

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 令和5年4月28日
【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)
【代表者の役職氏名】 エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス
(Fabrice Mas)
【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、アーロン通
り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健
【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 青山 正幸
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
【電話番号】 03(6212)8316
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション
(Emerging Bond Fund Currency Selection)
- 米ドル・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)
【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】
- 米ドル・ポートフォリオ受益証券:100億アメリカ合衆国ドル
(約1兆3,887億円)を上限とする。
- ユーロ・ポートフォリオ受益証券:80億ユーロ(約1兆1,486億
円)を上限とする。
- 豪ドル・ポートフォリオ受益証券:140億オーストラリア・ドル
(約1兆2,991億円)を上限とする。
- 南アフリカランド・ポートフォリオ受益証券:960億南アフリカ
ランド(約7,834億円)を上限とする。

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

米ドル・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２）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11月30日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、１米ドル＝138.87円、１ユーロ＝143.58円、１豪ドル＝92.79円および１南アフリカランド＝8.16円による。
以下同じ。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

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

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

２【訂正の内容】

（１）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

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

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

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション（Emerging Bond Fund Currency Selection）（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドである米ドル・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 |

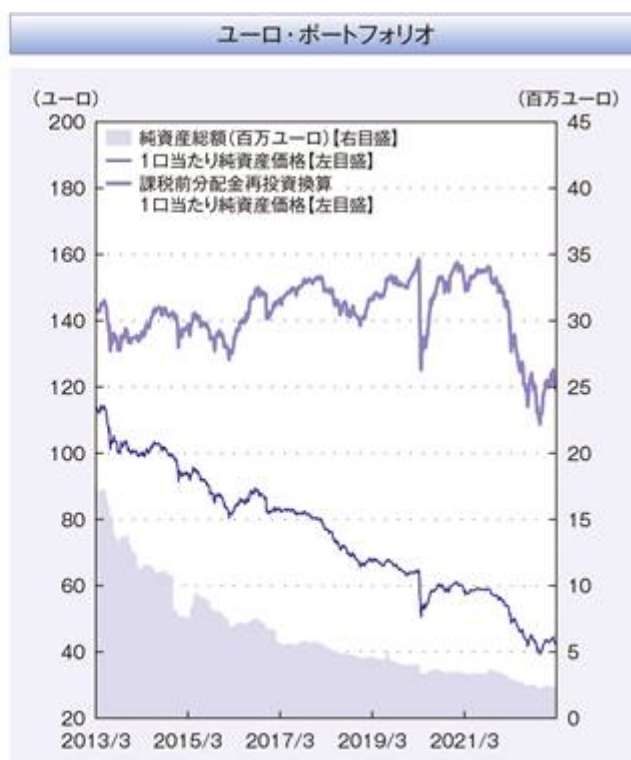
< 豪ドル・ポートフォリオ >

| | 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) |

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

- a．サブ・ファンドの日本文の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第４項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第１条の３第７項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドル、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。

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 米ドル・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 |
| 受取利息 | 605.31 | 56 |
| | 現金および現金等価物 | 605.31 |
| 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) |
| 代行協会員報酬 | (2,167.53) | (199) |
| | 現金および現金等価物 | (2,167.53) |
| 監査報酬 | (17,602.92) | (1,618) |
| | 現金および現金等価物 | (17,602.92) |
| 保管報酬 | (5,418.84) | (498) |
| | 現金および現金等価物 | (5,418.84) |
| 販売報酬 | (21,675.32) | (1,992) |
| | 現金および現金等価物 | (21,675.32) |
| 配当金 | (306,406.26) | (28,159) |
| | 現金および現金等価物 | (306,406.26) |
| 支払利息 | (4.98) | (0) |
| | 現金および現金等価物 | (4.98) |
| 投資顧問報酬 | (25,576.86) | (2,351) |
| | 現金および現金等価物 | (25,576.86) |
| 弁護士報酬 | (3,718.14) | (342) |
| | 現金および現金等価物 | (3,718.14) |
| 管理報酬 | (14,739.25) | (1,355) |
| | 現金および現金等価物 | (14,739.25) |
| 立替費用 | (2,604.65) | (239) |
| | 現金および現金等価物 | (2,604.65) |
| 専門家報酬 | (3,029.29) | (278) |
| | 現金および現金等価物 | (3,029.29) |
| 報告書作成費用 | (1,118.02) | (103) |
| | 現金および現金等価物 | (1,118.02) |
| 副投資運用報酬 | (1,083.76) | (100) |
| | 現金および現金等価物 | (1,083.76) |
| 受託報酬 | (12,036.93) | (1,106) |
| | 現金および現金等価物 | (12,036.93) |
| 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 |
| 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 |
| 長期価格に係る損益 | (372,404.04) | (34,224) |
| | ファンド | (372,404.04) |
| 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) |
| 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 |
| 短期価格に係る損益 | 0.21 | 0 |
| | ファンド | 0.21 |
| 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) |

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション - 米ドル・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% |
| 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（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口当たりの金額を除く） | （受益証券１口当たりの金額を除く） |

| | | |
|--|----------|--------|
| 純資産： | 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% | | |
| | | | Biocanico Sovereign Certificate Ltd. | | |
| | | | 0.000% due 06/05/2034 | \$ 1,217 | 813 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|--------------|
| Interoceanica IV Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 11/30/2025 | \$ 314 | \$ 259 |
| Interoceanica V Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 05/15/2030 | 2,106 | 1,635 |
| Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd. | | |
| 0.000% due 06/02/2025 | 1,718 | 1,623 |
| S.A. Global Sukuk Ltd. | | |
| 1.602% due 06/17/2026 | 700 | 644 |
| 2.694% due 06/17/2031 | 500 | 456 |
| Total Cayman Islands (Cost \$5,494) | | <u>5,430</u> |

| | | |
|---|-------|--------------|
| CHILE 2.9% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 2.1% | | |
| Banco del Estado de Chile | | |
| 2.704% due 01/09/2025 | 500 | 476 |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile | | |
| 3.700% due 01/30/2050 | 200 | 146 |
| 4.250% due 07/17/2042 | 3,200 | 2,593 |
| 4.500% due 08/01/2047 | 500 | 423 |
| 4.875% due 11/04/2044 | 1,600 | 1,406 |
| Empresa de los Ferrocarriles del Estado | | |
| 3.068% due 08/18/2050 | 200 | 123 |
| 3.830% due 09/14/2061 | 400 | 286 |
| Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. | | |
| 4.700% due 05/07/2050 | 600 | 509 |
| Empresa Nacional del Petroleo | | |
| 3.450% due 09/16/2031 | 200 | 168 |
| | | <u>6,130</u> |

| | | |
|-------------------------------------|-------|--------------|
| SOVEREIGN ISSUES 0.8% | | |
| Chile Government International Bond | | |
| 2.750% due 01/31/2027 | 1,500 | 1,392 |
| 3.250% due 09/21/2071 | 500 | 319 |
| 4.340% due 03/07/2042 | 700 | 602 |
| | | <u>2,313</u> |
| Total Chile (Cost \$10,001) | | <u>8,443</u> |

| | | |
|--------------------------------------|-------|--------------|
| CHINA 0.4% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.4% | | |
| Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd. | | |
| 2.100% due 07/28/2026 | 1,400 | 1,283 |
| Total China (Cost \$1,397) | | <u>1,283</u> |

| | | |
|------------------------------|-------|--------------|
| COLOMBIA 2.8% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.8% | | |
| Ecopetrol S.A. | | |
| 4.625% due 11/02/2031 | 500 | 391 |
| 5.875% due 05/28/2045 | 2,500 | 1,730 |
| 7.375% due 09/18/2043 | 100 | 84 |
| | | <u>2,205</u> |

| | | |
|--|--------|--------------|
| SOVEREIGN ISSUES 2.0% | | |
| Colombia Government International Bond | | |
| 2.625% due 03/15/2023 | \$ 500 | \$ 495 |
| 3.875% due 02/15/2061 | 700 | 395 |
| 4.000% due 02/26/2024 | 800 | 785 |
| 4.125% due 02/22/2042 | 200 | 126 |
| 4.125% due 05/15/2051 | 500 | 297 |
| 4.500% due 03/15/2029 | 800 | 701 |
| 5.200% due 05/15/2049 | 800 | 547 |
| 5.625% due 02/26/2044 | 3,300 | 2,414 |
| 7.375% due 09/18/2037 | 200 | 190 |
| | | <u>5,950</u> |
| Total Colombia (Cost \$10,710) | | <u>8,155</u> |

| | | |
|--|-------|--------------|
| COSTA RICA 0.5% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | |
| Costa Rica Government International Bond | | |
| 5.625% due 04/30/2043 | 1,800 | 1,361 |
| Total Costa Rica (Cost \$1,409) | | <u>1,361</u> |

| | | |
|--|-------|--------------|
| DOMINICAN REPUBLIC 3.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 3.3% | | |
| Dominican Republic International Bond | | |
| 4.875% due 09/23/2032 | 500 | 405 |
| 5.300% due 01/21/2041 | 500 | 372 |
| 5.500% due 01/27/2025 | 300 | 300 |
| 5.500% due 02/22/2029 | 700 | 641 |
| 5.875% due 01/30/2060 | 1,000 | 712 |
| 5.950% due 01/25/2027 | 3,500 | 3,431 |
| 6.000% due 07/19/2028 | 1,300 | 1,248 |
| 6.000% due 02/22/2033 | 300 | 263 |
| 6.400% due 06/05/2049 | 600 | 473 |
| 6.875% due 01/29/2026 | 1,700 | 1,744 |
| Total Dominican Republic (Cost \$10,557) | | <u>9,589</u> |

| | | |
|---------------------------------------|-------|--------------|
| ECUADOR 1.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.3% | | |
| Ecuador Government International Bond | | |
| 0.000% due 07/31/2030 | 710 | 245 |
| 1.500% due 07/31/2040 | 3,857 | 1,343 |
| 2.500% due 07/31/2035 | 3,651 | 1,422 |
| 5.500% due 07/31/2030 | 1,720 | 912 |
| Total Ecuador (Cost \$5,174) | | <u>3,922</u> |

| | | |
|-------------------------------------|-----------|--------------|
| EGYPT 2.8% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 2.8% | | |
| Egypt Government International Bond | | |
| 4.750% due 04/11/2025 | EUR 100 | 86 |
| 4.750% due 04/16/2026 | 2,000 | 1,582 |
| 5.625% due 04/16/2030 | 800 | 542 |
| 5.875% due 02/16/2031 | \$ 1,200 | 821 |
| 6.375% due 04/11/2031 | EUR 1,000 | 678 |
| 7.053% due 01/15/2032 | \$ 200 | 141 |
| 7.300% due 09/30/2033 | 700 | 477 |
| 7.500% due 02/16/2061 | 900 | 527 |
| 7.625% due 05/29/2032 | 1,500 | 1,058 |
| 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) | | <u>8,095</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) |
|---|----------------|--------------|---|----------------|--------------|
| EL SALVADOR 0.3% | | | HUNGARY 1.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | | SOVEREIGN ISSUES 1.3% | | |
| El Salvador Government International Bond | | | Hungary Government International Bond | | |
| 7.125% due 01/20/2050 | \$ 1,450 | \$ 486 | 2.125% due 09/22/2031 | \$ 800 | \$ 588 |
| 7.625% due 09/21/2034 | 100 | 32 | 3.125% due 09/21/2051 | 600 | 377 |
| 7.625% due 02/01/2041 | 1,000 | 351 | 5.250% due 06/16/2029 | 1,600 | 1,546 |
| 9.500% due 07/15/2052 | 400 | 150 | 5.500% due 06/16/2034 | 1,400 | 1,310 |
| Total El Salvador (Cost \$3,016) | | 1,019 | Total Hungary (Cost \$4,335) | | 3,821 |
| ETHIOPIA 0.1% | | | INDIA 0.8% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | | CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Ethiopia Government International Bond | | | Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | |
| 6.625% due 12/11/2024 | 600 | 338 | 3.249% due 02/13/2030 | 500 | 440 |
| Total Ethiopia (Cost \$600) | | 338 | 3.950% due 02/13/2050 | 300 | 234 |
| GEORGIA 0.1% | | | | | 674 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | | SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | |
| Georgia Government International Bond | | | Export-Import Bank of India | | |
| 2.750% due 04/22/2026 | 200 | 174 | 3.250% due 01/15/2030 | 1,800 | 1,610 |
| Total Georgia (Cost \$176) | | 174 | Total India (Cost \$2,580) | | 2,284 |
| GHANA 1.1% | | | INDONESIA 4.9% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 1.1% | | | CORPORATE BONDS & NOTES 4.3% | | |
| Republic of Ghana International Bond | | | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | | |
| 0.000% due 04/07/2025 (g) | 300 | 144 | 3.950% due 03/28/2024 | 2,200 | 2,187 |
| 7.625% due 05/16/2029 | 300 | 115 | Indonesia Asahan Aluminium Persero PT | | |
| 7.750% due 04/07/2029 | 1,000 | 383 | 5.450% due 05/15/2030 | 800 | 786 |
| 8.125% due 03/26/2032 | 1,000 | 383 | Pelabuhan Indonesia Persero PT | | |
| 8.625% due 04/07/2034 | 1,400 | 507 | 4.875% due 10/01/2024 | 3,100 | 3,124 |
| 8.750% due 03/11/2061 | 1,700 | 599 | Pertamina Persero PT | | |
| 8.875% due 05/07/2042 | 1,200 | 428 | 6.450% due 05/30/2044 | 1,700 | 1,784 |
| 8.950% due 03/26/2051 | 2,000 | 716 | 6.500% due 11/07/2048 | 1,700 | 1,769 |
| Total Ghana (Cost \$8,279) | | 3,275 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara | | |
| GUATEMALA 0.8% | | | 5.250% due 10/24/2042 | 2,800 | 2,475 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.8% | | | 5.250% due 05/15/2047 | 200 | 173 |
| Guatemala Government Bond | | | 6.150% due 05/21/2048 | 400 | 382 |
| 4.650% due 10/07/2041 | 500 | 398 | | | 12,680 |
| 4.875% due 02/13/2028 | 800 | 779 | SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | |
| 4.900% due 06/01/2030 | 600 | 573 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III | | |
| 6.125% due 06/01/2050 | 700 | 642 | 4.700% due 06/06/2032 | 1,600 | 1,649 |
| Total Guatemala (Cost \$2,751) | | 2,392 | Total Indonesia (Cost \$14,528) | | 14,329 |
| HONG KONG 1.1% | | | IRELAND 0.1% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.6% | | | SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Huarong Finance 2017 Co. Ltd. | | | Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC | | |
| 4.950% due 11/07/2047 | 400 | 266 | 6.927% due 02/19/2027 | 193 | 175 |
| Huarong Finance 2019 Co. Ltd. | | | Total Ireland (Cost \$182) | | 175 |
| 3.875% due 11/13/2029 | 200 | 148 | ISRAEL 0.4% | | |
| 4.105% due 02/24/2023 | 1,300 | 1,266 | CORPORATE BONDS & NOTES 0.4% | | |
| | | 1,680 | Israel Electric Corp. Ltd. | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | | 3.750% due 02/22/2032 | 1,000 | 928 |
| Airport Authority (b) | | | 5.000% due 11/12/2024 | 300 | 303 |
| 2.100% due 03/08/2026 | 700 | 649 | Total Israel (Cost \$1,311) | | 1,231 |
| 2.400% due 03/08/2028 | 1,000 | 886 | | | |
| | | 1,535 | | | |
| Total Hong Kong (Cost \$3,536) | | 3,215 | | | |

| | 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% | | | | | |
| Russia Government International Bond | | | | SOVEREIGN ISSUES 1.7% | |
| 4.375% due 03/21/2029 | 2,000 | 970 | | South Africa Government International Bond | |
| 5.100% due 03/28/2035 | 4,000 | 1,940 | | 4.850% due 09/30/2029 | 700 622 |
| Total Russia (Cost \$6,156) | | 2,910 | | 5.375% due 07/24/2044 | 1,000 720 |
| | | | | 5.750% due 09/30/2049 | 1,200 860 |
| RWANDA 0.1% | | | | 5.875% due 04/20/2032 | 400 357 |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | | | 6.300% due 06/22/2048 (g) | 2,000 1,561 |
| Rwanda International Government Bond | | | | 7.300% due 04/20/2052 | 300 250 |
| 5.500% due 08/09/2031 | 400 | 308 | | 10.500% due 12/21/2026 | ZAR 11,000 680 |
| Total Rwanda (Cost \$400) | | 308 | | | 5,050 |
| | | | | Total South Africa (Cost \$14,705) | 12,370 |
| | | | | | |
| SAUDI ARABIA 2.2% | | | | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.6% | | | | SRI LANKA 1.0% | |
| Saudi Arabian Oil Co. | | | | SOVEREIGN ISSUES 1.0% | |
| 2.250% due 11/24/2030 | 500 | 436 | | Sri Lanka Government International Bond (a) | |
| 3.500% due 11/24/2070 | 1,200 | 872 | | 5.750% due 04/18/2023 | \$ 1,000 346 |
| 4.250% due 04/16/2039 | 400 | 378 | | 5.875% due 07/25/2049 | 200 73 |
| | | 1,686 | | 6.125% due 06/03/2025 | 1,300 472 |
| | | | | 6.200% due 05/11/2027 | 2,700 923 |
| SOVEREIGN ISSUES 1.6% | | | | 6.850% due 11/03/2025 | 1,100 394 |
| Saudi Government International Bond | | | | 7.550% due 03/28/2030 | 1,700 583 |
| 2.250% due 02/02/2033 | 500 | 430 | | Total Sri Lanka (Cost \$6,720) | 2,791 |
| 3.450% due 02/02/2061 | 800 | 615 | | | |
| 3.750% due 01/21/2055 | 1,000 | 834 | | SUPRANATIONAL 0.6% | |
| 4.375% due 04/16/2029 | 1,100 | 1,143 | | CORPORATE BONDS & NOTES 0.3% | |
| 4.500% due 10/26/2046 | 1,700 | 1,592 | | Eastern & Southern African Trade & Development Bank | |
| | | 4,614 | | 4.125% due 06/30/2028 | 900 765 |
| Total Saudi Arabia (Cost \$7,494) | | 6,300 | | | |
| | | | | SOVEREIGN ISSUES 0.3% | |
| SENEGAL 0.6% | | | | African Export - Import Bank | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | | | 2.634% due 05/17/2026 | 1,000 903 |
| Senegal Government International Bond | | | | Total Supranational (Cost \$1,901) | 1,668 |
| 4.750% due 03/13/2028 | EUR | 1,600 | 1,359 | | |
| 5.375% due 06/08/2037 | | 100 | 69 | TUNISIA 0.2% | |
| 6.250% due 05/23/2033 | \$ | 200 | 163 | SOVEREIGN ISSUES 0.2% | |
| 6.750% due 03/13/2048 | | 400 | 282 | Tunisian Republic | |
| Total Senegal (Cost \$2,708) | | 1,873 | | 3.280% due 08/09/2027 | / 200,000 694 |
| | | | | Total Tunisia (Cost \$1,935) | 694 |
| | | | | | |
| SERBIA 0.5% | | | | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.5% | | | | TURKEY 4.2% | |
| Serbia Government International Bond | | | | SOVEREIGN ISSUES 4.2% | |
| 1.000% due 09/23/2028 | EUR | 1,100 | 804 | Turkey Government International Bond | |
| 1.500% due 06/26/2029 | | 200 | 145 | 5.125% due 02/17/2028 | \$ 500 395 |
| 2.050% due 09/23/2036 | | 400 | 232 | 5.750% due 05/11/2047 | 7,500 4,570 |
| 3.125% due 05/15/2027 | | 400 | 349 | 5.875% due 06/26/2031 | 300 222 |
| Total Serbia (Cost \$1,760) | | 1,530 | | 6.125% due 10/24/2028 | 1,900 1,547 |
| | | | | 6.375% due 10/14/2025 | 200 182 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|--------------|--|----------------|--------------|
| Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S | | | U.S. TREASURY OBLIGATIONS 2.5% | | |
| 5.375% due 10/24/2023 (g) | \$ 2,600 | \$ 2,502 | U.S. Treasury Bonds | | |
| 8.250% due 01/24/2024 | 2,800 | 2,754 | 1.750% due 08/15/2041 | \$ 500 | \$ 372 |
| Total Turkey (Cost \$15,325) | | 12,172 | 2.375% due 02/15/2042 | 1,100 | 912 |
| | | | 3.250% due 05/15/2042 | 5,300 | 5,071 |
| UKRAINE 0.7% | | | 3.375% due 08/15/2042 | 900 | 879 |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.1% | | | | | 7,234 |
| NPC Ukrenergo | | | Total United States (Cost \$8,958) | | 8,654 |
| 6.875% due 11/09/2028 | 1,200 | 234 | | | |
| | | | URUGUAY 1.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.6% | | | SOVEREIGN ISSUES 1.3% | | |
| Ukraine Government International Bond | | | Uruguay Government International Bond | | |
| 6.876% due 05/21/2031 | 600 | 119 | 4.975% due 04/20/2055 | 100 | 101 |
| 7.253% due 03/15/2035 | 900 | 164 | 7.625% due 03/21/2036 | 1,490 | 1,927 |
| 7.375% due 09/25/2034 | 1,500 | 277 | 7.875% due 01/15/2033 | 1,340 | 1,729 |
| 7.750% due 09/01/2025 | 1,900 | 475 | Total Uruguay (Cost \$3,555) | | 3,757 |
| 7.750% due 09/01/2026 | 700 | 147 | | | |
| 7.750% due 09/01/2027 | 1,000 | 208 | UZBEKISTAN 0.1% | | |
| 7.750% due 09/01/2029 | 1,400 | 294 | SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| 8.994% due 02/01/2026 | 300 | 65 | Republic of Uzbekistan International Bond | | |
| | | 1,749 | 3.700% due 11/25/2030 | 300 | 234 |
| Total Ukraine (Cost \$8,864) | | 1,983 | Total Uzbekistan (Cost \$259) | | 234 |
| | | | | | |
| UNITED ARAB EMIRATES 1.2% | | | VENEZUELA 1.0% | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 1.1% | | | CORPORATE BONDS & NOTES 0.3% | | |
| Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC | | | Petroleos de Venezuela S.A. | | |
| 3.650% due 11/02/2029 | 1,600 | 1,582 | 5.500% due 04/12/2037 (a) | 20,990 | 708 |
| | | | | | |
| Abu Dhabi Ports Co. PJSC | | | SOVEREIGN ISSUES 0.7% | | |
| 2.500% due 05/06/2031 | 900 | 787 | Venezuela Government International Bond (a) | | |
| | | | 7.000% due 03/31/2038 | 10,900 | 954 |
| DP World Ltd. | | | 7.650% due 04/21/2025 | 8,215 | 698 |
| 5.625% due 09/25/2048 | 700 | 693 | 9.250% due 09/15/2027 | 4,520 | 396 |
| | | | 11.950% due 08/05/2031 | 340 | 29 |
| MDGH GMTN RSC Ltd. | | | | | 2,077 |
| 3.950% due 05/21/2050 | 200 | 186 | Total Venezuela (Cost \$29,413) | | 2,785 |
| | | 3,248 | | | |
| | | | ZAMBIA 0.3% | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | | SOVEREIGN ISSUES 0.3% | | |
| Finance Department Government of Sharjah | | | Zambia Government International Bond (a) | | |
| 4.375% due 03/10/2051 | 200 | 131 | 5.375% due 09/20/2022 | 1,200 | 680 |
| Total United Arab Emirates (Cost \$3,653) | | 3,379 | 8.970% due 07/30/2027 | 500 | 304 |
| | | | Total Zambia (Cost \$1,579) | | 984 |
| UNITED KINGDOM 0.2% | | | | | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | | SHORT-TERM INSTRUMENTS 9.0% | | |
| State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC | | | REPURCHASE AGREEMENTS (f) 4.8% | | 14,000 |
| 9.375% due 03/10/2023 | 293 | 176 | | | |
| | | | | | |
| Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC | | | TIME DEPOSITS 0.5% | | |
| 8.250% due 07/09/2024 | 1,500 | 322 | Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | | |
| | | 498 | 1.830% due 09/01/2022 | 6 | 6 |
| | | | | | |
| SOVEREIGN ISSUES 0.0% | | | Bank of Nova Scotia | | |
| Ukreximbank Via Biz Finance PLC | | | 1.630% due 09/01/2022 | CAD 3 | 3 |
| 9.750% due 01/22/2025 | 250 | 113 | 1.830% due 09/01/2022 | \$ 7 | 7 |
| Total United Kingdom (Cost \$2,053) | | 611 | | | |
| | | | BNP Paribas Bank | | |
| UNITED STATES 3.0% | | | (0.350%) due 09/01/2022 | / 116 | 1 |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.5% | | | 1.630% due 09/01/2022 | CAD 4 | 3 |
| DAE Funding LLC | | | 1.830% due 09/01/2022 | \$ 2 | 2 |
| 2.625% due 03/20/2025 | 400 | 376 | | | |
| 3.375% due 03/20/2028 | 200 | 179 | Brown Brothers Harriman & Co. | | |
| | | | (0.350%) due 09/01/2022 | / 81 | 1 |
| Rutas 2 & 7 Finance Ltd. | | | 3.750% due 09/01/2022 | ZAR 1 | 0 |
| 0.000% due 09/30/2036 | 1,353 | 865 | | | |
| | | 1,420 | | | |

| | 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 | 1,236 |
| | | | | | <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 | 1,245 |
| 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 | | 合計 | 時価 | 未払変動証拠金 | | 合計 |
| | 買建 オプション | 先物 | スワップ 契約 | | 売建 オプション | 先物 | スワップ 契約 | |
| 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 | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 31</u> | <u>\$ 31</u> | |
| Over the counter | | | | | | | |
| Forward Foreign Currency Contracts | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 735 | \$ 0 | \$ 735 | |
| Swap Agreements | 0 | 667 | 0 | 0 | 0 | 667 | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 667</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 735</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 1,402</u> | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 667</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 735</u> | <u>\$ 31</u> | <u>\$ 1,433</u> | |
| Financial Derivative Instruments - Liabilities | | | | | | | |
| Exchange-traded or centrally cleared | | | | | | | |
| Futures | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (84) | \$ (84) | |
| Swap Agreements | 0 | 0 | 0 | 0 | (194) | (194) | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (278)</u> | <u>\$ (278)</u> | |
| Over the counter | | | | | | | |
| Forward Foreign Currency Contracts | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (456) | \$ 0 | \$ (456) | |
| Swap Agreements | 0 | (663) | 0 | 0 | 0 | (663) | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (663)</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (456)</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (1,119)</u> | |
| | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (663)</u> | <u>\$ 0</u> | <u>\$ (456)</u> | <u>\$ (278)</u> | <u>\$ (1,397)</u> | |

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.

[次へ](#)

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。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第１ ファンドの状況

１ ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

(前略)

() 資本金の額 (2022年11月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル (約260億円)

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

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(注) 米ドルの円貨換算は、2022年11月30日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、

1 米ドル = 138.87円による。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

() 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 (一株37.04米ドルの記名式額面株式)

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

(注) 米ドルの円貨換算は、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円による。

(後略)

2 投資方針

(3) 運用体制

<訂正前>

(イ) サブ・ファンドの運用体制

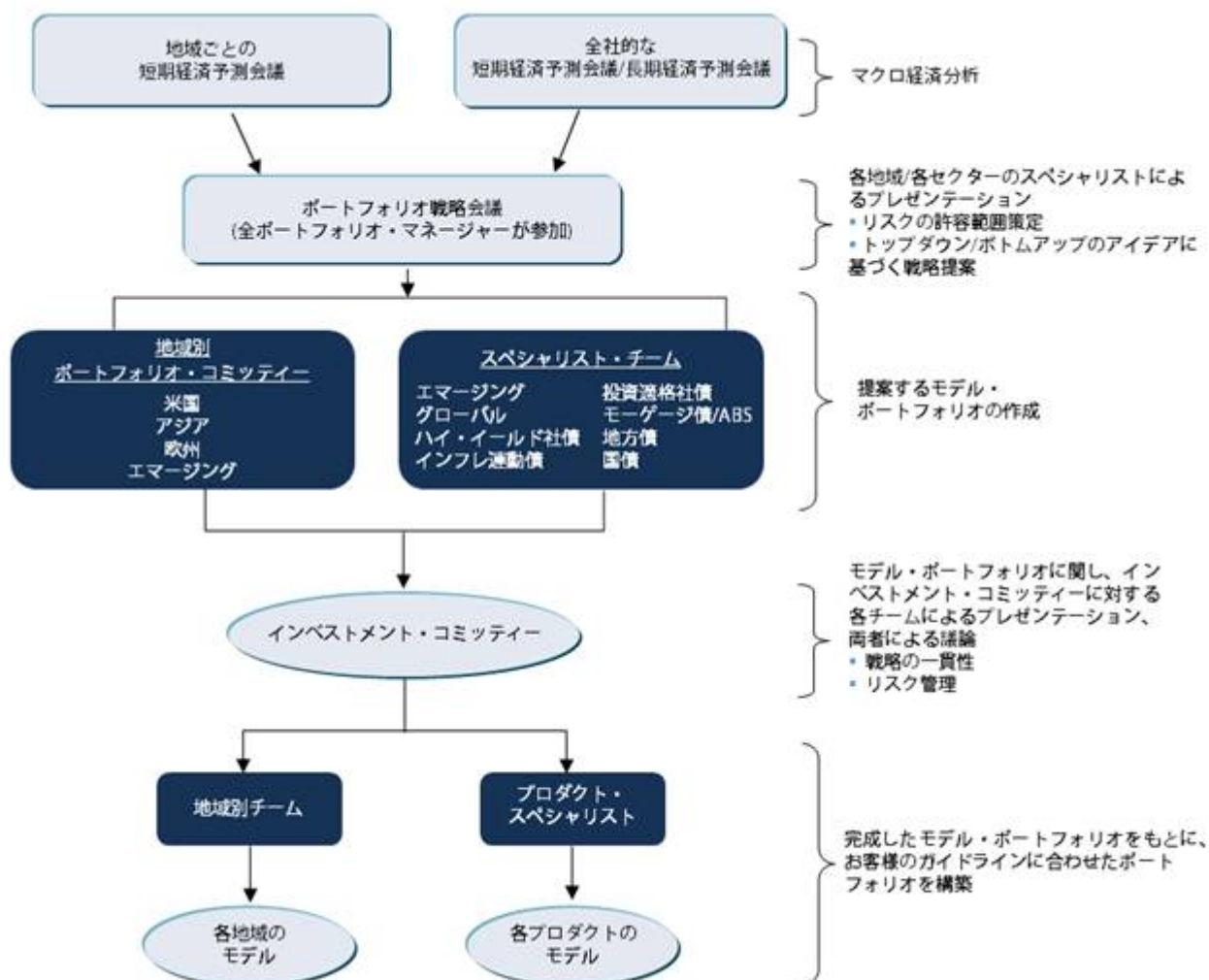
副投資運用会社の運用体制

(中略)

上記運用体制は、2022年12月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

(ロ) 投資先ファンドの運用体制

運用プロセス



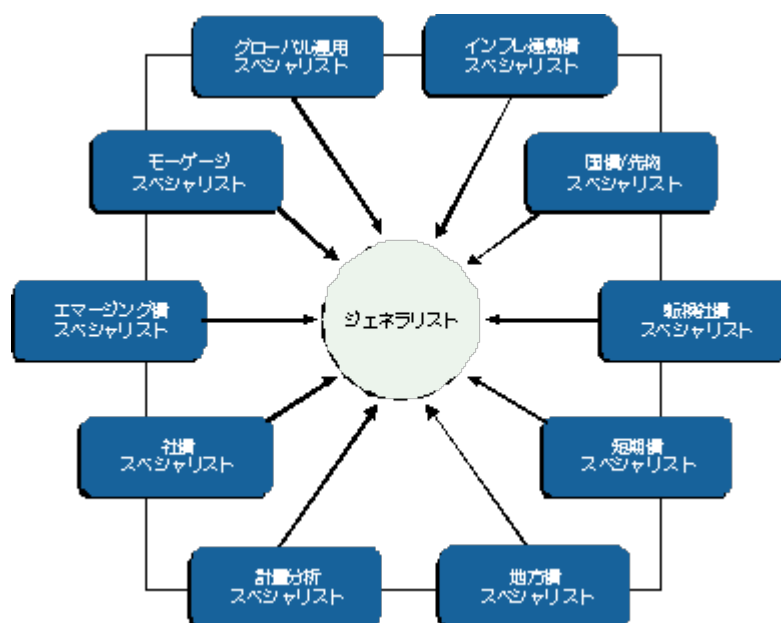
(2022年12月末日現在)

(中略)

運用体制

ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制

トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



(2022年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

（イ）サブ・ファンドの運用体制

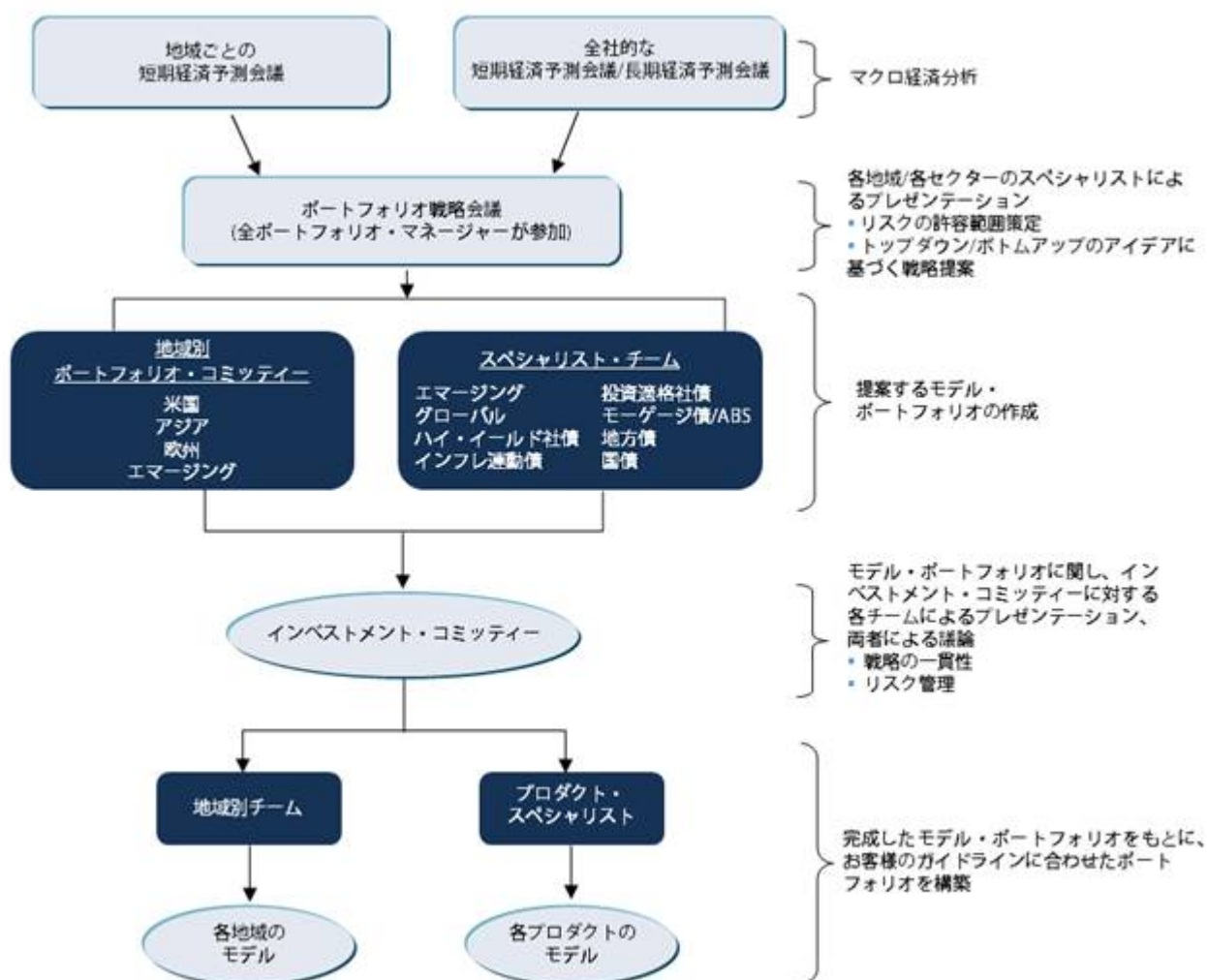
副投資運用会社の運用体制

（中略）

上記運用体制は、2023年2月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

（ロ）投資先ファンドの運用体制

運用プロセス



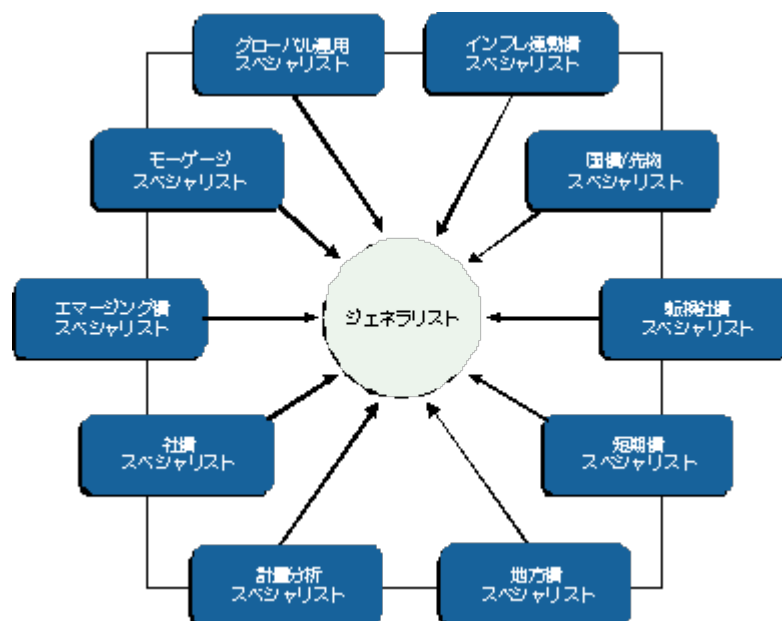
（2023年2月末日現在）

（中略）

運用体制

ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制

トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



（2023年2月末日現在）

（後略）

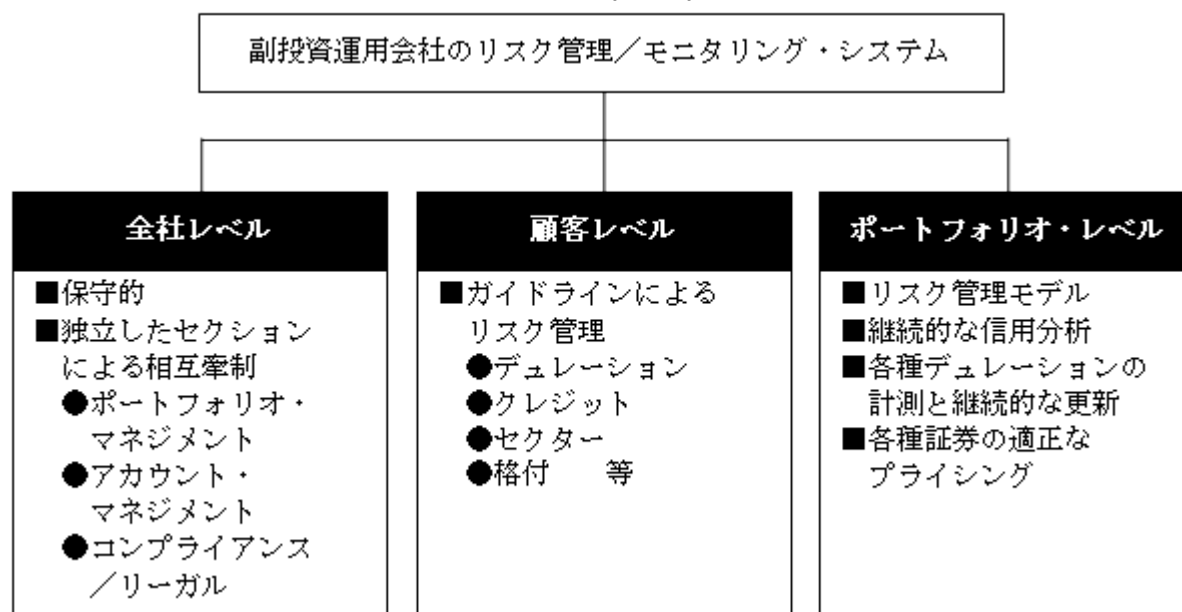
3 投資リスク

（2）リスクに対する管理体制

<訂正前>

（イ）サブ・ファンドのリスク管理体制

（中略）



（2022年12月末日現在）

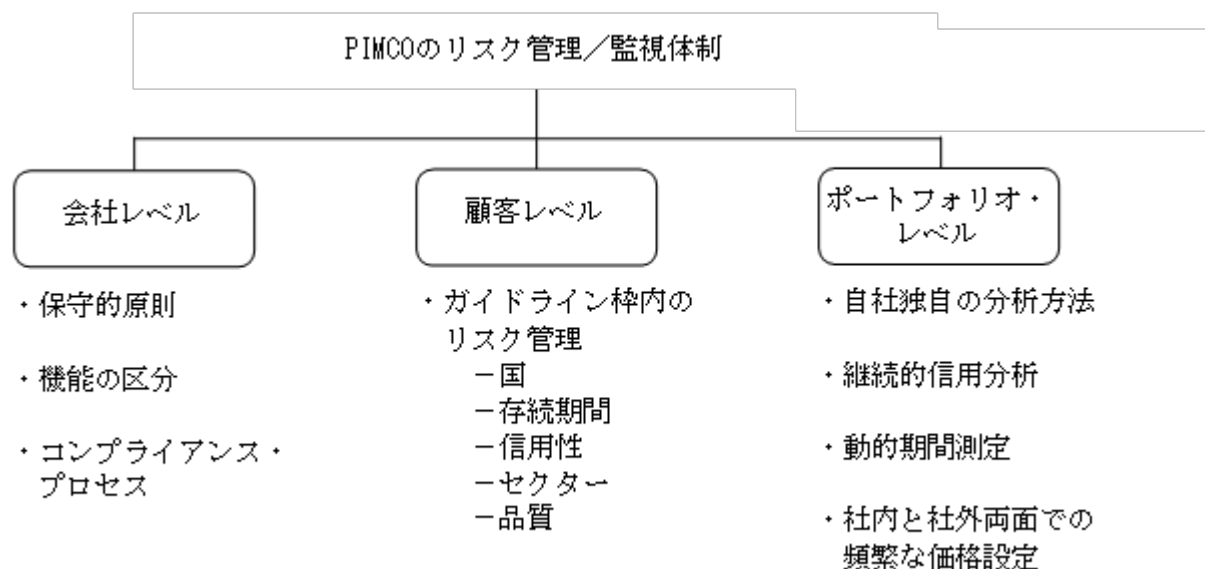
（中略）

（ロ）投資先ファンドのリスク管理体制

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

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

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



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

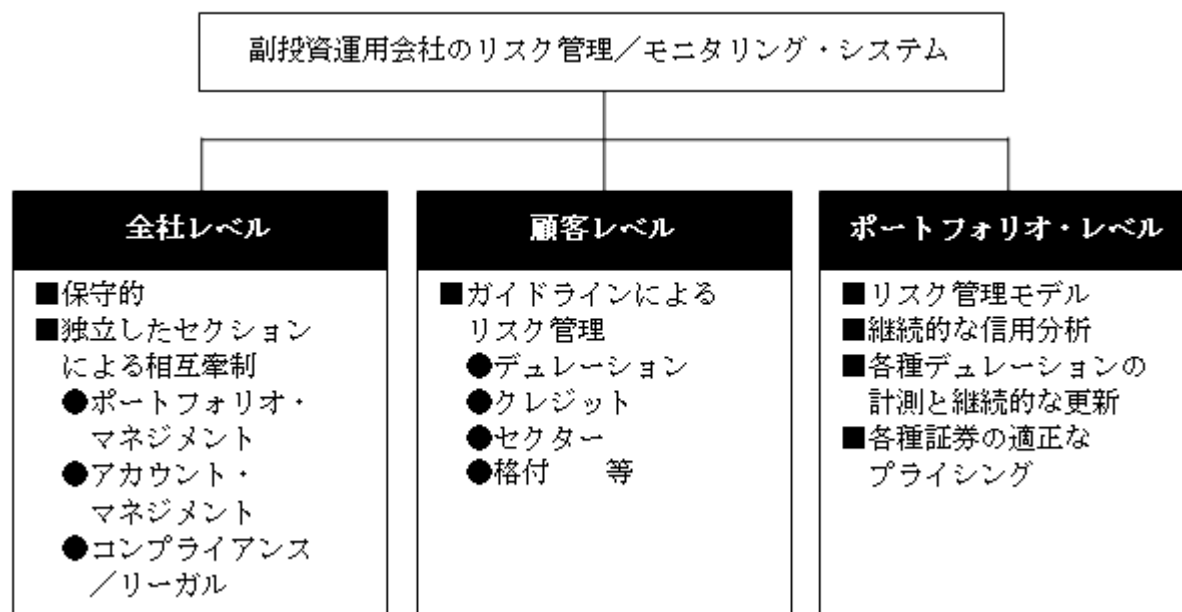
(2022年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

(イ) サブ・ファンドのリスク管理体制

(中略)



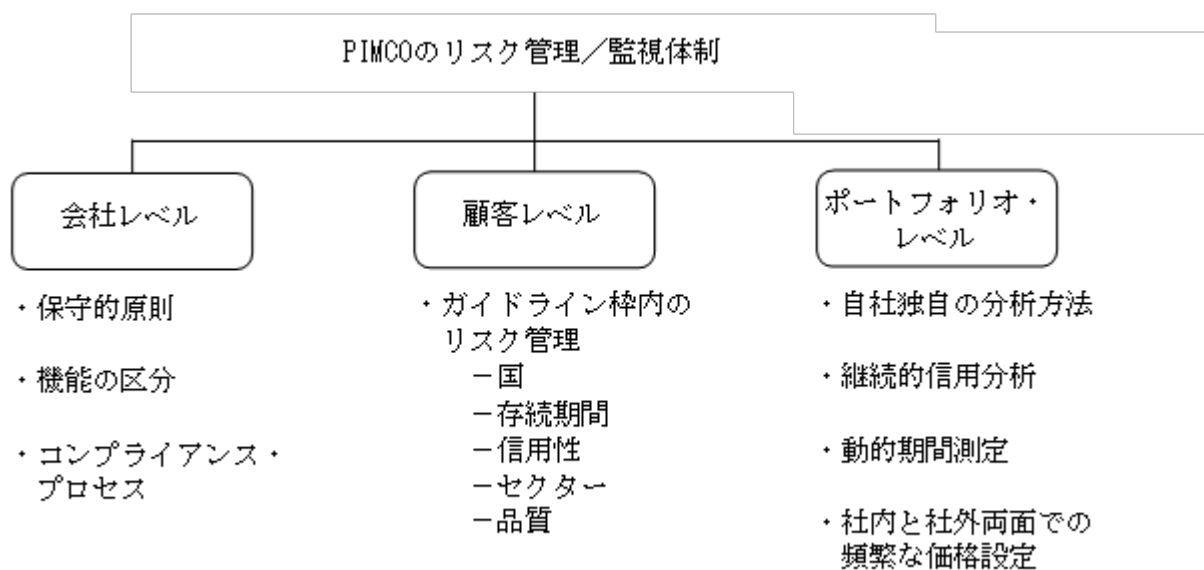
(2023年2月末日現在)

(中略)

(ロ) 投資先ファンドのリスク管理体制

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

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



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

(2023年2月末日現在)

(後略)

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

（Ａ）日本

2022年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（Ａ）日本

2023年 3 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

５ 運用状況

（２）投資資産

<訂正前>

投資有価証券の主要銘柄（2022年11月末日現在）

<米ドル・ポートフォリオ>

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（米ドル） | | 時価（米ドル） | | 投資比率（％） |
|----|--|------------|------|--------------|-----------|---------------|---------|---------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドＡ クラ スＦ（米ドル） | ケイマン 諸島 | 投資信託 | 1,982,176.55 | 11.44 | 22,679,337.46 | 9.11 | 18,057,628.37 | 99.74 |

<ユーロ・ポートフォリオ>

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（ユーロ） | | 時価（ユーロ） | | 投資比率（％） |
|----|--|------------|------|------------|-----------|--------------|---------|--------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドＡ クラ スＦ（ユーロ） | ケイマン 諸島 | 投資信託 | 287,436.88 | 11.34 | 3,259,179.83 | 8.58 | 2,466,208.43 | 100.74 |

<豪ドル・ポートフォリオ>

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（豪ドル） | | 時価（豪ドル） | | 投資比率（％） |
|----|--|------------|------|--------------|-----------|---------------|---------|--------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドＢ クラ スＦ（豪ドル） | ケイマン 諸島 | 投資信託 | 1,015,916.78 | 10.78 | 10,955,393.13 | 8.41 | 8,543,860.11 | 100.14 |

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格 （南アフリカランド） | | 時価 （南アフリカランド） | | 投資比率（％） |
|----|---|------------|------|--------------|--------------------|----------------|------------------|----------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | ピムコ ケイマン エマージング グ ボンド ファンドＢ クラ スＦ（南アフリカランド） | ケイマン 諸島 | 投資信託 | 1,859,557.01 | 109.74 | 204,059,713.46 | 88.04 | 163,715,399.16 | 99.90 |

< 参考情報 >

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

| 順位 | 組入上位銘柄 | クーポン | 償還日 | 組入比率 |
|----|--|---------|------------|------|
| 1 | PANAMA (REP OF) | 8.1250% | 2034/04/28 | 1.9% |
| 2 | REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC | 5.7500% | 2047/05/11 | 1.8% |
| 3 | U S TREASURY BOND | 3.2500% | 2042/05/15 | 1.7% |
| 4 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 4.7500% | 2050/01/14 | 1.7% |
| 5 | PANAMA (REP OF) GLBL UNSECURED | 9.3750% | 2023/01/16 | 1.6% |
| 6 | U S TREASURY NOTE | 3.1250% | 2029/08/31 | 1.6% |
| 7 | OMAN GOV INTERNTL BOND SR UNSEC REGS | 6.0000% | 2029/08/01 | 1.5% |
| 8 | DOMINICAN REPUBLIC REGS | 5.9500% | 2027/01/25 | 1.2% |
| 9 | STATE OIL CO OF THE AZER SR UNSEC REGS | 4.7500% | 2023/03/13 | 1.2% |
| 10 | MEXICO GOVT (UMS) GLBL SR NT | 5.7500% | 2110/10/12 | 1.1% |

● 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。

● 現金同等資産（米国短期国債等）を除いて表示しています。

投資不動産物件（2022年11月末日現在）

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの（2022年11月末日現在）

該当事項なし。

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄（2023年2月末日現在）

< 米ドル・ポートフォリオ >

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（米ドル） | | 時価（米ドル） | | 投資比率（％） |
|----|-------------------------------------|--------|------|--------------|-----------|---------------|---------|---------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | 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） | ケイマン諸島 | 投資信託 | 1,954,042.82 | 11.36 | 22,207,123.68 | 9.03 | 17,645,006.67 | 99.48 |

< ユーロ・ポートフォリオ >

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（ユーロ） | | 時価（ユーロ） | | 投資比率（％） |
|----|-------------------------------------|--------|------|------------|-----------|--------------|---------|--------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | 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（ユーロ） | ケイマン諸島 | 投資信託 | 275,576.75 | 11.30 | 3,112,823.17 | 8.48 | 2,336,890.84 | 99.95 |

< 豪ドル・ポートフォリオ >

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格（豪ドル） | | 時価（豪ドル） | | 投資比率（％） |
|----|-------------------------------------|--------|------|------------|-----------|---------------|---------|--------------|---------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | 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（豪ドル） | ケイマン諸島 | 投資信託 | 953,925.96 | 10.74 | 10,245,525.30 | 8.31 | 7,927,124.73 | 99.62 |

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

| 順位 | 銘柄 | 地域 | 種類 | 口数（口） | 取得価格 （南アフリカランド） | | 時価 （南アフリカランド） | | 投資 比率 （％） |
|----|--|------------|------|--------------|--------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | 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） | ケイマン 諸島 | 投資信託 | 1,806,923.82 | 109.12 | 197,171,871.28 | 87.21 | 157,581,826.35 | 99.57 |

< 参考情報 >

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

| 順位 | 組入上位銘柄 | クーポン | 償還日 | 組入比率 |
|----|--|---------|------------|------|
| 1 | PANAMA (REP OF) | 8.1250% | 2034/04/28 | 1.8% |
| 2 | U S TREASURY BOND | 3.2500% | 2042/05/15 | 1.7% |
| 3 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 4.7500% | 2050/01/14 | 1.6% |
| 4 | REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC | 5.7500% | 2047/05/11 | 1.6% |
| 5 | U S TREASURY NOTE | 3.1250% | 2029/08/31 | 1.6% |
| 6 | OMAN GOV INTERNTL BOND SR UNSEC REGS | 6.0000% | 2029/08/01 | 1.4% |
| 7 | DOMINICAN REPUBLIC REGS | 5.9500% | 2027/01/25 | 1.2% |
| 8 | STATE OIL CO OF THE AZER SR UNSEC REGS | 4.7500% | 2023/03/13 | 1.2% |
| 9 | PELABUHAN INDONESIA III SR UNSEC REGS | 4.8750% | 2024/10/01 | 1.1% |
| 10 | MEXICO GOVT (UMS) GLBL SR NT | 5.7500% | 2110/10/12 | 1.1% |

● 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。

● 現金同等資産（米国短期国債等）を除いて表示しています。

投資不動産物件（2023年2月末日現在）

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの（2023年2月末日現在）

該当事項なし。