

【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5年4月28日
【計算期間】	第14期中(自 令和4年8月1日 至 令和5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）（2023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	17,645,006.67	99.48
現金・その他の資産 （負債控除後）		92,213.10	0.52
合計（純資産総額）		17,737,219.77 (約2,418百万円)	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、2023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＝136.33円、１ユーロ＝144.61円、１豪ドル＝91.90円および１南アフリカランド＝7.41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	2,336,890.84	99.95
現金・その他の資産 （負債控除後）		1,090.56	0.05
合計（純資産総額）		2,337,981.40 (約338百万円)	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	7,927,124.73	99.62
現金・その他の資産 （負債控除後）		29,957.94	0.38
合計（純資産総額）		7,957,082.67 (約731百万円)	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	157,581,826.35	99.57
現金・その他の資産 （負債控除後）		685,368.77	0.43
合計（純資産総額）		158,267,195.12 (約1,173百万円)	100.00

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

2023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
2022年３月末日	23,568,737.49	3,213,126	75.57	10,302
４月末日	22,011,656.30	3,000,849	71.81	9,790
５月末日	21,434,149.11	2,922,118	70.65	9,632
６月末日	19,534,418.15	2,663,127	65.75	8,964
７月末日	19,509,267.19	2,659,698	66.87	9,116
８月末日	19,005,071.46	2,590,961	66.07	9,007
９月末日	17,363,550.36	2,367,173	61.55	8,391
10月末日	17,189,104.42	2,343,391	61.42	8,373
11月末日	18,104,038.63	2,468,124	65.62	8,946
12月末日	18,022,413.81	2,456,996	65.28	8,900
2023年１月末日	18,397,037.41	2,508,068	66.85	9,114
２月末日	17,737,219.77	2,418,115	64.99	8,860

<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
2022年３月末日	2,957,739.47	427,719	50.28	7,271
４月末日	2,801,367.02	405,106	47.62	6,886
５月末日	2,750,346.89	397,728	46.88	6,779
６月末日	2,491,367.75	360,277	43.50	6,291
７月末日	2,522,788.48	364,820	44.13	6,382
８月末日	2,491,355.45	360,275	43.58	6,302
９月末日	2,313,545.18	334,562	40.47	5,852
10月末日	2,302,032.89	332,897	40.40	5,842
11月末日	2,447,985.40	354,003	43.09	6,231
12月末日	2,406,455.29	347,997	42.82	6,192
2023年１月末日	2,411,590.00	348,740	43.78	6,331
２月末日	2,337,981.40	338,095	42.52	6,149

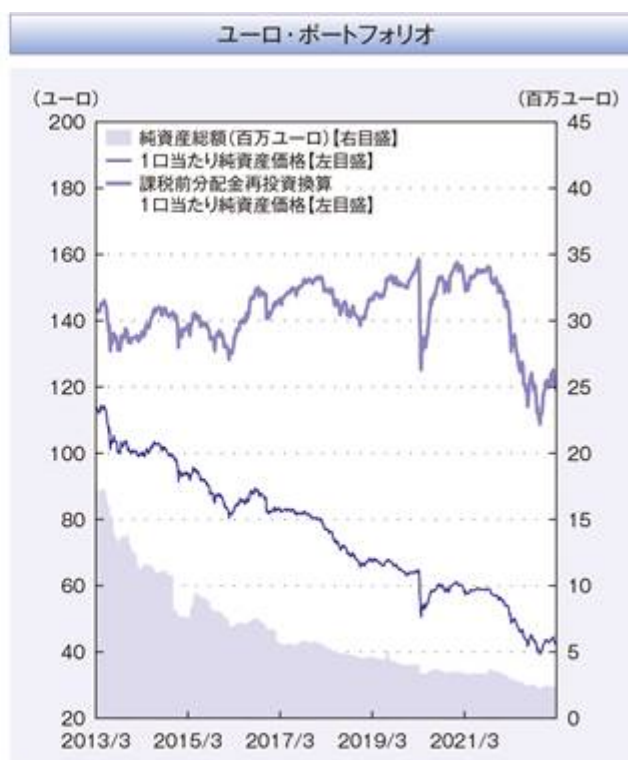
< 豪ドル・ポートフォリオ >

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2022年３月末日	10,707,506.62	984,020	35.17	3,232
４月末日	10,066,905.12	925,149	33.41	3,070
５月末日	9,850,292.21	905,242	32.84	3,018
６月末日	9,133,590.42	839,377	30.59	2,811
７月末日	9,187,152.76	844,299	31.04	2,853
８月末日	8,981,667.67	825,415	30.65	2,817
９月末日	8,178,528.00	751,607	28.54	2,623
10月末日	8,054,108.00	740,173	28.43	2,613
11月末日	8,531,792.11	784,072	30.19	2,774
12月末日	8,107,000.34	745,033	29.99	2,756
2023年１月末日	8,198,523.35	753,444	30.58	2,810
２月末日	7,957,082.67	731,256	29.71	2,730

< 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
2022年３月末日	198,095,732.08	1,467,889	589.78	4,370
４月末日	186,704,926.80	1,383,484	558.86	4,141
５月末日	183,029,427.63	1,356,248	549.25	4,070
６月末日	169,922,924.32	1,259,129	510.76	3,785
７月末日	171,651,307.20	1,271,936	516.45	3,827
８月末日	168,572,560.38	1,249,123	508.80	3,770
９月末日	156,388,301.84	1,158,837	473.09	3,506
10月末日	155,774,208.07	1,154,287	469.75	3,481
11月末日	163,874,117.55	1,214,307	496.44	3,679
12月末日	161,342,586.28	1,195,549	492.50	3,649
2023年１月末日	163,970,335.97	1,215,020	501.53	3,716
２月末日	158,267,195.12	1,172,760	484.97	3,594

< 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】

2023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
2022年３月１日～2023年２月末日	4.68	638

<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
2022年３月１日～2023年２月末日	2.04	295

<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
2022年３月１日～2023年２月末日	2.16	199

<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
2022年３月１日～2023年２月末日	74.40	551

< 参考情報 >

米ドル・ポートフォリオ	
(単位：米ドル)	
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
第13計算期間(2021年8月1日～2022年7月31日)	4.68
2022年10月	0.39
2022年11月	0.39
2022年12月	0.39
2023年 1 月	0.39
2023年 2 月	0.39
直近1年間累計	4.68
設定来累計	84.05

● 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 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
第13計算期間(2021年8月1日～2022年7月31日)	2.37
2022年10月	0.18
2022年11月	0.18
2022年12月	0.18
2023年 1 月	0.18
2023年 2 月	0.18
直近1年間累計	2.16
設定来累計	131.69

● 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 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
第13計算期間(2021年8月1日～2022年7月31日)	2.04
2022年10月	0.17
2022年11月	0.17
2022年12月	0.17
2023年 1 月	0.17
2023年 2 月	0.17
直近1年間累計	2.04
設定来累計	88.43

● 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 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
第13計算期間(2021年8月1日～2022年7月31日)	74.40
2022年10月	6.20
2022年11月	6.20
2022年12月	6.20
2023年 1 月	6.20
2023年 2 月	6.20
直近1年間累計	74.40
設定来累計	1,586.60

● 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）
2022年３月１日～2023年２月末日	- 8.41%

（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）
2022年３月１日～2023年２月末日	- 12.06%

<豪ドル・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2022年３月１日～2023年２月末日	- 9.97%

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2022年３月１日～2023年２月末日	- 5.71%

< 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
- 2023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】

2023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2023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
3,475 (3,475)	44,770 (44,770)	272,943 (272,943)

（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
0 (0)	4,127 (4,127)	54,990 (54,990)

<豪ドル・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
500 (500)	40,117 (40,117)	267,822 (267,822)

<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
1,974 (1,974)	12,904 (12,904)	326,341 (326,341)

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2023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＝136.33円、１ユーロ＝144.61円、１豪ドル＝91.90円および１南アフリカランド＝7.41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

2023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	18,323,872.81	2,498,094
現金（ロング）		
現金および現金等価物	160,416.96	21,870
未収金		
未収金	101.50	14
資産合計	18,484,391.27	2,519,977
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(841.49)	(115)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(46,806.00)	(6,381)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(12,830.70)	(1,749)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(8,417.67)	(1,148)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(9,963.92)	(1,358)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(5,736.44)	(782)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	3,818.60	521
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(1,535.13)	(209)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(5,041.11)	(687)
負債合計	(87,353.86)	(11,909)
純資産総額	18,397,037.41	2,508,068
発行済口数	275,202	口
1 口当たり純資産価格	66.85	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

2023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	2,429,636.77	351,350
現金（ロング）		
現金および現金等価物	20,856.17	3,016
資産合計	2,450,492.94	354,366
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(107.42)	(16)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(25,709.28)	(3,718)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(1,484.43)	(215)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(1,080.98)	(156)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(1,275.54)	(184)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(735.34)	(106)
未払金		
未払金	417.13	60
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(3,887.86)	(562)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(203.22)	(29)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(4,836.00)	(699)
負債合計	(38,902.94)	(5,626)
純資産総額	2,411,590.00	348,740
発行済口数	55,090	口
1 口当たり純資産価格	43.78	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

2023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	8,204,994.67	754,039
現金（ロング）		
現金および現金等価物	72,319.72	6,646
資産合計	8,277,314.39	760,685
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(366.30)	(34)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(54,370.75)	(4,997)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(5,091.53)	(468)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(3,659.94)	(336)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(4,312.01)	(396)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(2,485.12)	(228)
未払金		
未払金	346.25	32
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(3,559.80)	(327)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(706.09)	(65)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(4,585.75)	(421)
負債合計	(78,791.04)	(7,241)
純資産総額	8,198,523.35	753,444
発行済口数	268,064	口
1 口当たり純資産価格	30.58	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

2023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	163,623,715.52	1,212,452
現金（ロング）		
現金および現金等価物	1,430,339.33	10,599
未収金		
未収金	55,999.85	415
資産合計	165,110,054.70	1,223,466
負債		
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(7,306.39)	(54)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(590,490.15)	(4,376)
未払元本		
未払元本	(55,438.90)	(411)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(106,284.98)	(788)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(73,064.39)	(541)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(90,823.32)	(673)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(52,339.21)	(388)
未払金		
未払金	(51,158.64)	(379)
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	(11,024.59)	(82)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(13,752.16)	(102)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(88,036.00)	(652)
負債合計	(1,139,718.73)	(8,445)
純資産総額	163,970,335.97	1,215,020
発行済口数	326,943	口
1 口当たり純資産価格	501.53	南アフリカランド

[次へ](#)

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

2022年８月１日から2023年１月31日までの期間

（米ドルで表示）

	米ドル	千円
収益	767,616.86	104,649
受取配当金	765,504.18	104,361
ファンド	765,504.18	104,361
受取利息	2,112.68	288
現金および現金等価物	2,112.68	288
費用	(846,205.63)	(115,363)
A I F M D 報酬	(3,009.61)	(410)
現金および現金等価物	(3,009.61)	(410)
代行協会員報酬	(4,650.49)	(634)
現金および現金等価物	(4,650.49)	(634)
監査報酬	(13,558.09)	(1,848)
現金および現金等価物	(13,558.09)	(1,848)
保管報酬	(11,626.18)	(1,585)
現金および現金等価物	(11,626.18)	(1,585)
販売報酬	(46,504.83)	(6,340)
現金および現金等価物	(46,504.83)	(6,340)
配当金	(655,808.40)	(89,406)
現金および現金等価物	(655,808.40)	(89,406)
支払利息	(125.93)	(17)
現金および現金等価物	(125.93)	(17)
投資顧問報酬	(54,875.71)	(7,481)
現金および現金等価物	(54,875.71)	(7,481)
弁護士報酬	(7,552.10)	(1,030)
現金および現金等価物	(7,552.10)	(1,030)
管理報酬	(31,623.33)	(4,311)
現金および現金等価物	(31,623.33)	(4,311)
立替費用	(2,366.10)	(323)
現金および現金等価物	(2,366.10)	(323)
専門家報酬	(5,901.26)	(805)
現金および現金等価物	(5,901.26)	(805)
報告書作成費用	(1,182.33)	(161)
現金および現金等価物	(1,182.33)	(161)
副投資運用報酬	(2,325.19)	(317)
現金および現金等価物	(2,325.19)	(317)
受託報酬	(5,096.08)	(695)
現金および現金等価物	(5,096.08)	(695)
投資に係る実現および未実現損益	42,764.51	5,830
為替に係る未実現損益の変動	(209.70)	(29)
現金および現金等価物	(209.70)	(29)
価格に係る未実現損益の変動	622,439.03	84,857
ファンド	622,439.03	84,857
長期価格に係る損益	(579,660.59)	(79,025)
ファンド	(579,660.59)	(79,025)
為替取引の時価評価に係る損失	(307.22)	(42)
現金および現金等価物	(307.22)	(42)
為替取引の時価評価に係る利益	503.50	69
現金および現金等価物	503.50	69
短期価格に係る損益	(0.51)	(0)
ファンド	(0.51)	(0)
純損益	(35,824.26)	(4,884)

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

2022年８月１日から2023年１月31日までの期間

（ユーロで表示）

		ユーロ	千円
収益		77,370.34	11,189
受取配当金		77,350.02	11,186
	ファンド	77,350.02	11,186
受取利息		20.32	3
	現金および現金等価物	20.32	3
費用		(98,215.25)	(14,203)
A I F M D 報酬		(3,000.00)	(434)
	現金および現金等価物	(3,000.00)	(434)
代行協会員報酬		(616.15)	(89)
	現金および現金等価物	(616.15)	(89)
監査報酬		(8,666.62)	(1,253)
	現金および現金等価物	(8,666.62)	(1,253)
保管報酬		(1,540.51)	(223)
	現金および現金等価物	(1,540.51)	(223)
販売報酬		(6,161.86)	(891)
	現金および現金等価物	(6,161.86)	(891)
配当金		(57,757.67)	(8,352)
	現金および現金等価物	(57,757.67)	(8,352)
投資顧問報酬		(7,271.02)	(1,051)
	現金および現金等価物	(7,271.02)	(1,051)
弁護士報酬		(1,016.14)	(147)
	現金および現金等価物	(1,016.14)	(147)
管理報酬		(4,190.09)	(606)
	現金および現金等価物	(4,190.09)	(606)
立替費用		(1,304.05)	(189)
	現金および現金等価物	(1,304.05)	(189)
専門家報酬		(776.09)	(112)
	現金および現金等価物	(776.09)	(112)
報告書作成費用		(623.56)	(90)
	現金および現金等価物	(623.56)	(90)
副投資運用報酬		(308.07)	(45)
	現金および現金等価物	(308.07)	(45)
受託報酬		(4,983.42)	(721)
	現金および現金等価物	(4,983.42)	(721)
投資に係る実現および未実現損益		(1,482.68)	(214)
為替に係る未実現損益の変動		2,409.93	348
	現金および現金等価物	2,409.93	348
価格に係る未実現損益の変動		56,836.74	8,219
	ファンド	56,836.74	8,219
長期価格に係る損益		(60,035.00)	(8,682)
	ファンド	(60,035.00)	(8,682)
為替取引の時価評価に係る損失		(694.35)	(100)
	現金および現金等価物	(694.35)	(100)
純損益		(22,327.59)	(3,229)

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

2022年８月１日から2023年１月31日までの期間

（豪ドルで表示）

		豪ドル	千円
収益		317,824.44	29,208
受取配当金		317,219.13	29,152
	ファンド	317,219.13	29,152
受取利息		605.31	56
	現金および現金等価物	605.31	56
費用		(421,708.25)	(38,755)
A I F M D 報酬		(4,525.50)	(416)
	現金および現金等価物	(4,525.50)	(416)
代行協会員報酬		(2,167.53)	(199)
	現金および現金等価物	(2,167.53)	(199)
監査報酬		(17,602.92)	(1,618)
	現金および現金等価物	(17,602.92)	(1,618)
保管報酬		(5,418.84)	(498)
	現金および現金等価物	(5,418.84)	(498)
販売報酬		(21,675.32)	(1,992)
	現金および現金等価物	(21,675.32)	(1,992)
配当金		(306,406.26)	(28,159)
	現金および現金等価物	(306,406.26)	(28,159)
支払利息		(4.98)	(0)
	現金および現金等価物	(4.98)	(0)
投資顧問報酬		(25,576.86)	(2,351)
	現金および現金等価物	(25,576.86)	(2,351)
弁護士報酬		(3,718.14)	(342)
	現金および現金等価物	(3,718.14)	(342)
管理報酬		(14,739.25)	(1,355)
	現金および現金等価物	(14,739.25)	(1,355)
立替費用		(2,604.65)	(239)
	現金および現金等価物	(2,604.65)	(239)
専門家報酬		(3,029.29)	(278)
	現金および現金等価物	(3,029.29)	(278)
報告書作成費用		(1,118.02)	(103)
	現金および現金等価物	(1,118.02)	(103)
副投資運用報酬		(1,083.76)	(100)
	現金および現金等価物	(1,083.76)	(100)
受託報酬		(12,036.93)	(1,106)
	現金および現金等価物	(12,036.93)	(1,106)
投資に係る実現および未実現損益		(51,156.14)	(4,701)
為替に係る未実現損益の変動		1,098.96	101
	現金および現金等価物	1,098.96	101
価格に係る未実現損益の変動		320,956.88	29,496
	ファンド	320,956.88	29,496
長期価格に係る損益		(372,404.04)	(34,224)
	ファンド	(372,404.04)	(34,224)
為替取引の時価評価に係る損失		(1,413.41)	(130)
	現金および現金等価物	(1,413.41)	(130)
為替取引の時価評価に係る利益		605.26	56
	現金および現金等価物	605.26	56
短期価格に係る損益		0.21	0
	ファンド	0.21	0
純損益		(155,039.95)	(14,248)

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

2022年８月１日から2023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		9,546,399.88	70,739
受取配当金		9,546,399.88	70,739
	ファンド	9,546,399.88	70,739
費用		(14,255,411.73)	(105,633)
A I F M D 報酬		(52,478.12)	(389)
	現金および現金等価物	(52,478.12)	(389)
代行協会員報酬		(41,700.13)	(309)
	現金および現金等価物	(41,700.13)	(309)
監査報酬		(216,587.09)	(1,605)
	現金および現金等価物	(216,587.09)	(1,605)
保管報酬		(104,250.33)	(772)
	現金および現金等価物	(104,250.33)	(772)
販売報酬		(417,001.62)	(3,090)
	現金および現金等価物	(417,001.62)	(3,090)
配当金		(12,275,237.40)	(90,960)
	現金および現金等価物	(12,275,237.40)	(90,960)
投資顧問報酬		(492,061.94)	(3,646)
	現金および現金等価物	(492,061.94)	(3,646)
弁護士報酬		(71,091.26)	(527)
	現金および現金等価物	(71,091.26)	(527)
管理報酬		(283,561.08)	(2,101)
	現金および現金等価物	(283,561.08)	(2,101)
立替費用		(39,554.09)	(293)
	現金および現金等価物	(39,554.09)	(293)
専門家報酬		(137,412.09)	(1,018)
	現金および現金等価物	(137,412.09)	(1,018)
報告書作成費用		(15,171.41)	(112)
	現金および現金等価物	(15,171.41)	(112)
副投資運用報酬		(20,850.04)	(154)
	現金および現金等価物	(20,850.04)	(154)
受託報酬		(88,455.13)	(655)
	現金および現金等価物	(88,455.13)	(655)
投資に係る実現および未実現損益		(212,037.12)	(1,571)
為替に係る未実現損益の変動		(16,633.98)	(123)
	現金および現金等価物	(16,633.98)	(123)
価格に係る未実現損益の変動		4,391,629.89	32,542
	ファンド	4,391,629.89	32,542
長期価格に係る損益		(4,573,667.13)	(33,891)
	ファンド	(4,573,667.13)	(33,891)
為替取引の時価評価に係る損失		(18,875.44)	(140)
	現金および現金等価物	(18,875.44)	(140)
為替取引の時価評価に係る利益		5,480.59	41
	現金および現金等価物	5,480.59	41
短期価格に係る損益		28.95	0
	ファンド	28.95	0
純損益		(4,921,048.97)	(36,465)

（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

2023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					22,630,960.27	-4,146,670.50	0.00	18,484,289.77	100.00%
現金（ロング）					160,416.96	0.00	0.00	160,416.96	0.868%
現金および現金等価物					160,416.96	0.00	0.00	160,416.96	0.868%
米ドル					160,416.96	0.00	0.00	160,416.96	0.868%
米ドル	USD	160,416.960	1.0000	160,416.96	160,416.96	0.00	0.00	160,416.96	0.868%
投資有価証券（ロング）					22,470,543.31	-4,146,670.50	0.00	18,323,872.81	99.132%
ファンド					22,470,543.31	-4,146,670.50	0.00	18,323,872.81	99.132%
米ドル					22,470,543.31	-4,146,670.50	0.00	18,323,872.81	99.132%
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	1,974,555.260	9.2800	22,470,543.31	22,470,543.31	-4,146,670.50	0.00	18,323,872.81	99.132%
未収金					0.00	101.50	0.00	101.50	100.00%
未収金					0.00	101.50	0.00	101.50	100.00%
現金および現金等価物					0.00	101.50	0.00	101.50	100.00%
ユーロ					0.00	101.50	0.00	101.50	100.00%
ユーロ	EUR	0.000	NA	0.00	0.00	101.50	0.00	101.50	100.00%
未払金					-87,353.86	0.00	0.00	-87,353.86	100.00%
未払代行協会員報酬					-841.49	0.00	0.00	-841.49	0.963%
現金および現金等価物					-841.49	0.00	0.00	-841.49	0.963%
米ドル					-841.49	0.00	0.00	-841.49	0.963%
米ドル	USD	-841.490	1.0000	-841.49	-841.49	0.00	0.00	-841.49	0.963%
未払監査報酬					-46,806.00	0.00	0.00	-46,806.00	53.582%
現金および現金等価物					-46,806.00	0.00	0.00	-46,806.00	53.582%
米ドル					-46,806.00	0.00	0.00	-46,806.00	53.582%
米ドル	USD	-46,806.000	1.0000	-46,806.00	-46,806.00	0.00	0.00	-46,806.00	53.582%
未払保管報酬					-12,830.70	0.00	0.00	-12,830.70	14.688%
現金および現金等価物					-12,830.70	0.00	0.00	-12,830.70	14.688%
米ドル					-12,830.70	0.00	0.00	-12,830.70	14.688%
米ドル	USD	-12,830.700	1.0000	-12,830.70	-12,830.70	0.00	0.00	-12,830.70	14.688%

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					-8,417.67	0.00	0.00	-8,417.67	9.636%
現金および現金等価物					-8,417.67	0.00	0.00	-8,417.67	9.636%
米ドル					-8,417.67	0.00	0.00	-8,417.67	9.636%
米ドル	USD	-8,417.670	1.0000	-8,417.67	-8,417.67	0.00	0.00	-8,417.67	9.636%
未払投資顧問報酬					-9,963.92	0.00	0.00	-9,963.92	11.406%
現金および現金等価物					-9,963.92	0.00	0.00	-9,963.92	11.406%
米ドル					-9,963.92	0.00	0.00	-9,963.92	11.406%
米ドル	USD	-9,963.920	1.0000	-9,963.92	-9,963.92	0.00	0.00	-9,963.92	11.406%
未払管理報酬					-5,736.44	0.00	0.00	-5,736.44	6.567%
現金および現金等価物					-5,736.44	0.00	0.00	-5,736.44	6.567%
米ドル					-5,736.44	0.00	0.00	-5,736.44	6.567%
米ドル	USD	-5,736.440	1.0000	-5,736.44	-5,736.44	0.00	0.00	-5,736.44	6.567%
未払報告書作成費用					3,818.60	0.00	0.00	3,818.60	-4.371%
現金および現金等価物					3,818.60	0.00	0.00	3,818.60	-4.371%
ユーロ					3,818.60	0.00	0.00	3,818.60	-4.371%
ユーロ	EUR	3,609.500	1.0000	3,609.50	3,818.60	0.00	0.00	3,818.60	-4.371%
未払副投資運用報酬					-1,535.13	0.00	0.00	-1,535.13	1.757%
現金および現金等価物					-1,535.13	0.00	0.00	-1,535.13	1.757%
米ドル					-1,535.13	0.00	0.00	-1,535.13	1.757%
米ドル	USD	-1,535.130	1.0000	-1,535.13	-1,535.13	0.00	0.00	-1,535.13	1.757%
未払受託報酬					-5,041.11	0.00	0.00	-5,041.11	5.771%
現金および現金等価物					-5,041.11	0.00	0.00	-5,041.11	5.771%
米ドル					-5,041.11	0.00	0.00	-5,041.11	5.771%
米ドル	USD	-5,041.110	1.0000	-5,041.11	-5,041.11	0.00	0.00	-5,041.11	5.771%
報告額合計：					22,543,606.41	-4,146,569.00	0.00	18,397,037.41	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

2023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					3,171,794.29	-721,301.35	0.00	2,450,492.94	100.00%
現金(ロング)					20,856.17	0.00	0.00	20,856.17	0.851%
現金および現金等価物					20,856.17	0.00	0.00	20,856.17	0.851%
ユーロ					20,856.17	0.00	0.00	20,856.17	0.851%
ユーロ	EUR	20,856.170	1.0000	20,856.17	20,856.17	0.00	0.00	20,856.17	0.851%
投資有価証券(ロング)					3,150,938.12	-721,301.35	0.00	2,429,636.77	99.149%
ファンド					3,150,938.12	-721,301.35	0.00	2,429,636.77	99.149%
ユーロ					3,150,938.12	-721,301.35	0.00	2,429,636.77	99.149%
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	278,628.070	8.7200	3,150,938.12	3,150,938.12	-721,301.35	0.00	2,429,636.77	99.149%
未払金					-39,320.07	417.13	0.00	-38,902.94	100.00%
未払代行協会員報酬					-107.42	0.00	0.00	-107.42	0.276%
現金および現金等価物					-107.42	0.00	0.00	-107.42	0.276%
ユーロ					-107.42	0.00	0.00	-107.42	0.276%
ユーロ	EUR	-107.420	1.0000	-107.42	-107.42	0.00	0.00	-107.42	0.276%
未払監査報酬					-25,709.28	0.00	0.00	-25,709.28	66.086%
現金および現金等価物					-25,709.28	0.00	0.00	-25,709.28	66.086%
米ドル					-25,709.28	0.00	0.00	-25,709.28	66.086%
米ドル	USD	-27,774.280	1.0000	-27,774.28	-25,709.28	0.00	0.00	-25,709.28	66.086%
未払保管報酬					-1,484.43	0.00	0.00	-1,484.43	3.816%
現金および現金等価物					-1,484.43	0.00	0.00	-1,484.43	3.816%
ユーロ					-1,484.43	0.00	0.00	-1,484.43	3.816%
ユーロ	EUR	-1,484.430	1.0000	-1,484.43	-1,484.43	0.00	0.00	-1,484.43	3.816%
未払販売報酬					-1,080.98	0.00	0.00	-1,080.98	2.779%
現金および現金等価物					-1,080.98	0.00	0.00	-1,080.98	2.779%
ユーロ					-1,080.98	0.00	0.00	-1,080.98	2.779%
ユーロ	EUR	-1,080.980	1.0000	-1,080.98	-1,080.98	0.00	0.00	-1,080.98	2.779%
未払投資顧問報酬					-1,275.54	0.00	0.00	-1,275.54	3.279%
現金および現金等価物					-1,275.54	0.00	0.00	-1,275.54	3.279%
ユーロ					-1,275.54	0.00	0.00	-1,275.54	3.279%
ユーロ	EUR	-1,275.540	1.0000	-1,275.54	-1,275.54	0.00	0.00	-1,275.54	3.279%

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%
未払管理報酬					-735.34	0.00	0.00	-735.34	1.89%
現金および現金等価物					-735.34	0.00	0.00	-735.34	1.89%
ユーロ					-735.34	0.00	0.00	-735.34	1.89%
ユーロ	EUR	-735.340	1.0000	-735.34	-735.34	0.00	0.00	-735.34	1.89%
未払金					0.00	417.13	0.00	417.13	-1.072%
現金および現金等価物					0.00	417.13	0.00	417.13	-1.072%
米ドル					0.00	417.13	0.00	417.13	-1.072%
米ドル	USD	0.000	NA	0.00	0.00	417.13	0.00	417.13	-1.072%
未払報告書作成費用					-3,887.86	0.00	0.00	-3,887.86	9.994%
現金および現金等価物					-3,887.86	0.00	0.00	-3,887.86	9.994%
ユーロ					-3,887.86	0.00	0.00	-3,887.86	9.994%
ユーロ	EUR	-3,887.860	1.0000	-3,887.86	-3,887.86	0.00	0.00	-3,887.86	9.994%
未払副投資運用報酬					-203.22	0.00	0.00	-203.22	0.522%
現金および現金等価物					-203.22	0.00	0.00	-203.22	0.522%
ユーロ					-203.22	0.00	0.00	-203.22	0.522%
ユーロ	EUR	-203.220	1.0000	-203.22	-203.22	0.00	0.00	-203.22	0.522%
未払受託報酬					-4,836.00	0.00	0.00	-4,836.00	12.431%
現金および現金等価物					-4,836.00	0.00	0.00	-4,836.00	12.431%
米ドル					-4,836.00	0.00	0.00	-4,836.00	12.431%
米ドル	USD	-4,945.300	1.0000	-4,945.30	-4,836.00	0.00	0.00	-4,836.00	12.431%
報告額合計：					3,132,474.22	-720,884.22	0.00	2,411,590.00	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

2023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					10,405,202.55	-2,127,888.16	0.00	8,277,314.39	100.00%
現金(ロング)					72,319.72	0.00	0.00	72,319.72	0.874%
現金および現金等価物					72,319.72	0.00	0.00	72,319.72	0.874%
豪ドル					72,319.72	0.00	0.00	72,319.72	0.874%
豪ドル	AUD	72,319.720	1.0000	72,319.72	72,319.72	0.00	0.00	72,319.72	0.874%
投資有価証券(ロング)					10,332,882.83	-2,127,888.16	0.00	8,204,994.67	99.126%
ファンド					10,332,882.83	-2,127,888.16	0.00	8,204,994.67	99.126%
豪ドル					10,332,882.83	-2,127,888.16	0.00	8,204,994.67	99.126%
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	960,772.210	8.5400	10,332,882.83	10,332,882.83	-2,127,888.16	0.00	8,204,994.67	99.126%
未払金					-79,137.29	346.25	0.00	-78,791.04	100.00%
未払代行協会員報酬					-366.30	0.00	0.00	-366.30	0.465%
現金および現金等価物					-366.30	0.00	0.00	-366.30	0.465%
豪ドル					-366.30	0.00	0.00	-366.30	0.465%
豪ドル	AUD	-366.300	1.0000	-366.30	-366.30	0.00	0.00	-366.30	0.465%
未払監査報酬					-54,370.75	0.00	0.00	-54,370.75	69.006%
現金および現金等価物					-54,370.75	0.00	0.00	-54,370.75	69.006%
米ドル					-54,370.75	0.00	0.00	-54,370.75	69.006%
米ドル	USD	-38,224.830	1.0000	-38,224.83	-54,370.75	0.00	0.00	-54,370.75	69.006%
未払保管報酬					-5,091.53	0.00	0.00	-5,091.53	6.462%
現金および現金等価物					-5,091.53	0.00	0.00	-5,091.53	6.462%
豪ドル					-5,091.53	0.00	0.00	-5,091.53	6.462%
豪ドル	AUD	-5,091.530	1.0000	-5,091.53	-5,091.53	0.00	0.00	-5,091.53	6.462%
未払販売報酬					-3,659.94	0.00	0.00	-3,659.94	4.645%
現金および現金等価物					-3,659.94	0.00	0.00	-3,659.94	4.645%
豪ドル					-3,659.94	0.00	0.00	-3,659.94	4.645%
豪ドル	AUD	-3,659.940	1.0000	-3,659.94	-3,659.94	0.00	0.00	-3,659.94	4.645%
未払投資顧問報酬					-4,312.01	0.00	0.00	-4,312.01	5.473%
現金および現金等価物					-4,312.01	0.00	0.00	-4,312.01	5.473%
豪ドル					-4,312.01	0.00	0.00	-4,312.01	5.473%
豪ドル	AUD	-4,312.010	1.0000	-4,312.01	-4,312.01	0.00	0.00	-4,312.01	5.473%

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%
未払管理報酬					-2,485.12	0.00	0.00	-2,485.12	3.154%
現金および現金等価物					-2,485.12	0.00	0.00	-2,485.12	3.154%
豪ドル					-2,485.12	0.00	0.00	-2,485.12	3.154%
豪ドル	AUD	-2,485.120	1.0000	-2,485.12	-2,485.12	0.00	0.00	-2,485.12	3.154%
未払金					0.00	346.25	0.00	346.25	-0.439%
現金および現金等価物					0.00	346.25	0.00	346.25	-0.439%
ユーロ					0.00	-6.21	0.00	-6.21	0.008%
ユーロ	EUR	0.000	NA	0.00	0.00	-6.21	0.00	-6.21	0.008%
米ドル					0.00	352.46	0.00	352.46	-0.447%
米ドル	USD	0.000	NA	0.00	0.00	352.46	0.00	352.46	-0.447%
未払報告書作成費用					-3,559.80	0.00	0.00	-3,559.80	4.518%
現金および現金等価物					-3,559.80	0.00	0.00	-3,559.80	4.518%
ユーロ					-3,559.80	0.00	0.00	-3,559.80	4.518%
ユーロ	EUR	-2,313.290	1.0000	-2,313.29	-3,559.80	0.00	0.00	-3,559.80	4.518%
未払副投資運用報酬					-706.09	0.00	0.00	-706.09	0.896%
現金および現金等価物					-706.09	0.00	0.00	-706.09	0.896%
豪ドル					-706.09	0.00	0.00	-706.09	0.896%
豪ドル	AUD	-706.090	1.0000	-706.09	-706.09	0.00	0.00	-706.09	0.896%
未払受託報酬					-4,585.75	0.00	0.00	-4,585.75	5.82%
現金および現金等価物					-4,585.75	0.00	0.00	-4,585.75	5.82%
米ドル					-4,585.75	0.00	0.00	-4,585.75	5.82%
米ドル	USD	-3,070.680	1.0000	-3,070.68	-4,585.75	0.00	0.00	-4,585.75	5.82%
報告額合計：					10,326,065.26	-2,127,541.91	0.00	8,198,523.35	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

2023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					200,863,928.40	-35,809,873.55	0.00	165,054,054.85	100.00%
現金（ロング）					1,430,339.33	0.00	0.00	1,430,339.33	0.867%
現金および現金等価物					1,430,339.33	0.00	0.00	1,430,339.33	0.867%
南アフリカランド					1,430,339.33	0.00	0.00	1,430,339.33	0.867%
南アフリカランド	ZAR	1,430,339.330	1.0000	1,430,339.33	1,430,339.33	0.00	0.00	1,430,339.33	0.867%
投資有価証券（ロング）					199,433,589.07	-35,809,873.55	0.00	163,623,715.52	99.133%
ファンド					199,433,589.07	-35,809,873.55	0.00	163,623,715.52	99.133%
南アフリカランド					199,433,589.07	-35,809,873.55	0.00	163,623,715.52	99.133%
ビムコ 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	1,824,325.070	89.6900	199,433,589.07	199,433,589.07	-35,809,873.55	0.00	163,623,715.52	99.133%
未収金					55,999.85	0.00	0.00	55,999.85	100.00%
未収金					55,999.85	0.00	0.00	55,999.85	100.00%
現金および現金等価物					55,999.85	0.00	0.00	55,999.85	100.00%
南アフリカランド					55,999.85	0.00	0.00	55,999.85	100.00%
南アフリカランド	ZAR	55,999.850	1.0000	55,999.85	55,999.85	0.00	0.00	55,999.85	100.00%
未払金					-1,088,560.09	-51,158.64	0.00	-1,139,718.73	100.00%
未払代行協会員報酬					-7,306.39	0.00	0.00	-7,306.39	0.641%
現金および現金等価物					-7,306.39	0.00	0.00	-7,306.39	0.641%
南アフリカランド					-7,306.39	0.00	0.00	-7,306.39	0.641%
南アフリカランド	ZAR	-7,306.390	1.0000	-7,306.39	-7,306.39	0.00	0.00	-7,306.39	0.641%
未払監査報酬					-590,490.15	0.00	0.00	-590,490.15	51.81%
現金および現金等価物					-590,490.15	0.00	0.00	-590,490.15	51.81%
米ドル					-590,490.15	0.00	0.00	-590,490.15	51.81%
米ドル	USD	-36,770.690	1.0000	-36,770.69	-590,490.15	0.00	0.00	-590,490.15	51.81%
未払元本					-55,438.90	0.00	0.00	-55,438.90	4.864%
現金および現金等価物					-55,438.90	0.00	0.00	-55,438.90	4.864%
南アフリカランド					-55,438.90	0.00	0.00	-55,438.90	4.864%
南アフリカランド	ZAR	-55,438.900	1.0000	-55,438.90	-55,438.90	0.00	0.00	-55,438.90	4.864%

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%
未払保管報酬					-106,284.98	0.00	0.00	-106,284.98	9.326%
現金および現金等価物					-106,284.98	0.00	0.00	-106,284.98	9.326%
南アフリカランド					-106,284.98	0.00	0.00	-106,284.98	9.326%
南アフリカランド	ZAR	-106,284.980	1.0000	-106,284.98	-106,284.98	0.00	0.00	-106,284.98	9.326%
未払販売報酬					-73,064.39	0.00	0.00	-73,064.39	6.411%
現金および現金等価物					-73,064.39	0.00	0.00	-73,064.39	6.411%
南アフリカランド					-73,064.39	0.00	0.00	-73,064.39	6.411%
南アフリカランド	ZAR	-73,064.390	1.0000	-73,064.39	-73,064.39	0.00	0.00	-73,064.39	6.411%
未払投資顧問報酬					-90,823.32	0.00	0.00	-90,823.32	7.969%
現金および現金等価物					-90,823.32	0.00	0.00	-90,823.32	7.969%
南アフリカランド					-90,823.32	0.00	0.00	-90,823.32	7.969%
南アフリカランド	ZAR	-90,823.320	1.0000	-90,823.32	-90,823.32	0.00	0.00	-90,823.32	7.969%
未払管理報酬					-52,339.21	0.00	0.00	-52,339.21	4.592%
現金および現金等価物					-52,339.21	0.00	0.00	-52,339.21	4.592%
南アフリカランド					-52,339.21	0.00	0.00	-52,339.21	4.592%
南アフリカランド	ZAR	-52,339.210	1.0000	-52,339.21	-52,339.21	0.00	0.00	-52,339.21	4.592%
未払金					0.00	-51,158.64	0.00	-51,158.64	4.489%
現金および現金等価物					0.00	-51,158.64	0.00	-51,158.64	4.489%
ユーロ					0.00	-495.84	0.00	-495.84	0.044%
ユーロ	EUR	0.000	NA	0.00	0.00	-495.84	0.00	-495.84	0.044%
米ドル					0.00	-50,662.80	0.00	-50,662.80	4.445%
米ドル	USD	0.000	NA	0.00	0.00	-50,662.80	0.00	-50,662.80	4.445%
未払報告書作成費用					-11,024.59	0.00	0.00	-11,024.59	0.967%
現金および現金等価物					-11,024.59	0.00	0.00	-11,024.59	0.967%
ユーロ					-11,024.59	0.00	0.00	-11,024.59	0.967%
ユーロ	EUR	-608.670	1.0000	-608.67	-11,024.59	0.00	0.00	-11,024.59	0.967%
未払副投資運用報酬					-13,752.16	0.00	0.00	-13,752.16	1.207%
現金および現金等価物					-13,752.16	0.00	0.00	-13,752.16	1.207%
南アフリカランド					-13,752.16	0.00	0.00	-13,752.16	1.207%
南アフリカランド	ZAR	-13,752.160	1.0000	-13,752.16	-13,752.16	0.00	0.00	-13,752.16	1.207%
未払受託報酬					-88,036.00	0.00	0.00	-88,036.00	7.724%
現金および現金等価物					-88,036.00	0.00	0.00	-88,036.00	7.724%
米ドル					-88,036.00	0.00	0.00	-88,036.00	7.724%
米ドル	USD	-5,070.600	1.0000	-5,070.60	-88,036.00	0.00	0.00	-88,036.00	7.724%
報告額合計:					199,831,368.16	-35,861,032.19	0.00	163,970,335.97	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）

2022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＊	288,876	39,382
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	31	4
店頭取引	1,402	191
現金	97	13
取引相手への預け金	1,970	269
外貨、時価評価額	181	25
投資売却未収金	618	84
ファンド受益証券販売未収金	1,500	204
未収利息および／または未収配当金	4,337	591
	299,012	40,764
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	2,962	404
空売りに係る未払金	165	22
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	278	38
店頭取引	1,119	153
投資購入未払金	1,250	170
未払利息	15	2
取引相手からの預り金	820	112
ファンド受益証券買戻未払金	960	131
	7,569	1,032
純資産	291,443	39,732
投資有価証券原価	387,124	52,777
保有外貨原価	226	31
空売りに係る受領額	164	22
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	358	49
＊次の現先取引契約を含む：	14,000	1,909

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:	291,443	39,732
発行済受益証券口数:	20,140千口	
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)	14.47米ドル	1,973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)

(2022年8月31日現在)

(金額:千単位*、株式数、契約数、受益証券口数およびオンス(該当する場合)を除く。)

		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 99.1%				SOVEREIGN ISSUES 0.6%			
ALBANIA 0.1%				Republic of Azerbaijan International Bond			
SOVEREIGN ISSUES 0.1%				3.500% due 09/01/2032	\$	300	\$ 260
Republic of Albania				4.750% due 03/18/2024		1,500	1,500
3.500% due 11/23/2031	EUR	300	\$ 250				1,760
Total Albania (Cost \$334)			250	Total Azerbaijan (Cost \$8,073)			8,046
ANGOLA 1.1%				BAHAMAS 0.3%			
SOVEREIGN ISSUES 1.1%				SOVEREIGN ISSUES 0.3%			
Angolan Government International Bond				Bahamas Government International Bond			
8.000% due 11/26/2029	\$	600	500	6.000% due 11/21/2028		1,200	783
8.250% due 05/09/2028		1,100	959	Total Bahamas (Cost \$1,200)			783
8.750% due 04/14/2032		1,200	987				
9.125% due 11/26/2049		300	227	BAHRAIN 0.7%			
9.375% due 05/08/2048		600	460	SOVEREIGN ISSUES 0.7%			
9.500% due 11/12/2025		200	191	Bahrain Government International Bond			
Total Angola (Cost \$3,714)			3,324	4.250% due 01/25/2028		1,400	1,275
ARGENTINA 1.4%				5.625% due 09/30/2031		1,000	878
SOVEREIGN ISSUES 1.4%				Total Bahrain (Cost \$2,425)			2,153
Argentina Government International Bond				BELARUS 0.1%			
0.500% due 07/09/2030		330	79	SOVEREIGN ISSUES 0.1%			
1.000% due 07/09/2029		629	148	Republic of Belarus International Bond			
1.500% due 07/09/2035		6,099	1,382	5.875% due 02/24/2026		200	43
1.500% due 07/09/2046		2,415	556	6.378% due 02/24/2031		700	141
3.500% due 07/09/2041		1,481	392	7.625% due 06/29/2027		200	41
3.875% due 01/09/2038		1,468	415	Total Belarus (Cost \$1,074)			225
Argentine Bonos del Tesoro				BRAZIL 1.9%			
15.500% due 10/17/2026	ARS	1,650	2	CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%			
Provincia de Buenos Aires				Centrais Eletricas Brasileiras S.A.			
3.900% due 09/01/2037	\$	400	141	4.625% due 02/04/2030		500	448
Provincia de Entre Rios Argentina				SOVEREIGN ISSUES 1.7%			
5.750% due 08/08/2028 (a)		749	509	Brazil Government International Bond			
Provincia de la Rioja				4.750% due 01/14/2050		6,400	4,657
4.750% due 02/24/2028		1,062	510	8.250% due 01/20/2034		60	68
Total Argentina (Cost \$8,311)			4,134	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais			
ARMENIA 0.3%				5.333% due 02/15/2028		240	235
SOVEREIGN ISSUES 0.3%							4,960
Armenia Government International Bond				Total Brazil (Cost \$7,133)			5,408
3.600% due 02/02/2031		500	362	BRITISH VIRGIN ISLANDS 0.5%			
3.950% due 09/26/2029		800	610	SOVEREIGN ISSUES 0.5%			
Total Armenia (Cost \$1,278)			972	1MDB Global Investments Ltd.			
AZERBAIJAN 2.8%				4.400% due 03/09/2023		1,500	1,434
CORPORATE BONDS & NOTES 2.2%				Total British Virgin Islands (Cost \$1,504)			1,434
SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC				CAMEROON 0.2%			
7.230% due 03/17/2026		100	98	SOVEREIGN ISSUES 0.2%			
Southern Gas Corridor CJSC				Republic of Cameroon International Bond			
6.875% due 03/24/2026		2,700	2,848	5.950% due 07/07/2032	EUR	700	506
State Oil Company of the Azerbaijan Republic				Total Cameroon (Cost \$830)			506
4.750% due 03/13/2023		3,340	3,340	CAYMAN ISLANDS 1.9%			
			6,286	CORPORATE BONDS & NOTES 1.9%			
				Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.			
				0.000% due 06/05/2034	\$	1,217	813

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Interoceanica IV Finance Ltd.			SOVEREIGN ISSUES 2.0%		
0.000% due 11/30/2025	\$ 314	\$ 259	Colombia Government International Bond		
			2.625% due 03/15/2023	\$ 500	\$ 495
Interoceanica V Finance Ltd.			3.875% due 02/15/2061	700	395
0.000% due 05/15/2030	2,106	1,635	4.000% due 02/26/2024	800	785
			4.125% due 02/22/2042	200	126
Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.			4.125% due 05/15/2051	500	297
0.000% due 06/02/2025	1,718	1,623	4.500% due 03/15/2029	800	701
			5.200% due 05/15/2049	800	547
S.A. Global Sukuk Ltd.			5.625% due 02/26/2044	3,300	2,414
1.602% due 06/17/2026	700	644	7.375% due 09/18/2037	200	190
2.694% due 06/17/2031	500	456			5,950
Total Cayman Islands (Cost \$5,494)		5,430	Total Colombia (Cost \$10,710)		8,155
CHILE 2.9%			COSTA RICA 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.1%			SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Banco del Estado de Chile			Costa Rica Government International Bond		
2.704% due 01/09/2025	500	476	5.625% due 04/30/2043	1,800	1,361
			Total Costa Rica (Cost \$1,409)		1,361
Corp. Nacional del Cobre de Chile					
3.700% due 01/30/2050	200	146	DOMINICAN REPUBLIC 3.3%		
4.250% due 07/17/2042	3,200	2,593	SOVEREIGN ISSUES 3.3%		
4.500% due 08/01/2047	500	423	Dominican Republic International Bond		
4.875% due 11/04/2044	1,600	1,406	4.875% due 09/23/2032	500	405
			5.300% due 01/21/2041	500	372
Empresa de los Ferrocarriles del Estado			5.500% due 01/27/2025	300	300
3.068% due 08/18/2050	200	123	5.500% due 02/22/2029	700	641
3.830% due 09/14/2061	400	286	5.875% due 01/30/2060	1,000	712
			5.950% due 01/25/2027	3,500	3,431
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			6.000% due 07/19/2028	1,300	1,248
4.700% due 05/07/2050	600	509	6.000% due 02/22/2033	300	263
			6.400% due 06/05/2049	600	473
Empresa Nacional del Petroleo			6.875% due 01/29/2026	1,700	1,744
3.450% due 09/16/2031	200	168	Total Dominican Republic (Cost \$10,557)		9,589
		6,130			
SOVEREIGN ISSUES 0.8%			ECUADOR 1.3%		
Chile Government International Bond			SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
2.750% due 01/31/2027	1,500	1,392	Ecuador Government International Bond		
3.250% due 09/21/2071	500	319	0.000% due 07/31/2030	710	245
4.340% due 03/07/2042	700	602	1.500% due 07/31/2040	3,857	1,343
		2,313	2.500% due 07/31/2035	3,651	1,422
Total Chile (Cost \$10,001)		8,443	5.500% due 07/31/2030	1,720	912
			Total Ecuador (Cost \$5,174)		3,922
CHINA 0.4%			EGYPT 2.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%			SOVEREIGN ISSUES 2.8%		
Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd.			Egypt Government International Bond		
2.100% due 07/28/2026	1,400	1,283	4.750% due 04/11/2025	EUR 100	86
Total China (Cost \$1,397)		1,283	4.750% due 04/16/2026	2,000	1,582
			5.625% due 04/16/2030	800	542
COLOMBIA 2.8%			5.875% due 02/16/2031	\$ 1,200	821
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%			6.375% due 04/11/2031	EUR 1,000	678
Ecopetrol S.A.			7.053% due 01/15/2032	\$ 200	141
4.625% due 11/02/2031	500	391	7.300% due 09/30/2033	700	477
5.875% due 05/28/2045	2,500	1,730	7.500% due 02/16/2061	900	527
7.375% due 09/18/2043	100	84	7.625% due 05/29/2032	1,500	1,058
		2,205	7.903% due 02/21/2048	200	121
			8.500% due 01/31/2047	1,900	1,219
			8.875% due 05/29/2050	1,300	843
			Total Egypt (Cost \$11,353)		8,095

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
EL SALVADOR 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
El Salvador Government International Bond		
7.125% due 01/20/2050	\$ 1,450	\$ 486
7.625% due 09/21/2034	100	32
7.625% due 02/01/2041	1,000	351
9.500% due 07/15/2052	400	150
Total El Salvador (Cost \$3,016)		<u>1,019</u>
ETHIOPIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Ethiopia Government International Bond		
6.625% due 12/11/2024	600	338
Total Ethiopia (Cost \$600)		<u>338</u>
GEORGIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Georgia Government International Bond		
2.750% due 04/22/2026	200	174
Total Georgia (Cost \$176)		<u>174</u>
GHANA 1.1%		
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Republic of Ghana International Bond		
0.000% due 04/07/2025 (g)	300	144
7.625% due 05/16/2029	300	115
7.750% due 04/07/2029	1,000	383
8.125% due 03/26/2032	1,000	383
8.625% due 04/07/2034	1,400	507
8.750% due 03/11/2061	1,700	599
8.875% due 05/07/2042	1,200	428
8.950% due 03/26/2051	2,000	716
Total Ghana (Cost \$8,279)		<u>3,275</u>
GUATEMALA 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Guatemala Government Bond		
4.650% due 10/07/2041	500	398
4.875% due 02/13/2028	800	779
4.900% due 06/01/2030	600	573
6.125% due 06/01/2050	700	642
Total Guatemala (Cost \$2,751)		<u>2,392</u>
HONG KONG 1.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Huarong Finance 2017 Co. Ltd.		
4.950% due 11/07/2047	400	266
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.		
3.875% due 11/13/2029	200	148
4.105% due 02/24/2023	1,300	1,266
		<u>1,680</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Airport Authority (b)		
2.100% due 03/08/2026	700	649
2.400% due 03/08/2028	1,000	886
		<u>1,535</u>
Total Hong Kong (Cost \$3,536)		<u>3,215</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
HUNGARY 1.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Hungary Government International Bond		
2.125% due 09/22/2031	\$ 800	\$ 588
3.125% due 09/21/2051	600	377
5.250% due 06/16/2029	1,600	1,546
5.500% due 06/16/2034	1,400	1,310
Total Hungary (Cost \$4,335)		<u>3,821</u>
INDIA 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Indian Railway Finance Corp. Ltd.		
3.249% due 02/13/2030	500	440
3.950% due 02/13/2050	300	234
		<u>674</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Export-Import Bank of India		
3.250% due 01/15/2030	1,800	1,610
Total India (Cost \$2,580)		<u>2,284</u>
INDONESIA 4.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.3%		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		
3.950% due 03/28/2024	2,200	2,187
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT		
5.450% due 05/15/2030	800	786
Pelabuhan Indonesia Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,100	3,124
Pertamina Persero PT		
6.450% due 05/30/2044	1,700	1,784
6.500% due 11/07/2048	1,700	1,769
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara		
5.250% due 10/24/2042	2,800	2,475
5.250% due 05/15/2047	200	173
6.150% due 05/21/2048	400	382
		<u>12,680</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
4.700% due 06/06/2032	1,600	1,649
Total Indonesia (Cost \$14,528)		<u>14,329</u>
IRELAND 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC		
6.927% due 02/19/2027	193	175
Total Ireland (Cost \$182)		<u>175</u>
ISRAEL 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Israel Electric Corp. Ltd.		
3.750% due 02/22/2032	1,000	928
5.000% due 11/12/2024	300	303
Total Israel (Cost \$1,311)		<u>1,231</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
IVORY COAST 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Ivory Coast Government International Bond		
5.250% due 03/22/2030	EUR 2,600	\$ 2,122
5.750% due 12/31/2032	\$ 1,003	903
5.875% due 10/17/2031	EUR 200	162
6.625% due 03/22/2048	300	207
Total Ivory Coast (Cost \$4,482)		<u>3,394</u>
JAMAICA 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
TransJamaican Highway Ltd.		
5.750% due 10/10/2036	\$ 384	<u>327</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Jamaica Government International Bond		
7.875% due 07/28/2045	1,000	<u>1,166</u>
Total Jamaica (Cost \$1,384)		<u>1,493</u>
JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Corsair International Ltd.		
5.481% due 01/28/2027	EUR 900	876
5.823% due 01/28/2029	400	<u>386</u>
Total Jersey, Channel Islands (Cost \$1,452)		<u>1,262</u>
JORDAN 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Jordan Government International Bond		
5.750% due 01/31/2027	\$ 1,800	1,680
5.850% due 07/07/2030	200	176
7.375% due 10/10/2047	1,000	824
7.750% due 01/15/2028	900	<u>894</u>
Total Jordan (Cost \$4,014)		<u>3,574</u>
KAZAKHSTAN 1.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%		
Development Bank of Kazakhstan JSC		
4.125% due 12/10/2022	1,800	1,798
KazMunayGas National Co. JSC		
5.375% due 04/24/2030	1,300	1,217
5.750% due 04/19/2047	1,000	826
6.375% due 10/24/2048	200	169
KazTransGas JSC		
4.375% due 09/26/2027	200	<u>182</u>
		<u>4,192</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Kazakhstan Government International Bond		
6.500% due 07/21/2045	300	<u>303</u>
Total Kazakhstan (Cost \$4,653)		<u>4,495</u>
KENYA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Republic of Kenya Government International Bond		
6.300% due 01/23/2034 (g)	800	551
8.000% due 05/22/2032	2,000	<u>1,490</u>
Total Kenya (Cost \$2,849)		<u>2,041</u>
LUXEMBOURG 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
4.950% due 03/23/2027	1,700	892
5.150% due 02/11/2026	1,600	<u>840</u>
Total Luxembourg (Cost \$3,281)		<u>1,732</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
MALAYSIA 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
Petronas Capital Ltd.		
3.404% due 04/28/2061	\$ 600	\$ 468
4.550% due 04/21/2050	200	197
4.800% due 04/21/2060	900	920
Petronas Energy Canada Ltd.		
2.112% due 03/23/2028	600	<u>542</u>
		<u>2,127</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Malaysia Sukuk Global Bhd		
4.080% due 04/27/2046	700	<u>692</u>
Total Malaysia (Cost \$3,400)		<u>2,819</u>
MARSHALL ISLANDS 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Nakilat, Inc.		
6.267% due 12/31/2033	66	<u>71</u>
Total Marshall Islands (Cost \$78)		<u>71</u>
MAURITIUS 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Greenko Solar Mauritius Ltd.		
5.950% due 07/29/2026	500	<u>443</u>
Total Mauritius (Cost \$500)		<u>443</u>
MEXICO 3.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.5%		
Petroleos Mexicanos		
6.625% due 06/15/2038	4,400	2,931
6.700% due 02/16/2032	2,842	2,222
6.950% due 01/28/2060	2,460	1,547
7.690% due 01/23/2050	700	<u>483</u>
		<u>7,183</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Mexico Government International Bond		
5.750% due 10/12/2110	3,700	<u>3,179</u>
Total Mexico (Cost \$13,446)		<u>10,362</u>
MONGOLIA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Mongolia Government International Bond		
3.500% due 07/07/2027	900	753
5.625% due 05/01/2023	400	399
8.750% due 03/09/2024	800	<u>817</u>
Total Mongolia (Cost \$2,123)		<u>1,969</u>
MOROCCO 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
OCP S.A.		
3.750% due 06/23/2031	800	661
5.125% due 06/23/2051	1,000	<u>721</u>
		<u>1,382</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Morocco Government International Bond		
2.375% due 12/15/2027	500	432
3.000% due 12/15/2032	300	226
4.000% due 12/15/2050	1,000	653
4.250% due 12/11/2022	1,100	<u>1,099</u>
		<u>2,410</u>
Total Morocco (Cost \$4,617)		<u>3,792</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
NAMIBIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Namibia Government International Bond		
5.250% due 10/29/2025	\$ 1,000	\$ 907
Total Namibia (Cost \$996)		907
NETHERLANDS 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV		
6.950% due 07/10/2042	3,000	2,806
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Republic of Angola Via Avenir II BV		
6.609% due 12/07/2023	510	503
10.447% due 07/01/2023	443	447
		950
Total Netherlands (Cost \$4,477)		3,756
NIGERIA 3.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
BOI Finance BV		
7.500% due 02/16/2027	EUR 1,100	952
SOVEREIGN ISSUES 2.9%		
Nigeria Government International Bond		
6.125% due 09/28/2028	\$ 1,200	872
6.375% due 07/12/2023 (g)	2,400	2,340
7.143% due 02/23/2030	2,700	1,998
7.375% due 09/28/2033	900	605
7.625% due 11/21/2025	400	356
7.875% due 02/16/2032	400	290
8.250% due 09/28/2051	900	574
8.747% due 01/21/2031	1,800	1,413
		8,448
Total Nigeria (Cost \$11,934)		9,400
OMAN 2.2%		
SOVEREIGN ISSUES 2.2%		
Oman Government International Bond		
4.125% due 01/17/2023	200	200
6.000% due 08/01/2029	4,200	4,202
6.500% due 03/08/2047	600	527
6.750% due 01/17/2048	700	629
7.000% due 01/25/2051	800	740
Oman Sovereign Sukuk Co.		
4.397% due 06/01/2024	200	200
Total Oman (Cost \$6,528)		6,498
PAKISTAN 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Pakistan Government International Bond		
6.000% due 04/08/2026	400	251
6.875% due 12/05/2027	1,200	747
7.375% due 04/08/2031	700	397
8.875% due 04/08/2051	2,000	1,072
Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.		
5.625% due 12/05/2022	300	286
Total Pakistan (Cost \$4,129)		2,753
PANAMA 4.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.		
5.125% due 08/11/2061	600	487

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Banco Nacional de Panama		
2.500% due 08/11/2030	\$ 600	\$ 486
		973
SOVEREIGN ISSUES 3.9%		
Panama Government International Bond		
4.500% due 04/01/2056	1,000	776
4.500% due 01/19/2063	200	152
6.700% due 01/26/2036	500	540
8.125% due 04/28/2034	4,400	5,401
9.375% due 01/16/2023	4,500	4,594
		11,463
Total Panama (Cost \$12,529)		12,436
PARAGUAY 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Paraguay Government International Bond		
3.849% due 06/28/2033	300	258
4.700% due 03/27/2027	400	396
5.400% due 03/30/2050	400	336
6.100% due 08/11/2044	400	374
Total Paraguay (Cost \$1,535)		1,364
PERU 0.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Petroleos del Peru S.A.		
5.625% due 06/19/2047	1,000	691
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Peru Government International Bond		
3.000% due 01/15/2034	800	654
3.230% due 07/28/2121	400	251
3.600% due 01/15/2072	500	344
6.550% due 03/14/2037	205	226
		1,475
Total Peru (Cost \$2,885)		2,166
PHILIPPINES 1.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Philippines Government International Bond		
2.650% due 12/10/2045	200	144
2.950% due 05/05/2045	1,800	1,351
3.700% due 03/01/2041	2,500	2,179
3.950% due 01/20/2040	200	183
Total Philippines (Cost \$5,003)		3,857
QATAR 1.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%		
Qatar Energy		
2.250% due 07/12/2031	800	699
3.125% due 07/12/2041	700	571
3.300% due 07/12/2051	600	480
		1,750
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Qatar Government International Bond		
4.400% due 04/16/2050	1,000	983
4.817% due 03/14/2049	1,200	1,242
5.103% due 04/23/2048	200	215
5.750% due 01/20/2042	500	575
6.400% due 01/20/2040	500	612
		3,627
Total Qatar (Cost \$6,051)		5,377

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
ROMANIA 1.7%			SINGAPORE 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.7%			CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Romania Government International Bond			Singapore Airlines Ltd.		
1.750% due 07/13/2030	EUR	600 \$	436	3.375% due 01/19/2029	\$ 900 \$ 830
2.125% due 03/07/2028		1,000	847	Total Singapore (Cost \$894)	830
2.375% due 04/19/2027		1,000	910		
2.875% due 04/13/2042		200	117	SOUTH AFRICA 4.2%	
3.000% due 02/14/2031	\$	400	320	CORPORATE BONDS & NOTES 2.5%	
3.500% due 04/03/2034	EUR	100	76	Development Bank of Southern Africa Ltd.	
3.750% due 02/07/2034		500	392	8.600% due 10/21/2024 (e)	ZAR 41,000 2,360
4.000% due 02/14/2051	\$	1,400	973		
4.625% due 04/03/2049	EUR	200	149	Eskom Holdings SOC Ltd.	
6.000% due 05/25/2034	\$	800	768	4.314% due 07/23/2027	\$ 1,500 1,328
Total Romania (Cost \$6,794)		4,988		6.350% due 08/10/2028	2,800 2,658
				6.750% due 08/06/2023	1,000 974
					7,320
RUSSIA 1.0%					
SOVEREIGN ISSUES 1.0%				SOVEREIGN ISSUES 1.7%	
Russia Government International Bond				South Africa Government International Bond	
4.375% due 03/21/2029		2,000	970	4.850% due 09/30/2029	700 622
5.100% due 03/28/2035		4,000	1,940	5.375% due 07/24/2044	1,000 720
Total Russia (Cost \$6,156)		2,910		5.750% due 09/30/2049	1,200 860
				5.875% due 04/20/2032	400 357
RWANDA 0.1%				6.300% due 06/22/2048 (g)	2,000 1,561
SOVEREIGN ISSUES 0.1%				7.300% due 04/20/2052	300 250
Rwanda International Government Bond				10.500% due 12/21/2026	ZAR 11,000 680
5.500% due 08/09/2031		400	308		5,050
Total Rwanda (Cost \$400)		308		Total South Africa (Cost \$14,705)	12,370
SAUDI ARABIA 2.2%				SRI LANKA 1.0%	
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%				SOVEREIGN ISSUES 1.0%	
Saudi Arabian Oil Co.				Sri Lanka Government International Bond (a)	
2.250% due 11/24/2030		500	436	5.750% due 04/18/2023	\$ 1,000 346
3.500% due 11/24/2070		1,200	872	5.875% due 07/25/2049	200 73
4.250% due 04/16/2039		400	378	6.125% due 06/03/2025	1,300 472
			1,686	6.200% due 05/11/2027	2,700 923
				6.850% due 11/03/2025	1,100 394
SOVEREIGN ISSUES 1.6%				7.550% due 03/28/2030	1,700 583
Saudi Government International Bond				Total Sri Lanka (Cost \$6,720)	2,791
2.250% due 02/02/2033		500	430		
3.450% due 02/02/2061		800	615	SUPRANATIONAL 0.6%	
3.750% due 01/21/2055		1,000	834	CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%	
4.375% due 04/16/2029		1,100	1,143	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	
4.500% due 10/26/2046		1,700	1,592	4.125% due 06/30/2028	900 765
			4,614		
Total Saudi Arabia (Cost \$7,494)		6,300		SOVEREIGN ISSUES 0.3%	
				African Export - Import Bank	
SENEGAL 0.6%				2.634% due 05/17/2026	1,000 903
SOVEREIGN ISSUES 0.6%				Total Supranational (Cost \$1,901)	1,668
Senegal Government International Bond					
4.750% due 03/13/2028	EUR	1,600	1,359	TUNISIA 0.2%	
5.375% due 06/08/2037		100	69	SOVEREIGN ISSUES 0.2%	
6.250% due 05/23/2033	\$	200	163	Tunisian Republic	
6.750% due 03/13/2048		400	282	3.280% due 08/09/2027	/ 200,000 694
Total Senegal (Cost \$2,708)		1,873		Total Tunisia (Cost \$1,935)	694
SERBIA 0.5%				TURKEY 4.2%	
SOVEREIGN ISSUES 0.5%				SOVEREIGN ISSUES 4.2%	
Serbia Government International Bond				Turkey Government International Bond	
1.000% due 09/23/2028	EUR	1,100	804	5.125% due 02/17/2028	\$ 500 395
1.500% due 06/26/2029		200	145	5.750% due 05/11/2047	7,500 4,570
2.050% due 09/23/2036		400	232	5.875% due 06/26/2031	300 222
3.125% due 05/15/2027		400	349	6.125% due 10/24/2028	1,900 1,547
Total Serbia (Cost \$1,760)		1,530		6.375% due 10/14/2025	200 182

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S		
5.375% due 10/24/2023 (g)	\$ 2,600	\$ 2,502
8.250% due 01/24/2024	2,800	2,754
Total Turkey (Cost \$15,325)		<u>12,172</u>
UKRAINE 0.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
NPC Ukrenerg		
6.875% due 11/09/2028	1,200	234
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Ukraine Government International Bond		
6.876% due 05/21/2031	600	119
7.253% due 03/15/2035	900	164
7.375% due 09/25/2034	1,500	277
7.750% due 09/01/2025	1,900	475
7.750% due 09/01/2026	700	147
7.750% due 09/01/2027	1,000	208
7.750% due 09/01/2029	1,400	294
8.994% due 02/01/2026	300	65
		<u>1,749</u>
Total Ukraine (Cost \$8,864)		<u>1,983</u>
UNITED ARAB EMIRATES 1.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC		
3.650% due 11/02/2029	1,600	1,582
Abu Dhabi Ports Co. PJSC		
2.500% due 05/06/2031	900	787
DP World Ltd.		
5.625% due 09/25/2048	700	693
MDGH GMTN RSC Ltd.		
3.950% due 05/21/2050	200	186
		<u>3,248</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Finance Department Government of Sharjah		
4.375% due 03/10/2051	200	131
Total United Arab Emirates (Cost \$3,653)		<u>3,379</u>
UNITED KINGDOM 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC		
9.375% due 03/10/2023	293	176
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC		
8.250% due 07/09/2024	1,500	322
		<u>498</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC		
9.750% due 01/22/2025	250	113
Total United Kingdom (Cost \$2,053)		<u>611</u>
UNITED STATES 3.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
DAE Funding LLC		
2.625% due 03/20/2025	400	376
3.375% due 03/20/2028	200	179
Rutas 2 & 7 Finance Ltd.		
0.000% due 09/30/2036	1,353	865
		<u>1,420</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 2.5%		
U.S. Treasury Bonds		
1.750% due 08/15/2041	\$ 500	\$ 372
2.375% due 02/15/2042	1,100	912
3.250% due 05/15/2042	5,300	5,071
3.375% due 08/15/2042	900	879
		<u>7,234</u>
Total United States (Cost \$8,958)		<u>8,654</u>
URUGUAY 1.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Uruguay Government International Bond		
4.975% due 04/20/2055	100	101
7.625% due 03/21/2036	1,490	1,927
7.875% due 01/15/2033	1,340	1,729
Total Uruguay (Cost \$3,555)		<u>3,757</u>
UZBEKISTAN 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Republic of Uzbekistan International Bond		
3.700% due 11/25/2030	300	234
Total Uzbekistan (Cost \$259)		<u>234</u>
VENEZUELA 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.500% due 04/12/2037 (a)	20,990	708
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Venezuela Government International Bond (a)		
7.000% due 03/31/2038	10,900	954
7.650% due 04/21/2025	8,215	698
9.250% due 09/15/2027	4,520	396
11.950% due 08/05/2031	340	29
		<u>2,077</u>
Total Venezuela (Cost \$29,413)		<u>2,785</u>
ZAMBIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Zambia Government International Bond (a)		
5.375% due 09/20/2022	1,200	680
8.970% due 07/30/2027	500	304
Total Zambia (Cost \$1,579)		<u>984</u>
SHORT-TERM INSTRUMENTS 9.0%		
REPURCHASE AGREEMENTS (f) 4.8%		<u>14,000</u>
TIME DEPOSITS 0.5%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
1.830% due 09/01/2022	6	6
Bank of Nova Scotia		
1.630% due 09/01/2022	CAD 3	3
1.830% due 09/01/2022	\$ 7	7
BNP Paribas Bank		
(0.350%) due 09/01/2022	/ 116	1
1.630% due 09/01/2022	CAD 4	3
1.830% due 09/01/2022	\$ 2	2
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.350%) due 09/01/2022	/ 81	1
3.750% due 09/01/2022	ZAR 1	0

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Citibank N.A.			Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
1.830% due 09/01/2022	\$ 81	\$ 81	(0.350%) due 09/01/2022	/ 44	\$ 0
			0.920% due 09/01/2022	GBP 1	1
DBS Bank Ltd.			1.830% due 09/01/2022	\$ 643	643
1.830% due 09/01/2022	260	260			<u>1,316</u>
HSBC Bank PLC			ISRAEL TREASURY BILLS (c) 3.3%		
0.920% due 09/01/2022	GBP 13	15	1.254% due 05/03/2023	ILS 18,600	5,520
JPMorgan Chase Bank N.A.			1.748% due 07/05/2023	10,200	3,011
1.830% due 09/01/2022	\$ 208	208	1.833% due 08/02/2023	4,200	<u>1,236</u>
					<u>9,767</u>
MUFG Bank Ltd.			MALAYSIA TREASURY BILLS 0.4%		
(0.350%) due 09/01/2022	/ 2,993	22	2.373% due 11/08/2022 (d)	MYR 5,600	<u>1,245</u>
National Australia Bank Ltd.			Total Short-Term Instruments		26,328
1.830% due 09/01/2022	\$ 1	1	(Cost \$26,387)		
Royal Bank of Canada			Total Investments in Securities 99.1%		\$ 288,876
1.830% due 09/01/2022	7	7	(Cost \$387,124)		
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			Financial Derivative Instruments (h)(i) 0.0%		36
(0.350%) due 09/01/2022	/ 46	0	(Cost or Premiums, net \$358)		
0.920% due 09/01/2022	GBP 5	5	Other Assets and Liabilities, net 0.9%		<u>2,531</u>
1.830% due 09/01/2022	\$ 50	50			
			Net Assets 100.0%		<u>\$ 291,443</u>

[次へ](#)

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

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

(a) Security is in default.

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

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

(d) Coupon represents a yield to maturity.

(e) RESTRICTED SECURITIES:

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	時価	時価 純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	\$ 2,753	\$ 2,360	0.81%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(f) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受入担保 (時価評価額)	現先取引 (時価評価額)	現先取引に係る未収金 ⁽¹⁾
RCY	2.300%	08/31/2022	09/01/2022	\$ 14,000	U.S. Treasury Notes 2.250% due 08/15/2027	\$ (14,279)	\$ 14,000	\$ 14,001
Total Repurchase Agreements						\$ (14,279)	\$ 14,000	\$ 14,001

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日 ⁽³⁾	借入額 ⁽²⁾	逆現先取引に係る未払金
BPS	1.750%	05/06/2022	TBD	\$ (445)	\$ (446)
BRC	0.000%	05/31/2022	TBD	(388)	(386)
BRC	1.650%	04/08/2022	TBD	(681)	(680)
FBF	(1.000%)	08/11/2022	TBD	(1,293)	(1,292)
NOM	(0.250%)	07/29/2022	TBD	(158)	(158)
Total Reverse Repurchase Agreements				\$	(2,962)

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. Government Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,962)	\$	(2,962)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,962)	\$	(2,962)
Total Borrowings	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,962)	\$	(2,962)
Payable for Reverse Repurchase Agreements					\$	(2,962)

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 ⁽⁴⁾
GSC	U.S. Treasury Bonds	2.250%	05/15/2041	\$ 200	\$ (164)	\$ (165)
Total Short Sales (0.1%)					\$ (164)	\$ (165)

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, 2022:

(g) Securities with an aggregate market value of \$2,738 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of August 31, 2022.

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 (5)
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 0	\$ (446)	\$ 0	\$ 0	\$ (446)	\$ 390	\$ (56)
BRC	0	(1,066)	0	0	(1,066)	936	(130)
FBF	0	(1,292)	0	0	(1,292)	1,268	(24)
NOM	0	(158)	0	0	(158)	144	(14)
RCY	14,001	0	0	0	14,001	(14,279)	(278)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
GSC	0	0	0	(165)	(165)	0	(165)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 14,001	\$ (2,962)	\$ 0	\$ (165)			

(1) Includes accrued interest.

(2) The average amount of borrowings outstanding during the period ended August 31, 2022 was \$14,402 at a weighted average interest rate of 0.798%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

(3) Open maturity reverse repurchase agreement.

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

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

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

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価益 / (損)	変動証拠金	
					資産	負債
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Short	12/2022	51	\$ 24	\$ 2	\$ 0
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Short	12/2022	182	98	28	0
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2022	108	(119)	0	(50)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures	Long	12/2022	22	(16)	0	(34)
Total Futures Contracts				\$ (13)	\$ 30	\$ (84)

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	1.500%	06/21/2027	\$ 22,600	\$ (1,934)	\$ (218)	\$ 0	\$ (194)
Receive(1)	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	09/21/2024	7,800	388	66	1	0
Total Swap Agreements					\$ (1,546)	\$ (152)	\$ 1	\$ (194)

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, 2022:

Cash of \$885 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of August 31, 2022. 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	\$ 30	\$ 1	\$ 31	\$ 0	\$ (84)	\$ (194)	\$ (278)

(1) This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価益 / (損)	
						資産	負債
BOA	09/2022	\$	650	PEN	2,511	\$ 3	\$ 0
BPS	09/2022	EUR	1,078	\$	1,105	20	0
BPS	09/2022	JPY	151,200		1,146	55	0
BPS	09/2022	\$	10,317	PEN	39,750	4	0
BPS	05/2023	ILS	1,383	\$	429	8	0
CBK	09/2022	EUR	234		238	3	0
CBK	09/2022	PEN	2,511		638	0	(15)
CBK	10/2022		2,412		610	0	(14)
CBK	10/2022		40,678		10,193	0	(335)
CBK	12/2022		7,621		1,958	0	(2)
CBK	12/2022	\$	1,245	PEN	5,223	100	0
CBK	01/2023	ZAR	9,876	\$	564	0	(8)
CBK	02/2023	\$	630	PEN	2,511	14	0
CBK	05/2023	ILS	17,029	\$	5,135	0	(52)
CBK	07/2023		10,045		3,140	70	0
CBK	08/2023		4,126		1,279	16	0
DUB	12/2022	ZAR	5,599		356	31	0
GLM	10/2022		21,559		1,368	108	0
GLM	12/2022	\$	602	PEN	2,398	15	0
HUS	11/2022	MYR	5,570	\$	1,257	13	0
MBC	09/2022	EUR	13,598		13,897	224	0
MYI	09/2022	ZAR	9,758		564	0	(8)
SCX	09/2022		5,106		330	31	0
SOG	09/2022	\$	14,973	EUR	14,910	20	0
SOG	10/2022	EUR	14,910	\$	15,004	0	(21)
UAG	10/2022	ZAR	4,056		236	0	(1)
Total Forward Foreign Currency Contracts						\$ 735	\$ (456)

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	2022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	7.692%	\$ 700	\$ 60	\$ 65	\$ 125	\$ 0
CBK	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	7.692%	400	34	37	71	0
DUB	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	7.692%	300	30	23	53	0
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	7.583%	2,500	311	13	324	0
HUS	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.817%	200	(1)	0	0	(1)
JPM	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.817%	700	(1)	(3)	0	(4)
JPM	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	7.692%	300	29	25	54	0
						\$ 462	\$ 160	\$ 627	\$ (5)

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	2022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%	06/20/2031	3.344%	\$ 300	\$ (43)	\$ (3)	\$ 0	\$ (46)
BOA	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.889%	100	0	0	0	0
BOA	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.922%	1,100	1	3	4	0
BOA	Montenegro Government International Bond	1.000%	06/20/2023	3.851%	EUR 100	(8)	6	0	(2)
BOA	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	1.066%	\$ 200	2	(2)	0	0
BPS	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.409%	700	4	(14)	0	(10)
BPS	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	1.066%	1,000	9	(9)	0	0
BRC	Argentina Government International Bond	5.000%	12/20/2023	40.182%	600	(83)	(127)	0	(210)
BRC	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.889%	400	1	1	2	0
BRC	QNB Finance Ltd.	1.000%	06/20/2023	0.503%	100	1	0	1	0
BRC	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2031	N/A	400	(42)	(175)	0	(217)
BRC	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.322%	188	2	1	3	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.403%	300	(19)	3	0	(16)
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.927%	200	0	0	0	0
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.048%	200	0	0	0	0
CBK	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	1.066%	3,600	25	(26)	0	(1)
GST	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.889%	700	2	1	3	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	2022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
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	1.185%	\$ 700	\$ 2	\$ (6)	\$ 0	\$ (4)
GST	Peru Government International Bond	1.000%	12/20/2025	0.974%	5,000	105	(91)	14	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	1.066%	1,300	13	(13)	0	0
GST	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.322%	112	1	1	2	0
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2022	6.042%	1,200	(54)	38	0	(16)
JPM	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.409%	200	1	(4)	0	(3)
JPM	Israel Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.160%	600	14	(4)	10	0
JPM	Nigeria Government International Bond	1.000%	06/20/2023	5.690%	700	(17)	(7)	0	(24)
MYC	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.922%	100	0	1	1	0
MYC	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2031	N/A	200	(21)	(88)	0	(109)
						\$ (104)	\$ (514)	\$ 40	\$ (658)
Total Swap Agreements						\$ 358	\$ (354)	\$ 667	\$ (663)

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, 2022:

Cash of \$1,085 has been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as of August 31, 2022.

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	\$ 3	\$ 0	\$ 129	\$ 132	\$ 0	\$ 0	\$ (48)	\$ (48)	\$ 84	\$ 0	\$ 84
BPS	87	0	0	87	0	0	(10)	(10)	77	0	77
BRC	0	0	6	6	0	0	(427)	(427)	(421)	532	111
CBK	203	0	71	274	(426)	0	(17)	(443)	(169)	280	111
DUB	31	0	53	84	0	0	0	0	84	0	84
GLM	123	0	0	123	0	0	0	0	123	0	123
GST	0	0	343	343	0	0	(20)	(20)	323	(230)	93
HUS	13	0	0	13	0	0	(1)	(1)	12	0	12
JPM	0	0	64	64	0	0	(31)	(31)	33	0	33
MBC	224	0	0	224	0	0	0	0	224	(350)	(126)
MYC	0	0	1	1	0	0	(109)	(109)	(108)	273	165
MYI	0	0	0	0	(8)	0	0	(8)	(8)	0	(8)
SCX	31	0	0	31	0	0	0	0	31	(240)	(209)
SOG	20	0	0	20	(21)	0	0	(21)	(1)	0	(1)
UAG	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
Total Over the Counter	\$ 735	\$ 0	\$ 667	\$ 1,402	\$ (456)	\$ 0	\$ (663)	\$ (1,119)			

- (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. Under certain circumstances, implied credit spreads may not be applicable when the reference obligation or underlying security is distressed or in default (identified as "N/A") and, as such, the market value would serve as the indicator of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative.
- (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, 2022:

	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	\$ 30	\$ 30	
Swap Agreements	0	0	0	0	1	1	
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 31	\$ 31	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 735	\$ 0	\$ 735	
Swap Agreements	0	667	0	0	0	667	
	\$ 0	\$ 667	\$ 0	\$ 735	\$ 0	\$ 1,402	
	\$ 0	\$ 667	\$ 0	\$ 735	\$ 31	\$ 1,433	
Financial Derivative Instruments - Liabilities							
Exchange-traded or centrally cleared							
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (84)	\$ (84)	
Swap Agreements	0	0	0	0	(194)	(194)	
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (278)	\$ (278)	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (456)	\$ 0	\$ (456)	
Swap Agreements	0	(663)	0	0	0	(663)	
	\$ 0	\$ (663)	\$ 0	\$ (456)	\$ 0	\$ (1,119)	
	\$ 0	\$ (663)	\$ 0	\$ (456)	\$ (278)	\$ (1,397)	

The Effect of Financial Derivative Instruments on the Statement of Operations for the period ended
August 31, 2022:

	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	\$ 770	\$ 770
Swap Agreements	0	(46)	0	0	138	92
	\$ 0	\$ (46)	\$ 0	\$ 0	\$ 908	\$ 862
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 3,504	\$ 0	\$ 3,504
Swap Agreements	0	(61)	0	0	0	(61)
	\$ 0	\$ (61)	\$ 0	\$ 3,504	\$ 0	\$ 3,443
	\$ 0	\$ (107)	\$ 0	\$ 3,504	\$ 908	\$ 4,305
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (55)	\$ (55)
Swap Agreements	0	24	0	0	(1,532)	(1,508)
	\$ 0	\$ 24	\$ 0	\$ 0	\$ (1,587)	\$ (1,563)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (212)	\$ 0	\$ (212)
Swap Agreements	0	92	0	0	0	92
	\$ 0	\$ 92	\$ 0	\$ (212)	\$ 0	\$ (120)
	\$ 0	\$ 116	\$ 0	\$ (212)	\$ (1,587)	\$ (1,683)

FAIR VALUE MEASUREMENTS

The following is a summary of the fair valuations according to the inputs used as of August 31, 2022 in valuing the Fund's assets and liabilities:

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2022	Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2022
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Albania					Dominican Republic				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 250	\$ 0	\$ 250	Sovereign Issues	\$ 0	\$ 9,589	\$ 0	\$ 9,589
Angola					Ecuador				
Sovereign Issues	0	3,324	0	3,324	Sovereign Issues	0	3,922	0	3,922
Argentina					Egypt				
Sovereign Issues	0	4,134	0	4,134	Sovereign Issues	0	8,095	0	8,095
Armenia					El Salvador				
Sovereign Issues	0	972	0	972	Sovereign Issues	0	1,019	0	1,019
Azerbaijan					Ethiopia				
Corporate Bonds & Notes	0	6,286	0	6,286	Sovereign Issues	0	338	0	338
Sovereign Issues	0	1,760	0	1,760	Georgia				
Bahamas					Sovereign Issues	0	174	0	174
Sovereign Issues	0	783	0	783	Ghana				
Bahrain					Sovereign Issues	0	3,275	0	3,275
Sovereign Issues	0	2,153	0	2,153	Guatemala				
Belarus					Sovereign Issues	0	2,392	0	2,392
Sovereign Issues	0	225	0	225	Hong Kong				
Brazil					Corporate Bonds & Notes	0	1,680	0	1,680
Corporate Bonds & Notes	0	448	0	448	Sovereign Issues	0	1,535	0	1,535
Sovereign Issues	0	4,960	0	4,960	Hungary				
British Virgin Islands					Sovereign Issues	0	3,821	0	3,821
Sovereign Issues	0	1,434	0	1,434	India				
Cameroon					Corporate Bonds & Notes	0	674	0	674
Sovereign Issues	0	506	0	506	Sovereign Issues	0	1,610	0	1,610
Cayman Islands					Indonesia				
Corporate Bonds & Notes	0	5,430	0	5,430	Corporate Bonds & Notes	0	12,680	0	12,680
Chile					Sovereign Issues	0	1,649	0	1,649
Corporate Bonds & Notes	0	6,130	0	6,130	Ireland				
Sovereign Issues	0	2,313	0	2,313	Sovereign Issues	0	175	0	175
China					Israel				
Corporate Bonds & Notes	0	1,283	0	1,283	Corporate Bonds & Notes	0	1,231	0	1,231
Colombia					Ivory Coast				
Corporate Bonds & Notes	0	2,205	0	2,205	Sovereign Issues	0	3,394	0	3,394
Sovereign Issues	0	5,950	0	5,950	Jamaica				
Costa Rica					Corporate Bonds & Notes	0	327	0	327
Sovereign Issues	0	1,361	0	1,361	Sovereign Issues	0	1,166	0	1,166

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2022
Investments in Securities, at Value				
Jersey, Channel Islands				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 1,262	\$ 0	\$ 1,262
Jordan				
Sovereign Issues	0	3,574	0	3,574
Kazakhstan				
Corporate Bonds & Notes	0	4,192	0	4,192
Sovereign Issues	0	303	0	303
Kenya				
Sovereign Issues	0	2,041	0	2,041
Luxembourg				
Corporate Bonds & Notes	0	1,732	0	1,732
Malaysia				
Corporate Bonds & Notes	0	2,127	0	2,127
Sovereign Issues	0	692	0	692
Marshall Islands				
Corporate Bonds & Notes	0	71	0	71
Mauritius				
Corporate Bonds & Notes	0	443	0	443
Mexico				
Corporate Bonds & Notes	0	7,183	0	7,183
Sovereign Issues	0	3,179	0	3,179
Mongolia				
Sovereign Issues	0	1,969	0	1,969
Morocco				
Corporate Bonds & Notes	0	1,382	0	1,382
Sovereign Issues	0	2,410	0	2,410
Namibia				
Sovereign Issues	0	907	0	907
Netherlands				
Corporate Bonds & Notes	0	2,806	0	2,806
Sovereign Issues	0	950	0	950
Nigeria				
Corporate Bonds & Notes	0	952	0	952
Sovereign Issues	0	8,448	0	8,448
Oman				
Sovereign Issues	0	6,498	0	6,498
Pakistan				
Sovereign Issues	0	2,753	0	2,753
Panama				
Corporate Bonds & Notes	0	973	0	973

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2022
Investments in Securities, at Value				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 11,463	\$ 0	\$ 11,463
Paraguay				
Sovereign Issues	0	1,364	0	1,364
Peru				
Corporate Bonds & Notes	0	691	0	691
Sovereign Issues	0	1,475	0	1,475
Philippines				
Sovereign Issues	0	3,857	0	3,857
Qatar				
Corporate Bonds & Notes	0	1,750	0	1,750
Sovereign Issues	0	3,627	0	3,627
Romania				
Sovereign Issues	0	4,988	0	4,988
Russia				
Sovereign Issues	0	2,910	0	2,910
Rwanda				
Sovereign Issues	0	308	0	308
Saudi Arabia				
Corporate Bonds & Notes	0	1,686	0	1,686
Sovereign Issues	0	4,614	0	4,614
Senegal				
Sovereign Issues	0	1,873	0	1,873
Serbia				
Sovereign Issues	0	1,530	0	1,530
Singapore				
Corporate Bonds & Notes	0	830	0	830
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	0	4,960	2,360	7,320
Sovereign Issues	0	5,050	0	5,050
Sri Lanka				
Sovereign Issues	0	2,791	0	2,791
Supranational				
Corporate Bonds & Notes	0	765	0	765
Sovereign Issues	0	903	0	903
Tunisia				
Sovereign Issues	0	694	0	694
Turkey				
Sovereign Issues	0	12,172	0	12,172
Ukraine				
Corporate Bonds & Notes	0	234	0	234
Sovereign Issues	0	1,749	0	1,749

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2022
Investments in Securities, at Value				
United Arab Emirates				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 3,248	\$ 0	\$ 3,248
Sovereign Issues	0	131	0	131
United Kingdom				
Corporate Bonds & Notes	0	498	0	498
Sovereign Issues	0	113	0	113
United States				
Corporate Bonds & Notes	0	1,420	0	1,420
U.S. Treasury Obligations	0	7,234	0	7,234
Uruguay				
Sovereign Issues	0	3,757	0	3,757
Uzbekistan				
Sovereign Issues	0	234	0	234
Venezuela				
Corporate Bonds & Notes	0	708	0	708
Sovereign Issues	0	2,077	0	2,077
Zambia				
Sovereign Issues	0	984	0	984
Short-Term Instruments	0	26,328	0	26,328
Total Investments	\$ 0	\$ 286,516	\$ 2,360	\$ 288,876
Short Sales, at value	\$ 0	\$ (165)	\$ 0	\$ (165)
Financial Derivative Instruments - Assets				
Exchange-traded or centrally cleared	0	31	0	31
Over the counter	0	1,402	0	1,402
	\$ 0	\$ 1,433	\$ 0	\$ 1,433
Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Exchange-traded or centrally cleared	0	(278)	0	(278)
Over the counter	0	(1,117)	(2)	(1,119)
	\$ 0	\$ (1,395)	\$ (2)	\$ (1,397)
Totals	\$ 0	\$ 286,398	\$ 2,358	\$ 288,747

There were no significant transfers into or out of Level 3 during the period ended August 31, 2022.

4【管理会社の概況】

(1)【資本金の額】(2023年2月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約255億円)

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2023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	3,384,897,402.35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、2023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＝136.33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)

2022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	7,307,751,556.09	996,265,770
020	手元現金		
030	中央銀行における現金残高	5,003,476,980.83	682,124,017
040	その他の要求払預金	2,304,274,575.26	314,141,753
050	売買目的で保有される金融資産	107,099,072.14	14,600,817
060	デリバティブ	107,099,072.14	14,600,817
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		
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		
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	2,591.61	353
142	持分証券	2,591.61	353
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	2,040,386,764.92	278,165,928
182	債務証券		
183	ローンおよび貸付金	2,040,386,764.92	278,165,928
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	2,494,125.49	340,024
280	有形固定資産	2,494,125.49	340,024
290	投資不動産		
300	無形資産	2,577,775.88	351,428
310	営業権		
320	その他の無形資産	2,577,775.88	351,428
330	税金資産	13,799,588.21	1,881,298
340	現行税金資産	13,799,588.21	1,881,298
350	繰延税金資産		
360	その他の資産	41,012,071.07	5,591,176
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	9,515,123,545.39	1,297,196,793

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)

2022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	58,421,702.88	7,964,631
020	デリバティブ	58,421,702.88	7,964,631
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		
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	8,885,414,337.89	1,211,348,537
120	預金	8,883,247,381.29	1,211,053,115
130	発行済み債務証券		
140	その他の金融負債	2,166,956.60	295,421
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		
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	15,689,662.84	2,138,972
250	現行税金負債	14,990,027.56	2,043,590
260	繰延税金負債	699,635.28	95,381
270	要求払株式資本		
280	その他の負債	36,068,672.82	4,917,242
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	8,995,594,376.44	1,226,369,381

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)

2022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	25,509,792
020	払込資本	187,117,965.90	25,509,792
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		
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		
095	損益に再分類されることがない項目		
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	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		
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	794,885.79	108,367
200	再評価準備金		
210	その他の準備金	302,480,181.34	41,237,123
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	302,480,181.34	41,237,123
240	(-) 自己株式		
250	親会社株主に帰属する損益	29,136,135.93	3,972,129

米ドル

千円

		米ドル	千円
260	(-) 中間配当		
270	少数株主持分〔非支配持分〕		
280	その他の累積包括利益		
290	その他の項目		
300	資本合計	519,529,168.96	70,827,412
310	資本および負債合計	9,515,123,545.40	1,297,196,793

(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

2022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	38,134,683.26	5,198,901
020	売買目的で保有される金融資産	29,158,916.27	3,975,235
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	5,162,052.74	703,743
070	デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク		
080	その他の資産	388,092.13	52,909
085	負債に係る利息収益	3,425,622.12	467,015
090	(支払利息)	19,073,028.47	2,600,226
100	(売買目的で保有される金融負債)	136,344.47	18,588
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)	1,453,880.25	198,207
130	(デリバティブ・ヘッジ会計、金利リスク)		
140	(その他の負債)	43,945.63	5,991
145	(資産に係る支払利息)	17,438,858.12	2,377,440
150	(要求払株式資本に係る費用)		
160	受取配当		
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	69,068,200.25	9,416,068
210	(支払手数料)	25,936,416.67	3,535,912
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		
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	8,728,801.26	1,189,997
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の認識除外に係る利 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	3,652,536.23	497,950

米ドル

千円

350	（その他の事業費用）	1,470,368.69	200,455
355	事業収益合計、純額	73,104,407.17	9,966,324
360	（管理費用）	30,884,563.95	4,210,493
370	（従業員費用）	11,745,977.85	1,601,329
380	（その他の管理費用）	19,138,586.10	2,609,163
385	（破綻処理基金および預金保証制度に拠出する現金）	2,148,302.61	292,878
390	（減価償却）	1,340,688.86	182,776
400	（有形固定資産）	703,348.13	95,887
410	（投資不動産）		
420	（その他の無形資産）	637,340.73	86,889
425	修正利益または（－）損失、純額		
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）		
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）	467,321.09	63,710
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）	467,321.09	63,710
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）		
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	38,263,530.66	5,216,467
620	（継続事業からの損益に関する税金費用または（－）収入）	9,127,394.73	1,244,338
630	継続事業からの税引後利益または（－）損失	29,136,135.93	3,972,129
640	非継続事業からの税引後利益または（－）損失		
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	29,136,135.93	3,972,129
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	29,136,135.93	3,972,129