ユーロ	EUR	6,000.02000	1.0000	6,000.02	6,000.02	0.00	0.00	6,000.02	100.00%
未払金					-49,109.85	-1,245.33	0.00	-50,355.18	100.00%
未払代行協会員報酬					-582.66	0.00	0.00	-582.66	1.157%
現金および現金等価物					-582.66	0.00	0.00	-582.66	1.157%
ユーロ					-582.66	0.00	0.00	-582.66	1.157%
ユーロ	EUR	-582.66000	1.0000	-582.66	-582.66	0.00	0.00	-582.66	1.157%
未払監査報酬					-24,224.47	0.00	0.00	-24,224.47	48.107%
現金および現金等価物					-24,224.47	0.00	0.00	-24,224.47	48.107%
米ドル					-24,224.47	0.00	0.00	-24,224.47	48.107%
米ドル	USD	-28,372.18000	1.0000	-28,372.18	-24,224.47	0.00	0.00	-24,224.47	48.107%
未払元本					-5,396.00	0.00	0.00	-5,396.00	10.716%
現金および現金等価物					-5,396.00	0.00	0.00	-5,396.00	10.716%
ユーロ					-5,396.00	0.00	0.00	-5,396.00	10.716%
ユーロ	EUR	-5,396.00000	1.0000	-5,396.00	-5,396.00	0.00	0.00	-5,396.00	10.716%
未払保管報酬					-1,456.61	0.00	0.00	-1,456.61	2.893%
現金および現金等価物					-1,456.61	0.00	0.00	-1,456.61	2.893%
ユーロ					-1,456.61	0.00	0.00	-1,456.61	2.893%
ユーロ	EUR	-1,456.61000	1.0000	-1,456.61	-1,456.61	0.00	0.00	-1,456.61	2.893%

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					-5,832.88	0.00	0.00	-5,832.88	11.583%
現金および現金等価物					-5,832.88	0.00	0.00	-5,832.88	11.583%
ユーロ					-5,832.88	0.00	0.00	-5,832.88	11.583%
ユーロ	EUR	-5,832.88000	1.0000	-5,832.88	-5,832.88	0.00	0.00	-5,832.88	11.583%
未払投資顧問報酬					-1,640.05	0.00	0.00	-1,640.05	3.257%
現金および現金等価物					-1,640.05	0.00	0.00	-1,640.05	3.257%
ユーロ					-1,640.05	0.00	0.00	-1,640.05	3.257%
ユーロ	EUR	-1,640.05000	1.0000	-1,640.05	-1,640.05	0.00	0.00	-1,640.05	3.257%
未払管理報酬					-945.44	0.00	0.00	-945.44	1.878%
現金および現金等価物					-945.44	0.00	0.00	-945.44	1.878%
ユーロ					-945.44	0.00	0.00	-945.44	1.878%
ユーロ	EUR	-945.44000	1.0000	-945.44	-945.44	0.00	0.00	-945.44	1.878%
未払金					0.00	-1,245.33	0.00	-1,245.33	2.473%
現金および現金等価物					0.00	-1,245.33	0.00	-1,245.33	2.473%
米ドル					0.00	-1,245.33	0.00	-1,245.33	2.473%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-1,245.33	0.00	-1,245.33	2.473%
未払報告書作成費用					-3,702.22	0.00	0.00	-3,702.22	7.352%
現金および現金等価物					-3,702.22	0.00	0.00	-3,702.22	7.352%
ユーロ					-3,702.22	0.00	0.00	-3,702.22	7.352%
ユーロ	EUR	-3,702.22000	1.0000	-3,702.22	-3,702.22	0.00	0.00	-3,702.22	7.352%
未払副投資運用報酬					-291.81	0.00	0.00	-291.81	0.58%
現金および現金等価物					-291.81	0.00	0.00	-291.81	0.58%
ユーロ					-291.81	0.00	0.00	-291.81	0.58%
ユーロ	EUR	-291.81000	1.0000	-291.81	-291.81	0.00	0.00	-291.81	0.58%
未払受託報酬					-5,037.71	0.00	0.00	-5,037.71	10.004%
現金および現金等価物					-5,037.71	0.00	0.00	-5,037.71	10.004%
米ドル					-5,037.71	0.00	0.00	-5,037.71	10.004%
米ドル	USD	-5,826.79000	1.0000	-5,826.79	-5,037.71	0.00	0.00	-5,037.71	10.004%
報告額合計：					3,516,739.86	-283,620.06	0.00	3,233,119.80	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・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					12,503,892.93	-760,277.31	0.00	11,743,615.62	100.00%
現金(ロング)					102,676.41	0.00	0.00	102,676.41	0.87%
現金および現金等価物					102,676.41	0.00	0.00	102,676.41	0.87%
豪ドル					102,676.41	0.00	0.00	102,676.41	0.87%
豪ドル	AUD	102,676.41000	1.0000	102,676.41	102,676.41	0.00	0.00	102,676.41	0.87%
投資有価証券(ロング)					12,401,216.52	-760,277.31	0.00	11,640,939.21	99.13%
ファンド					12,401,216.52	-760,277.31	0.00	11,640,939.21	99.13%
豪ドル					12,401,216.52	-760,277.31	0.00	11,640,939.21	99.13%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスF(豪ドル)	618341	1,136,810.47000	10.2400	12,401,216.52	12,401,216.52	-760,277.31	0.00	11,640,939.21	99.13%
未収金					3.77	0.00	0.00	3.77	100.00%
未収利息					3.77	0.00	0.00	3.77	100.00%
現金および現金等価物					3.77	0.00	0.00	3.77	100.00%
豪ドル					3.77	0.00	0.00	3.77	100.00%
豪ドル	AUD	3.77000	1.0000	3.77	3.77	0.00	0.00	3.77	100.00%
未払金					-101,569.69	-2,072.59	0.00	-103,642.28	100.00%
未払代行協会員報酬					-2,000.81	0.00	0.00	-2,000.81	1.93%
現金および現金等価物					-2,000.81	0.00	0.00	-2,000.81	1.93%
豪ドル					-2,000.81	0.00	0.00	-2,000.81	1.93%
豪ドル	AUD	-2,000.81000	1.0000	-2,000.81	-2,000.81	0.00	0.00	-2,000.81	1.93%
未払監査報酬					-50,218.05	0.00	0.00	-50,218.05	48.45%
現金および現金等価物					-50,218.05	0.00	0.00	-50,218.05	48.45%
米ドル					-50,218.05	0.00	0.00	-50,218.05	48.45%
米ドル	USD	-36,693.26000	1.0000	-36,693.26	-50,218.05	0.00	0.00	-50,218.05	48.45%
未払保管報酬					-5,001.76	0.00	0.00	-5,001.76	4.83%
現金および現金等価物					-5,001.76	0.00	0.00	-5,001.76	4.83%
豪ドル					-5,001.76	0.00	0.00	-5,001.76	4.83%
豪ドル	AUD	-5,001.76000	1.0000	-5,001.76	-5,001.76	0.00	0.00	-5,001.76	4.83%
未払販売報酬					-20,005.19	0.00	0.00	-20,005.19	19.30%
現金および現金等価物					-20,005.19	0.00	0.00	-20,005.19	19.30%
豪ドル					-20,005.19	0.00	0.00	-20,005.19	19.30%
豪ドル	AUD	-20,005.19000	1.0000	-20,005.19	-20,005.19	0.00	0.00	-20,005.19	19.30%

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%
未払投資顧問報酬					-5,837.85	0.00	0.00	-5,837.85	5.63%
現金および現金等価物					-5,837.85	0.00	0.00	-5,837.85	5.63%
豪ドル					-5,837.85	0.00	0.00	-5,837.85	5.63%
豪ドル	AUD	-5,837.85000	1.0000	-5,837.85	-5,837.85	0.00	0.00	-5,837.85	5.63%
未払管理報酬					-3,364.41	0.00	0.00	-3,364.41	3.25%
現金および現金等価物					-3,364.41	0.00	0.00	-3,364.41	3.25%
豪ドル					-3,364.41	0.00	0.00	-3,364.41	3.25%
豪ドル	AUD	-3,364.41000	1.0000	-3,364.41	-3,364.41	0.00	0.00	-3,364.41	3.25%
未払金					0.00	-2,072.59	0.00	-2,072.59	2.00%
現金および現金等価物					0.00	-2,072.59	0.00	-2,072.59	2.00%
ユーロ					0.00	59.98	0.00	59.98	-0.06%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	59.98	0.00	59.98	-0.06%
米ドル					0.00	-2,132.57	0.00	-2,132.57	2.06%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-2,132.57	0.00	-2,132.57	2.06%
未払報告書作成費用					-5,888.07	0.00	0.00	-5,888.07	5.68%
現金および現金等価物					-5,888.07	0.00	0.00	-5,888.07	5.68%
ユーロ					-5,888.07	0.00	0.00	-5,888.07	5.68%
ユーロ	EUR	-3,662.95000	1.0000	-3,662.95	-5,888.07	0.00	0.00	-5,888.07	5.68%
未払副投資運用報酬					-1,000.36	0.00	0.00	-1,000.36	0.97%
現金および現金等価物					-1,000.36	0.00	0.00	-1,000.36	0.97%
豪ドル					-1,000.36	0.00	0.00	-1,000.36	0.97%
豪ドル	AUD	-1,000.36000	1.0000	-1,000.36	-1,000.36	0.00	0.00	-1,000.36	0.97%
未払受託報酬					-8,253.19	0.00	0.00	-8,253.19	7.96%
現金および現金等価物					-8,253.19	0.00	0.00	-8,253.19	7.96%
米ドル					-8,253.19	0.00	0.00	-8,253.19	7.96%
米ドル	USD	-6,005.22000	1.0000	-6,005.22	-8,253.19	0.00	0.00	-8,253.19	7.96%
報告額合計：					12,402,327.01	-762,349.90	0.00	11,639,977.11	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 - 南アフリカランド・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					225,075,233.61	-9,569,992.13	0.00	215,505,241.48	100.00%
現金(ロング)					1,827,007.89	0.00	0.00	1,827,007.89	0.848%
現金および現金等価物					1,827,007.89	0.00	0.00	1,827,007.89	0.848%
南アフリカランド					1,827,007.89	0.00	0.00	1,827,007.89	0.848%
南アフリカランド	ZAR	1,827,007.89000	1.0000	1,827,007.89	1,827,007.89	0.00	0.00	1,827,007.89	0.848%
投資有価証券(ロング)					223,248,225.72	-9,569,992.13	0.00	213,678,233.59	99.152%
ファンド					223,248,225.72	-9,569,992.13	0.00	213,678,233.59	99.152%
南アフリカランド					223,248,225.72	-9,569,992.13	0.00	213,678,233.59	99.152%
ヒムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスF (南アフリカランド)	618342	1,999,234.97000	106.8800	223,248,225.72	223,248,225.72	-9,569,992.13	0.00	213,678,233.59	99.152%
未払金					-1,392,716.78	-31,769.52	0.00	-1,424,486.30	100.00%
未払代行協会員報酬					-37,996.12	0.00	0.00	-37,996.12	2.667%
現金および現金等価物					-37,996.12	0.00	0.00	-37,996.12	2.667%
南アフリカランド					-37,996.12	0.00	0.00	-37,996.12	2.667%
南アフリカランド	ZAR	-37,996.12000	1.0000	-37,996.12	-37,996.12	0.00	0.00	-37,996.12	2.667%
未払監査報酬					-529,263.39	0.00	0.00	-529,263.39	37.155%
現金および現金等価物					-529,263.39	0.00	0.00	-529,263.39	37.155%
米ドル					-529,263.39	0.00	0.00	-529,263.39	37.155%
米ドル	USD	-36,062.67000	1.0000	-36,062.67	-529,263.39	0.00	0.00	-529,263.39	37.155%
未払保管報酬					-95,024.95	0.00	0.00	-95,024.95	6.671%
現金および現金等価物					-95,024.95	0.00	0.00	-95,024.95	6.671%
南アフリカランド					-95,024.95	0.00	0.00	-95,024.95	6.671%
南アフリカランド	ZAR	-95,024.95000	1.0000	-95,024.95	-95,024.95	0.00	0.00	-95,024.95	6.671%

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					-379,961.28	0.00	0.00	-379,961.28	26.674%
現金および現金等価物					-379,961.28	0.00	0.00	-379,961.28	26.674%
南アフリカランド					-379,961.28	0.00	0.00	-379,961.28	26.674%
南アフリカランド	ZAR	-379,961.28000	1.0000	-379,961.28	-379,961.28	0.00	0.00	-379,961.28	26.674%
未払投資顧問報酬					-113,327.85	0.00	0.00	-113,327.85	7.956%
現金および現金等価物					-113,327.85	0.00	0.00	-113,327.85	7.956%
南アフリカランド					-113,327.85	0.00	0.00	-113,327.85	7.956%
南アフリカランド	ZAR	-113,327.85000	1.0000	-113,327.85	-113,327.85	0.00	0.00	-113,327.85	7.956%
未払管理報酬					-65,307.98	0.00	0.00	-65,307.98	4.585%
現金および現金等価物					-65,307.98	0.00	0.00	-65,307.98	4.585%
南アフリカランド					-65,307.98	0.00	0.00	-65,307.98	4.585%
南アフリカランド	ZAR	-65,307.98000	1.0000	-65,307.98	-65,307.98	0.00	0.00	-65,307.98	4.585%
未払金					0.00	-31,769.52	0.00	-31,769.52	2.23%
現金および現金等価物					0.00	-31,769.52	0.00	-31,769.52	2.23%
ユーロ					0.00	-730.58	0.00	-730.58	0.051%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	-730.58	0.00	-730.58	0.051%
米ドル					0.00	-31,038.94	0.00	-31,038.94	2.179%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-31,038.94	0.00	-31,038.94	2.179%
未払報告書作成費用					-63,163.84	0.00	0.00	-63,163.84	4.434%
現金および現金等価物					-63,163.84	0.00	0.00	-63,163.84	4.434%
ユーロ					-63,163.84	0.00	0.00	-63,163.84	4.434%
ユーロ	EUR	-3,684.41000	1.0000	-3,684.41	-63,163.84	0.00	0.00	-63,163.84	4.434%
未払副投資運用報酬					-19,005.07	0.00	0.00	-19,005.07	1.334%
現金および現金等価物					-19,005.07	0.00	0.00	-19,005.07	1.334%
南アフリカランド					-19,005.07	0.00	0.00	-19,005.07	1.334%
南アフリカランド	ZAR	-19,005.07000	1.0000	-19,005.07	-19,005.07	0.00	0.00	-19,005.07	1.334%
未払受託報酬					-89,666.30	0.00	0.00	-89,666.30	6.295%
現金および現金等価物					-89,666.30	0.00	0.00	-89,666.30	6.295%
米ドル					-89,666.30	0.00	0.00	-89,666.30	6.295%
米ドル	USD	-5,952.09000	1.0000	-5,952.09	-89,666.30	0.00	0.00	-89,666.30	6.295%
報告額合計：					223,682,516.83	-9,601,761.65	0.00	214,080,755.18	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Ａまたはピムコ 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Ａまたはピムコ 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。

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 (受益証券 1 口当た
りの金額を除く) 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)
GHANA 2.0%		
SOVEREIGN ISSUES 2.0%		
Republic of Ghana International Bond		
0.000% due 04/07/2025	\$ 300	\$ 237
7.625% due 05/16/2029	300	301
7.750% due 04/07/2029	1,000	1,013
8.125% due 01/18/2026	1,200	1,253
8.125% due 03/26/2032	1,400	1,408
8.625% due 04/07/2034	1,000	1,015
8.750% due 03/11/2061	1,700	1,638
8.950% due 03/26/2051	2,000	1,969
Total Ghana (Cost \$8,819)		8,834
GUATEMALA 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Guatemala Government Bond		
4.875% due 02/13/2028	800	894
4.900% due 06/01/2030	600	673
5.750% due 06/06/2022	600	619
6.125% due 06/01/2050	1,200	1,444
Total Guatemala (Cost \$3,462)		3,630
HONG KONG 0.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.		
1.253% due 02/24/2023 (d)	1,300	1,232
Huarong Finance II Co. Ltd.		
5.000% due 11/19/2025	200	204
		1,436
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Airport Authority (b)		
2.100% due 03/08/2026	700	711
2.400% due 03/08/2028	1,000	1,012
		1,723
Total Hong Kong (Cost \$3,193)		3,159
INDIA 1.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Indian Railway Finance Corp. Ltd.		
3.249% due 02/13/2030	500	514
3.950% due 02/13/2050	300	296
State Bank of India		
4.000% due 01/24/2022	1,578	1,599
		2,409
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Export-Import Bank of India		
3.250% due 01/15/2030	3,000	3,099
Total India (Cost \$5,340)		5,508
INDONESIA 4.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 3.7%		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		
3.950% due 03/28/2024	2,200	2,358
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT		
5.450% due 05/15/2030	800	936
Pelabuhan Indonesia III Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,100	3,433
Pertamina Persero PT		
6.450% due 05/30/2044 (d)	1,700	2,274
6.500% due 11/07/2048	2,400	3,271

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara		
5.250% due 10/24/2042	\$ 2,800	\$ 3,203
5.250% due 05/15/2047	200	229
6.150% due 05/21/2048	400	509
		16,213
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Indonesia Government International Bond		
4.750% due 07/18/2047	200	244
5.125% due 01/15/2045	400	505
5.250% due 01/17/2042	200	253
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
2.800% due 06/23/2030 (d)	300	312
		1,314
Total Indonesia (Cost \$14,786)		17,527
ISRAEL 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Israel Electric Corp. Ltd.		
5.000% due 11/12/2024	300	334
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Israel Government International Bond		
2.750% due 07/03/2030	500	539
3.800% due 05/13/2060	400	464
		1,003
Total Israel (Cost \$1,281)		1,337
IVORY COAST 1.6%		
SOVEREIGN ISSUES 1.6%		
Ivory Coast Government International Bond		
4.875% due 01/30/2032	EUR 800	965
5.250% due 03/22/2030	3,000	3,792
5.750% due 12/31/2032	\$ 1,324	1,349
5.875% due 10/17/2031	EUR 200	258
6.625% due 03/22/2048	500	636
Total Ivory Coast (Cost \$6,575)		7,000
JAMAICA 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
TransJamaican Highway Ltd.		
5.750% due 10/10/2036	\$ 396	397
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Jamaica Government International Bond		
7.875% due 07/28/2045	1,500	2,137
Total Jamaica (Cost \$1,896)		2,534
JORDAN 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Jordan Government International Bond		
5.750% due 01/31/2027	2,200	2,401
5.850% due 07/07/2030	200	212
7.375% due 10/10/2047	1,200	1,295
Total Jordan (Cost \$3,729)		3,908
KAZAKHSTAN 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Development Bank of Kazakhstan JSC		
4.125% due 12/10/2022	700	729
KazMunayGas National Co. JSC		
5.375% due 04/24/2030	2,100	2,520
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)		<u>2,317</u>
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)		<u>12,005</u>
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
		<u>4,747</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Malaysia Sukuk Global Bhd		
4.080% due 04/27/2046	1,000	1,242
Total Malaysia (Cost \$6,109)		<u>5,989</u>
MARSHALL ISLANDS 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Nakilat, Inc.		
6.267% due 12/31/2033	70	88
Total Marshall Islands (Cost \$83)		<u>88</u>
MAURITIUS 0.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Greenko Solar Mauritius Ltd.		
5.950% due 07/29/2026	500	535
Total Mauritius (Cost \$499)		<u>535</u>
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
		<u>11,148</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Mexico Government International Bond		
5.750% due 10/12/2110	4,600	5,628
Total Mexico (Cost \$15,571)		<u>16,776</u>

	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)		<u>3,241</u>
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
		<u>1,825</u>
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
		<u>3,208</u>
Total Morocco (Cost \$5,069)		<u>5,033</u>
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)		<u>1,079</u>
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
		<u>5,812</u>
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
		<u>1,360</u>
Total Netherlands (Cost \$6,326)		<u>7,172</u>
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)		<u>14,198</u>
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)		<u>11,164</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)
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)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UNITED KINGDOM 0.6%			SHORT-TERM INSTRUMENTS 4.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%			TIME DEPOSITS 0.1%		
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC			Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
9.375% due 03/10/2023	\$ 586	\$ 615	0.005% due 09/01/2021	\$ 103	\$ 103
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC			Bank of Nova Scotia		
8.250% due 07/09/2024	1,500	1,575	0.005% due 09/01/2021	2	2
Ukraine Railways Via Shortline PLC			BNP Paribas Bank		
9.875% due 09/15/2021	20	20	(0.310%) due 09/01/2021	/ 7,729	70
		2,210	0.005% due 09/01/2021	\$ 11	11
			0.010% due 09/01/2021	CAD 7	5
SOVEREIGN ISSUES 0.1%			Brown Brothers Harriman & Co.		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC			(0.310%) due 09/01/2021	/ 3	0
9.750% due 01/22/2025	350	380	Citibank N.A.		
Total United Kingdom (Cost \$2,479)		2,590	0.005% due 09/01/2021	\$ 26	26
UNITED STATES 0.3%			DBS Bank Ltd.		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%			0.005% due 09/01/2021	109	109
DAE Funding LLC			HSBC Bank PLC		
2.625% due 03/20/2025	400	409	(0.780%) due 09/01/2021	EUR 0	1
3.375% due 03/20/2028	200	207	JPMorgan Chase Bank N.A.		
Rutas 2 & 7 Finance Ltd.			0.005% due 09/01/2021	\$ 35	35
0.000% due 09/30/2036	1,000	733	Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
Total United States (Cost \$1,262)		1,349	(0.310%) due 09/01/2021	/ 727	7
URUGUAY 1.7%			0.005% due 09/01/2021	GBP 3	4
SOVEREIGN ISSUES 1.7%			0.005% due 09/01/2021	\$ 45	45
Uruguay Government International Bond			Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
4.975% due 04/20/2055	100	132	(0.310%) due 09/01/2021	/ 1,444	13
7.625% due 03/21/2036	2,290	3,502	0.005% due 09/01/2021	GBP 15	21
7.875% due 01/15/2033	2,440	3,690	0.005% due 09/01/2021	\$ 145	145
Total Uruguay (Cost \$5,909)		7,324			597
VENEZUELA 0.8%			U.S. TREASURY BILLS (c) 4.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%			0.027% due 10/28/2021	3,200	3,200
Petroleos de Venezuela S.A.			0.035% due 09/30/2021	5,600	5,600
5.500% due 04/12/2037 (a)	20,990	976	0.038% due 12/09/2021	4,400	4,400
SOVEREIGN ISSUES 0.6%			0.050% due 02/24/2022	6,200	6,198
Venezuela Government International Bond (a)			0.060% due 09/02/2021 (g)	900	900
7.000% due 03/31/2038	10,900	1,161			20,298
7.650% due 04/21/2025	8,215	842	Total Short-Term Instruments		20,895
9.250% due 09/15/2027	4,520	482	(Cost \$20,895)		
11.950% due 08/05/2031	340	36	Total Investments in Securities 104.5%		
		2,521	(Cost \$462,989)	\$	463,233
Total Venezuela (Cost \$29,412)		3,497	Financial Derivative Instruments (e)(f) 0.5%		
ZAMBIA 0.3%			(Cost or Premiums, net \$748)		2,063
SOVEREIGN ISSUES 0.3%			Other Assets and Liabilities, net (5.0%)		(22,196)
Zambia Government International Bond (a)			Net Assets 100.0%	\$	443,100
5.375% due 09/20/2022	1,200	921			
8.970% due 07/30/2027	500	395			
Total Zambia (Cost \$1,445)		1,316			

[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	先物	スワップ 契約	合計	売建	先物	スワップ 契約	合計
	オプション				オプション			
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.

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。

５【管理会社の経理の概況】

- a．管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。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．管理会社の中間財務書類は、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．管理会社の原文の中間財務書類は米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。日本円による金額は、2022年2月28日現在における株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝115.55円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 【資産及び負債の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資産

米ドル

千円

		米ドル	千円
010	現金、中央銀行における現金残高およびその他の要求払預金	7,246,028,529.00	837,278,597
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,362,012,390.00	619,580,532
040	その他の要求払預金	1,884,016,139.00	217,698,065
050	売買目的で保有される金融資産	107,280,955.27	12,396,314
060	デリバティブ	107,280,955.27	12,396,314
070	持分証券		
080	債務証券		
090	ローンおよび貸付金		
096	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産	0.00	0
097	持分証券		
098	債務証券		
099	ローンおよび貸付金		
100	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産	0.00	0
120	債務証券		
130	ローンおよび貸付金		
141	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産	2,939.77	340
142	持分証券	2,939.77	340
143	債務証券		
144	ローンおよび貸付金		
181	償却後原価における金融資産	1,466,622,700.00	169,468,253
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	1,466,622,700.00	169,468,253
240	デリバティブ・ヘッジ会計		
250	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
260	子会社、合併会社および関連会社への投資		
270	有形資産	4,109,560.00	474,860
280	有形固定資産	4,109,560.00	474,860
290	投資不動産		
300	無形資産	3,715,285.88	429,301
310	営業権		
320	その他の無形資産	3,715,285.88	429,301
330	税金資産	634.46	73
340	現行税金資産	634.46	73
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	28,126,532.00	3,250,021
370	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
380	資産合計	8,855,887,136.38	1,023,297,759

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

負債

		米ドル	千円
010	売買目的で保有される金融負債	43,403,070.62	5,015,225
020	デリバティブ	43,403,070.62	5,015,225
030	ショート・ポジション		
040	預金		
050	発行済み債務証券		
060	その他の金融負債		
070	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債	0.00	0
080	預金		
090	発行済み債務証券		
100	その他の金融負債		
110	償却後原価で測定される金融負債	8,290,907,401.92	958,014,350
120	預金	8,287,410,580.92	957,610,293
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	3,496,821.00	404,058
150	デリバティブ・ヘッジ会計		
160	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
170	引当金	0.00	0
180	年金およびその他の退職後給付金債務		
190	その他の長期従業員給付金		
200	再編		
210	係属中の法的問題および租税訟務		
220	コミットメントおよび保証		
230	その他の引当金		
240	税金負債	6,001,713.00	693,498
250	現行税金負債	5,196,887.00	600,500
260	繰延税金負債	804,826.00	92,998
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	26,055,829.00	3,010,751
290	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
300	負債合計	8,366,368,014.54	966,733,824

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

貸借対照表(財政状態計算書)

2021年6月30日現在

(単位:米ドル)

資本

		米ドル	千円
010	資本	187,117,965.90	21,621,481
020	払込資本	187,117,965.90	21,621,481
030	未払込請求資本		
040	株式発行差金		
050	資本を除く発行済みエクイティ商品	0.00	0
060	複合金融商品のエクイティ部分		
070	その他の発行済みエクイティ商品		
080	その他のエクイティ		
090	その他の累積包括利益	0.00	0
095	損益に再分類されることがない項目	0.00	0
100	有形資産		
110	無形資産		
120	確定給付型年金制度に係る数理計算上の利益または(-) 損失		
122	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
124	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
320	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動		
330	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値ヘッジに対するヘッジ非有効性		
340	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ項目〕		
350	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される持分証券の公正価値変動〔ヘッジ手段〕		
360	負債の信用リスク変動に帰属する損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債の公正価値変動		
128	損益に再分類されることがある項目	0.00	0
130	外国事業純投資のヘッジ〔有効部分〕		
140	外貨換算		
150	ヘッジ・デリバティブ、キャッシュ・フロー・ヘッジ準備金〔有効部分〕		
155	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される債務証券の公正価値変動		
165	ヘッジ手段〔指定されていない要素〕		
170	売却目的保有に分類される非流動資産および売却グループ		
180	子会社、合併会社および関連会社への投資のその他の認識収益および費用の持分		
190	利益剰余金	51,012.00	5,894
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	287,051,461.95	33,168,796
220	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の準備金または累積損失		
230	その他	287,051,461.95	33,168,796
240	(-) 自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	15,298,683.00	1,767,763

米ドル

千円

260	(-) 中間配当	0.00	0
270	少数株主持分〔非支配持分〕	0.00	0
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	489,519,122.85	56,563,935
310	資本および負債合計	8,855,887,137.00	1,023,297,759

(2)【損益の状況】

ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.

損益計算書

2021年6月30日に終了した期間

(単位:米ドル)

		米ドル	千円
010	利息収益	24,982,244.29	2,886,698
020	売買目的で保有される金融資産	14,527,723.86	1,678,678
025	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
030	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融資産		
041	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
051	償却後原価における金融資産	2,856,428.89	330,060
070	デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	274,086.66	31,671
085	負債に係る利息収益	7,324,004.88	846,289
090	(支払利息)	19,004,963.84	2,196,024
100	(売買目的で保有される金融負債)	84,365.71	9,748
110	(損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして 指定した金融負債)		
120	(償却後原価で測定される金融負債)	75,371.77	8,709
130	(デリバティブ-ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	2,730.93	316
145	(資産に係る支払利息)	18,842,495.43	2,177,250
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当	0.00	0
170	売買目的で保有される金融資産		
175	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される 売買目的保有以外の金融資産		
191	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
192	持分法を用いて計上されるもの以外の子会社、合併会社および 関連会社への投資		
200	受取手数料	78,830,139.63	9,108,823
210	(支払手数料)	41,110,599.86	4,750,330
220	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産および負 債の認識除外に係る利益または(-)損失、純額	0.00	0
231	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
241	償却後原価における金融資産		
260	償却後原価で測定される金融負債		
270	その他		
280	売買目的で保有される金融資産および負債に係る利益または (-)損失、純額	8,302,578.19	959,363
287	強制的に損益計算書を通じて公正価値で測定される売買目的保 有以外の金融資産に係る利益または(-)損失、純額		
290	損益計算書を通じて公正価値で測定されるものとして指定した 金融資産および負債に係る利益または(-)損失、純額		
300	ヘッジ会計からの利益または(-)損失、純額		
310	為替差額[利益または(-)損失]、純額		
320	子会社、合併会社および関連会社への投資に係る利益または (-)損失、純額		
330	非金融資産の認識除外に係る利益または(-)損失、純額		
340	その他の事業収益	3,261,533.33	376,870

米ドル

千円

350	（その他の事業費用）	1,727,802.18	199,648
355	事業収益合計、純額	53,533,129.56	6,185,753
360	（管理費用）	29,465,307.91	3,404,716
370	（従業員費用）	12,612,334.22	1,457,355
380	（その他の管理費用）	16,852,973.69	1,947,361
385	（破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金）	1,973,595.71	228,049
390	（減価償却）	1,394,486.93	161,133
400	（有形固定資産）	749,949.70	86,657
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	644,537.23	74,476
425	修正利益または（－）損失、純額	0.00	0
426	その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産		
427	償却後原価における金融資産		
430	（引当金または（－）引当金の戻入）	0.00	0
435	（破綻処理基金および預金保証制度に支払うコミットメント）		
440	（コミットメントおよび保証）		
450	（その他の引当金）		
460	（損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	314,583.91	36,350
481	（その他の包括利益を通じて公正価値で測定される金融資産）		
491	（償却後原価における金融資産）	314,583.91	36,350
510	（子会社、合併会社および関連会社への投資の減損または（－）減損の戻入）		
520	（非金融資産に係る減損または（－）減損の戻入）	0.00	0
530	（有形固定資産）		
540	（投資不動産）		
550	（営業権）		
560	（その他の無形資産）		
570	（その他）		
580	損益認識されるマイナスの営業権		
590	持分法を用いて計上される子会社、合併会社および関連会社への投資の利益または（－）損失の持分		
600	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない売却目的保有に分類される売却グループからの利益または（－）損失		
610	継続事業からの税引前利益または（－）損失	20,385,155.10	2,355,505
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	5,086,471.60	587,742
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	15,298,683.50	1,767,763
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失	0.00	0
650	非継続事業からの税引前利益または（－）損失		
660	（非継続事業に関する税金費用または（－）収入）		
670	当期利益または（－）損失	15,298,683.50	1,767,763
680	少数株主持分〔非支配持分〕に帰属する金額		
690	親会社株主に帰属する金額	15,298,683.50	1,767,763