

## 【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】 2024年2月29日

【発行者名】 ピムコ・グローバル・アドバイザーズ（ルクセンブルグ）エス・エイ  
（PIMCO Global Advisors（Luxembourg）S.A.）

【代表者の役職氏名】 取締役および署名権限者 イェンス・ハートマン  
（Jens Hartmann, Director and authorized signatory）

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、L-1536 ルクセンブルグ、フォセ通り2  
（2 rue du Fossé, L-1536 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 大 西 信 治

【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】  
ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト  
（PIMCO LUXEMBOURG TRUST IV）

【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】

ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト -

ピムコ・トータル・リターン・ファンド

米ドル建クラス受益証券：

60億米ドル（約8,510億円）を上限とします。

円建クラス受益証券：

5,000億円を上限とします。

ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト -

ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・

セレクション

豪ドル建クラス受益証券：

60億豪ドル（約5,816億円）を上限とします。

米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券：

60億米ドル（約8,510億円）を上限とします。

豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券：

60億豪ドル（約5,816億円）を上限とします。

トルコリラ建クラス受益証券：

100億トルコリラ（約482億円）を上限とします。

（注）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」といいます。）、オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」といいます。）およびトルコリラの円貨換算は、別段の記載がない限り、2023年12月29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（１米ドル＝141.83円、１豪ドル＝96.94円および１トルコリラ＝4.82円）によります。

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年11月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況」の「1 ファンドの性格」および「5 運用状況」、「第二部 ファンド情報、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」および「2 事業の内容及び営業の概況」を新たな情報により訂正および追加するため、また「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況」の「2 投資方針」、「3 投資リスク」および「4 手数料等及び税金」に記載の一定の事項を直近の情報により更新するため、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）半期報告書の提出に伴う訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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 ファンド情報<br>第1 ファンドの状況<br>1 ファンドの性格 | (3) ファンドの<br>仕組み<br>管理会社の<br>概況<br><br>( ) 資本金の額 | 4 管理会社の<br>概況   | (1) 資本金の額            | 更新      |
| 第1 ファンドの状況<br>5 運用状況                  | (1) 投資状況                                         | 1 ファンドの<br>運用状況 | (1) 投資状況             | 更新      |
|                                       | (3) 運用実績                                         |                 | (2) 運用実績             | 更新 / 追加 |
|                                       | (4) 販売及び<br>買戻しの実績                               | 2 販売及び買戻しの実績    |                      | 追加      |
| 第3 ファンドの経理状況<br>1 財務諸表                |                                                  | 3 ファンドの経理状況     |                      | 追加      |
| 第三部 特別情報<br>第1 管理会社の概況<br>1 管理会社の概況   | (1) 資本金の額                                        | 4 管理会社の<br>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<br>び営業の状況 | 更新      |

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

ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト（以下「トラスト」といいます。）のサブ・ファンドであるピムコ・トータル・リターン・ファンド（以下「ピムコ・トータル・リターン・ファンド」といいます。）およびピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション（以下「ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション」といい、ピムコ・トータル・リターン・ファンドとあわせて以下、個別にまたは総称して「ファンド」といいます。）の運用状況は、次の通りです。

### （１）投資状況

#### 資産別および地域別の投資状況

#### （ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド

（2023年11月末日現在）

| 資産の種類               | 国・地域名   | 時価合計<br>(米ドル)                  | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|---------|--------------------------------|-------------|
| 投資信託                | ルクセンブルグ | 203,358,158.49                 | 99.95       |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 101,034.71                     | 0.05        |
| 合計（純資産総額）           |         | 203,459,193.20<br>(約28,857百万円) | 100.00      |

（注１）投資比率とは、各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います。以下、別段の記載がない限り同じです。

（注２）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」といいます。）、オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」といいます。）およびトルコリラの円貨換算は、便宜上、2023年12月29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（１米ドル＝141.83円、１豪ドル＝96.94円および１トルコリラ＝4.82円）によります。以下、同じです。

（注３）トラストは、ルクセンブルグ大公国の法律に基づいて設立されていますが、ファンド証券は、米ドル建て、日本円建て、豪ドル建てまたはトルコリラ建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル、日本円、豪ドルまたはトルコリラをもって行います。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、適宜の単位に四捨五入している場合があります。従って、合計の数字が一致しない場合があります。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ります。従って、本書の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ります。

#### （ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

（2023年11月末日現在）

| 資産の種類               | 国・地域名   | 時価合計<br>(米ドル)                 | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|---------|-------------------------------|-------------|
| 投資信託                | ルクセンブルグ | 72,032,245.50                 | 87.84       |
| 短期金融商品              | 米国      | 8,522,908.56                  | 10.39       |
| 小計                  |         | 80,555,154.06                 | 98.24       |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 1,446,536.90                  | 1.76        |
| 合計（純資産総額）           |         | 82,001,690.96<br>(約11,630百万円) | 100.00      |

## &lt; 参考情報 &gt;

対象ファンド（ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド）の投資状況

（2023年11月末日現在）

| 資産の種類          | 国・地域名   | 時価合計<br>(米ドル)  | 投資比率<br>(%) |
|----------------|---------|----------------|-------------|
| 米国政府機関証券       | 米国      | 176,047,878.30 | 53.00       |
| 社債             | 米国      | 84,330,881.14  | 25.39       |
|                | 英国      | 13,983,423.40  | 4.21        |
|                | フランス    | 9,339,994.15   | 2.81        |
|                | オランダ    | 8,716,468.81   | 2.62        |
|                | 日本      | 8,154,891.74   | 2.46        |
|                | カナダ     | 4,529,043.45   | 1.36        |
|                | イタリア    | 4,202,151.49   | 1.27        |
|                | 国際機関    | 3,407,091.74   | 1.03        |
|                | スイス     | 3,002,643.54   | 0.90        |
|                | ドイツ     | 2,809,379.97   | 0.85        |
|                | ルクセンブルグ | 2,710,618.34   | 0.82        |
|                | スウェーデン  | 2,516,361.48   | 0.76        |
|                | アイルランド  | 2,417,055.87   | 0.73        |
|                | デンマーク   | 2,128,722.34   | 0.64        |
|                | フィンランド  | 1,429,743.50   | 0.43        |
|                | スペイン    | 1,374,283.09   | 0.41        |
|                | バミューダ   | 1,132,155.67   | 0.34        |
|                | 韓国      | 1,123,211.93   | 0.34        |
|                | オーストラリア | 1,109,281.41   | 0.33        |
|                | インド     | 858,266.05     | 0.26        |
|                | シンガポール  | 700,861.63     | 0.21        |
|                | ケイマン諸島  | 502,907.40     | 0.15        |
|                | ベルギー    | 297,890.65     | 0.09        |
|                | ポルトガル   | 240,042.07     | 0.07        |
| 米国財務省証券        | 米国      | 66,434,877.46  | 20.00       |
| アセット・バック証券     | アイルランド  | 20,609,607.36  | 6.21        |
|                | 米国      | 8,627,276.86   | 2.60        |
| 非政府モーゲージ・バック証券 | 英国      | 12,515,320.23  | 3.77        |
|                | 米国      | 2,926,015.50   | 0.88        |
|                | アイルランド  | 1,210,221.14   | 0.36        |
| ソブリン債          | メキシコ    | 2,141,959.84   | 0.64        |
|                | 南アフリカ   | 1,786,308.60   | 0.54        |
|                | ブラジル    | 1,405,600.85   | 0.42        |
|                | 国際機関    | 950,100.71     | 0.29        |
|                | イスラエル   | 772,950.75     | 0.23        |
|                | アルゼンチン  | 433.28         | 0.00        |

|                     |    |                                |         |
|---------------------|----|--------------------------------|---------|
| 地方債                 | 米国 | 2,339,548.44                   | 0.70    |
| 短期金融商品              | 米国 | 491,417.97                     | 0.15    |
| 小計                  |    | 459,276,888.15                 | 138.28  |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |    | - 127,137,712.68               | - 38.28 |
| 合計（純資産総額）           |    | 332,139,175.47<br>（約47,107百万円） | 100.00  |

（注１）投資比率とは、対象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います。

（注２）上記の資産の種類の区分方法は、後記「（２）運用実績（参考情報）（2023年12月末日現在）」で使用される種類の区分方法とは異なります。

## （２）運用実績

## 純資産の推移

2023年12月末日前１年間における各月末の純資産の推移は、次の通りです。

## （ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド

## &lt;米ドル建クラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額          |                | １口当たり純資産価格 |        |
|-----------|----------------|----------------|------------|--------|
|           | 米ドル            | 円              | 米ドル        | 円      |
| 2023年１月末日 | 161,160,259.90 | 22,857,359,662 | 79.80      | 11,318 |
| ２月末日      | 166,488,058.06 | 23,613,001,275 | 77.60      | 11,006 |
| ３月末日      | 177,754,055.60 | 25,210,857,706 | 78.85      | 11,183 |
| ４月末日      | 184,293,107.37 | 26,138,291,418 | 79.06      | 11,213 |
| ５月末日      | 187,540,925.44 | 26,598,929,455 | 78.01      | 11,064 |
| ６月末日      | 191,135,659.10 | 27,108,770,530 | 77.39      | 10,976 |
| ７月末日      | 192,146,522.30 | 27,252,141,258 | 77.30      | 10,963 |
| ８月末日      | 193,122,261.10 | 27,390,530,292 | 76.48      | 10,847 |
| ９月末日      | 189,375,910.40 | 26,859,185,372 | 74.31      | 10,539 |
| 10月末日     | 187,453,653.59 | 26,586,551,689 | 72.67      | 10,307 |
| 11月末日     | 201,272,834.13 | 28,546,526,065 | 75.82      | 10,754 |
| 12月末日     | 210,316,589.41 | 29,829,201,876 | 78.51      | 11,135 |

（注）2023年５月末日の純資産総額が各日における取引すべてを反映した数字であるのに対し、各月末の純資産総額は各日の米国東部標準時午後７時時点で公表された数字です。以下同じです。

## &lt;円建クラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額       | １口当たり純資産価格 |
|-----------|-------------|------------|
|           | 円           | 円          |
| 2023年１月末日 | 271,793,288 | 7,239      |
| ２月末日      | 313,284,300 | 7,017      |
| ３月末日      | 321,985,684 | 7,105      |
| ４月末日      | 322,052,316 | 7,107      |
| ５月末日      | 338,393,019 | 6,989      |
| ６月末日      | 334,419,784 | 6,907      |
| ７月末日      | 334,359,049 | 6,885      |
| ８月末日      | 329,558,196 | 6,786      |
| ９月末日      | 319,153,778 | 6,572      |
| 10月末日     | 311,061,954 | 6,405      |
| 11月末日     | 323,220,395 | 6,655      |
| 12月末日     | 325,629,672 | 6,862      |

## （ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

## &lt;豪ドル建クラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額         |               | 1口当たり純資産価格 |       |
|-----------|---------------|---------------|------------|-------|
|           | 豪ドル           | 円             | 豪ドル        | 円     |
| 2023年1月末日 | 41,690,003.09 | 4,041,428,900 | 66.27      | 6,424 |
| 2月末日      | 40,846,084.82 | 3,959,619,462 | 64.50      | 6,253 |
| 3月末日      | 42,564,990.73 | 4,126,250,201 | 65.33      | 6,333 |
| 4月末日      | 43,169,590.31 | 4,184,860,085 | 65.42      | 6,342 |
| 5月末日      | 42,534,079.67 | 4,123,253,683 | 64.65      | 6,267 |
| 6月末日      | 42,971,721.71 | 4,165,678,703 | 64.12      | 6,216 |
| 7月末日      | 43,265,263.28 | 4,194,134,622 | 63.98      | 6,202 |
| 8月末日      | 42,547,628.43 | 4,124,567,100 | 63.26      | 6,132 |
| 9月末日      | 41,425,550.42 | 4,015,792,858 | 61.57      | 5,969 |
| 10月末日     | 40,543,083.21 | 3,930,246,486 | 60.25      | 5,841 |
| 11月末日     | 41,780,279.77 | 4,050,180,321 | 62.46      | 6,055 |
| 12月末日     | 42,424,739.41 | 4,112,654,238 | 64.34      | 6,237 |

## &lt;トルコリラ建クラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額            |               | 1口当たり純資産価格 |       |
|-----------|------------------|---------------|------------|-------|
|           | トルコリラ            | 円             | トルコリラ      | 円     |
| 2023年1月末日 | 756,532,947.40   | 3,646,488,806 | 255.97     | 1,234 |
| 2月末日      | 745,777,837.55   | 3,594,649,177 | 253.71     | 1,223 |
| 3月末日      | 809,274,239.70   | 3,900,701,835 | 258.40     | 1,245 |
| 4月末日      | 841,002,020.91   | 4,053,629,741 | 267.55     | 1,290 |
| 5月末日      | 906,896,962.20   | 4,371,243,358 | 286.16     | 1,379 |
| 6月末日      | 993,726,043.80   | 4,789,759,531 | 310.38     | 1,496 |
| 7月末日      | 993,131,219.20   | 4,786,892,477 | 313.86     | 1,513 |
| 8月末日      | 1,010,532,040.00 | 4,870,764,433 | 316.92     | 1,528 |
| 9月末日      | 1,005,794,290.00 | 4,847,928,478 | 314.25     | 1,515 |
| 10月末日     | 1,021,692,774.18 | 4,924,559,172 | 320.27     | 1,544 |
| 11月末日     | 1,082,133,713.33 | 5,215,884,498 | 341.65     | 1,647 |
| 12月末日     | 1,080,180,988.78 | 5,206,472,366 | 361.82     | 1,744 |

## &lt;米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額         |               | 1口当たり純資産価格 |       |
|-----------|---------------|---------------|------------|-------|
|           | 米ドル           | 円             | 米ドル        | 円     |
| 2023年1月末日 | 13,049,440.78 | 1,850,802,186 | 20.63      | 2,926 |
| 2月末日      | 12,456,191.34 | 1,766,661,618 | 19.70      | 2,794 |
| 3月末日      | 13,029,531.12 | 1,847,978,399 | 20.70      | 2,936 |
| 4月末日      | 13,270,330.72 | 1,882,131,006 | 21.12      | 2,995 |
| 5月末日      | 12,650,100.32 | 1,794,163,728 | 20.54      | 2,913 |
| 6月末日      | 13,147,104.56 | 1,864,653,840 | 21.77      | 3,088 |
| 7月末日      | 13,291,521.18 | 1,885,136,449 | 22.16      | 3,143 |
| 8月末日      | 12,691,463.19 | 1,800,030,224 | 21.20      | 3,007 |
| 9月末日      | 12,281,504.03 | 1,741,885,717 | 20.52      | 2,910 |
| 10月末日     | 11,953,155.27 | 1,695,316,012 | 20.03      | 2,841 |
| 11月末日     | 12,411,643.41 | 1,760,343,385 | 21.33      | 3,025 |
| 12月末日     | 12,818,302.40 | 1,818,019,829 | 22.46      | 3,186 |

## &lt;豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

|           | 純資産総額        |             | 1口当たり純資産価格 |       |
|-----------|--------------|-------------|------------|-------|
|           | 豪ドル          | 円           | 豪ドル        | 円     |
| 2023年1月末日 | 6,427,824.57 | 623,113,314 | 30.06      | 2,914 |
| 2月末日      | 6,399,661.06 | 620,383,143 | 30.00      | 2,908 |
| 3月末日      | 6,727,743.52 | 652,187,457 | 31.73      | 3,076 |
| 4月末日      | 6,850,023.77 | 664,041,304 | 32.82      | 3,182 |
| 5月末日      | 6,735,701.07 | 652,958,862 | 32.59      | 3,159 |
| 6月末日      | 6,938,911.07 | 672,658,039 | 33.59      | 3,256 |
| 7月末日      | 6,871,157.90 | 666,090,047 | 33.77      | 3,274 |
| 8月末日      | 6,794,911.54 | 658,698,725 | 33.62      | 3,259 |
| 9月末日      | 6,571,960.56 | 637,085,857 | 32.67      | 3,167 |
| 10月末日     | 6,504,468.42 | 630,543,169 | 32.51      | 3,152 |
| 11月末日     | 6,607,749.60 | 640,555,246 | 33.07      | 3,206 |
| 12月末日     | 6,536,391.00 | 633,637,744 | 33.84      | 3,280 |

## 分配の推移

2023年12月末日前 1 年間における各月の 1 口当たり分配金の額は、次の通りです。（分配落ち日  
ベース）

（ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド

<米ドル建クラス受益証券>

|           | 1 口当たり分配金 |    |
|-----------|-----------|----|
|           | 米ドル       | 円  |
| 2023年 1 月 | 0.30      | 43 |
| 2 月       | 0.30      | 43 |
| 3 月       | 0.30      | 43 |
| 4 月       | 0.30      | 43 |
| 5 月       | 0.30      | 43 |
| 6 月       | 0.30      | 43 |
| 7 月       | 0.30      | 43 |
| 8 月       | 0.30      | 43 |
| 9 月       | 0.30      | 43 |
| 10月       | 0.30      | 43 |
| 11月       | 0.30      | 43 |
| 12月       | 0.30      | 43 |

<円クラス受益証券>

|           | 1 口当たり分配金 |
|-----------|-----------|
|           | 円         |
| 2023年 1 月 | 15        |
| 2 月       | 15        |
| 3 月       | 15        |
| 4 月       | 15        |
| 5 月       | 15        |
| 6 月       | 15        |
| 7 月       | 15        |
| 8 月       | 15        |
| 9 月       | 15        |
| 10月       | 15        |
| 11月       | 15        |
| 12月       | 15        |

（ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

&lt;豪ドル建クラス受益証券&gt;

|           | 1口当たり分配金 |    |
|-----------|----------|----|
|           | 豪ドル      | 円  |
| 2023年 1 月 | 0.25     | 24 |
| 2 月       | 0.25     | 24 |
| 3 月       | 0.25     | 24 |
| 4 月       | 0.25     | 24 |
| 5 月       | 0.25     | 24 |
| 6 月       | 0.25     | 24 |
| 7 月       | 0.25     | 24 |
| 8 月       | 0.25     | 24 |
| 9 月       | 0.25     | 24 |
| 10月       | 0.25     | 24 |
| 11月       | 0.25     | 24 |
| 12月       | 0.25     | 24 |

&lt;トルコリラ建クラス受益証券&gt;

|           | 1口当たり分配金 |   |
|-----------|----------|---|
|           | トルコリラ    | 円 |
| 2023年 1 月 | 0.55     | 3 |
| 2 月       | 0.55     | 3 |
| 3 月       | 0.55     | 3 |
| 4 月       | 0.55     | 3 |
| 5 月       | 0.55     | 3 |
| 6 月       | 0.55     | 3 |
| 7 月       | 0.55     | 3 |
| 8 月       | 0.55     | 3 |
| 9 月       | 0.55     | 3 |
| 10月       | 0.55     | 3 |
| 11月       | 0.55     | 3 |
| 12月       | 0.55     | 3 |

## &lt;米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

|           | 1口当たり分配金 |    |
|-----------|----------|----|
|           | 米ドル      | 円  |
| 2023年 1 月 | 0.08     | 11 |
| 2 月       | 0.08     | 11 |
| 3 月       | 0.08     | 11 |
| 4 月       | 0.08     | 11 |
| 5 月       | 0.08     | 11 |
| 6 月       | 0.08     | 11 |
| 7 月       | 0.08     | 11 |
| 8 月       | 0.08     | 11 |
| 9 月       | 0.08     | 11 |
| 10月       | 0.08     | 11 |
| 11月       | 0.08     | 11 |
| 12月       | 0.08     | 11 |

## &lt;豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

|           | 1口当たり分配金 |    |
|-----------|----------|----|
|           | 豪ドル      | 円  |
| 2023年 1 月 | 0.12     | 12 |
| 2 月       | 0.12     | 12 |
| 3 月       | 0.12     | 12 |
| 4 月       | 0.12     | 12 |
| 5 月       | 0.12     | 12 |
| 6 月       | 0.12     | 12 |
| 7 月       | 0.12     | 12 |
| 8 月       | 0.12     | 12 |
| 9 月       | 0.12     | 12 |
| 10月       | 0.12     | 12 |
| 11月       | 0.12     | 12 |
| 12月       | 0.12     | 12 |

## 収益率の推移

( ) ピムコ・トータル・リターン・ファンド

&lt;米ドル建クラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 6.03%  |

（注）各クラス受益証券の収益率は、以下の算式により算出されています。

$$\text{収益率（％）} = 100 \times (a - b) / b$$

a = 2023年12月末日現在の 1 口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b = 2022年12月末日現在の 1 口当たり純資産価格（分配落ちの額）

&lt;円建クラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 0.00%  |

( ) ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

&lt;豪ドル建クラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 4.16%  |

&lt;トルコリラ建クラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 51.02% |

&lt;米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 21.35% |

&lt;豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券&gt;

| 期間                       | 収益率（注） |
|--------------------------|--------|
| 2023年 1 月 1 日～2023年12月末日 | 20.74% |

（参考情報）（2023年12月末日現在）

※ファンドの運用実績は2023年12月末日現在のものであり、将来の運用成果を保証または示唆するものではありません。  
 ※金額及び比率を表示する場合には、四捨五入して記入しております。従って、合計の数値が一致しない場合があります。

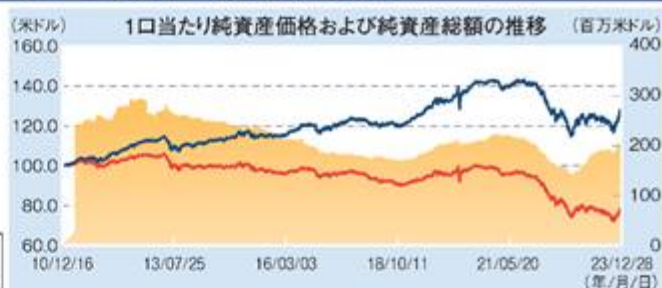
### ビムコ・トータル・リターン・ファンド ミドル建クラス

#### 純資産の推移

（2010年12月16日（設定日）～2023年12月末日）

|                 |        |
|-----------------|--------|
| 1口当たり純資産価格（米ドル） | 78.51  |
| 純資産総額（百万米ドル）    | 210.32 |

■ 純資産総額（右軸）  
— 1口当たり純資産価格（左軸）  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格（左軸）



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

#### 分配の推移（単位：米ドル）

| 分配月（分配落ち日ベース） | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 3.60    | 3.60    | 3.60     | 3.60     | 3.60     | 0.30    | 0.30    |
| 分配月（分配落ち日ベース） | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 0.30    | 0.30    | 0.30     | 0.30     | 0.30     | 46.50   |         |

#### 収益率の推移



（注1）ファンドにはベンチマークはありません。

（注2）ファンドの収益率(%)=100×(a-b)/b  
 a=会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b=当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

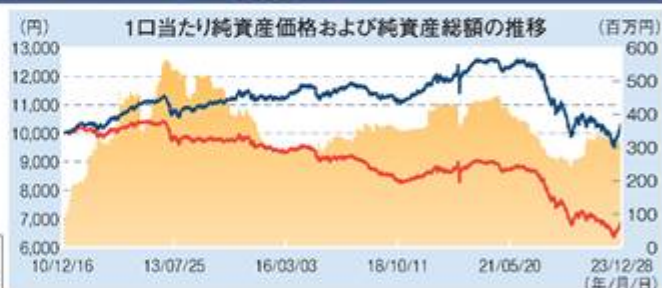
### ビムコ・トータル・リターン・ファンド 円建クラス

#### 純資産の推移

（2010年12月16日（設定日）～2023年12月末日）

|               |        |
|---------------|--------|
| 1口当たり純資産価格（円） | 6,862  |
| 純資産総額（百万円）    | 325.63 |

■ 純資産総額（右軸）  
— 1口当たり純資産価格（左軸）  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格（左軸）



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

#### 分配の推移（単位：円）

| 分配月（分配落ち日ベース） | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 270     | 180     | 180      | 180      | 180      | 15      | 15      |
| 分配月（分配落ち日ベース） | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 15      | 15      | 15       | 15       | 15       | 3,735   |         |

#### 収益率の推移



（注1）ファンドにはベンチマークはありません。

（注2）ファンドの収益率(%)=100×(a-b)/b  
 a=会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b=当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

# **ビムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション 豪ドル建クラス**

## **純資産の推移**

(2010年12月16日(設定日)～2023年12月末日)

|                 |       |
|-----------------|-------|
| 1口当たり純資産価格(豪ドル) | 64.34 |
| 純資産総額(百万豪ドル)    | 42.42 |

■ 純資産総額(右軸)  
— 1口当たり純資産価格(左軸)  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格(左軸)



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

## **分配の推移(単位: 豪ドル)**

| 分配月(分配落ち日ベース) | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 3.90    | 3.00    | 3.00     | 3.00     | 3.00     | 0.25    | 0.25    |
| 分配月(分配落ち日ベース) | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 0.25    | 0.25    | 0.25     | 0.25     | 0.25     | 69.95   |         |

## **収益率の推移**



(注1) ファンドにはベンチマークはありません。

(注2) ファンドの収益率(%) =  $100 \times (a-b)/b$   
 a = 会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b = 当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

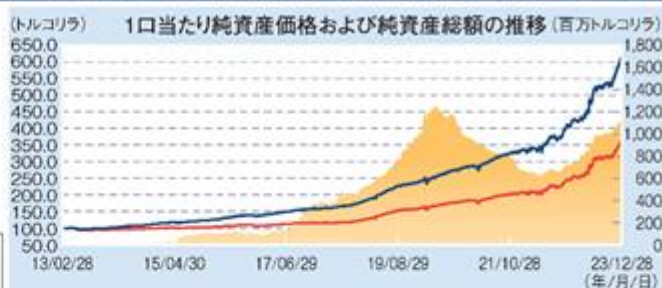
# **ビムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション トルコリラ建クラス**

## **純資産の推移**

(2013年2月28日(設定日)～2023年12月末日)

|                   |          |
|-------------------|----------|
| 1口当たり純資産価格(トルコリラ) | 361.82   |
| 純資産総額(百万トルコリラ)    | 1,080.18 |

■ 純資産総額(右軸)  
— 1口当たり純資産価格(左軸)  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格(左軸)



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

## **分配の推移(単位: トルコリラ)**

| 分配月(分配落ち日ベース) | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 6.60    | 6.60    | 6.60     | 6.60     | 6.60     | 0.55    | 0.55    |
| 分配月(分配落ち日ベース) | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 0.55    | 0.55    | 0.55     | 0.55     | 0.55     | 70.95   |         |

## **収益率の推移**



(注1) ファンドにはベンチマークはありません。

(注2) ファンドの収益率(%) =  $100 \times (a-b)/b$   
 a = 会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b = 当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

# ビムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション 米ドル建ブラジルレアルクラス

## 純資産の推移

(2010年12月16日(設定日)～2023年12月末日)

|                 |       |
|-----------------|-------|
| 1口当たり純資産価格(米ドル) | 22.46 |
| 純資産総額(百万米ドル)    | 12.82 |

■ 純資産総額(右軸)  
— 1口当たり純資産価格(左軸)  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格(左軸)



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

## 分配の推移(単位: 米ドル)

| 分配月(分配落ち日ベース) | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 3.60    | 2.40    | 1.08     | 0.96     | 0.96     | 0.08    | 0.08    |
| 分配月(分配落ち日ベース) | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 0.08    | 0.08    | 0.08     | 0.08     | 0.08     | 75.21   |         |

## 収益率の推移



(注1) ファンドにはベンチマークはありません。

(注2) ファンドの収益率(%)=100×(a-b)/b  
 a=会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b=当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

# ビムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション 豪ドル建ブラジルレアルクラス

## 純資産の推移

(2010年12月16日(設定日)～2023年12月末日)

|                 |       |
|-----------------|-------|
| 1口当たり純資産価格(豪ドル) | 33.84 |
| 純資産総額(百万豪ドル)    | 6.54  |

■ 純資産総額(右軸)  
— 1口当たり純資産価格(左軸)  
— 分配金再投資1口当たり純資産価格(左軸)



※分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

## 分配の推移(単位: 豪ドル)

| 分配月(分配落ち日ベース) | 第9会計年度  | 第10会計年度 | 第11会計年度  | 第12会計年度  | 第13会計年度  | 2023年6月 | 2023年7月 |
|---------------|---------|---------|----------|----------|----------|---------|---------|
| 1口当たり分配金      | 5.10    | 3.00    | 1.57     | 1.44     | 1.44     | 0.12    | 0.12    |
| 分配月(分配落ち日ベース) | 2023年8月 | 2023年9月 | 2023年10月 | 2023年11月 | 2023年12月 | 設定来累計   |         |
| 1口当たり分配金      | 0.12    | 0.12    | 0.12     | 0.12     | 0.12     | 83.59   |         |

## 収益率の推移



(注1) ファンドにはベンチマークはありません。

(注2) ファンドの収益率(%)=100×(a-b)/b  
 a=会計年度末の1口当たり純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)  
 b=当該会計年度末の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配前の額)

## 主要な資産の状況

2023年12月末日現在

### <投資有価証券の主要銘柄>

ビムコ・トータル・リターン・ファンド

| 順位 | 銘柄                               | 種類   | 投資比率(%) |
|----|----------------------------------|------|---------|
| 1  | PIMCO Total Return Strategy Fund | 投資信託 | 99.94   |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

ビムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

| 順位 | 銘柄                               | 種類   | 投資比率(%) |
|----|----------------------------------|------|---------|
| 1  | PIMCO Total Return Strategy Fund | 投資信託 | 90.05   |

※下記は、ファンドの主な投資先である「ビムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド(対象ファンド)」についての2023年12月末日現在の情報です。

### <通貨別投資比率>

| 通貨  | 比 率 (%) |
|-----|---------|
| 米ドル | 99      |
| 豪ドル | 1       |
| その他 | -1      |

\*キャッシュ等には、PIMCOがキャッシュとみなす債券（高格付けの短期債）等が含まれています。

### <セクター別投資比率>

| 種 類      | 比 率 (%) |
|----------|---------|
| 国債・政府機関債 | 9       |
| モーゲージ債   | 53      |
| 社債       | 34      |
| 米国以外の公社債 | -6      |
| エマージング債  | 4       |
| その他      | 1       |
| キャッシュ等*  | 5       |

### <格付別投資比率>

| 格付    | 比 率 (%) |
|-------|---------|
| AAA   | 43      |
| AA    | 5       |
| A     | 17      |
| BBB   | 30      |
| BB    | 3       |
| B     | 1       |
| B 格未満 | 1       |

### <投資有価証券の主要銘柄>

| 順位 | 銘柄                | 種類       | 償還日       | 投資比率(%) |
|----|-------------------|----------|-----------|---------|
| 1  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 7.8     |
| 2  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 6.8     |
| 3  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2053/6/1  | 4.5     |
| 4  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 4.4     |
| 5  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/1/16 | 4.3     |
| 6  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/1/16 | 4.2     |
| 7  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 3.2     |
| 8  | US Treasury Bonds | 国債・政府機関債 | 2044/5/15 | 3.0     |
| 9  | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 2.4     |
| 10 | Fannie Mae        | モーゲージ債   | 2054/2/13 | 2.2     |

(注1)通貨別投資比率、セクター別投資比率、格付別投資比率については四捨五入のため全体計が100%とならないことがあります。

(注2)投資比率とは、対象ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

[次へ](#)

## 2 販売及び買戻しの実績

2023年12月末日前 1 年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年12月末日現在の発行済口数は、次の通りです。

（ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド

<米ドル建クラス受益証券>

| 販売口数        | 買戻口数        | 発行済口数         |
|-------------|-------------|---------------|
| 887,603     | 151,627     | 2,678,978     |
| ( 887,603 ) | ( 151,627 ) | ( 2,678,978 ) |

（注）（ ）内の数字は日本国内における販売・買戻および発行済の口数を示します。以下同じです。

<円建クラス受益証券>

| 販売口数       | 買戻口数      | 発行済口数      |
|------------|-----------|------------|
| 12,450     | 2,540     | 47,456     |
| ( 12,450 ) | ( 2,540 ) | ( 47,456 ) |

（ ）ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

<豪ドル建クラス受益証券>

| 販売口数       | 買戻口数       | 発行済口数       |
|------------|------------|-------------|
| 74,950     | 43,681     | 659,341     |
| ( 74,950 ) | ( 43,681 ) | ( 659,341 ) |

<トルコリラ建クラス受益証券>

| 販売口数        | 買戻口数        | 発行済口数         |
|-------------|-------------|---------------|
| 569,937     | 507,843     | 2,985,408     |
| ( 569,937 ) | ( 507,843 ) | ( 2,985,408 ) |

<米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券>

| 販売口数    | 買戻口数       | 発行済口数       |
|---------|------------|-------------|
| 210     | 62,866     | 570,603     |
| ( 210 ) | ( 62,866 ) | ( 570,603 ) |

<豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券>

| 販売口数    | 買戻口数       | 発行済口数       |
|---------|------------|-------------|
| 365     | 21,074     | 193,128     |
| ( 365 ) | ( 21,074 ) | ( 193,128 ) |

[次へ](#)

### 3 ファンドの経理状況

- a . ファンドの日本文の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた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。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 . ファンドの中間財務書類は、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 . ファンドの原文の中間財務書類は米ドル、豪ドル、トルコリラおよび日本円で表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、株式会社三菱UFJ銀行の2023年12月29日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝141.83円、1豪ドル＝96.94円、1トルコリラ＝4.82円）を使用して換算された円換算額が併記されている。なお、百万円未満の金額は四捨五入されている。

## （１）資産及び負債の状況

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 資 産 負 債 計 算 書

2023年11月30日現在

（単位：千米ドル、１口当たり金額を除く）

|                     | 注記   | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド |         |
|---------------------|------|------------------------|---------|
|                     |      | （千米ドル）                 | （百万円）   |
| 資 産：                |      |                        |         |
| 投資有価証券              | 2(b) | 0                      | 0       |
| 関係会社に対する投資有価証券      | 2(b) | 203,358                | 28,842  |
| 為替予約契約にかかる未実現評価益    | 4(a) | 23                     | 3       |
| 現金                  | 2(e) | 200                    | 28      |
| 未収投資有価証券売却金         |      | 0                      | 0       |
| 未収ファンド受益証券売却金       |      | 1,565                  | 222     |
| 資 産 合 計             |      | 205,146                | 29,096  |
| 負 債：                |      |                        |         |
| 為替予約契約にかかる未実現評価損    | 4(a) | (5)                    | (1)     |
| 未払投資有価証券購入金         |      | (1,487)                | (211)   |
| 未払ファンド受益証券買戻金       |      | (70)                   | (10)    |
| 未払販売会社報酬            | 6    | (32)                   | (5)     |
| 未払管理報酬              | 6    | (66)                   | (9)     |
| 未払代行協会員報酬           | 6    | (8)                    | (1)     |
| その他の負債              |      | (19)                   | (3)     |
| 相手方からの預託金           |      | 0                      | 0       |
| 負 債 合 計             |      | (1,687)                | (239)   |
| 純 資 産               |      | 203,459                | 28,857  |
| 投資有価証券の取得原価         |      | 0                      | 0       |
| 関係会社に対する投資有価証券の取得原価 |      | 204,545                | 29,011  |
| 発行済受益証券口数：          |      | 2,703 千口               |         |
| 受益証券１口当たり純資産価格：     |      |                        |         |
| 豪ドル建クラス受益証券         |      | 該当なし                   |         |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券  |      | 該当なし                   |         |
| 円建クラス受益証券           |      | 6,655.00 円             |         |
| トルコリラ建クラス受益証券       |      | 該当なし                   |         |
| 米ドル建クラス受益証券         |      | 75.82 米ドル              | 10,754円 |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券  |      | 該当なし                   |         |

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。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 資 産 負 債 計 算 書

2023年11月30日現在

（単位：千米ドル、1口当たり金額を除く）

|                     | 注記   | ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・セレクション |        |
|---------------------|------|---------------------------------------|--------|
|                     |      | （千米ドル）                                | （百万円）  |
| 資 産：                |      |                                       |        |
| 投資有価証券              | 2(b) | 8,523                                 | 1,209  |
| 関係会社に対する投資有価証券      | 2(b) | 72,032                                | 10,216 |
| 為替予約契約にかかる未実現評価益    | 4(a) | 2,028                                 | 288    |
| 現金                  | 2(e) | 543                                   | 77     |
| 未収投資有価証券売却金         |      | 108                                   | 15     |
| 未収ファンド受益証券売却金       |      | 1                                     | 0      |
| 資 産 合 計             |      | 83,235                                | 11,805 |
| 負 債：                |      |                                       |        |
| 為替予約契約にかかる未実現評価損    | 4(a) | (225)                                 | (32)   |
| 未払投資有価証券購入金         |      | (1)                                   | (0)    |
| 未払ファンド受益証券買戻金       |      | (120)                                 | (17)   |
| 未払販売会社報酬            | 6    | (28)                                  | (4)    |
| 未払管理報酬              | 6    | (33)                                  | (5)    |
| 未払代行協会員報酬           | 6    | (8)                                   | (1)    |
| その他の負債              |      | (7)                                   | (1)    |
| 相手方からの預託金           |      | (811)                                 | (115)  |
| 負 債 合 計             |      | (1,233)                               | (175)  |
| 純 資 産               |      | 82,002                                | 11,630 |
| 投資有価証券の取得原価         |      | 8,522                                 | 1,209  |
| 関係会社に対する投資有価証券の取得原価 |      | 77,392                                | 10,977 |
| 発行済受益証券口数：          |      | 4,618 千口                              |        |
| 受益証券1口当たり純資産価格：     |      |                                       |        |
| 豪ドル建クラス受益証券         |      | 62.46 豪ドル                             | 6,055円 |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券  |      | 33.07 豪ドル                             | 3,206円 |
| 円建クラス受益証券           |      | 該当なし                                  |        |
| トルコリラ建クラス受益証券       |      | 341.65 トルコリラ                          | 1,647円 |
| 米ドル建クラス受益証券         |      | 該当なし                                  |        |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券  |      | 21.33 米ドル                             | 3,025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。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 運 用 計 算 書

2023年11月30日に終了した期間

（単位：千米ドル）

|                                         | 注記   | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド |       |
|-----------------------------------------|------|------------------------|-------|
|                                         |      | （千米ドル）                 | （百万円） |
| 収 益：                                    |      |                        |       |
| 受取利息                                    | 2(c) | 3                      | 0     |
| 収益合計                                    |      | 3                      | 0     |
| 費 用：                                    |      |                        |       |
| 管理報酬                                    | 6    | (394)                  | (56)  |
| 年次税                                     | 7    | 0                      | 0     |
| 販売会社報酬                                  | 6    | (144)                  | (20)  |
| 代行協会員報酬                                 | 6    | (96)                   | (14)  |
| 支払利息                                    |      | 0                      | 0     |
| その他の報酬                                  |      | (19)                   | (3)   |
| 費用合計                                    |      | (653)                  | (93)  |
| 純投資利益 / （費用）                            |      | (650)                  | (92)  |
| 投資有価証券にかかる実現純利益 /<br>（損失）               | 2(c) | 746                    | 106   |
| 為替予約契約および外国通貨にかかる<br>実現純利益 / （損失）       | 2(c) | (297)                  | (42)  |
| 当期実現純利益 / （損失）                          |      | 449                    | 64    |
| 投資有価証券にかかる未実現評価益 /<br>（評価損）純変動額         | 2(c) | (826)                  | (117) |
| 為替予約契約および外国通貨にかかる<br>未実現評価益 / （評価損）純変動額 | 2(c) | 99                     | 14    |
| 当期末実現評価益 / （評価損）純変動額                    |      | (727)                  | (103) |
| 当期運用成績                                  |      | (928)                  | (132) |

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。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 運 用 計 算 書

2023年11月30日に終了した期間

（単位：千米ドル）

|                                         | 注記   | ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・セレクション |         |
|-----------------------------------------|------|---------------------------------------|---------|
|                                         |      | （千米ドル）                                | （百万円）   |
| 収 益：                                    |      |                                       |         |
| 受取利息                                    | 2(c) | 226                                   | 32      |
| 収益合計                                    |      | 226                                   | 32      |
| 費 用：                                    |      |                                       |         |
| 管理報酬                                    | 6    | (206)                                 | (29)    |
| 年次税                                     | 7    | (2)                                   | (0)     |
| 販売会社報酬                                  | 6    | (143)                                 | (20)    |
| 代行協会員報酬                                 | 6    | (41)                                  | (6)     |
| 支払利息                                    |      | (11)                                  | (2)     |
| その他の報酬                                  |      | (8)                                   | (1)     |
| 費用合計                                    |      | (411)                                 | (58)    |
| 純投資利益 / （費用）                            |      | (185)                                 | (26)    |
| 投資有価証券にかかる実現純利益 /<br>（損失）               | 2(c) | (1,834)                               | (260)   |
| 為替予約契約および外国通貨にかかる<br>実現純利益 / （損失）       | 2(c) | (7,221)                               | (1,024) |
| 当期実現純利益 / （損失）                          |      | (9,055)                               | (1,284) |
| 投資有価証券にかかる未実現評価益 /<br>（評価損）純変動額         | 2(c) | 1,663                                 | 236     |
| 為替予約契約および外国通貨にかかる<br>未実現評価益 / （評価損）純変動額 | 2(c) | 3,223                                 | 457     |
| 当期末実現評価益 / （評価損）純変動額                    |      | 4,886                                 | 693     |
| 当期運用成績                                  |      | (4,354)                               | (618)   |

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。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 純資産変動計算書

2023年11月30日に終了した期間

（単位：千米ドル）

|               | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド |        |
|---------------|------------------------|--------|
|               | （千米ドル）                 | （百万円）  |
| 期首現在純資産額      | 189,963                | 26,942 |
| 受益証券の発行による受取額 | 25,121                 | 3,563  |
| 分配金支払額        | (4,535)                | (643)  |
| 分配金再投資による受取額  | 0                      | 0      |
| 受益証券買戻支払額     | (6,162)                | (874)  |
| 当期運用成績        | (928)                  | (132)  |
| 期末現在純資産額      | 203,459                | 28,857 |

|               | ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・セレクション |        |
|---------------|---------------------------------------|--------|
|               | （千米ドル）                                | （百万円）  |
| 期首現在純資産額      | 88,349                                | 12,531 |
| 受益証券の発行による受取額 | 3,987                                 | 565    |
| 分配金支払額        | (1,448)                               | (205)  |
| 分配金再投資による受取額  | 0                                     | 0      |
| 受益証券買戻支払額     | (4,532)                               | (643)  |
| 当期運用成績        | (4,354)                               | (618)  |
| 期末現在純資産額      | 82,002                                | 11,630 |

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。

注記は本財務書類と不可分である。

ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト  
発行済受益証券変動計算書  
2023年11月30日に終了した期間  
(単位：千口)

|                    | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・<br>セクション |
|--------------------|------------------------|----------------------------------------------|
| 期首現在発行済受益証券：       |                        |                                              |
| 豪ドル建クラス受益証券        | 該当なし                   | 658                                          |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 207                                          |
| 円建クラス受益証券          | 49                     | 該当なし                                         |
| トルコリラ建クラス受益証券      | 該当なし                   | 3,169                                        |
| 米ドル建クラス受益証券        | 2,404                  | 該当なし                                         |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 616                                          |
| 期中受益証券発行           |                        |                                              |
| 豪ドル建クラス受益証券        | 該当なし                   | 32                                           |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 0                                            |
| 円建クラス受益証券          | 0                      | 該当なし                                         |
| トルコリラ建クラス受益証券      | 該当なし                   | 219                                          |
| 米ドル建クラス受益証券        | 332                    | 該当なし                                         |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 0                                            |
| 分配金の再投資による受益証券発行   |                        |                                              |
| 豪ドル建クラス受益証券        | 該当なし                   | 0                                            |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 0                                            |
| 円建クラス受益証券          | 0                      | 該当なし                                         |
| トルコリラ建クラス受益証券      | 該当なし                   | 0                                            |
| 米ドル建クラス受益証券        | 0                      | 該当なし                                         |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 0                                            |
| 期中受益証券買戻し          |                        |                                              |
| 豪ドル建クラス受益証券        | 該当なし                   | (21)                                         |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | (7)                                          |
| 円建クラス受益証券          | 0                      | 該当なし                                         |
| トルコリラ建クラス受益証券      | 該当なし                   | (221)                                        |
| 米ドル建クラス受益証券        | (82)                   | 該当なし                                         |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | (34)                                         |
| 期末現在発行済受益証券：       |                        |                                              |
| 豪ドル建クラス受益証券        | 該当なし                   | 669                                          |
| 豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 200                                          |
| 円建クラス受益証券          | 49                     | 該当なし                                         |
| トルコリラ建クラス受益証券      | 該当なし                   | 3,167                                        |
| 米ドル建クラス受益証券        | 2,654                  | 該当なし                                         |
| 米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券 | 該当なし                   | 582                                          |

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。

注記は本財務書類と不可分である。

[次へ](#)

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 統 計 情 報

（未監査）

（単位：千、１口当たり金額を除く）

## ピムコ・トータル・リターン・ファンド

|                | 2023年11月30日現在 |          | 2023年 5 月31日現在 |          | 2022年 5 月31日現在 |          |
|----------------|---------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|
|                |               | 百 万      |                | 百 万      |                | 百 万      |
| 純 資 産          | 203,459 千米ドル  | 28,857 円 | 189,963 千米ドル   | 26,942 円 | 166,419 千米ドル   | 23,603 円 |
| 純資産（日本円）       | 323,220 千円    |          | 338,393 千円     |          | 269,912 千円     |          |
|                |               | 百 万      |                | 百 万      |                | 百 万      |
| 純資産（米ドル）       | 201,273 千米ドル  | 28,547 円 | 187,541 千米ドル   | 26,599 円 | 164,321 千米ドル   | 23,306 円 |
| 受益証券１口当たり純資産価格 |               |          |                |          |                |          |
| 円建クラス受益証券      | 6,655.00 円    |          | 6,989.00 円     |          | 7,743.00 円     |          |
| 米ドル建クラス受益証券    | 75.82 米ドル     | 10,754 円 | 78.01 米ドル      | 11,064 円 | 84.16 米ドル      | 11,936 円 |

## ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

|                | 2023年11月30日現在    |          | 2023年 5 月31日現在 |          | 2022年 5 月31日現在 |          |
|----------------|------------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|
|                |                  | 百 万      |                | 百 万      |                | 百 万      |
| 純 資 産          | 82,002 千米ドル      | 11,630 円 | 88,349 千米ドル    | 12,531 円 | 94,365 千米ドル    | 13,384 円 |
|                |                  | 百 万      |                | 百 万      |                | 百 万      |
| 純資産（豪ドル）       | 48,388 千豪ドル      | 4,691 円  | 49,270 千豪ドル    | 4,776 円  | 54,493 千豪ドル    | 5,283 円  |
| 純 資 産（トルコリラ）   | 1,082,134 千トルコリラ | 5,216 円  | 906,897 千トルコリラ | 4,371 円  | 637,542 千トルコリラ | 3,073 円  |
|                |                  | 百 万      |                | 百 万      |                | 百 万      |
| 純資産（米ドル）       | 12,412 千米ドル      | 1,760 円  | 12,650 千米ドル    | 1,794 円  | 16,363 千米ドル    | 2,321 円  |
| 受益証券１口当たり純資産価格 |                  |          |                |          |                |          |
| 豪ドル建クラス受益証券    | 62.46 豪ドル        | 6,055 円  | 64.65 豪ドル      | 6,267 円  | 70.40 豪ドル      | 6,825 円  |
| 豪ドル建ブラジルレアル    |                  |          |                |          |                |          |
| クラス受益証券        | 33.07 豪ドル        | 3,206 円  | 32.59 豪ドル      | 3,159 円  | 31.69 豪ドル      | 3,072 円  |
| トルコリラ建クラス受益証券  | 341.65 トルコリラ     | 1,647 円  | 286.16 トルコリラ   | 1,379 円  | 210.53 トルコリラ   | 1,015 円  |
| 米ドル建ブラジルレアル    |                  |          |                |          |                |          |
| クラス受益証券        | 21.33 米ドル        | 3,025 円  | 20.54 米ドル      | 2,913 円  | 22.15 米ドル      | 3,142 円  |

[次へ](#)

## ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト

## 財務書類に対する注記

2023年11月30日現在

## １．概要

ピムコ・ルクセンブルグ・トラスト（以下「トラスト」という。）は、法人格を有しない資産の共同所有体である、ルクセンブルグ大公国の法律に基づいて設立された共有持分型（契約型）投資信託（Fonds Commun de Placement）である。トラストは、ルクセンブルグに登録上の住所を有するルクセンブルグ大公国の法律に従って設立された、トラストの管理会社およびオルタナティブ投資ファンド運用会社であるピムコ・グローバル・アドバイザーズ（ルクセンブルグ）エス・エイ（以下「管理会社」または「AIFM」という。）によって、共同所有者（以下「受益者」という。）の利益のために運用される。ステート・ストリート・バンク・インターナショナル・ゲー・エム・ベー・ハー ルクセンブルグ支店（以下「保管受託銀行」という。）によって保管されるトラストの資産は、管理会社の資産から分離される。トラストは、投資信託に関する2010年12月17日法（改正済）のパート に基づき、ルクセンブルグにおいて設立されている。

管理会社は、2010年11月18日に設立された2013年の法律（ルクセンブルグの管理会社に関する2013年7月12日法、随時改正される。）（以下「2013年法」という。）の第2章に基づくトラストの管理会社である。管理会社は、トラストのために、トラスト内で設立される特定の資産のポートフォリオ（以下それぞれ「ファンド」という。）に関連する異なるシリーズの受益証券（以下「受益証券」という。）を発行することができる。ファンドは、（目論見書に定義されているとおり）マスター・フィーダー構造を通じ、主にピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド（以下「対象ファンド」という。）に投資するファンドとして組成されている。

現在、3つのファンドが運用されている。

| ファンド名                                                        | 基準通貨 | 開始日         |
|--------------------------------------------------------------|------|-------------|
| ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>（以下「TRFファンド」という。）                      | 米ドル  | 2010年12月16日 |
| ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>（以下「TRFファンド」という。）                      | 米ドル  | 2013年10月25日 |
| ピムコ・トータル・リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・セレクション<br>（以下「TRFMSファンド」という。） | 米ドル  | 2010年12月16日 |

## ２．重要な会計方針

本中間財務書類は、ルクセンブルグの法律および規則の要求に従って作成されている。ルクセンブルグの要求に準拠した財務書類の作成は、財務書類上の報告金額および開示に影響を及ぼす見積りおよび仮定を行うことを経営陣に要求している。実際の結果は、これらの見積りと異なることがある。本財務書類は、別段の記載がない限り、本報告書を通じて千未満を四捨五入している。

すべての金額は、別段の記載がない限り、千未満を四捨五入している。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。特定のファンドの投資有価証券明細表は、実際の額面価額および公正価値の千未満を四捨五入した時に両方がゼロと表示される譲渡性のある有価証券を保有することがある。

## （a）受益証券の純資産価格の決定

各ファンドの1口当たり受益証券の純資産価格（以下「純資産価格」という。）は、米ドルで表示されている。各ファンドの純資産価格は、通常、各「営業日」（以下それぞれ「取引日」という。）における

ニューヨーク証券取引所（以下「NYSE」という。）取引終了時点（通常米国東部標準時の午後４時）で算定される。営業日とは、ルクセンブルグ、アメリカ合衆国のカリフォルニア州および日本において銀行が営業を行う日、ならびにNYSEが営業を行う日（土曜日と日曜日を除く。）をいう。

（b）有価証券の評価

対象ファンドへの投資は、当該対象ファンドの純資産価額で評価される。トラストは通常、現地市場終了直後に受領した持分証券については価格決定データを用い、市場終了後に行われる取引、清算または決済については通常は考慮しない。

満期が60日以内の短期金融商品は、一般的に、公正価値に近似する償却原価により評価される。

（c）証券取引および投資収益

財務報告の目的上、証券取引は取引日現在において計上される。発行時取引または後渡取引ベースで購入または売却された証券は、取引日から15日以上経過してから決済される場合がある。売却証券からの実現損益は、個別法により計上される。配当落ち日が経過した外国証券からの特定の分配金が、トラストが配当を知らされた直後に計上される場合を除き、受取配当金は配当落ち日に計上される。割引の増加およびプレミアムの償却調整後の受取利息は、実効日より発生主義で計上される先スタート条件付の実効日を有する証券を除き、決済日から発生主義で計上され、実効金利法を用いて計算される。転換証券について、転換に起因するプレミアムは償却されない。特定の外国証券にかかる見積税金負債は発生主義で計上され、必要に応じて、運用計算書における受取利息の構成要素または投資有価証券にかかる未実現評価益／（評価損）純変動額の項目に反映される。

債務担保証券は、未収利息不計上の状態で保留され、一貫して適用される手続きに基づき、すべてのまたは一部の利息の回収が不確実な場合において、現在の発生額の計上を中止し、かつ未収利息を損金処理することによって関連受取利息を減額することがある。担保債務証券は、発行体が利息支払を再開した場合、または利息回収可能性が高い場合において、未収利息不計上の状態が取り消される。

（d）分配

管理会社は、インカム・ゲインおよび／またはキャピタル・ゲインの一部またはすべてを、毎年または中間分配金として分配することを決定すること、もしくは一定の期間分配を行わず、代わりに特定のファンドまたはクラス受益証券の一口当たり純資産価格中の当該インカム・ゲインおよび／またはキャピタル・ゲインを累積することを決定することができる。特定のクラスのすべての受益証券は、当該クラスに関する収益および配当に等しく関与する権利を有する。配当の支払いが決定した場合、決定後、合理的に実務上可能な限り早急に支払いがなされる。当会計期間中の配当落ち日の受益証券にかかる分配金支払額は、純資産変動計算書で認識され、サブ・ファンドに再投資された分配総額の一部である分配金の再投資もまた、純資産変動計算書で認識される。

ピムコ・トータル・リターン・ファンドおよびピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクションの場合、通常の場合下では、管理会社は、各ファンドに対し各クラスに帰属する投資利益および／またはキャピタル・ゲインを考慮して、毎月の最終取引日を分配基準日として、分配を宣言する意向である。管理会社が適切とみなす場合、追加の分配が宣言される可能性がある。

ピムコ・トータル・リターン・ファンド の場合、管理会社は、毎月またはインカム・ゲインおよび／またはキャピタル・ゲインを考慮して決定する他のタイミングで、分配を宣言する意向である。管理会社が適切とみなす場合、追加の分配が宣言される可能性がある。

通常の場合下では、管理会社は、累積クラス受益証券に帰属する純投資利益またはキャピタル・ゲイン（もしあれば）について分配を行わない意向である。したがって、累積クラス受益証券の純投資利益およびキャピタル・ゲインは宣言されず、分配もされない。他方、累積クラス受益証券の一口当たり純資産価格には、純投資利益またはキャピタル・ゲインが反映される。

（e）現金および外貨

ファンドの表示通貨は米ドルである。トラストの表示通貨は米ドルである。ファンドの表示通貨以外の通貨建ての外国証券、保有外貨ならびにその他の資産および負債の市場価格は、毎営業日現在の為替レートに基づきそれぞれの通貨に換算される。

為替レートの変動により生じる保有通貨ならびにその他の資産および負債の時価の変動は、未実現外貨評価損益として計上される。投資証券にかかる実現損益および未実現評価損益ならびに収益および費用は、当該取引の行われた各日ならびに報告日にそれぞれ換算される。投資有価証券にかかる外貨換算レートの変動による影響は、運用計算書において当該証券の市場価格の変動による影響から区別されず、外国通貨にかかる実現純損益および未実現評価損益に含まれる。

下記の表は、米ドル以外の通貨建ての投資ならびにその他の資産および負債を米ドル残高へ変換するために使用される為替レートを表したものである。

| 外貨       | 表示通貨<br>(米ドル) |
|----------|---------------|
| 豪ドル      | 1.50818       |
| ブラジル・リアル | 4.93225       |
| ユーロ(€)   | 0.91651       |
| 日本円(¥)   | 147.83500     |
| トルコリラ    | 28.85200      |
| 米ドル(\$)  | 1.00000       |

#### (f) 取引費用

取引費用は、投資有価証券取得時に発生する費用である。これらには、エージェント、アドバイザー、ブローカーおよびディーラーに対して支払われた報酬および手数料が含まれる。取引費用は、運用計算書において、投資有価証券にかかる実現純利益/(損失)ならびに未実現評価益/(評価損)純変動額、為替予約契約および外国通貨にかかる実現純利益/(損失)ならびに未実現評価益/(評価損)純変動額に含まれる。確定利付証券および特定のデリバティブについて、取引費用は、証券の購入価格から個別に識別できないため、単独で開示を行うことができない。

### ３．証券およびその他の投資有価証券

#### （a）米国政府機関証券または政府支援企業証券

特定のファンドは、米国政府機関または政府支援企業によって発行された証券に投資することができる。米国政府証券は、特定の場合においては米国政府、その機関または下部機構により保証される債務である。米国短期財務省証券、債券、および連邦政府抵当金庫（以下「GNMA」または「ジニーメイ」という。）により保証された証券等のいくつかの米国政府証券は、米国政府の十分な信頼と信用により支えられており、連邦住宅貸付銀行等のその他については、米国財務省（以下「米国財務省」という。）から借入するという発行者の権利により支えられている。また、連邦抵当金庫（以下「FNMA」または「ファニーメイ」という。）等のその他については、当該機関の債務を購入する権限を持つ米国政府の裁量により支えられている。米国政府証券には、ゼロ・クーポン証券が含まれる。ゼロ・クーポン債は、時価基準で利息を分配せず、利息分配型証券よりも大きなリスクを伴う傾向がある。

政府関連保証人（すなわち、米国政府の十分な信頼と信用の裏付けのない保証人）には、FNMAおよび連邦住宅貸付抵当公社（以下「FHLMC」または「フレディマック」という。）が含まれる。FNMAは政府支援企業である。FNMAは、州および連邦政府によって認定された貯蓄貸付組合、相互貯蓄銀行、商業銀行、信用組合およびモーゲージバンカーを含む、承認された売り手/サービスの一覧から、慣習的な（すなわち、いかなる政府機関によっても保証されない）住宅モーゲージを購入する。FNMAが発行するパス・スルー証券は、FNMAの適時の元金および利子の支払いについては保証されるが、米国政府の十分な信頼と信用による裏付けはない。FHLMCは、参加証書（以下「PCs」という。）を発行するが、これは住宅モーゲージのプールにある未分割の利息を表すパス・スルー証券である。FHLMCは、適時の利子の支払いおよび元金の最終受取の保証はするが、PCsへの米国政府の十分な信頼と信用による裏付けはない。

2019年6月、FNMAおよびFHLMCは、現在のTBA適格証券（以下「単一証券イニシアティブ」という。）の発行に代えて、ユニホーム・モーゲージ・バック証券（以下「UMBS」という。）の発行を開始した。単一証券イニシアティブは、TBA市場の全体的な流動性を支援し、FNMAとFHLMCの証書の特性を一致させることを目指している。単一証券イニシアティブがTBA市場およびその他のモーゲージ・バック証券市場に及ぼし得る影響は不明である。

ファンドは、権利失効日前にポジションを手じまいし、後日付の権利失効日を有する同一の原資産に関連して新たなポジションを開くことにより、原資産にかかる発表予定（以下「TBA」という。）証券等のポジションの権利失効や満期の延長を図るロール・タイミング戦略を用いることができる。売買されたTBA証券は、資産負債計算書においてそれぞれ資産または負債として反映される。

#### （b）発行時取引

特定のファンドは、発行時取引ベースで証券の購入または売却を行うことができる。証券は、認可されていても、市場で発行されていないため、かかる取引は条件付きで行われる。ファンドによる約定は、支払および交付を通常の決済期間を越えて行われ、当該証券があらかじめ決められた価格または利回りで売買される。ファンドは、当該証券の交付前に発行時取引証券の売却を行うことができ、この結果として実現利益または損失が生じることがある。

#### ４．金融デリバティブ商品

以下の開示は、特定のファンドによる金融デリバティブ商品の利用方法および利用事由ならびに金融デリバティブ商品がファンドの財務状態および運用結果にどのような影響を及ぼすかについての情報を含む。投資有価証券明細表で開示されるとおり、期末現在未決済の金融デリバティブ商品ならびに運用計算書で開示される当期中の金融デリバティブ商品にかかる実現損益および未実現評価損益の変動額は、ファンドの金融デリバティブ活動の取引高に対する指針の役割を果たす。

##### （a）為替予約契約

特定のファンドは、予定されている有価証券の購入または売却の決済に関連して、一部またはすべてのファンドの有価証券に付随する為替リスクをヘッジする目的で、あるいは投資戦略の一環として、為替予約契約を締結することができる。為替予約契約とは、将来において定められた価格で通貨を売買する２当事者間の契約である。外国為替レートの変動に伴い、為替予約契約の時価は変動する。

為替予約契約は日次で時価評価され、ファンドは価値の変動を未実現評価損益として計上する。契約締結時の価値と契約終了時の価値との差額に相当する実現損益は、通貨の受渡し時に計上される。これらの契約には、資産負債計算書に反映された未実現評価損益を上回る市場リスクが含まれる場合がある。さらに、相手方が契約条件を履行できない場合、または通貨価値が基準通貨に対して不利に変動した場合、ファンドはリスクにさらされる可能性がある。かかるリスクを軽減するために、現金または有価証券を、原契約の条項に従って担保として交換することができる。

特定のファンドは、米ドル以外の通貨に対するエクスポージャーを残すために、ファンド・レベルでヘッジの効果を相殺することを目的とし、為替予約契約が締結されたヘッジクラスを発行する。これらのクラス特定の為替予約契約が成功するという保証はない。

#### ５．市場リスクおよび信用リスク

ファンドは、実質的にすべての資産を対象ファンドに投資する。ファンドへの投資に付随するリスクは、対象ファンドが保有する有価証券およびその他の投資有価証券に付随するリスクと密接に関連している。ファンドがその投資目的を達成する能力は、対象ファンドがそれぞれの投資目的を達成する能力に左右される。対象ファンドがその投資目的を達成するとの保証はない。ファンドのNAVは、その投資先である対象ファンドの各NAVの変動に対応して変動する。投資運用実績およびファンドに付随するリスクが対象ファンドの投資運用実績およびリスクに連動する範囲は、ファンドの資産が対象ファンドへの投資に随時配分される範囲に左右されるが、その範囲は異なりうる。対象ファンドへの投資は、対象ファンドへの投資に直接表示されない特定の追加費用および税金の発生を伴うことがある。

投資運用実績は、その資産がファンドの資産配分の目標と範囲に応じてどのように配分および再配分されるかによって決まる。各ファンドへの投資に対する主要なリスクは、ファンドの資産配分を行う副投資顧問会社により、最善ではない、または誤った資産配分の決定がなされる可能性があることである。資産配分を行う副投資顧問会社は、一貫して質の高い運用実績をファンドに提供しようとする対象ファンドに対し、投資配分を特定するよう努めるが、かかる配分技法が望ましい結果をもたらすという保証はない。

## ６．報酬、費用および関連当事者

ファンドは、下記の表で示される年率（各ファンドのそれぞれのクラスの日々平均純資産額に対する割合として表示されている。）で支払われる管理報酬および代行協会員／販売会社報酬の対象となる。

受益者もまた、申込金額に基づく当初申込手数料の対象となる。

| ファンド                    | 管理報酬              | 代行協会員報酬 | 販売会社報酬 | 当初申込手数料 |
|-------------------------|-------------------|---------|--------|---------|
| ＴＲＦファンド                 |                   |         |        |         |
| 米ドル建クラス受益証券             | 0.41%             | 0.10%   | 0.15%  | 上限2.00% |
| 円建クラス受益証券               | 0.41%             | 0.10%   | 0.15%  | 上限2.00% |
| ＴＲＦファンド                 |                   |         |        |         |
| クラスＪ受益証券（日本円）           | 該当なし <sup>*</sup> | 該当なし    | 該当なし   | 該当なし    |
| クラスＪ受益証券<br>（日本円、ヘッジあり） | 該当なし <sup>*</sup> | 該当なし    | 該当なし   | 該当なし    |
| ＴＲＦＭＳファンド               |                   |         |        |         |
| 豪ドル建クラス受益証券             | 0.41%             | 0.10%   | 0.15%  | 上限2.00% |
| 豪ドル建ブラジルリアル<br>クラス受益証券  | 0.55%             | 0.10%   | 0.45%  | 上限3.50% |
| トルコリラ建クラス受益証券           | 0.55%             | 0.10%   | 0.45%  | 上限3.50% |
| 米ドル建ブラジルリアル<br>クラス受益証券  | 0.55%             | 0.10%   | 0.45%  | 上限3.50% |

<sup>\*</sup> クラスＪ受益証券（日本円）およびクラスＪ受益証券（日本円、ヘッジあり）につき、管理会社に支払われる管理報酬はない。パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（以下「投資顧問会社」という。）は、ＴＲＦファンドに投資する投資ビークルより管理報酬の支払いを受ける。

投資顧問会社は、トラストの特定の報酬の支払いに責任を負うものとする。当該報酬には、保管受託銀行および主管理事務代行会社に対して支払われる報酬が含まれる。また、投資顧問会社は、法律、監査および税務サービス等の継続的な通常業務、ならびに受益者向け定期報告書および情報交換を含む特定の受益者向けサービス機能に関連する報酬および費用を負担しなければならない。

各ファンド（ＴＲＦファンドを除く。）は、日々発生し、各暦月の最終営業日におけるルクセンブルグでの営業終了時点で後払いされる、資産ベースの報酬（以下「販売会社報酬」という。）を代行協会員および販売会社に対して毎月支払う。

## 7. 課税

ファンドは、ルクセンブルグの法令に従って課税される。ルクセンブルグの現行法規に従い、ファンドは、すべての機関投資家クラスについては、その純資産に対し年率0.01%の年次税（taxe d'abonnement）を、ならびにすべての非機関投資家クラスについては、その純資産に対し年率0.05%の年次税を課され、四半期毎に計算し支払う。かかる税金は、ファンドにより負担される。ファンドは、その組入証券から生じた収益から、当該国において適用される源泉税控除後の収益を回収する。対象ファンドに投資された資産は、年次税の対象とはならない。

## 8. 実現利益 /（損失）および未実現評価益 /（評価損）純変動額

2023年11月30日に終了した会計期間における投資有価証券、為替予約契約および外国通貨にかかる実現純利益 /（損失）ならびに未実現評価益 /（評価損）純変動額は、以下のとおり表示される。

|                                      | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド           | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド           | ピムコ・トータル・<br>リターン・ファンド<br>マルチカレンシー・<br>セレクション |
|--------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------------|
|                                      | 2023年11月30日に<br>終了した期間<br>（千米ドル） | 2023年11月30日に<br>終了した期間<br>（千米ドル） | 2023年11月30日に<br>終了した期間<br>（千米ドル）              |
| 投資有価証券にかかる<br>実現純利益                  | 746                              | 335                              | 0                                             |
| 投資有価証券にかかる<br>実現純（損失）                | 0                                | 0                                | (1,834)                                       |
| 投資有価証券にかかる<br>実現純利益 /（損失）            | 746                              | 335                              | (1,834)                                       |
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>実現純利益       | 101                              | 713                              | 6,907                                         |
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>実現純（損失）     | (398)                            | (2,760)                          | (14,128)                                      |
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>実現純利益 /（損失） | (297)                            | (2,047)                          | (7,221)                                       |
| 当期実現純利益 /（損失）                        | 449                              | (1,712)                          | (9,055)                                       |
| 投資有価証券にかかる<br>未実現評価益純変動額             | 0                                | (506)                            | 0                                             |
| 投資有価証券にかかる<br>未実現（評価損）純変動額           | (826)                            | 0                                | 1,663                                         |
| 投資有価証券にかかる<br>未実現評価益 /（評価損）<br>純変動額  | (826)                            | (506)                            | 1,663                                         |

|                                                 |       |     |       |
|-------------------------------------------------|-------|-----|-------|
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>未実現評価益純変動額             | 22    | 134 | 860   |
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>未実現（評価損）純変動額           | 77    | 589 | 2,363 |
| 為替予約契約および<br>外国通貨にかかる<br>未実現評価益 / （評価損）<br>純変動額 | 99    | 723 | 3,223 |
| 当期末実現評価益 /<br>（評価損）純変動額                         | (727) | 217 | 4,886 |

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。

#### 9．規制および訴訟事項

トラストは、いかなる重大な訴訟または調停手続の被告ともされておらず、トラストに対するいかなる重大な訴訟もしくは未解決または発生する恐れのある申立ても認識していない。

前述の事項は、2023年11月30日付においてのみ言及するものである。

#### 10．重大な事象

当会計期間中の重大な事象はなかった。

#### 11．後発事象

当期末後の後発事象はなかった。

[次へ](#)

## （２）投資有価証券明細表等

ピムコ・トータル・リターン・ファンド  
投資有価証券明細表  
2023年11月30日現在

| 銘柄                           | 受益証券      | 時価<br>(千米ドル)      | 純資産<br>比率%   |
|------------------------------|-----------|-------------------|--------------|
| <b>投資ファンド</b>                |           |                   |              |
| <b>集団投資スキーム</b>              |           |                   |              |
| ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド（a） | 1,679,246 | \$ 203,358        | 99.95        |
| <b>投資ファンド合計</b>              |           | <b>\$ 203,358</b> | <b>99.95</b> |

## OTC金融デリバティブ商品（金額：千単位\*、契約数を除く）

\* 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。

## ヘッジ為替予約契約

2023年11月30日現在、円建クラスは、以下の未決済為替予約契約を有していた。

| 取引相手方                  | 決済月<br>(月/年) | 通貨<br>引渡額 | 通貨<br>受取額 | 未実現<br>利益 | 未実現<br>(損失) | 未実現純利益<br>/ (損失)  | 純資産<br>比率%    |
|------------------------|--------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-------------------|---------------|
| BOA                    | 12/2023      | / 53,454  | \$ 360    | \$ 0      | \$ (1)      | \$ (1)            | 0.00          |
|                        | 01/2024      | \$ 360    | / 53,133  | 2         | 0           | 2                 | 0.00          |
| BPS                    | 12/2023      | / 104,255 | \$ 706    | 1         | 0           | 1                 | 0.00          |
|                        | 12/2023      | \$ 709    | / 105,603 | 6         | 0           | 6                 | 0.01          |
|                        | 01/2024      | 681       | 99,845    | 0         | (3)         | (3)               | 0.00          |
| CBK                    | 12/2023      | 371       | 55,526    | 5         | 0           | 5                 | 0.00          |
| MBC                    | 12/2023      | / 2,098   | \$ 14     | 0         | 0           | 0                 | 0.00          |
|                        | 12/2023      | \$ 695    | / 103,552 | 5         | 0           | 5                 | 0.00          |
| MYI                    | 12/2023      | / 40,611  | \$ 274    | 0         | (1)         | (1)               | 0.00          |
|                        | 01/2024      | \$ 274    | / 40,367  | 1         | 0           | 1                 | 0.00          |
| TOR                    | 12/2023      | 198       | 29,493    | 2         | 0           | 2                 | 0.00          |
| UAG                    | 12/2023      | / 8,993   | \$ 61     | 0         | 0           | 0                 | 0.00          |
|                        | 12/2023      | \$ 151    | / 22,442  | 1         | 0           | 1                 | 0.00          |
|                        | 01/2024      | 61        | 8,939     | 0         | 0           | 0                 | 0.00          |
|                        |              |           |           | \$ 23     | \$ (5)      | \$ 18             | 0.01          |
| <b>OTC金融デリバティブ商品合計</b> |              |           |           |           |             | <b>\$ 18</b>      | <b>0.01</b>   |
| <b>投資有価証券合計</b>        |              |           |           |           |             | <b>\$ 203,376</b> | <b>99.96</b>  |
| <b>その他の流動資産および負債</b>   |              |           |           |           |             | <b>\$ 83</b>      | <b>0.04</b>   |
| <b>純資産</b>             |              |           |           |           |             | <b>\$ 203,459</b> | <b>100.00</b> |

注記は本財務書類と不可分である。

ピムコ・トータル・リターン・ファンド  
投資有価証券明細表（続き）  
2023年11月30日現在

投資有価証券明細表に対する注記（金額：千単位\*）

\* 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。  
(a) ファンドの関係会社

OTC金融デリバティブ商品に対して（受領）／差入された担保

以下は、2023年11月30日現在の、相手方とのOTC金融デリバティブ商品の時価および（受領）／差入された担保の概要である。

| 取引相手方 | OTCデリバティブの時価総額 | 担保（受領）／差入 | エクスポージャー純額（1） |
|-------|----------------|-----------|---------------|
| BOA   | \$ 1           | \$ 0      | \$ 1          |
| BPS   | 4              | 0         | 4             |
| CBK   | 5              | 0         | 5             |
| MBC   | 5              | 0         | 5             |
| TOR   | 2              | 0         | 2             |
| UAG   | 1              | 0         | 1             |

（1）エクスポージャー純額は、債務不履行時の相手方からの未収金／（相手方への未払金）の純額を表す。

| 銘柄                              | 額面価格（千単位） | 公正価値（千米ドル）      | 純資産比率%       |
|---------------------------------|-----------|-----------------|--------------|
| <b>譲渡性のある有価証券</b>               |           |                 |              |
| <b>米国財務省短期証券</b>                |           |                 |              |
| 5.394% due 23/01/2024 (b)(c)    | \$ 800    | \$ 794          | 0.97         |
| 5.399% due 15/02/2024 (b)(c)    | 3,400     | 3,363           | 4.09         |
| 5.418% due 02/01/2024 (a)(b)(c) | 1,000     | 995             | 1.21         |
| 5.480% due 04/01/2024 (b)(c)    | 800       | 796             | 0.97         |
| 5.512% due 06/02/2024 (b)(c)    | 800       | 792             | 0.97         |
| 5.513% due 30/01/2024 (a)(b)(c) | 800       | 793             | 0.97         |
| 5.524% due 06/02/2024 (b)(c)    | 1,000     | 990             | 1.21         |
| 短期金融商品合計                        |           | 8,523           | 10.39        |
| <b>譲渡性のある有価証券合計</b>             |           | <b>\$ 8,523</b> | <b>10.39</b> |

投資ファンド  
集団投資スキーム

|                               |         |                  |              |
|-------------------------------|---------|------------------|--------------|
| ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド (d) | 594,812 | \$ 72,032        | 87.84        |
| <b>投資ファンド合計</b>               |         | <b>\$ 72,032</b> | <b>87.84</b> |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

## 投資有価証券明細表

2023年11月30日現在

OTC金融デリバティブ商品（金額：千単位\*、契約数を除く）

\* 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。

## 為替予約契約

| 取引相手方 | 決済月<br>(月/年) | 通貨<br>引渡額 | 通貨<br>受取額 | 未実現<br>利益 | 未実現<br>(損失) | 未実現純利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|-------|--------------|-----------|-----------|-----------|-------------|------------------|------------|
| BPS   | 12/2023      | \$ 5 AUD  | 7         | \$ 0      | \$ 0        | \$ 0             | 0.00       |
|       | 12/2023      |           | 35 TRY    | 1,007     | 0           | 0                | 0.00       |
| JPM   | 12/2023      | AUD 2 \$  | 1         | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
| MYI   | 12/2023      | \$ 6 AUD  | 10        | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       |              |           |           | \$ 0      | \$ 0        | \$ 0             | 0.00       |

## ヘッジ為替予約契約

2023年11月30日現在、豪ドル建クラスは、以下の未決済為替予約契約を有していた。

| 取引相手方 | 決済月<br>(月/年) |     | 通貨<br>引渡額 |     | 通貨<br>受取額 | 未実現<br>利益 |       | 未実現<br>(損失) |      | 未実現純利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |        |
|-------|--------------|-----|-----------|-----|-----------|-----------|-------|-------------|------|------------------|------------|--------|
| AZD   | 12/2023      | AUD | 21,674    | \$  | 14,355    | \$        | 0     | \$          | (16) | \$               | (16)       | (0.02) |
|       | 12/2023      | \$  | 4,505     | AUD | 7,090     |           | 196   |             | 0    |                  | 196        | 0.24   |
|       | 01/2024      |     | 14,372    |     | 21,674    |           | 17    |             | 0    |                  | 17         | 0.02   |
| BOA   | 12/2023      | AUD | 427       | \$  | 272       |           | 0     |             | (11) |                  | (11)       | (0.01) |
|       | 12/2023      | \$  | 4,390     | AUD | 6,918     |           | 197   |             | 0    |                  | 197        | 0.24   |
| BPS   | 12/2023      | AUD | 69        | \$  | 44        |           | 0     |             | (2)  |                  | (2)        | 0.00   |
| CBK   | 12/2023      | \$  | 681       | AUD | 1,063     |           | 24    |             | 0    |                  | 24         | 0.03   |
| MBC   | 12/2023      | AUD | 6,811     | \$  | 4,508     |           | 0     |             | (7)  |                  | (7)        | (0.01) |
|       | 12/2023      | \$  | 409       | AUD | 627       |           | 7     |             | 0    |                  | 7          | 0.01   |
|       | 01/2024      |     | 4,392     |     | 6,625     |           | 5     |             | 0    |                  | 5          | 0.01   |
| TOR   | 12/2023      |     | 8,236     |     | 12,925    |           | 335   |             | 0    |                  | 335        | 0.41   |
| UAG   | 12/2023      | AUD | 10,438    | \$  | 6,917     |           | 0     |             | (4)  |                  | (4)        | (0.01) |
|       | 12/2023      | \$  | 8,597     | AUD | 13,503    |           | 356   |             | 0    |                  | 356        | 0.43   |
|       | 01/2024      |     | 6,925     |     | 10,438    |           | 4     |             | 0    |                  | 4          | 0.00   |
|       |              |     |           |     |           | \$        | 1,141 | \$          | (40) | \$               | 1,101      | 1.34   |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

2023年11月30日現在、豪ドル建ブラジルリアルクラスおよび米ドル建ブラジルリアルクラスは、以下の未決済為替予約契約を有していた。

| 取引相手方 | 決済月<br>(月/年) | 通貨<br>引渡額  | 通貨<br>受取額  | 未実現<br>利益 | 未実現<br>(損失) | 未実現純利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|-------|--------------|------------|------------|-----------|-------------|------------------|------------|
| BOA   | 12/2023      | BRL 27,465 | \$ 5,599   | \$ 31     | \$ 0        | \$ 31            | 0.04       |
|       | 12/2023      | \$ 5       | BRL 25     | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 01/2024      | BRL 25     | \$ 5       | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 01/2024      | \$ 5,599   | BRL 27,554 | 0         | (32)        | (32)             | (0.04)     |
| BPS   | 12/2023      | BRL 783    | \$ 159     | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
| CBK   | 12/2023      | 27,934     | 5,705      | 42        | (1)         | 41               | 0.05       |
|       | 12/2023      | \$ 394     | BRL 1,951  | 3         | (1)         | 2                | 0.00       |
|       | 01/2024      | BRL 63     | \$ 13      | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 01/2024      | \$ 5,625   | BRL 27,622 | 0         | (44)        | (44)             | (0.05)     |
| DUB   | 12/2023      | BRL 233    | \$ 48      | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 5,302   | BRL 26,834 | 138       | 0           | 138              | 0.17       |
|       | 01/2024      | 48         | 234        | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
| FAR   | 12/2023      | 5,302      | 26,887     | 149       | 0           | 149              | 0.18       |
| GLM   | 12/2023      | BRL 919    | \$ 187     | 1         | 0           | 1                | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 5,515   | BRL 27,978 | 158       | (1)         | 157              | 0.19       |
|       | 01/2024      | 132        | 644        | 0         | (2)         | (2)              | 0.00       |
| JPM   | 12/2023      | BRL 27,703 | \$ 5,703   | 86        | 0           | 86               | 0.11       |
|       | 12/2023      | \$ 86      | BRL 420    | 0         | (1)         | (1)              | 0.00       |
|       | 01/2024      | 5,609      | 27,327     | 0         | (87)        | (87)             | (0.11)     |
| MYI   | 12/2023      | BRL 259    | \$ 51      | 0         | (1)         | (1)              | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 97      | BRL 491    | 2         | 0           | 2                | 0.00       |
| SOG   | 12/2023      | BRL 217    | \$ 44      | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 01/2024      | 338        | 69         | 1         | 0           | 1                | 0.00       |
| SSB   | 12/2023      | 25         | 5          | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
| TOR   | 12/2023      | 68         | 14         | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 209     | BRL 1,020  | 0         | (2)         | (2)              | 0.00       |
|       |              |            |            | \$ 611    | \$ (172)    | \$ 439           | 0.54       |

注記は本財務書類と不可分である。

ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション  
投資有価証券明細表（続き）  
2023年11月30日現在

2023年11月30日現在、トルコリラ建クラスは、以下の未決済為替予約契約を有していた。

| 取引相手方           | 決済月<br>(月/年) |     | 通貨<br>引渡額 | 通貨<br>受取額   | 未実現<br>利益 | 未実現<br>(損失) | 未実現純利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|-----------------|--------------|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|------------------|------------|
| BOA             | 12/2023      | TRY | 398       | \$ 14       | \$ 0      | \$ 0        | \$ 0             | 0.00       |
|                 | 12/2023      | \$  | 3,809     | TRY 111,143 | 35        | 0           | 35               | 0.04       |
| BPS             | 12/2023      | TRY | 2,066     | \$ 71       | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|                 | 12/2023      | \$  | 593       | TRY 17,322  | 5         | 0           | 5                | 0.01       |
| BRC             | 12/2023      | TRY | 349       | \$ 12       | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
| CBK             | 12/2023      | \$  | 4,847     | TRY 139,519 | 0         | (12)        | (12)             | (0.01)     |
|                 | 01/2024      |     | 4,220     | 127,658     | 59        | 0           | 59               | 0.07       |
| GLM             | 12/2023      |     | 4,193     | 121,604     | 11        | 0           | 11               | 0.01       |
|                 | 02/2024      |     | 4,385     | 135,334     | 65        | 0           | 65               | 0.08       |
| JPM             | 12/2023      | TRY | 783       | \$ 27       | 0         | 0           | 0                | 0.00       |
|                 | 01/2024      | \$  | 5,257     | TRY 158,379 | 47        | 0           | 47               | 0.06       |
| MBC             | 12/2023      | TRY | 2,440     | \$ 84       | 0         | (1)         | (1)              | 0.00       |
|                 | 12/2023      | \$  | 619       | TRY 17,954  | 3         | 0           | 3                | 0.00       |
| MYI             | 12/2023      |     | 4,578     | 133,528     | 28        | 0           | 28               | 0.03       |
| UAG             | 12/2023      |     | 4,751     | 138,322     | 23        | 0           | 23               | 0.03       |
|                 |              |     |           |             | \$ 276    | \$ (13)     | \$ 263           | 0.32       |
| OTC金融デリバティブ商品合計 |              |     |           |             |           |             | \$ 1,803         | 2.20       |
| 投資有価証券合計        |              |     |           |             |           |             | \$ 82,358        | 100.43     |
| その他の流動資産および負債   |              |     |           |             |           |             | \$ (356)         | (0.43)     |
| 純資産             |              |     |           |             |           |             | \$ 82,002        | 100.00     |

投資有価証券に対する注記（金額：千単位\*）

- \* 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。
- (a) 発行時決済証券
  - (b) ゼロ・クーポン証券
  - (c) クーポンは、満期までの利回りを表す。
  - (d) ファンドの関係会社

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクション

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## OTC金融デリバティブ商品に対して（受領）／差入された担保

以下は、2023年11月30日現在の、相手方とのOTC金融デリバティブ商品の時価および（受領）／差入された担保の概要である。

| 取引相手方 | OTCデリバティブ<br>の時価総額 | 担保<br>（受領）／差入 | エクスポージャー<br>純額（１） |
|-------|--------------------|---------------|-------------------|
| AZD   | \$ 197             | \$ 0          | \$ 197            |
| BOA   | 220                | 0             | 220               |
| BPS   | 3                  | 0             | 3                 |
| CBK   | 70                 | 0             | 70                |
| DUB   | 138                | 0             | 138               |
| FAR   | 149                | 0             | 149               |
| GLM   | 232                | (260)         | (28)              |
| JPM   | 45                 | 0             | 45                |
| MBC   | 7                  | 0             | 7                 |
| MYI   | 29                 | 0             | 29                |
| SOG   | 1                  | 0             | 1                 |
| TOR   | 333                | (280)         | 53                |
| UAG   | 379                | (270)         | 109               |

（１）エクスポージャー純額は、債務不履行時の相手方からの未収金／（相手方への未払金）の純額を表す。

注記は本財務書類と不可分である。

## 対象ファンド投資有価証券明細表

ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド  
投資有価証券明細表  
2023年11月30日現在

| 銘柄                                          |     | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------------|-----|---------------|----------------|------------|
| <b>譲渡性のある有価証券</b>                           |     |               |                |            |
| <b>アルゼンチン</b>                               |     |               |                |            |
| <b>ソブリン債</b>                                |     |               |                |            |
| Provincia de Buenos Aires                   |     |               |                |            |
| 129.664% due 12/04/2025 (a)                 | ARS | 409           | \$ 0           | 0.00       |
| <b>オーストラリア</b>                              |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                   |     |               |                |            |
| Commonwealth Bank of Australia              |     |               |                |            |
| 5.316% due 13/03/2026                       | \$  | 500           | 503            | 0.15       |
| Santos Finance Ltd.                         |     |               |                |            |
| 6.875% due 19/09/2033                       |     | 600           | 606            | 0.18       |
| オーストラリア合計                                   |     |               | 1,109          | 0.33       |
| <b>ベルギー</b>                                 |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                   |     |               |                |            |
| KBC Group NV                                |     |               |                |            |
| 5.796% due 19/01/2029                       |     | 300           | 298            | 0.09       |
| <b>バミューダ</b>                                |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                   |     |               |                |            |
| Aircastle Ltd.                              |     |               |                |            |
| 2.850% due 26/01/2028                       |     | 1,300         | 1,132          | 0.34       |
| <b>ブラジル</b>                                 |     |               |                |            |
| <b>ソブリン債</b>                                |     |               |                |            |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional           |     |               |                |            |
| 0.000% due 01/01/2024 (c)                   | BRL | 7,000         | 1,406          | 0.42       |
| <b>カナダ</b>                                  |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                   |     |               |                |            |
| Bank of Montreal                            |     |               |                |            |
| 5.203% due 01/02/2028                       | \$  | 400           | 399            | 0.12       |
| Bank of Nova Scotia                         |     |               |                |            |
| 4.750% due 02/02/2026                       |     | 800           | 790            | 0.24       |
| Enbridge, Inc.                              |     |               |                |            |
| 5.700% due 08/03/2033                       |     | 300           | 300            | 0.09       |
| Federation des Caisses Desjardins du Quebec |     |               |                |            |
| 5.700% due 14/03/2028                       |     | 500           | 502            | 0.15       |
| Open Text Corp.                             |     |               |                |            |
| 6.900% due 01/12/2027                       |     | 900           | 926            | 0.28       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                      |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Royal Bank of Canada<br>4.900% due 12/01/2028           | \$ | 300           | \$ 297         | 0.09       |
| Toronto-Dominion Bank<br>3.879% due 13/03/2026          | €  | 800           | 440            | 0.13       |
| 4.443% due 20/01/2025                                   |    | 400           | 875            | 0.26       |
| カナダ合計                                                   |    |               | 4,529          | 1.36       |
| <b>ケイマン諸島</b>                                           |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                                               |    |               |                |            |
| Gaci First Investment Co.<br>5.125% due 14/02/2053      | \$ | 600           | 503            | 0.15       |
| <b>デンマーク</b>                                            |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                                               |    |               |                |            |
| Danske Bank A/S<br>6.259% due 22/09/2026                |    | 600           | 604            | 0.18       |
| 6.500% due 23/08/2028                                   | £  | 500           | 650            | 0.20       |
| TDC Net A/S<br>5.056% due 31/05/2028                    | €  | 800           | 875            | 0.26       |
| デンマーク合計                                                 |    |               | 2,129          | 0.64       |
| <b>フィンランド</b>                                           |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                                               |    |               |                |            |
| Kojamo Oyj<br>1.875% due 27/05/2027                     |    | 1,500         | 1,430          | 0.43       |
| <b>フランス</b>                                             |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                                               |    |               |                |            |
| Altarea S.C.A.<br>1.875% due 17/01/2028                 |    | 900           | 808            | 0.24       |
| BNP Paribas S.A.<br>1.904% due 30/09/2028               | \$ | 1,400         | 1,213          | 0.37       |
| 5.125% due 13/01/2029                                   |    | 300           | 295            | 0.09       |
| BPCE S.A.<br>5.748% due 19/07/2033                      |    | 800           | 764            | 0.23       |
| 6.612% due 19/10/2027                                   |    | 600           | 608            | 0.18       |
| Credit Agricole S.A.<br>0.500% due 21/09/2029           | €  | 1,000         | 930            | 0.28       |
| Electricite de France S.A.<br>3.750% due 05/06/2027 (b) |    | 600           | 657            | 0.20       |
| 4.250% due 25/01/2032                                   |    | 600           | 663            | 0.20       |
| 5.700% due 23/05/2028                                   | \$ | 300           | 304            | 0.09       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                                                          |    | 額面価格<br>(千単位)            | 公正価値<br>(千米ドル)        | 純資産<br>比率%           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----|--------------------------|-----------------------|----------------------|
| RCI Banque S.A.<br>2.000% due 11/07/2024                                                    | €  | 1,200 \$                 | 1,293                 | 0.39                 |
| Societe Generale S.A.<br>1.488% due 14/12/2026<br>6.446% due 10/01/2029                     | \$ | 1,200<br>400             | 1,086<br>404          | 0.33<br>0.12         |
| Worldline S.A.<br>4.125% due 12/09/2028                                                     | €  | 300                      | 315                   | 0.09                 |
| フランス合計                                                                                      |    |                          | 9,340                 | 2.81                 |
| <b>ドイツ</b>                                                                                  |    |                          |                       |                      |
| <b>社債</b>                                                                                   |    |                          |                       |                      |
| Deutsche Bank AG<br>1.000% due 19/11/2025<br>1.750% due 19/11/2030<br>3.961% due 26/11/2025 |    | 100<br>1,100<br>\$ 1,300 | 105<br>1,001<br>1,266 | 0.03<br>0.30<br>0.38 |
| DZ Bank AG<br>4.637% due 16/11/2026                                                         | €  | 400                      | 437                   | 0.14                 |
| ドイツ合計                                                                                       |    |                          | 2,809                 | 0.85                 |
| <b>インド</b>                                                                                  |    |                          |                       |                      |
| <b>社債</b>                                                                                   |    |                          |                       |                      |
| ReNew Wind Energy AP2<br>4.500% due 14/07/2028                                              | \$ | 1,000                    | 858                   | 0.26                 |
| <b>アイルランド</b>                                                                               |    |                          |                       |                      |
| <b>アセット・バック証券</b>                                                                           |    |                          |                       |                      |
| Aqueduct European CLO DAC<br>4.633% due 20/07/2030                                          | €  | 1,016                    | 1,099                 | 0.33                 |
| Ares European CLO DAC<br>4.745% due 15/10/2031                                              |    | 987                      | 1,063                 | 0.32                 |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC<br>4.615% due 15/07/2030                                      |    | 642                      | 696                   | 0.21                 |
| Bosphorus CLO DAC<br>4.665% due 15/12/2030                                                  |    | 1,121                    | 1,211                 | 0.36                 |
| Bridgepoint CLO DAC<br>5.175% due 15/01/2034                                                |    | 1,000                    | 1,082                 | 0.33                 |
| Bridgepoint CLO DAC<br>5.175% due 15/01/2034                                                |    | 1,098                    | 1,179                 | 0.36                 |
| GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC<br>4.893% due 20/01/2032                             |    | 1,000                    | 1,076                 | 0.32                 |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                               |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|------------------------------------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Harvest CLO DAC<br>4.815% due 15/01/2032                         | €  | 1,100 \$      | 1,180          | 0.36       |
| Invesco Euro CLO DAC<br>4.615% due 15/07/2031                    |    | 1,100         | 1,177          | 0.35       |
| Madison Park Euro Funding DAC<br>4.765% due 15/07/2032           |    | 800           | 859            | 0.26       |
| Marlay Park CLO DAC<br>4.705% due 15/10/2030                     |    | 1,141         | 1,235          | 0.37       |
| OCP Euro CLO DAC<br>4.882% due 22/09/2034                        |    | 1,200         | 1,280          | 0.39       |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>4.685% due 15/10/2031 |    | 782           | 839            | 0.25       |
| 4.745% due 15/04/2031                                            |    | 735           | 789            | 0.24       |
| Palmerston Park CLO DAC<br>4.625% due 18/04/2030                 |    | 449           | 485            | 0.15       |
| Purple Finance CLO DAC<br>4.756% due 25/01/2031                  |    | 479           | 521            | 0.16       |
| Segovia European CLO DAC<br>4.745% due 18/01/2031                |    | 2,094         | 2,249          | 0.68       |
| 4.873% due 20/07/2032                                            |    | 1,000         | 1,075          | 0.32       |
| Toro European CLO DAC<br>4.705% due 15/10/2030                   |    | 408           | 441            | 0.13       |
| 4.908% due 12/01/2032                                            |    | 1,000         | 1,074          | 0.32       |
|                                                                  |    |               | 20,610         | 6.21       |
| <b>社債</b>                                                        |    |               |                |            |
| AerCap Ireland Capital DAC<br>2.875% due 14/08/2024              | \$ | 300           | 293            | 0.09       |
| 6.100% due 15/01/2027                                            |    | 400           | 402            | 0.12       |
| AIB Group PLC<br>2.875% due 30/05/2031                           | €  | 1,200         | 1,229          | 0.37       |
| SMBC Aviation Capital Finance DAC<br>5.450% due 03/05/2028       | \$ | 500           | 493            | 0.15       |
|                                                                  |    |               | 2,417          | 0.73       |
| <b>非政府モーゲージ・バック証券</b>                                            |    |               |                |            |
| Primrose Residential DAC<br>4.568% due 24/03/2061                | €  | 1,113         | 1,210          | 0.36       |
| アイルランド合計                                                         |    |               | 24,237         | 7.30       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                    |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| <b>イスラエル</b>                          |    |               |                |            |
| <b>ソブリン債</b>                          |    |               |                |            |
| Israel Government International Bond  |    |               |                |            |
| 5.000% due 30/10/2026                 | €  | 700           | \$ 773         | 0.23       |
| <b>イタリア</b>                           |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                             |    |               |                |            |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA   |    |               |                |            |
| 6.750% due 05/09/2027                 |    | 800           | 893            | 0.27       |
| Intesa Sanpaolo SpA                   |    |               |                |            |
| 7.200% due 28/11/2033                 | \$ | 700           | 709            | 0.22       |
| UniCredit SpA                         |    |               |                |            |
| 7.830% due 04/12/2023                 |    | 2,600         | 2,600          | 0.78       |
| イタリア合計                                |    |               | 4,202          | 1.27       |
| <b>日本</b>                             |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                             |    |               |                |            |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.  |    |               |                |            |
| 1.412% due 17/07/2025                 |    | 1,700         | 1,590          | 0.48       |
| 5.719% due 20/02/2026                 |    | 500           | 500            | 0.15       |
| Mizuho Financial Group, Inc.          |    |               |                |            |
| 2.201% due 10/07/2031                 |    | 1,100         | 884            | 0.27       |
| 5.414% due 13/09/2028                 |    | 500           | 498            | 0.15       |
| Nissan Motor Co. Ltd.                 |    |               |                |            |
| 4.810% due 17/09/2030                 |    | 1,400         | 1,247          | 0.38       |
| Nomura Holdings, Inc.                 |    |               |                |            |
| 2.172% due 14/07/2028                 |    | 100           | 86             | 0.03       |
| 5.709% due 09/01/2026                 |    | 600           | 599            | 0.18       |
| 5.842% due 18/01/2028                 |    | 500           | 501            | 0.15       |
| 6.181% due 18/01/2033                 |    | 300           | 308            | 0.09       |
| ORIX Corp.                            |    |               |                |            |
| 1.919% due 20/04/2026                 | €  | 900           | 941            | 0.28       |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. |    |               |                |            |
| 1.902% due 17/09/2028                 | \$ | 700           | 599            | 0.18       |
| 5.520% due 13/01/2028                 |    | 400           | 402            | 0.12       |
| 日本合計                                  |    |               | 8,155          | 2.46       |
| <b>ルクセンブルグ</b>                        |    |               |                |            |
| <b>社債</b>                             |    |               |                |            |
| CPI Property Group S.A.               |    |               |                |            |
| 2.750% due 12/05/2026                 | €  | 900           | 807            | 0.24       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                     |     | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|----------------------------------------|-----|---------------|----------------|------------|
| Logicor Financing SARL                 |     |               |                |            |
| 2.000% due 17/01/2034                  | €   | 900           | \$ 711         | 0.22       |
| 2.750% due 15/01/2030                  | £   | 1,200         | 1,193          | 0.36       |
| ルクセンブルグ合計                              |     |               | 2,711          | 0.82       |
| <b>メキシコ</b>                            |     |               |                |            |
| <b>ソブリン債</b>                           |     |               |                |            |
| Mexico Government International Bond   |     |               |                |            |
| 2.750% due 27/11/2031 (d)              | MXN | 9,927         | 495            | 0.15       |
| 3.000% due 03/12/2026 (d)              |     | 4,288         | 230            | 0.07       |
| 4.000% due 30/11/2028 (d)              |     | 7,465         | 417            | 0.13       |
| 8.500% due 01/03/2029                  |     | 13,000        | 722            | 0.22       |
| 8.500% due 31/05/2029                  |     | 5,000         | 278            | 0.08       |
| メキシコ合計                                 |     |               | 2,142          | 0.65       |
| <b>オランダ</b>                            |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                              |     |               |                |            |
| ABN AMRO Bank NV                       |     |               |                |            |
| 6.339% due 18/09/2027                  | \$  | 600           | 603            | 0.18       |
| 6.575% due 13/10/2026                  |     | 300           | 303            | 0.09       |
| Cooperatieve Rabobank UA               |     |               |                |            |
| 4.375% due 04/08/2025                  |     | 1,000         | 970            | 0.29       |
| 4.655% due 22/08/2028                  |     | 800           | 769            | 0.23       |
| CTP NV                                 |     |               |                |            |
| 0.500% due 21/06/2025                  | €   | 500           | 507            | 0.15       |
| 0.625% due 27/09/2026                  |     | 1,000         | 960            | 0.29       |
| Enel Finance International NV          |     |               |                |            |
| 0.375% due 28/05/2029                  |     | 700           | 642            | 0.19       |
| 1.875% due 12/07/2028                  | \$  | 1,200         | 1,020          | 0.31       |
| JDE Peet 's NV                         |     |               |                |            |
| 4.125% due 23/01/2030 (b)              | €   | 1,500         | 1,641          | 0.49       |
| JT International Financial Services BV |     |               |                |            |
| 3.875% due 28/09/2028                  | \$  | 600           | 561            | 0.17       |
| OCI NV                                 |     |               |                |            |
| 6.700% due 16/03/2033                  |     | 300           | 293            | 0.09       |
| Sandoz Finance BV                      |     |               |                |            |
| 4.500% due 17/11/2033                  | €   | 400           | 448            | 0.14       |
| オランダ合計                                 |     |               | 8,717          | 2.62       |
| <b>ポルトガル</b>                           |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                              |     |               |                |            |
| Banco Espirito Santo S.A.              |     |               |                |            |
| 4.750% due 15/01/2018 ^                |     | 800           | 240            | 0.07       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                         |     | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|--------------------------------------------|-----|---------------|----------------|------------|
| <b>シンガポール</b>                              |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                  |     |               |                |            |
| DBS Group Holdings Ltd.                    |     |               |                |            |
| 5.958% due 12/09/2025                      | \$  | 700           | 701            | 0.21       |
| <b>南アフリカ</b>                               |     |               |                |            |
| <b>ソブリン債</b>                               |     |               |                |            |
| South Africa Government International Bond |     |               |                |            |
| 10.500% due 21/12/2026                     | ZAR | 32,400        | 1,786          | 0.54       |
| <b>韓国</b>                                  |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                  |     |               |                |            |
| Kookmin Bank                               |     |               |                |            |
| 4.500% due 01/02/2029 (e)                  | \$  | 1,200         | 1,123          | 0.34       |
| <b>スペイン</b>                                |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                  |     |               |                |            |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.       |     |               |                |            |
| 1.125% due 18/09/2025                      |     | 700           | 645            | 0.19       |
| Banco Santander S.A.                       |     |               |                |            |
| 1.849% due 25/03/2026                      |     | 800           | 729            | 0.22       |
| スペイン合計                                     |     |               | 1,374          | 0.41       |
| <b>国際機関</b>                                |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                  |     |               |                |            |
| European Investment Bank                   |     |               |                |            |
| 0.750% due 15/11/2024                      | £   | 1,500         | 1,823          | 0.55       |
| International Development Association      |     |               |                |            |
| 0.750% due 21/09/2028                      |     | 800           | 854            | 0.25       |
| 1.750% due 05/05/2037                      | €   | 800           | 730            | 0.22       |
|                                            |     |               | 3,407          | 1.02       |
| <b>ソブリン債</b>                               |     |               |                |            |
| European Union                             |     |               |                |            |
| 0.000% due 04/10/2028 (c)                  |     | 1,000         | 950            | 0.29       |
| 国際機関合計                                     |     |               | 4,357          | 1.31       |
| <b>スウェーデン</b>                              |     |               |                |            |
| <b>社債</b>                                  |     |               |                |            |
| EQT AB                                     |     |               |                |            |
| 2.375% due 06/04/2028                      |     | 800           | 807            | 0.24       |
| 2.875% due 06/04/2032                      |     | 800           | 743            | 0.23       |
| Sagax AB                                   |     |               |                |            |
| 1.125% due 30/01/2027                      |     | 1,000         | 966            | 0.29       |
| スウェーデン合計                                   |     |               | 2,516          | 0.76       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                              | 額面価格<br>（千単位） | 公正価値<br>（千米ドル） | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------|---------------|----------------|------------|
| <b>スイス</b>                      |               |                |            |
| <b>社債</b>                       |               |                |            |
| UBS Group AG                    |               |                |            |
| 2.193% due 05/06/2026           | \$ 1,700      | \$ 1,599       | 0.48       |
| 5.711% due 12/01/2027           | 800           | 797            | 0.24       |
| 6.327% due 22/12/2027           | 600           | 607            | 0.18       |
| スイス合計                           |               | 3,003          | 0.90       |
| <b>英国</b>                       |               |                |            |
| <b>社債</b>                       |               |                |            |
| Babcock International Group PLC |               |                |            |
| 1.375% due 13/09/2027           | € 900         | 887            | 0.27       |
| Barclays PLC                    |               |                |            |
| 3.125% due 17/01/2024           | £ 500         | 631            | 0.19       |
| 7.325% due 02/11/2026           | \$ 500        | 512            | 0.16       |
| 7.385% due 02/11/2028           | 400           | 417            | 0.13       |
| BAT International Finance PLC   |               |                |            |
| 5.931% due 02/02/2029           | 700           | 711            | 0.21       |
| Berkeley Group PLC              |               |                |            |
| 2.500% due 11/08/2031           | £ 800         | 731            | 0.22       |
| Chanel Ceres PLC                |               |                |            |
| 0.500% due 31/07/2026           | € 700         | 701            | 0.21       |
| HSBC Holdings PLC               |               |                |            |
| 7.390% due 03/11/2028           | \$ 1,000      | 1,057          | 0.32       |
| Imperial Brands Finance PLC     |               |                |            |
| 3.500% due 26/07/2026           | 1,100         | 1,037          | 0.31       |
| Informa PLC                     |               |                |            |
| 2.125% due 06/10/2025           | € 1,200       | 1,264          | 0.38       |
| Lloyds Banking Group PLC        |               |                |            |
| 3.900% due 12/03/2024           | \$ 1,300      | 1,293          | 0.39       |
| 5.520% due 07/03/2025           | AUD 1,000     | 664            | 0.20       |
| Nationwide Building Society     |               |                |            |
| 6.557% due 18/10/2027           | \$ 600        | 609            | 0.18       |
| Santander UK Group Holdings PLC |               |                |            |
| 6.833% due 21/11/2026           | 700           | 706            | 0.21       |
| Standard Chartered PLC          |               |                |            |
| 6.301% due 09/01/2029           | 700           | 703            | 0.21       |
| 7.776% due 16/11/2025           | 500           | 508            | 0.15       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                                    |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|-----------------------------------------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Thames Water Utilities Finance PLC<br>8.250% due 25/04/2040           | £  | 500 \$        | 685            | 0.21       |
| Yorkshire Building Society<br>3.511% due 11/10/2030                   |    | 800           | 868            | 0.26       |
|                                                                       |    |               | 13,984         | 4.21       |
| <b>非政府モーゲージ・バック証券</b>                                                 |    |               |                |            |
| Alba PLC<br>5.509% due 17/03/2039                                     |    | 223           | 273            | 0.08       |
| Eurosail PLC<br>6.289% due 13/06/2045                                 |    | 403           | 508            | 0.15       |
| Great Hall Mortgages PLC<br>5.739% due 18/06/2039                     | \$ | 307           | 305            | 0.09       |
| Ludgate Funding PLC<br>6.014% due 01/01/2061                          | £  | 583           | 711            | 0.21       |
| Newgate Funding PLC<br>5.510% due 01/12/2050                          |    | 465           | 567            | 0.17       |
| Resloc UK PLC<br>4.005% due 15/12/2043                                | €  | 891           | 937            | 0.28       |
| 5.499% due 15/12/2043                                                 | £  | 611           | 747            | 0.23       |
| Ripon Mortgages PLC<br>5.921% due 28/08/2056                          |    | 957           | 1,211          | 0.37       |
| 6.371% due 28/08/2056                                                 |    | 1,400         | 1,739          | 0.52       |
| RMAC PLC<br>0.000% due 15/02/2047                                     |    | 800           | 1,016          | 0.31       |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>6.366% due 20/10/2051              |    | 570           | 723            | 0.22       |
| 6.571% due 20/05/2045                                                 |    | 1,364         | 1,728          | 0.52       |
| 6.572% due 20/07/2045                                                 |    | 520           | 659            | 0.20       |
| Uropa Securities PLC<br>5.540% due 10/10/2040                         |    | 1,134         | 1,391          | 0.42       |
|                                                                       |    |               | 12,515         | 3.77       |
| 英国合計                                                                  |    |               | 26,499         | 7.98       |
| <b>米国</b>                                                             |    |               |                |            |
| <b>アセット・バック証券</b>                                                     |    |               |                |            |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>5.707% due 25/04/2037 ^ | \$ | 201           | 298            | 0.09       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                                                            | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| CIT Mortgage Loan Trust<br>6.807% due 25/10/2037                                              | \$ 6          | \$ 6           | 0.00       |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates<br>6.402% due 25/10/2034 | 536           | 509            | 0.15       |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>6.237% due 25/01/2036                                  | 587           | 582            | 0.18       |
| Countrywide Asset-Backed Certificates<br>6.357% due 25/03/2047 ^                              | 1,426         | 1,064          | 0.32       |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>5.997% due 25/12/2034                    | 831           | 798            | 0.24       |
| GSAA Home Equity Trust<br>5.817% due 25/07/2037                                               | 187           | 167            | 0.05       |
| Home Equity Asset Trust<br>6.237% due 25/10/2034                                              | 343           | 336            | 0.10       |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.<br>6.042% due 25/05/2035                                  | 622           | 608            | 0.18       |
| MF1 LLC<br>7.483% due 19/06/2037                                                              | 700           | 699            | 0.21       |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust<br>5.892% due 25/03/2036                 | 263           | 258            | 0.08       |
| Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates<br>6.147% due 25/11/2035             | 670           | 626            | 0.19       |
| Residential Asset Mortgage Products Trust<br>6.027% due 25/01/2036                            | 745           | 720            | 0.22       |
| Residential Asset Securities Corp. Trust<br>5.582% due 25/01/2034                             | 220           | 218            | 0.07       |
| 6.087% due 25/12/2035                                                                         | 361           | 359            | 0.11       |
| Structured Asset Investment Loan Trust<br>6.177% due 25/10/2035                               | 248           | 238            | 0.07       |
| 6.222% due 25/08/2035                                                                         | 683           | 648            | 0.19       |
| Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.<br>5.169% due 01/04/2041                       | 500           | 493            | 0.15       |
|                                                                                               |               | 8,627          | 2.60       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                            | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| <b>社債</b>                                                     |               |                |            |
| AES Corp.<br>5.450% due 01/06/2028                            | \$ 500        | \$ 496         | 0.15       |
| Ally Financial, Inc.<br>5.800% due 01/05/2025                 | 1,400         | 1,390          | 0.42       |
| American Airlines Pass-Through Trust<br>2.875% due 11/01/2036 | 473           | 385            | 0.12       |
| American Honda Finance Corp.<br>5.000% due 23/05/2025         | 800           | 797            | 0.24       |
| 6.027% due 10/01/2025                                         | 400           | 400            | 0.12       |
| 6.064% due 22/11/2024                                         | 200           | 200            | 0.06       |
| American Tower Corp.<br>3.375% due 15/10/2026                 | 800           | 755            | 0.23       |
| Amgen, Inc.<br>5.750% due 02/03/2063                          | 500           | 490            | 0.15       |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.<br>6.125% due 15/09/2028 | 600           | 616            | 0.19       |
| Avangrid, Inc.<br>3.800% due 01/06/2029                       | 1,600         | 1,457          | 0.44       |
| Aviation Capital Group LLC<br>6.250% due 15/04/2028           | 700           | 693            | 0.21       |
| 6.750% due 25/10/2028                                         | 300           | 304            | 0.09       |
| Bank of America Corp.<br>4.376% due 27/04/2028                | 600           | 577            | 0.17       |
| 5.933% due 15/09/2027                                         | 800           | 806            | 0.24       |
| Bayer U.S. Finance LLC<br>6.125% due 21/11/2026               | 700           | 702            | 0.21       |
| 6.500% due 21/11/2033                                         | 600           | 596            | 0.18       |
| Brandywine Operating Partnership LP<br>3.950% due 15/11/2027  | 800           | 693            | 0.21       |
| British Airways Pass-Through Trust<br>4.250% due 15/05/2034   | 750           | 679            | 0.20       |
| Broadcom, Inc.<br>3.137% due 15/11/2035                       | 1,355         | 1,055          | 0.32       |
| 3.419% due 15/04/2033                                         | 1,200         | 1,009          | 0.30       |
| 4.300% due 15/11/2032                                         | 1,400         | 1,287          | 0.39       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                               |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|------------------------------------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Centene Corp.<br>3.000% due 15/10/2030                           | \$ | 400           | \$ 334         | 0.10       |
| CenterPoint Energy Houston Electric LLC<br>5.200% due 01/10/2028 |    | 500           | 505            | 0.15       |
| CenterPoint Energy Resources Corp.<br>5.200% due 01/10/2028      |    | 600           | 603            | 0.18       |
| Cheniere Energy Partners LP<br>3.250% due 31/01/2032             |    | 600           | 494            | 0.15       |
| Citibank N.A.<br>5.488% due 04/12/2026 (b)                       |    | 1,000         | 1,005          | 0.30       |
| 5.803% due 29/09/2028                                            |    | 500           | 510            | 0.15       |
| Constellation Energy Generation LLC<br>5.600% due 01/03/2028     |    | 400           | 403            | 0.12       |
| Corebridge Global Funding<br>5.750% due 02/07/2026               |    | 200           | 200            | 0.06       |
| 5.900% due 19/09/2028                                            |    | 400           | 405            | 0.12       |
| Crown Castle, Inc.<br>3.650% due 01/09/2027                      |    | 600           | 561            | 0.17       |
| 4.800% due 01/09/2028                                            |    | 600           | 580            | 0.17       |
| CVS Health Corp.<br>5.000% due 30/01/2029                        |    | 500           | 497            | 0.15       |
| CVS Pass-Through Trust<br>6.943% due 10/01/2030                  |    | 44            | 45             | 0.01       |
| Digital Euro Finco LLC<br>2.625% due 15/04/2024                  | €  | 2,300         | 2,491          | 0.75       |
| Duke Energy Florida LLC<br>2.500% due 01/12/2029                 | \$ | 700           | 608            | 0.18       |
| Edison International<br>3.550% due 15/11/2024                    |    | 900           | 879            | 0.26       |
| Emory University<br>2.143% due 01/09/2030                        |    | 1,400         | 1,164          | 0.35       |
| Energy Transfer LP<br>4.400% due 15/03/2027                      |    | 600           | 577            | 0.17       |
| 6.050% due 01/12/2026                                            |    | 300           | 304            | 0.09       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                               | 額面価格<br>（千単位） | 公正価値<br>（千米ドル） | 純資産<br>比率% |
|------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| EPR Properties<br>4.950% due 15/04/2028                          | \$ 1,600      | \$ 1,462       | 0.44       |
| Equinix, Inc.<br>2.625% due 18/11/2024                           | 1,300         | 1,261          | 0.38       |
| Equitable Financial Life Global Funding<br>5.450% due 03/03/2028 | 300           | 297            | 0.09       |
| Eversource Energy<br>4.750% due 15/05/2026                       | 600           | 589            | 0.18       |
| Exelon Corp.<br>5.150% due 15/03/2028                            | 500           | 500            | 0.15       |
| Florida Power & Light Co.<br>5.050% due 01/04/2028               | 500           | 501            | 0.15       |
| GLP Capital LP<br>5.300% due 15/01/2029                          | 1,100         | 1,053          | 0.32       |
| GN Bondco LLC<br>9.500% due 15/10/2031                           | 200           | 190            | 0.06       |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>3.272% due 29/09/2025               | 1,800         | 1,761          | 0.53       |
| 6.484% due 24/10/2029                                            | 500           | 518            | 0.16       |
| Goodman U.S. Finance Four LLC<br>4.500% due 15/10/2037           | 1,400         | 1,140          | 0.34       |
| GTCR W-2 Merger Sub LLC<br>7.500% due 15/01/2031                 | 300           | 306            | 0.09       |
| Hyundai Capital America<br>1.000% due 17/09/2024                 | 550           | 530            | 0.16       |
| 1.650% due 17/09/2026                                            | 1,100         | 985            | 0.30       |
| 6.512% due 04/08/2025                                            | 300           | 300            | 0.09       |
| Intel Corp.<br>5.125% due 10/02/2030                             | 500           | 507            | 0.15       |
| Jackson National Life Global Funding<br>6.498% due 28/06/2024    | 450           | 451            | 0.14       |
| JPMorgan Chase & Co.<br>3.509% due 23/01/2029                    | 600           | 558            | 0.17       |
| 3.960% due 29/01/2027                                            | 900           | 871            | 0.26       |
| 5.299% due 24/07/2029                                            | 700           | 698            | 0.21       |
| 6.070% due 22/10/2027                                            | 600           | 610            | 0.18       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                      |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|-----------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Marriott International, Inc.            |    |               |                |            |
| 3.500% due 15/10/2032                   | \$ | 1,400         | \$ 1,190       | 0.36       |
| 5.450% due 15/09/2026                   |    | 500           | 503            | 0.15       |
| MassMutual Global Funding               |    |               |                |            |
| 5.050% due 07/12/2027                   |    | 600           | 597            | 0.18       |
| 6.337% due 10/07/2026                   |    | 400           | 401            | 0.12       |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC |    |               |                |            |
| 4.800% due 30/03/2028                   |    | 700           | 691            | 0.21       |
| Metropolitan Edison Co.                 |    |               |                |            |
| 5.200% due 01/04/2028                   |    | 300           | 296            | 0.09       |
| Morgan Stanley                          |    |               |                |            |
| 5.050% due 28/01/2027                   |    | 600           | 595            | 0.18       |
| 6.138% due 16/10/2026                   |    | 600           | 605            | 0.18       |
| 6.407% due 01/11/2029                   |    | 400           | 414            | 0.12       |
| National Securities Clearing Corp.      |    |               |                |            |
| 5.000% due 30/05/2028                   |    | 550           | 550            | 0.17       |
| 5.100% due 21/11/2027                   |    | 500           | 502            | 0.15       |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.   |    |               |                |            |
| 3.550% due 01/05/2027                   |    | 1,500         | 1,421          | 0.43       |
| 6.051% due 01/03/2025                   |    | 400           | 402            | 0.12       |
| Niagara Mohawk Power Corp.              |    |               |                |            |
| 4.278% due 15/12/2028                   |    | 1,600         | 1,520          | 0.46       |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC         |    |               |                |            |
| 2.450% due 15/09/2028                   |    | 1,360         | 1,125          | 0.34       |
| Ohio Power Co.                          |    |               |                |            |
| 5.000% due 01/06/2033                   |    | 500           | 481            | 0.15       |
| Omega Healthcare Investors, Inc.        |    |               |                |            |
| 4.500% due 15/01/2025                   |    | 1,200         | 1,173          | 0.35       |
| Oncor Electric Delivery Co. LLC         |    |               |                |            |
| 4.300% due 15/05/2028                   |    | 500           | 485            | 0.15       |
| ONEOK, Inc.                             |    |               |                |            |
| 5.850% due 15/01/2026                   |    | 600           | 605            | 0.18       |
| Oracle Corp.                            |    |               |                |            |
| 4.650% due 06/05/2030                   |    | 300           | 290            | 0.09       |
| 6.150% due 09/11/2029 (f)               |    | 300           | 315            | 0.10       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                                     | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| Pacific Gas & Electric Co.<br>3.150% due 01/01/2026                    | \$ 800        | \$ 754         | 0.23       |
| 3.750% due 15/02/2024                                                  | 1,600         | 1,591          | 0.48       |
| 4.550% due 01/07/2030                                                  | 700           | 643            | 0.19       |
| 6.100% due 15/01/2029                                                  | 700           | 704            | 0.21       |
| Pacific Life Global Funding<br>4.900% due 04/04/2028                   | 400           | 392            | 0.12       |
| 5.500% due 18/07/2028                                                  | 300           | 301            | 0.09       |
| Penske Truck Leasing Co. LP<br>3.450% due 01/07/2024                   | 1,200         | 1,182          | 0.36       |
| Pioneer Natural Resources Co.<br>5.100% due 29/03/2026                 | 300           | 299            | 0.09       |
| Public Service Co. of Colorado<br>1.900% due 15/01/2031                | 1,100         | 875            | 0.26       |
| Republic Services, Inc.<br>3.375% due 15/11/2027                       | 500           | 472            | 0.14       |
| Retail Opportunity Investments Partnership LP<br>6.750% due 15/10/2028 | 600           | 603            | 0.18       |
| RGA Global Funding<br>6.000% due 21/11/2028                            | 600           | 606            | 0.18       |
| Santander Holdings USA, Inc.<br>6.499% due 09/03/2029                  | 575           | 581            | 0.18       |
| SBA Tower Trust<br>2.328% due 15/07/2052                               | 1,100         | 951            | 0.29       |
| Southern California Edison Co.<br>5.850% due 01/11/2027                | 800           | 821            | 0.25       |
| Southern Power Co.<br>0.900% due 15/01/2026                            | 1,000         | 910            | 0.27       |
| Southwest Airlines Co.<br>5.250% due 04/05/2025                        | 300           | 298            | 0.09       |
| Southwest Gas Corp.<br>5.450% due 23/03/2028                           | 500           | 499            | 0.15       |
| Sutter Health<br>5.164% due 15/08/2033                                 | 700           | 686            | 0.21       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                      |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|-----------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| T-Mobile USA, Inc.                      |    |               |                |            |
| 4.800% due 15/07/2028                   | \$ | 500           | \$ 493         | 0.15       |
| 4.950% due 15/03/2028                   |    | 600           | 596            | 0.18       |
| Tapestry, Inc.                          |    |               |                |            |
| 5.350% due 27/11/2025                   | €  | 400           | 442            | 0.13       |
| Toyota Motor Credit Corp.               |    |               |                |            |
| 6.060% due 11/12/2023                   | \$ | 400           | 400            | 0.12       |
| Truist Financial Corp.                  |    |               |                |            |
| 4.873% due 26/01/2029                   |    | 300           | 288            | 0.09       |
| U.S. Bancorp                            |    |               |                |            |
| 4.653% due 01/02/2029                   |    | 500           | 480            | 0.14       |
| United Airlines Pass-Through Trust      |    |               |                |            |
| 2.875% due 07/04/2030                   |    | 963           | 847            | 0.26       |
| 5.800% due 15/07/2037                   |    | 500           | 481            | 0.15       |
| Venture Global LNG, Inc.                |    |               |                |            |
| 8.125% due 01/06/2028                   |    | 250           | 248            | 0.07       |
| 8.375% due 01/06/2031                   |    | 250           | 247            | 0.07       |
| 9.500% due 01/02/2029                   |    | 1,100         | 1,136          | 0.34       |
| Volkswagen Group of America Finance LLC |    |               |                |            |
| 4.750% due 13/11/2028                   |    | 1,100         | 1,060          | 0.32       |
| 5.700% due 12/09/2026                   |    | 900           | 900            | 0.27       |
| Wells Fargo & Co.                       |    |               |                |            |
| 2.406% due 30/10/2025                   |    | 1,100         | 968            | 0.29       |
| 3.196% due 17/06/2027                   |    | 700           | 660            | 0.20       |
| 5.574% due 25/07/2029                   |    | 700           | 699            | 0.21       |
| Wells Fargo Bank N.A.                   |    |               |                |            |
| 5.450% due 07/08/2026                   |    | 400           | 402            | 0.12       |
| 5.550% due 01/08/2025                   |    | 300           | 301            | 0.09       |
| Weyerhaeuser Co.                        |    |               |                |            |
| 4.750% due 15/05/2026                   |    | 800           | 788            | 0.24       |
| WRKCo, Inc.                             |    |               |                |            |
| 4.650% due 15/03/2026                   |    | 1,600         | 1,568          | 0.47       |
| Wynn Las Vegas LLC                      |    |               |                |            |
| 5.500% due 01/03/2025                   |    | 664           | 657            | 0.20       |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc.            |    |               |                |            |
| 5.350% due 01/12/2028 (b)               |    | 700           | 701            | 0.21       |
|                                         |    |               | 84,331         | 25.39      |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                                                                                                                        | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| <b>地方債</b>                                                                                                                                |               |                |            |
| JobsOhio Beverage System Revenue Notes, Series 2023<br>4.433% due 01/01/2033                                                              | \$ 600        | \$ 585         | 0.18       |
| Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Authority Revenue Bonds, Series 2023<br>5.048% due 01/12/2034 | 500           | 496            | 0.15       |
| New York State Urban Development Corp. Revenue Notes, Series 2020<br>1.496% due 15/03/2027                                                | 1,400         | 1,259          | 0.38       |
|                                                                                                                                           |               | 2,340          | 0.71       |
| <b>非政府モーゲージ・バック証券</b>                                                                                                                     |               |                |            |
| Citigroup Mortgage Loan Trust<br>4.785% due 25/09/2037 ^                                                                                  | 117           | 104            | 0.03       |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>5.892% due 25/08/2035                                                                              | 3             | 2              | 0.00       |
| Countrywide Home Loan Repperforming REMIC Trust<br>5.797% due 25/01/2036                                                                  | 214           | 197            | 0.06       |
| GSR Mortgage Loan Trust<br>4.241% due 25/06/2034                                                                                          | 17            | 16             | 0.01       |
| 4.663% due 25/09/2035                                                                                                                     | 28            | 26             | 0.01       |
| HomeBanc Mortgage Trust<br>5.817% due 25/12/2036                                                                                          | 1             | 1              | 0.00       |
| JPMorgan Mortgage Trust<br>4.728% due 25/08/2034                                                                                          | 1             | 1              | 0.00       |
| 4.833% due 25/04/2035                                                                                                                     | 43            | 40             | 0.01       |
| 5.419% due 25/07/2035                                                                                                                     | 0             | 0              | 0.00       |
| 5.654% due 25/08/2035                                                                                                                     | 95            | 90             | 0.03       |
| MortgageIT Trust<br>5.977% due 25/12/2035                                                                                                 | 108           | 105            | 0.03       |
| NAAC Repperforming Loan REMIC Trust Certificates<br>6.500% due 25/02/2035 ^                                                               | 317           | 260            | 0.08       |
| PHH Alternative Mortgage Trust<br>5.777% due 25/02/2037                                                                                   | 449           | 326            | 0.10       |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust<br>6.069% due 25/04/2035                                                                   | 52            | 47             | 0.01       |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>3.947% due 25/12/2035                                                                    | 409           | 360            | 0.11       |
| 4.749% due 25/09/2035                                                                                                                     | 47            | 42             | 0.01       |
| 6.037% due 25/10/2045                                                                                                                     | 325           | 305            | 0.09       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                    |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust |    |               |                |            |
| 2.652% due 15/08/2049                 | \$ | 1,100         | \$ 1,004       | 0.30       |
|                                       |    |               | 2,926          | 0.88       |
| <b>米国政府機関証券</b>                       |    |               |                |            |
| Fannie Mae                            |    |               |                |            |
| 4.550% due 01/05/2028                 |    | 500           | 494            | 0.15       |
| 5.347% due 01/05/2038                 |    | 165           | 169            | 0.05       |
| 5.823% due 25/11/2042                 |    | 121           | 118            | 0.04       |
| 6.043% due 25/10/2041                 |    | 324           | 315            | 0.09       |
| Freddie Mac                           |    |               |                |            |
| 4.000% due 01/02/2030 - 01/04/2042    |    | 38            | 37             | 0.01       |
| 5.759% due 15/07/2034                 |    | 635           | 619            | 0.19       |
| Ginnie Mae                            |    |               |                |            |
| 3.000% due 15/10/2049                 |    | 256           | 220            | 0.07       |
| 4.000% due 15/02/2050                 |    | 90            | 83             | 0.02       |
| 5.825% due 20/01/2072                 |    | 270           | 263            | 0.08       |
| 5.899% due 20/02/2067                 |    | 300           | 298            | 0.09       |
| 5.939% due 20/04/2064                 |    | 111           | 111            | 0.03       |
| 6.039% due 20/10/2065                 |    | 288           | 288            | 0.09       |
| 6.075% due 20/10/2072                 |    | 490           | 487            | 0.15       |
| 6.125% due 20/01/2073                 |    | 507           | 502            | 0.15       |
| 6.195% due 20/01/2073                 |    | 917           | 911            | 0.27       |
| 6.205% due 20/02/2073                 |    | 1,205         | 1,199          | 0.36       |
| 6.225% due 20/01/2073                 |    | 907           | 904            | 0.27       |
| 6.345% due 20/12/2072                 |    | 406           | 407            | 0.12       |
| 6.464% due 20/04/2067                 |    | 1,267         | 1,268          | 0.38       |
| Ginnie Mae, TBA                       |    |               |                |            |
| 2.000% due 01/12/2053 - 01/01/2054    |    | 700           | 565            | 0.17       |
| Uniform Mortgage-Backed Security      |    |               |                |            |
| 3.000% due 01/07/2051 - 01/04/2053    |    | 19,822        | 16,786         | 5.05       |
| 3.500% due 01/05/2035 - 01/04/2053    |    | 5,602         | 4,965          | 1.49       |
| 4.000% due 01/09/2030 - 01/10/2052    |    | 1,351         | 1,239          | 0.37       |
| 4.500% due 01/09/2052 - 01/05/2053    |    | 3,198         | 2,998          | 0.90       |
| 5.000% due 01/05/2053                 |    | 18,578        | 17,892         | 5.39       |
| 5.500% due 01/01/2033 - 01/04/2034    |    | 24            | 25             | 0.01       |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |    |               |                |            |
| 2.500% due 01/01/2054                 |    | 5,000         | 4,054          | 1.22       |
| 3.000% due 01/01/2054                 |    | 16,400        | 13,843         | 4.17       |
| 3.500% due 01/01/2054                 |    | 28,200        | 24,751         | 7.45       |
| 4.000% due 01/01/2054                 |    | 23,200        | 21,075         | 6.35       |
| 4.500% due 01/01/2054                 |    | 11,400        | 10,683         | 3.22       |
| 5.000% due 01/12/2053                 |    | 14,800        | 14,243         | 4.29       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                                               |    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|--------------------------------------------------|----|---------------|----------------|------------|
| 5.500% due 01/01/2054                            | \$ | 26,600 \$     | 26,215         | 7.88       |
| 6.000% due 01/01/2054                            |    | 8,000         | 8,021          | 2.42       |
|                                                  |    |               | 176,048        | 52.99      |
| <b>米国財務省証券</b>                                   |    |               |                |            |
| U.S. Treasury Bonds                              |    |               |                |            |
| 1.375% due 15/11/2040                            |    | 5,500         | 3,369          | 1.01       |
| 1.375% due 15/08/2050                            |    | 1,100         | 559            | 0.17       |
| 1.625% due 15/11/2050                            |    | 1,600         | 872            | 0.26       |
| 1.875% due 15/02/2041                            |    | 1,100         | 733            | 0.22       |
| 2.000% due 15/11/2041                            |    | 1,500         | 1,005          | 0.30       |
| 2.000% due 15/02/2050                            |    | 4,100         | 2,480          | 0.75       |
| 2.250% due 15/08/2049                            |    | 400           | 257            | 0.08       |
| 2.250% due 15/02/2052                            |    | 1,300         | 828            | 0.25       |
| 2.750% due 15/08/2042                            |    | 2,000         | 1,511          | 0.45       |
| 2.750% due 15/11/2042                            |    | 2,800         | 2,109          | 0.64       |
| 2.875% due 15/05/2043                            |    | 1,200         | 917            | 0.28       |
| 2.875% due 15/08/2045                            |    | 1,900         | 1,422          | 0.43       |
| 2.875% due 15/05/2049                            |    | 400           | 294            | 0.09       |
| 2.875% due 15/05/2052                            |    | 600           | 441            | 0.13       |
| 3.000% due 15/02/2049                            |    | 400           | 301            | 0.09       |
| 3.125% due 15/08/2044                            |    | 5,600         | 4,411          | 1.33       |
| 3.375% due 15/05/2044 (g)                        |    | 11,800        | 9,701          | 2.92       |
| 3.875% due 15/05/2043 (g)                        |    | 7,300         | 6,508          | 1.96       |
| 4.000% due 15/11/2042                            |    | 700           | 637            | 0.19       |
| 4.250% due 15/05/2039                            |    | 700           | 675            | 0.20       |
| 4.375% due 15/11/2039                            |    | 2,000         | 1,950          | 0.59       |
| 4.375% due 15/08/2043                            |    | 200           | 191            | 0.06       |
| 4.625% due 15/02/2040                            |    | 500           | 502            | 0.15       |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) |    |               |                |            |
| 0.125% due 15/10/2024                            |    | 1,439         | 1,401          | 0.42       |
| 0.125% due 15/07/2031                            |    | 1,722         | 1,485          | 0.45       |
| 0.125% due 15/01/2032                            |    | 666           | 567            | 0.17       |
| 0.125% due 15/02/2051                            |    | 591           | 341            | 0.10       |
| 0.125% due 15/02/2052                            |    | 111           | 63             | 0.02       |
| 0.250% due 15/01/2025                            |    | 2,599         | 2,509          | 0.76       |
| 0.250% due 15/02/2050                            |    | 479           | 292            | 0.09       |
| 0.500% due 15/04/2024                            |    | 488           | 480            | 0.14       |
| 0.625% due 15/01/2024                            |    | 1,319         | 1,308          | 0.39       |
| 0.625% due 15/07/2032                            |    | 1,589         | 1,404          | 0.42       |
| 0.625% due 15/02/2043                            |    | 535           | 397            | 0.12       |
| 0.750% due 15/02/2045                            |    | 2,222         | 1,642          | 0.49       |
| 0.875% due 15/02/2047                            |    | 510           | 379            | 0.11       |
| 1.000% due 15/02/2046                            |    | 130           | 101            | 0.03       |
| 1.000% due 15/02/2049                            |    | 245           | 185            | 0.06       |
| 1.250% due 15/04/2028 (g)                        |    | 1,026         | 982            | 0.30       |
| 1.375% due 15/02/2044                            |    | 396           | 337            | 0.10       |
| 1.500% due 15/02/2053                            |    | 311           | 264            | 0.08       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 銘柄                    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル)    | 純資産<br>比率%    |
|-----------------------|---------------|-------------------|---------------|
| U.S. Treasury Notes   |               |                   |               |
| 2.125% due 30/09/2024 | 10,900        | 10,625            | 3.20          |
|                       |               | 66,435            | 20.00         |
| 米国合計                  |               | 340,707           | 102.57        |
| <b>短期金融商品</b>         |               |                   |               |
| <b>コマーシャル・ペーパー</b>    |               |                   |               |
| AT+T, Inc.            |               |                   |               |
| 5.700% due 19/03/2024 | 500           | 491               | 0.15          |
| 短期金融商品合計              |               | 491               | 0.15          |
| <b>譲渡性のある有価証券合計</b>   |               | <b>\$ 459,277</b> | <b>138.27</b> |

## 規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品（金額：千単位\*、契約数を除く）

\* 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。

## 先物

| 銘柄                                             | 種類    | 権利失効月<br>(月/年) | 契約数 | 未実現利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率%    |
|------------------------------------------------|-------|----------------|-----|-----------------|---------------|
| 3-Month SOFR June Futures                      | Long  | 09/2024        | 139 | \$ 107          | 0.03          |
| 3-Month SOFR September Futures                 | Short | 12/2024        | 139 | (123)           | (0.04)        |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures   | Long  | 03/2024        | 14  | 6               | 0.00          |
| Euro-Bobl December Futures                     | Short | 12/2023        | 80  | (6)             | 0.00          |
| Euro-Bund 10-Year Bond December Futures        | Short | 12/2023        | 21  | (10)            | 0.00          |
| Japan Government 10-Year Bond December Futures | Short | 12/2023        | 4   | (11)            | 0.00          |
| U.S. Treasury 2-Year Note March Futures        | Long  | 03/2024        | 61  | 52              | 0.02          |
| U.S. Treasury 5-Year Note March Futures        | Long  | 03/2024        | 183 | 91              | 0.03          |
| U.S. Treasury 10-Year Note March Futures       | Short | 03/2024        | 237 | (187)           | (0.06)        |
|                                                |       |                |     | \$ (81)         | (0.02)        |
| <b>規制ある市場で取引されている金融デリバティブ商品合計</b>              |       |                |     | <b>\$ (81)</b>  | <b>(0.02)</b> |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## 集中清算の対象となる金融デリバティブ商品（金額：千単位\*）

\* 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。

社債、ソブリン債および米国地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - セル・プロテクション<sup>(1)</sup>

| レファレンス・エンティティ -                | 固定取引<br>受領金利 | 満期日<br>(日/月/年) | 想定元本 <sup>(3)</sup> | 未実現利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|--------------------------------|--------------|----------------|---------------------|-----------------|------------|
| AT&T, Inc.                     | 1.000%       | 20/06/2024     | \$ 1,500            | \$ 8            | 0.00       |
| AT&T, Inc.                     | 1.000        | 20/12/2027     | 600                 | 6               | 0.00       |
| Barclays Bank PLC              | 1.000        | 20/12/2023     | € 300               | 1               | 0.00       |
| British Telecommunications PLC | 1.000        | 20/06/2028     | 600                 | 7               | 0.00       |
| Ford Motor Co.                 | 5.000        | 20/12/2028     | \$ 800              | 12              | 0.01       |
| General Electric Co.           | 1.000        | 20/12/2023     | 600                 | 17              | 0.01       |
| General Electric Co.           | 1.000        | 20/06/2024     | 300                 | 2               | 0.00       |
| General Electric Co.           | 1.000        | 20/12/2024     | 1,300               | 33              | 0.01       |
| T-Mobile USA, Inc.             | 5.000        | 20/06/2028     | 300                 | 5               | 0.00       |
| Verizon Communications, Inc.   | 1.000        | 20/12/2027     | 100                 | 1               | 0.00       |
| Verizon Communications, Inc.   | 1.000        | 20/06/2028     | 1,000               | 10              | 0.00       |
| Verizon Communications, Inc.   | 1.000        | 20/12/2028     | 200                 | 3               | 0.00       |
|                                |              |                | \$                  | 105             | 0.03       |

クレジット指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - バイ・プロテクション<sup>(2)</sup>

| 指数/トランシェ               | 固定取引<br>(支払)金利 | 満期日<br>(日/月/年) | 想定元本 <sup>(3)</sup> | 未実現利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|------------------------|----------------|----------------|---------------------|-----------------|------------|
| CDX.HY-38 5-Year Index | (5.000)%       | 20/06/2027     | \$ 7,857            | \$ (721)        | (0.22)     |

## 金利スワップ

| 支払/受領<br>変動金利  | 変動金利指数                                                    | 固定金利   | 満期日<br>(日/月/年) | 想定元本       | 未実現利益<br>/ (損失) | 純資産<br>比率% |
|----------------|-----------------------------------------------------------|--------|----------------|------------|-----------------|------------|
| Receive        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS                            | 0.900% | 15/03/2052     | £ 700      | \$ 410          | 0.12       |
| Receive<br>(4) | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS                            | 4.250  | 20/03/2054     | 500        | (11)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS                         | 0.123  | 22/08/2039     | / 109,610  | (131)           | (0.04)     |
| Receive<br>(4) | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS                         | 0.250  | 17/03/2031     | 10,840,000 | 1,084           | 0.33       |
| Receive        | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS                         | 0.500  | 15/03/2042     | 54,700     | 34              | 0.01       |
| Receive        | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS                         | 0.662  | 19/04/2042     | 18,000     | 14              | 0.00       |
| Receive        | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS                         | 0.800  | 15/06/2052     | 52,000     | 59              | 0.02       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1.750  | 15/06/2032     | \$ 500     | 14              | 0.00       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1.750  | 21/12/2052     | 5,700      | 1,075           | 0.32       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2.850  | 29/08/2027     | 400        | (18)            | (0.01)     |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3.050  | 14/12/2052     | 690        | 112             | 0.03       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3.340  | 23/02/2030     | 500        | (23)            | (0.01)     |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## 金利スワップ

| 支払／受領<br>変動金利  | 変動金利指数                                                       | 固定金利  | 満期日<br>（日/月/年） | 想定元本    | 未実現利益<br>／（損失） | 純資産<br>比率％ |
|----------------|--------------------------------------------------------------|-------|----------------|---------|----------------|------------|
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.470 | 22/02/2030     | \$ 600  | \$ (23)        | (0.01)     |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.500 | 20/09/2025     | 9,300   | 13             | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.525 | 02/03/2030     | 200     | (7)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.650 | 10/07/2033     | 400     | (12)           | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.730 | 03/08/2033     | 200     | (4)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.735 | 07/08/2033     | 200     | (4)            | 0.00       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.750 | 21/06/2025     | 15,100  | 78             | 0.02       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.760 | 23/08/2033     | 600     | (11)           | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.800 | 10/03/2028     | 600     | (11)           | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.800 | 22/08/2030     | 100     | (1)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.800 | 30/08/2033     | 300     | (4)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.830 | 12/10/2053     | 100     | 0              | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.870 | 17/10/2053     | 100     | 1              | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.880 | 16/10/2053     | 100     | 1              | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.900 | 30/08/2033     | 500     | (3)            | 0.00       |
| Pay            | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 3.950 | 13/09/2033     | 900     | (1)            | 0.00       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 4.250 | 22/11/2033     | 300     | (7)            | 0.00       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 4.600 | 17/07/2025     | 2,200   | 12             | 0.00       |
| Receive        | 1-Day USD-Secured Overnight<br>Financing Rate Compounded-OIS | 5.388 | 18/10/2024     | 5,800   | (9)            | 0.00       |
| Receive<br>（４） | 3-Month CAD-CAONREPO<br>Compounded-OIS                       | 3.500 | 01/06/2032     | CAD 700 | (3)            | 0.00       |
| Pay            | 3-Month CAD-CAONREPO<br>Compounded-OIS                       | 3.750 | 20/09/2025     | 14,600  | 99             | 0.03       |
| Receive<br>（４） | 3-Month CAD-CAONREPO<br>Compounded-OIS                       | 3.750 | 20/12/2033     | 900     | (5)            | 0.00       |
| Pay            | 3-Month CAD-CAONREPO<br>Compounded-OIS                       | 4.000 | 21/06/2025     | 22,800  | 77             | 0.02       |
| Pay            | 3-Month CAD-CAONREPO<br>Compounded-OIS                       | 4.750 | 14/07/2025     | 4,900   | 16             | 0.01       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## 金利スワップ

| 支払／受領                  |                      |       | 満期日        |     |        |    | 未実現利益 | 純資産    |
|------------------------|----------------------|-------|------------|-----|--------|----|-------|--------|
| 変動金利                   | 変動金利指数               | 固定金利  | （日/月/年）    |     | 想定元本   |    | ／（損失） | 比率％    |
| Pay                    | 3-Month CAD-CAONREPO |       |            |     |        |    |       |        |
|                        | Compounded-OIS       | 4.820 | 13/07/2025 | CAD | 2,000  | \$ | 8     | 0.00   |
| Pay                    | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4.500 | 20/09/2033 | AUD | 1,900  |    | 6     | 0.00   |
| Pay（４）                 | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4.500 | 20/03/2034 |     | 1,000  |    | 16    | 0.01   |
| Pay                    | 6-Month EUR-EURIBOR  | 1.000 | 18/05/2027 | €   | 4,400  |    | (202) | (0.06) |
| Pay                    | 6-Month EUR-EURIBOR  | 2.547 | 09/03/2033 |     | 500    |    | 0     | 0.00   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  |       |            |     |        |    |       |        |
| （４）                    |                      | 2.750 | 20/03/2054 |     | 2,200  |    | (128) | (0.04) |
| Pay（４）                 | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.000 | 20/03/2034 |     | 2,800  |    | 118   | 0.04   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.148 | 20/11/2033 |     | 200    |    | (4)   | 0.00   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.179 | 29/11/2028 |     | 200    |    | (2)   | 0.00   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.255 | 22/11/2028 |     | 100    |    | (2)   | 0.00   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.280 | 22/11/2033 |     | 100    |    | (3)   | 0.00   |
| Receive                | 6-Month EUR-EURIBOR  | 3.305 | 27/11/2033 |     | 200    |    | (7)   | 0.00   |
| Pay                    | 28-Day MXN-TIIE      | 8.945 | 22/11/2028 | MXN | 10,000 |    | 1     | 0.00   |
|                        |                      |       |            |     |        | \$ | 2,612 | 0.79   |
| 集中清算の対象となる金融デリバティブ商品合計 |                      |       |            |     |        | \$ | 1,996 | 0.60   |

- （１） ファンド（注：対象ファンドのこと。）がプロテクションの売り手であり、特定のスワップ契約の条項で定義されたように信用事由が起った場合、ファンド（注：対象ファンドのこと。）はプロテクションの買い手に対し、（ ）スワップの想定元本に等しい金額を支払い、参照債務もしくは参照銘柄指数を構成する原証券を受領するか、または（ ）想定元本額から参照債務または参照銘柄指数を構成する原証券の回復額を減じた額に等しい純決済額を現金、証券もしくはその他の引渡可能債務の形態で支払う。
- （２） ファンド（注：対象ファンドのこと。）がプロテクションの買い手であり、特定のスワップ契約の条項で定義されたように信用事由が起った場合、ファンド（注：対象ファンドのこと。）はプロテクションの売り手から、（ ）スワップの想定元本に等しい金額を受領し、参照債務もしくは参照銘柄指数を構成する原証券を引き渡すか、または（ ）想定元本額から参照債務または参照銘柄指数を構成する原証券の回復額を減じた額に等しい純決済額を現金、証券もしくはその他の引渡可能債務の形態で受領する。
- （３） 特定のスワップ契約の条項で定義されたように信用事由が起った場合、ファンド（注：対象ファンドのこと。）が信用プロテクションの売り手として支払うこと、または信用プロテクションの買い手として受領することが要求される最大見込額。
- （４） かかる商品は、先スタート条件付の実効日を有している。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## OTC金融デリバティブ商品（金額：千単位\*、契約数を除く）

\* 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。

## 購入オプション

## 金利スワップション

| 取引<br>相手方 | 銘柄                 | 変動金利<br>指数 | 支払 / 受領<br>変動金利 | 行使率    | 権利失効日<br>(日/月/年) | 想定元本 <sup>(1)</sup> | 取得原価  | 公正価値  | 純資産<br>比率% |
|-----------|--------------------|------------|-----------------|--------|------------------|---------------------|-------|-------|------------|
| BPS       | Put - OTC 1-Year   | 3-Month    |                 |        |                  |                     |       |       |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR  | Receive         | 5.050% | 28/05/2024       | 4,400               | \$ 5  | \$ 5  | 0.00       |
| DUB       | Call - OTC 30-Year | 3-Month    |                 |        |                  |                     |       |       |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR  | Pay             | 3.610  | 25/10/2024       | 700                 | 22    | 35    | 0.01       |
| GLM       | Put - OTC 1-Year   | 3-Month    |                 |        |                  |                     |       |       |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR  | Receive         | 4.975  | 29/05/2024       | 4,400               | 5     | 6     | 0.00       |
|           |                    |            |                 |        |                  |                     | \$ 32 | \$ 46 | 0.01       |

## 売却オプション

## 金利スワップション

| 取引<br>相手方 | 銘柄                 | 変動金利<br>指数  | 支払 / 受領<br>変動金利 | 行使率    | 権利失効日<br>（日/月/年） | 想定元本 <sup>（1）</sup> | プレミアム  | 公正価値   | 純資産<br>比率% |
|-----------|--------------------|-------------|-----------------|--------|------------------|---------------------|--------|--------|------------|
| BOA       | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 0.040% | 13/12/2023       | 200                 | \$ (1) | \$ (2) | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
| BPS       | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.530  | 13/12/2023       | 200                 | (1)    | 0      | 0.00       |
|           | Call - OTC 2-Year  | 3-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.350  | 28/05/2024       | 2,200               | (5)    | (6)    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.910  | 27/12/2023       | 200                 | (1)    | (2)    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 3.063  | 04/12/2023       | 200                 | (1)    | (2)    | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.250  | 27/12/2023       | 200                 | (1)    | 0      | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.451  | 04/12/2023       | 200                 | (1)    | 0      | 0.00       |
| CBK       | Call - OTC 5-Year  | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.880  | 15/12/2023       | 400                 | (1)    | (1)    | 0.00       |
|           | Put - OTC 5-Year   | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.220  | 15/12/2023       | 400                 | (1)    | 0      | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.990  | 06/12/2023       | 200                 | (1)    | (1)    | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
| DUB       | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.390  | 06/12/2023       | 200                 | (1)    | 0      | 0.00       |
|           | Put - OTC 30-Year  | 3-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
| GLM       | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 5.058  | 25/10/2024       | 700                 | (22)   | (7)    | (0.01)     |
|           | Call - OTC 2-Year  | 3-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.195  | 29/05/2024       | 2,200               | (5)    | (5)    | 0.00       |
|           | Call - OTC 5-Year  | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.920  | 11/12/2023       | 400                 | (1)    | (1)    | 0.00       |
|           | Put - OTC 5-Year   | 6-Month     |                 |        |                  |                     |        |        |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.260  | 11/12/2023       | 400                 | (1)    | 0      | 0.00       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 取引<br>相手方 | 銘柄                 | 変動金利<br>指数  | 支払 / 受領<br>変動金利 | 権利失効日<br>行使率（日/月/年） | 想定元本 <sup>（１）</sup> | プレミアム      | 公正価値 | 純資産<br>比率% |
|-----------|--------------------|-------------|-----------------|---------------------|---------------------|------------|------|------------|
| GLM       | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.684% 29/12/2023   | 100                 | \$ (1) \$  | 0    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.750 28/12/2023    | 100                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.810 28/12/2023    | 100                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.854 27/12/2023    | 100                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.084 29/12/2023    | 100                 | (1)        | (1)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.150 28/12/2023    | 100                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.210 28/12/2023    | 100                 | 0          | 0    | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.254 27/12/2023    | 100                 | 0          | 0    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.890 20/12/2023    | 300                 | (1)        | (2)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.250 20/12/2023    | 300                 | (1)        | (1)  | 0.00       |
| JPM       | Call - OTC 5-Year  | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.950 27/12/2023    | 200                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 5-Year   | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.270 27/12/2023    | 200                 | 0          | 0    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.842 21/12/2023    | 200                 | (1)        | (1)  | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 4.030 13/12/2023    | 200                 | (1)        | (2)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.292 21/12/2023    | 200                 | (1)        | (1)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.530 13/12/2023    | 200                 | (1)        | 0    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Receive         | 2.970 13/12/2023    | 300                 | (1)        | (2)  | 0.00       |
| MYC       | Put - OTC 10-Year  | 6-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | EUR-EURIBOR | Pay             | 3.350 13/12/2023    | 300                 | (1)        | 0    | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.854 27/12/2023    | 100                 | 0          | (1)  | 0.00       |
|           | Call - OTC 10-Year | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Receive         | 3.950 15/12/2023    | 300                 | (1)        | (2)  | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.254 27/12/2023    | 100                 | 0          | 0    | 0.00       |
|           | Put - OTC 10-Year  | 3-Month     |                 |                     |                     |            |      |            |
|           | Interest Rate Swap | USD-LIBOR   | Pay             | 4.450 15/12/2023    | 300                 | (1)        | 0    | 0.00       |
|           |                    |             |                 |                     |                     | \$ (56) \$ | (45) | (0.01)     |

（１） 想定元本は、契約数を表している。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## 証券に係るオプション

| 取引<br>相手方 | 銘柄                                                                        | 行使価格（日/月/年） | 権利失効日      | 想定元本<br>（１） | プレミアム  | 公正価値   | 純資産<br>比率% |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------|-------------|------------|-------------|--------|--------|------------|
| BOA       | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed<br>Security, TBA 6.000% due 01/02/2054 | \$ 101.094  | 06/02/2024 | 300         | \$ (1) | \$ (1) | 0.00       |

（１） 想定元本は、契約数を表している。

## 社債、ソブリン債および米国地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - セル・プロテクション（１）

| 取引<br>相手方 | レファレンス・<br>エンティティ -                           | 固定取引<br>受領金利 | 満期日<br>（日/月/年） | 想定元本<br>（１） | プレミアム<br>支払 / （受領） | 未実現利益<br>/ （損失） | 公正価値    | 純資産<br>比率% |
|-----------|-----------------------------------------------|--------------|----------------|-------------|--------------------|-----------------|---------|------------|
| BOA       | South Africa Government<br>International Bond | 1.000%       | 20/12/2026     | \$ 1,000    | \$ (47)            | \$ 34           | \$ (13) | (0.01)     |
| GST       | Colombia Government<br>International Bond     | 1.000        | 20/06/2027     | 900         | (36)               | 30              | (6)     | 0.00       |
|           | Colombia Government<br>International Bond     | 1.000        | 20/12/2027     | 500         | (44)               | 37              | (7)     | 0.00       |
| MYC       | Colombia Government<br>International Bond     | 1.000        | 20/06/2027     | 100         | (6)                | 5               | (1)     | 0.00       |
|           | Colombia Government<br>International Bond     | 1.000        | 20/12/2027     | 100         | (9)                | 7               | (2)     | 0.00       |
|           | South Africa Government<br>International Bond | 1.000        | 20/12/2026     | 2,000       | (90)               | 63              | (27)    | (0.01)     |
|           |                                               |              |                |             | \$ (232)           | \$ 176          | \$ (56) | (0.02)     |

（１） ファンド（注：対象ファンドのこと。）がプロテクションの売り手であり、特定のスワップ契約の条項で定義されたように信用事由が起った場合、ファンド（注：対象ファンドのこと。）はプロテクションの買い手に対し、（ ）スワップの想定元本に等しい金額を支払い、参照債務もしくは参照銘柄指数を構成する原証券を受領するか、または（ ）想定元本額から参照債務または参照銘柄指数を構成する原証券の回復額を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは証券の形態で支払う。

（２） 特定のスワップ契約の条項で定義されたように信用事由が起った場合、ファンド（注：対象ファンドのこと。）が信用プロテクションの売り手として支払うこと、または信用プロテクションの買い手として受領することが要求される最大見込額。

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

## 為替予約契約

| 取引相手方 | 決済月<br>(月/年) | 通貨引渡額         | 通貨受取額         | 未実現利益 | 未実現<br>(損失) | 未実現純利<br>益 / (損失) | 純資産<br>比率% |
|-------|--------------|---------------|---------------|-------|-------------|-------------------|------------|
| AZD   | 12/2023      | AUD 2,600     | \$ 1,720      | \$ 0  | \$ (4)      | \$ (4)            | 0.00       |
|       | 12/2023      | 1,652         | AUD 2,600     | 72    | 0           | 72                | 0.02       |
|       | 01/2024      | 1,722         | 2,600         | 4     | 0           | 4                 | 0.00       |
| BOA   | 12/2023      | CAD 953       | 690           | 0     | (13)        | (13)              | 0.00       |
|       | 12/2023      | INR 1,328     | 16            | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | 845           | AUD 1,332     | 38    | 0           | 38                | 0.01       |
|       | 12/2023      | 1,312         | 1,206         | 4     | 0           | 4                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | 844           | £ 665         | 0     | (3)         | (3)               | 0.00       |
|       | 01/2024      | £ 665         | 844           | 3     | 0           | 3                 | 0.00       |
| BPS   | 12/2023      | € 642         | 700           | 2     | (2)         | 0                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 1,471      | € 1,339       | 0     | (10)        | (10)              | 0.00       |
|       | 12/2023      | 3,213         | £ 2,534       | 0     | (5)         | (5)               | 0.00       |
|       | 12/2023      | 100           | TWD 3,206     | 3     | 0           | 3                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | ZAR 27,827    | \$ 1,516      | 50    | 0           | 50                | 0.01       |
|       | 01/2024      | £ 2,534       | 3,214         | 5     | 0           | 5                 | 0.00       |
|       | 01/2024      | MXN 653       | 36            | 0     | (2)         | (2)               | 0.00       |
|       | 02/2024      | TWD 3,180     | 100           | 0     | (3)         | (3)               | 0.00       |
|       | 03/2024      | CNH 72        | 10            | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |
| BRC   | 12/2023      | € 48,176      | 50,824        | 0     | (1,740)     | (1,740)           | (0.52)     |
|       | 12/2023      | £ 16,965      | 20,580        | 0     | (897)       | (897)             | (0.27)     |
| BSH   | 01/2024      | BRL 4,000     | 804           | 0     | (4)         | (4)               | 0.00       |
| CBK   | 12/2023      | € 862         | 921           | 0     | (20)        | (20)              | (0.01)     |
|       | 12/2023      | / 126,000     | 835           | 0     | (17)        | (17)              | (0.01)     |
|       | 12/2023      | MXN 20,595    | 1,191         | 12    | (4)         | 8                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 1,432      | CLP 1,316,272 | 83    | 0           | 83                | 0.03       |
|       | 12/2023      | 0             | MXN 8         | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |
|       | 01/2024      | MXN 9,904     | \$ 555        | 1     | (11)        | (10)              | 0.00       |
|       | 02/2024      | BRL 1,348     | 263           | 0     | (9)         | (9)               | 0.00       |
| DUB   | 12/2023      | CLP 1,299,422 | 1,452         | 0     | (43)        | (43)              | (0.01)     |
|       | 12/2023      | MXN 1,993     | 113           | 0     | (2)         | (2)               | 0.00       |
| GLM   | 12/2023      | 2,637         | 152           | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 567        | / 85,700      | 13    | 0           | 13                | 0.00       |
|       | 12/2023      | ZAR 4,024     | \$ 218        | 6     | 0           | 6                 | 0.00       |
|       | 01/2024      | \$ 0          | MXN 3         | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |
| JPM   | 12/2023      | INR 102,724   | \$ 1,233      | 1     | 0           | 1                 | 0.00       |
|       | 12/2023      | SGD 1,641     | 1,210         | 0     | (21)        | (21)              | (0.01)     |
|       | 12/2023      | TWD 5,621     | 178           | 0     | (2)         | (2)               | 0.00       |
|       | 12/2023      | \$ 82         | INR 6,807     | 0     | (1)         | (1)               | 0.00       |
|       | 01/2024      | BRL 3,000     | \$ 599        | 0     | (7)         | (7)               | 0.00       |
|       | 02/2024      | \$ 1,211      | INR 101,175   | 0     | (1)         | (1)               | 0.00       |
| MBC   | 12/2023      | AUD 1,220     | \$ 808        | 0     | (1)         | (1)               | 0.00       |
|       | 12/2023      | CAD 501       | 369           | 0     | (1)         | (1)               | 0.00       |
|       | 12/2023      | / 16,000      | 107           | 0     | (1)         | (1)               | 0.00       |
|       | 01/2024      | \$ 809        | AUD 1,220     | 1     | 0           | 1                 | 0.00       |
|       | 03/2024      | 20            | TWD 640       | 0     | 0           | 0                 | 0.00       |

注記は本財務書類と不可分である。

## ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド

## 投資有価証券明細表（続き）

2023年11月30日現在

| 取引相手方           | 決済月<br>(月/年) |     | 通貨引渡額  |     | 通貨受取額     |    | 未実現<br>利益 / (損失) |     | 未実現純利<br>益 / (損失) |         | 純資産<br>比率% |         |  |        |
|-----------------|--------------|-----|--------|-----|-----------|----|------------------|-----|-------------------|---------|------------|---------|--|--------|
| MYI             | 12/2023      | TWD | 2,857  | \$  | 91        | \$ | 0                | \$  | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | \$  | 53,607 | €   | 48,856    |    | 0                |     | (300)             |         | (0.09)     |         |  |        |
|                 | 01/2024      | €   | 48,856 | \$  | 53,699    |    | 303              |     | 0                 |         | 0.09       |         |  |        |
|                 | 03/2024      | \$  | 72     | IDR | 1,114,136 |    | 0                |     | (1)               |         | 0.00       |         |  |        |
| NGF             | 12/2023      |     | 743    | INR | 61,312    |    | 0                |     | (8)               |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 03/2024      |     | 131    | TWD | 4,126     |    | 3                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
| SCX             | 12/2023      | €   | 382    | \$  | 418       |    | 1                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | INR | 858    |     | 10        |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | MXN | 382    |     | 22        |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | TWD | 3,007  |     | 96        |    | 0                |     | (1)               |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | \$  | 211    | INR | 17,561    |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
| SOG             | 03/2024      |     | 217    | TWD | 6,834     |    | 5                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
| TOR             | 12/2023      |     | 230    | INR | 19,166    |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
| UAG             | 12/2023      | AUD | 986    | \$  | 653       |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 12/2023      | \$  | 807    | AUD | 1,268     |    | 33               |     | 0                 |         | 0.01       |         |  |        |
|                 | 12/2023      |     | 3,074  | £   | 2,432     |    | 5                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 01/2024      | £   | 2,432  | \$  | 3,075     |    | 0                |     | (5)               |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 01/2024      | MXN | 1,448  |     | 82        |    | 0                |     | (1)               |         | 0.00       |         |  |        |
|                 | 01/2024      | \$  | 654    | AUD | 986       |    | 0                |     | 0                 |         | 0.00       |         |  |        |
|                 |              |     |        |     |           |    | \$               | 648 | \$                | (3,140) | \$         | (2,492) |  | (0.75) |
| OTC金融デリバティブ商品合計 |              |     |        |     |           |    |                  |     | \$                | (2,548) |            | (0.77)  |  |        |

## 空売り証券

| 銘柄                                    | 額面価格<br>(千単位) | 公正価値<br>(千米ドル) | 純資産<br>比率% |
|---------------------------------------|---------------|----------------|------------|
| 米国政府機関債                               |               |                |            |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |               |                |            |
| 2.000% due 01/12/2053                 |               |                |            |
|                                       | \$ 2,200      | \$ (1,709)     | (0.51)     |
| 空売り証券合計                               |               | \$ (1,709)     | (0.51)     |
| 投資有価証券合計                              |               | \$ 456,935     | 137.57     |
| その他の流動資産および負債                         |               | \$ (124,796)   | (37.57)    |
| 純資産                                   |               | \$ 332,139     | 100.00     |

## 投資有価証券明細表に対する注記（金額：千単位\*）

\* 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。

^ 債務不履行に陥った証券。

(a) 証券は、インタレスト・オンリー（以下「IO」という。）またはIOストリップである。

(b) 発行時決済証券

(c) ゼロ・クーポン証券

(d) 証券の額面価格はインフレ率に対して調整されている。

(e) 偶発転換証券

注記は本財務書類と不可分である。

ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド  
投資有価証券明細表（続き）  
2023年11月30日現在

(f) 譲渡制限証券：

| 発行体名称        | クーポン   | 満期日<br>(日/月/年) | 取得日<br>(日/月/年) | 取得原価   | 公正価値   | 純資産<br>比率% |
|--------------|--------|----------------|----------------|--------|--------|------------|
| Oracle Corp. | 6.150% | 09/11/2029     | 07/11/2022     | \$ 300 | \$ 315 | 0.10       |

(g) 2023年11月30日現在、マスター・レボ契約および／またはグローバル・マスター・レボ契約の条項に基づき、時価総額12,424米ドルの組入証券が担保となっている。

2023年11月30日現在、4,472米ドルの現金が、上場金融デリバティブ商品および集中清算の対象となる金融デリバティブ商品の担保として差入れられている。

2023年11月30日現在、国際スワップデリバティブ協会（ISDA）マスター契約で規律されるとおり、2,840米ドルの現金が、金融デリバティブ商品の担保として差入れられている。

2023年11月30日現在のリバース・レボ契約

| 取引相手方       | 借入比率   | 決済日<br>(日/年/年) | 満期日<br>(日/年/年) | 借入額       | リバース・レボ契約<br>にかかる未払金 | 純資産比率% |
|-------------|--------|----------------|----------------|-----------|----------------------|--------|
| BOS         | 5.430% | 13/11/2023     | 04/12/2023     | € (4,875) | \$ (4,888)           | (1.47) |
| BSN         | 5.430  | 16/11/2023     | 07/12/2023     | (6,351)   | (6,366)              | (1.92) |
| DEU         | 5.430  | 27/11/2023     | 04/12/2023     | (978)     | (978)                | (0.29) |
| リバース・レボ契約合計 |        |                |                |           | \$ (12,232)          | (3.68) |

OTC金融デリバティブ商品に対して（受領）／差入された担保

以下は、2023年11月30日現在の、相手方とのOTC金融デリバティブ商品の時価および（受領）／差入された担保の概要である。

| 取引相手方 | OTCデリバティブの<br>時価総額 | 担保<br>(受領) / 差入 | エクスポージャー<br>純額 <sup>(1)</sup> |
|-------|--------------------|-----------------|-------------------------------|
| AZD   | \$ 72              | \$ 0            | \$ 72                         |
| BOA   | 13                 | 0               | 13                            |
| BPS   | 33                 | 0               | 33                            |
| BRC   | (2,637)            | 2,840           | 203                           |
| BSH   | (4)                | 0               | (4)                           |
| CBK   | 33                 | 0               | 33                            |
| DUB   | (17)               | 0               | (17)                          |
| GLM   | 11                 | 0               | 11                            |
| GST   | (13)               | 0               | (13)                          |
| JPM   | (38)               | 0               | (38)                          |
| MBC   | (2)                | 0               | (2)                           |
| MYC   | (33)               | 0               | (33)                          |
| MYI   | 2                  | 0               | 2                             |
| NGF   | (5)                | 0               | (5)                           |
| SOG   | 5                  | 0               | 5                             |
| UAG   | 32                 | 0               | 32                            |

<sup>(1)</sup> エクスポージャー純額は、債務不履行時の相手方からの未収金／（相手方への未払金）の純額を表す。

注記は本財務書類と不可分である。

[次へ](#)

#### 4 管理会社の概況

##### （１）資本金の額（2023年12月末日現在）

管理会社の資本金は4,501千ユーロ（約7億720万円）であり、そのうち3,751千ユーロ（約5億8,936万円）が払い込まれています。なお、額面1,000ユーロ（約157,120円）の記名式株式4,501株を発行済みです。

管理会社の未発行の授權資本金は1,000万ユーロ（約15億7,120万円）です。

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年12月29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（１ユーロ＝157.12円）によります。

##### （２）事業の内容及び営業の状況

管理会社の目的は、以下のとおりです。

a) オルタナティブ投資ファンド運用会社に関する2011年6月8日付通達2011/61/EU（随時改正されることがあります。）（「AIFM指令」）に規定される範囲内でオルタナティブ投資ファンド（以下「AIF」といいます。）としての適格性を有しているルクセンブルグおよび外国の契約型投資信託、変動資本を有する投資法人および／または固定資本を有する投資法人に関し、ルクセンブルグの投資信託に関する2010年12月17日法（以下「2010年法」といいます。）第125-2条に基づく管理会社としての役割の履行

b) オルタナティブ投資ファンド運用会社に関する2011年6月8日付通達2011/61/EU（随時改正されることがあります。）に定める範囲内のルクセンブルグおよび外国のAIFに関し、ルクセンブルグのオルタナティブ投資ファンド運用会社に関する2013年7月12日法（以下「2013年法」といいます。）第5条第2項及び別紙 に定める範囲内の投資運用機能、管理機能および／またはマーケティング機能の実行

管理会社は、自らが運用するAIFの子会社に対して上記の運用、管理および販売業務を提供することができます。

管理会社は、自らが運用するAIFの運用、管理および業務促進に関するあらゆる活動を管理するものとします。管理会社は、自らが運用するAIFに代わって、契約を締結し、あらゆる証券の売買、交換、受渡しを行い、ルクセンブルグまたは外国の会社の株主名簿または社債原簿に自己名義または第三者名義により登録または名義書換を行うことができ、またかかるAIFおよび受益証券または証書の保持者に代わって、AIFの資産を構成する証券に付随するすべての権利、特権、特に議決権を行使することができます。上記の権限は、すべてを網羅したものではなく単に例示したにすぎないものとします。

管理会社は、役務の無償提供および／または支店開設を通じ、ルクセンブルグ国外において許可を受けた活動を行うことができます。

管理会社は、2010年法、2013年法ならびにその他の適用ある法律および規則の定める制限の範囲内で、その目的の達成に有益とみなされるあらゆる活動を行うことができます。

一切の委託にかかわらず、管理会社は、トラストに係る以下の機能について最終的責任を負います。

a) ポートフォリオ運用およびリスク管理を含む投資運用機能

b) 以下を含む一般的な管理機能

（ ）法務およびファンド運用上の会計業務

（ ）顧客からの質問への対応

（ ）税務申告を含む資産の評価および価格決定

（ ）規制遵守の監視

（ ）受益者名簿の維持

（ ）収入の分配

（ ）受益証券の発行および買戻し

（ ）証書の発送を含む契約の確定

（ ）記録の維持

c) マーケティング機能

管理会社は、トラストの主管理事務をステート・ストリート・バンク・インターナショナル・ゲー・エム・ベー・ハー ルクセンブルグ支店に委託しており、また、投資運用業務をパシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに委託しています。

2023年12月末日現在、管理会社は、下記の投資信託の管理および運用を行っています。

| 国別（設立国）  | 種類別             | 本数 | 純資産額の合計（通貨別）        |
|----------|-----------------|----|---------------------|
| ルクセンブルグ籍 | オープン・エンド型       | 4  | 1,040,603,009米ドル    |
|          | フィックス・インカム・ファンド | 1  | 1,260,499,427スイスフラン |

（3）その他

半期報告書提出日前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ありません。

[次へ](#)

## (2) その他の訂正

(注) 下線および傍線の部分は、訂正箇所を示します。

## 第一部 証券情報

## (8) 申込取扱場所

## &lt;訂正前&gt;

S M B C 日興証券株式会社

東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

ホームページ・アドレス：<https://www.smbcnikko.co.jp/>

電話番号：03-5644-3111(受付時間：日本における営業日の8:40~17:10)

(中略)

なお、申込取扱場所となる各金融商品取引業者を「日本における販売会社」といいます。

## &lt;訂正後&gt;

S M B C 日興証券株式会社<sup>(注)</sup>

東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

ホームページ・アドレス：<https://www.smbcnikko.co.jp/>

電話番号：03-5644-3111(受付時間：日本における営業日の8:40~17:10)

(中略)

なお、申込取扱場所となる各金融商品取引業者を「日本における販売会社」といいます。

(注) S M B C 日興証券株式会社は、2024年3月8日以降、ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクションの米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券および豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券の申込みの取扱いを停止しています。以下、同じです。

## (12) その他

## (口) 引受等の概要

## &lt;訂正前&gt;

日本における販売会社は、管理会社との間の、受益証券販売・買戻契約に基づき、ファンド証券の募集を行います。

(後略)

## &lt;訂正後&gt;

日本における販売会社は、管理会社との間の、受益証券販売・買戻契約に基づき、ファンド証券の募集を行います。ただし、S M B C 日興証券株式会社は、2024年3月8日以降、ピムコ・トータル・リターン・ファンド マルチカレンシー・セレクションの米ドル建ブラジルリアルクラス受益証券および豪ドル建ブラジルリアルクラス受益証券の申込みの取扱いを停止しています。

(後略)

## 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（2023年9月末日現在）

（中略）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年9月29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（１ユーロ＝158.00円）によります。以下同じです。

（後略）

##### <訂正後>

（前略）

（ ）資本金の額（2023年12月末日現在）

（中略）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年12月29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（１ユーロ＝157.12円）によります。以下同じです。

（後略）

## 2 投資方針

### （１）投資方針

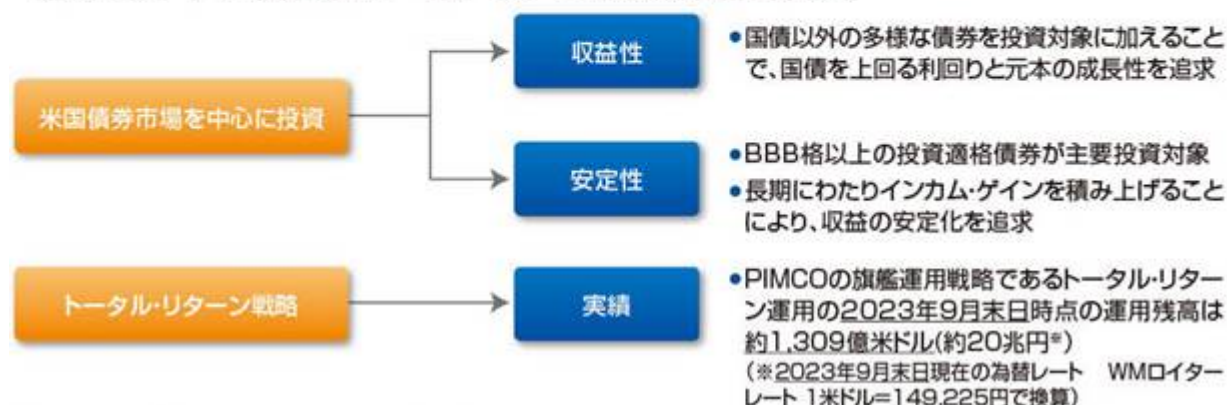
< 訂正前 >

（前略）

#### 米国投資適格債券を中心とする様々な債券に投資し、トータル・リターンの最大化を追求

■対象ファンドへの投資を通じて、主にBBB格以上の米国投資適格債券(米国公債、米国政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券等)に投資を行います。ただし、BB格以下の債券、米国以外の債券、エマージング債券などにも投資を行う場合があります。

■債券投資により得られる金利収入等(インカム・ゲイン)だけではなく、債券価格の上昇によって得られる収益(キャピタル・ゲイン)も含めた「トータル・リターン」の最大化を目指します。



（後略）

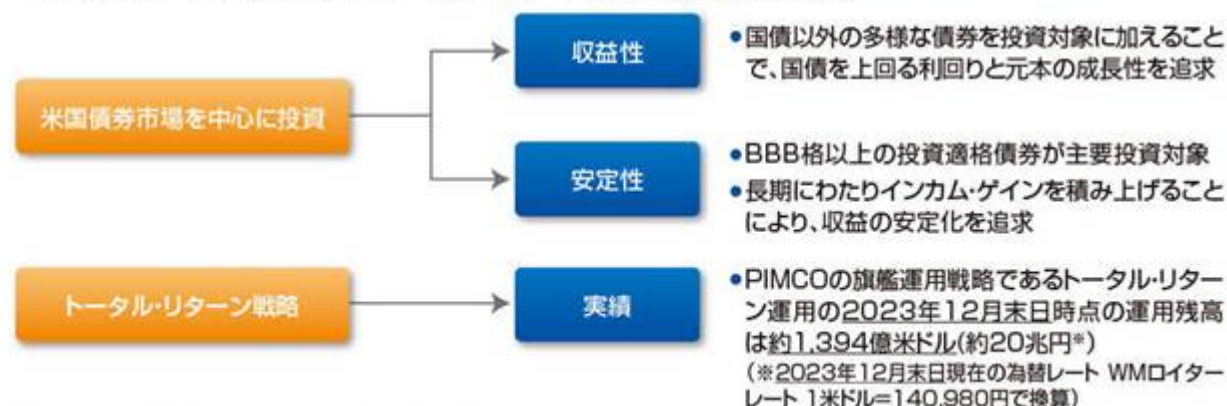
< 訂正後 >

（前略）

#### 米国投資適格債券を中心とする様々な債券に投資し、トータル・リターンの最大化を追求

■対象ファンドへの投資を通じて、主にBBB格以上の米国投資適格債券(米国公債、米国政府機関債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券等)に投資を行います。ただし、BB格以下の債券、米国以外の債券、エマージング債券などにも投資を行う場合があります。

■債券投資により得られる金利収入等(インカム・ゲイン)だけではなく、債券価格の上昇によって得られる収益(キャピタル・ゲイン)も含めた「トータル・リターン」の最大化を目指します。



（後略）

## （２）投資対象

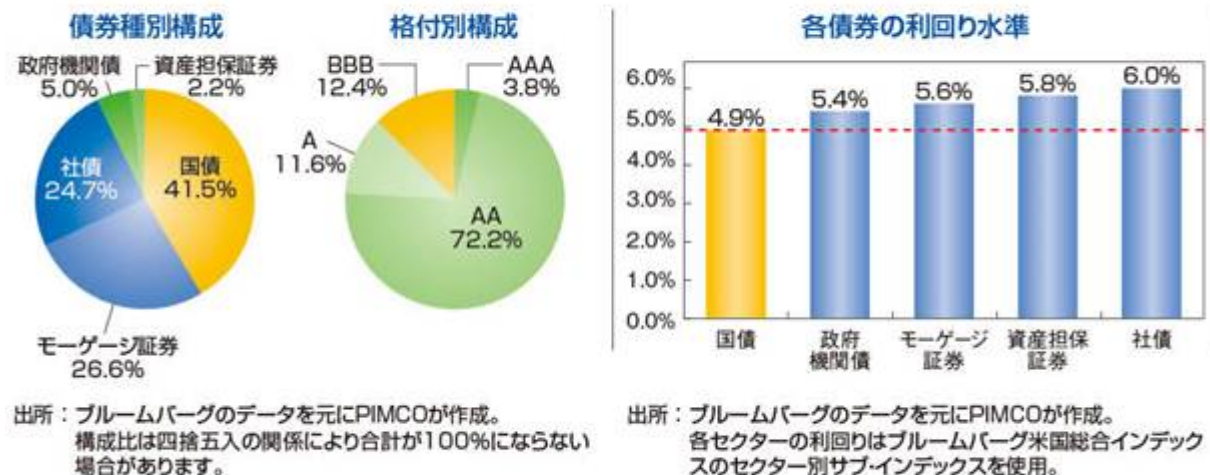
&lt;訂正前&gt;

（前略）

## 米国投資適格債券市場の概要(2023年9月末日現在)

対象ファンドは、ブルームバーグ米国総合インデックスを参考指数として用います。

ブルームバーグ米国総合インデックスに見る米国投資適格債券市場の概要は以下のとおりです。



(注)上記は市場の概要を説明するもので、ファンドの投資方針を示すものではなく、またファンドの将来の運用成果を予測、保証または示唆するものでもありません。

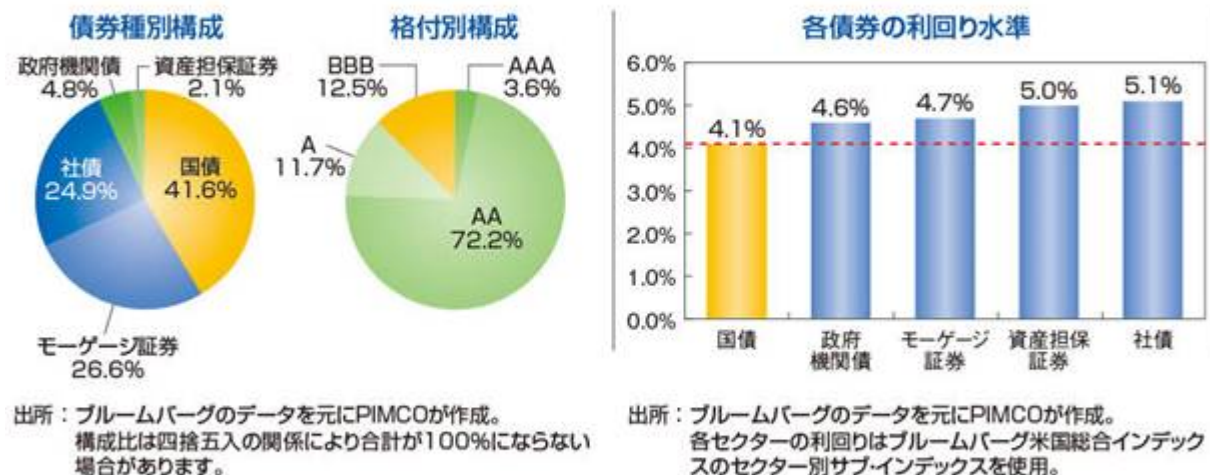
&lt;訂正後&gt;

（前略）

## 米国投資適格債券市場の概要(2023年12月末日現在)

対象ファンドは、ブルームバーグ米国総合インデックスを参考指数として用います。

ブルームバーグ米国総合インデックスに見る米国投資適格債券市場の概要は以下のとおりです。



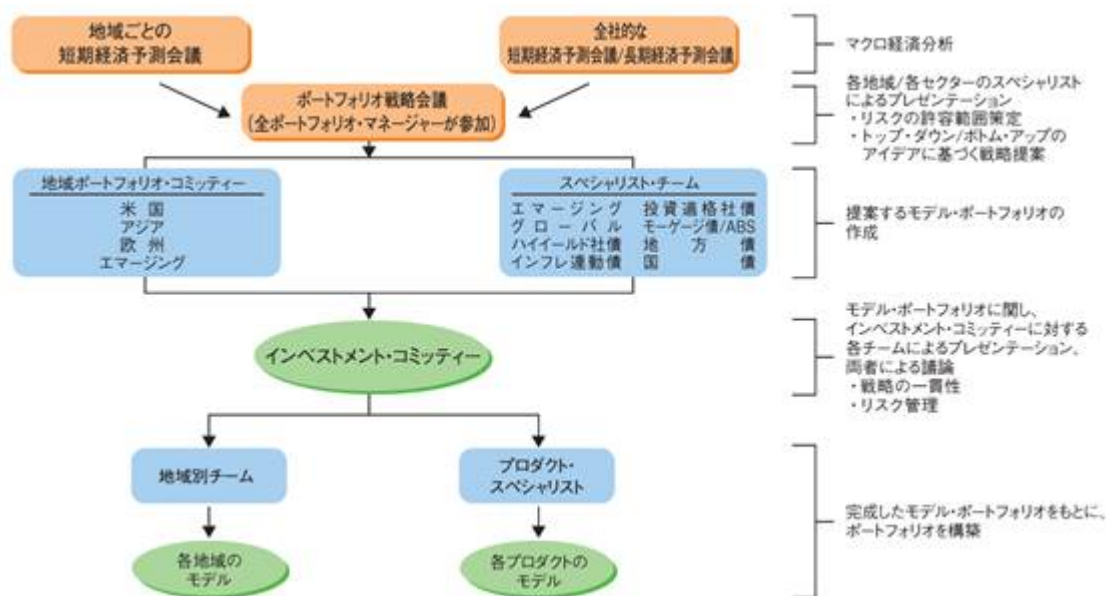
(注)上記は市場の概要を説明するもので、ファンドの投資方針を示すものではなく、またファンドの将来の運用成果を予測、保証または示唆するものでもありません。

### （３）運用体制

<訂正前>

#### 運用プロセス

- \* 長期的な視点に基づいた投資戦略
- \* トップダウン戦略とボトムアップ戦略の融合
- \* 可能な限り付加価値の源泉を多様化し、特定のリスクに偏らない運用

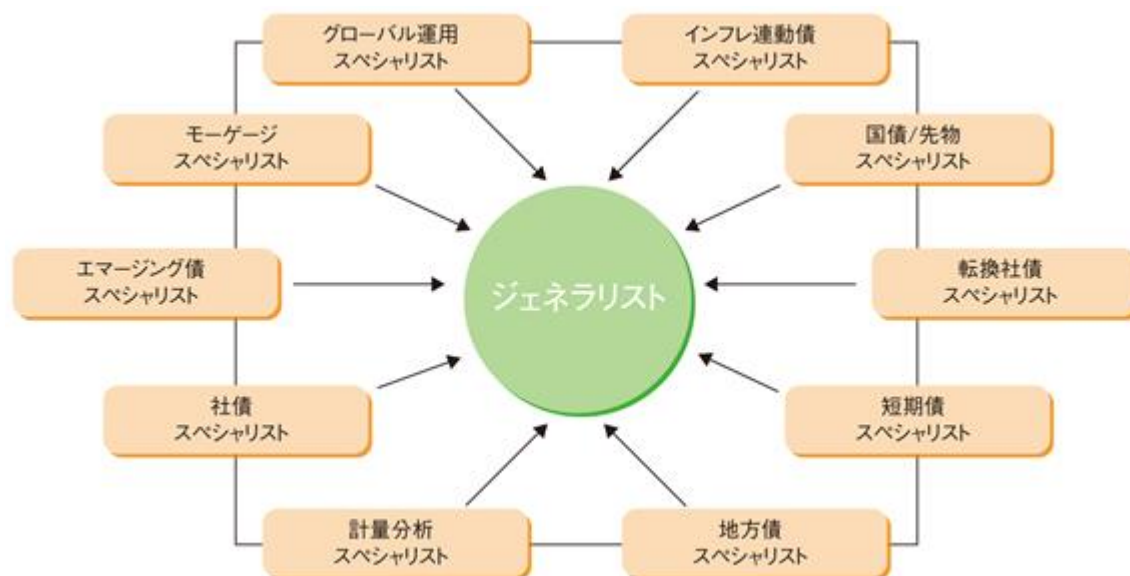


2023年9月末日現在

（中略）

#### PIMCOの運用体制

- \* 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9月末日現在

（中略）

## PIMCOについて

- Pacific Investment Management Company LLC パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（略称「PIMCO」）は1971年に設立され、世界最大級の債券運用残高を誇る運用会社として、2023年9月末日現在、約1.74兆米ドル（約259兆円<sup>\*</sup>）の運用資産（関係会社からの受託分を含む）を有します。（<sup>\*</sup>2023年9月末日現在の為替レート WMロイターレート 1米ドル=149.225円で換算）
- 米国をはじめ、ロンドン、ミュンヘン、日本、シンガポール、シドニー、トロント、香港等を拠点としてグローバルにビジネスを展開しています。

## PIMCOの運用に対する外部からの評価

### 年間最優秀債券マネージャー賞

米国モーニングスター社  
2012年、2013年、2015年

### 運用実績賞

アジア・インベスター誌  
[日本債券]  
2010年、2011年、2013年、2014年  
[グローバル債券（ヘッジ付）]  
2008年、2013年、2015年

The Morningstar Fixed-Income Fund Manager of the Year award (Jerome Schneider and Team, PIMCO Short Term (2015); Dan Ivascyn and Alfred Murata, PIMCO Income (2013); Mark Kiesel, PIMCO Investment Grade Corporate Bond (2012); U.S.) is based on the strength of the manager, performance, strategy, and firm's stewardship.

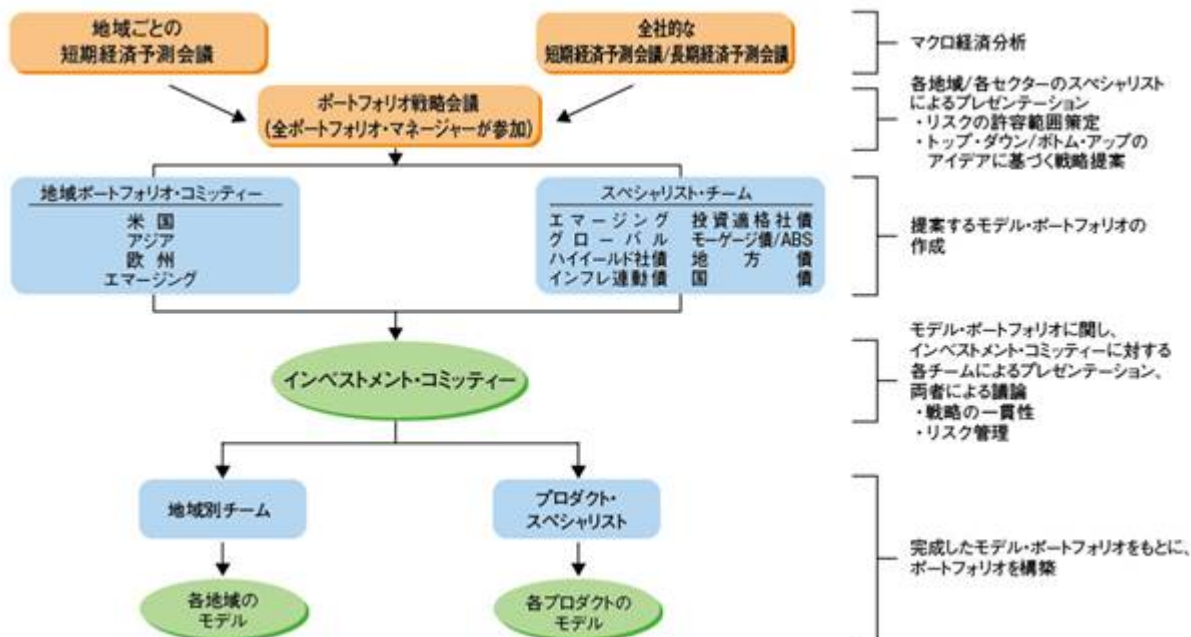
個別の商品への言及は当該商品の推奨や勧誘を意図するものではありません。

当該評価は過去の一定期間の実績を分析したものであり、将来の運用成果等を保証または示唆するものではありません。

### < 訂正後 >

#### 運用プロセス

- \* 長期的な視点に基づいた投資戦略
- \* トップダウン戦略とボトムアップ戦略の融合
- \* 可能な限り付加価値の源泉を多様化し、特定のリスクに偏らない運用

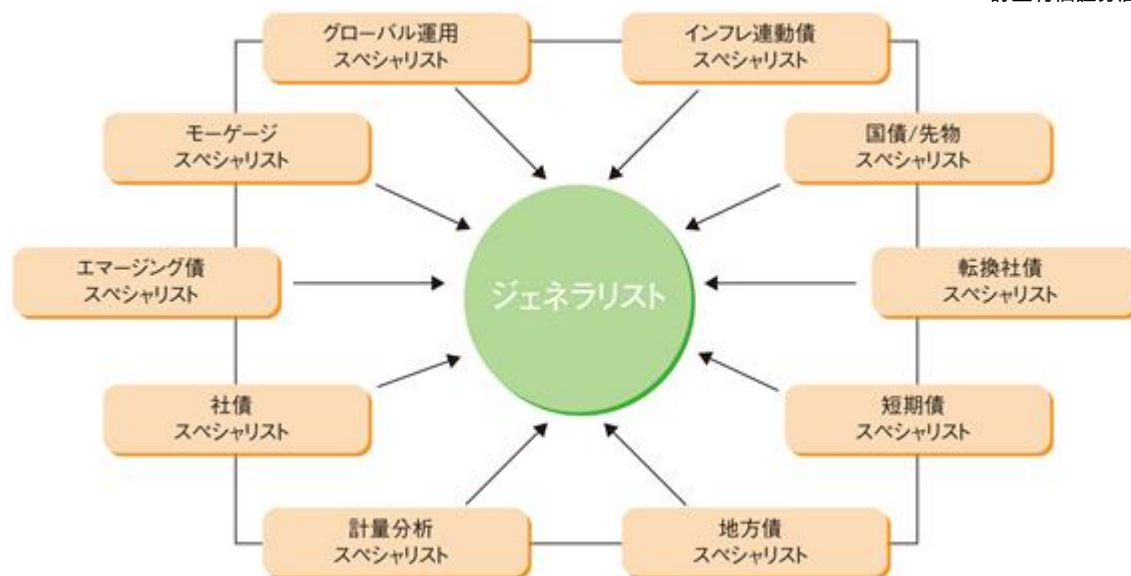


2023年12月末日現在

（中略）

#### PIMCOの運用体制

- \* 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12月末日現在

（中略）

## PIMCOについて

- Pacific Investment Management Company LLC パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(略称「PIMCO」)は1971年に設立され、世界最大級の債券運用残高を誇る運用会社として、2023年12月末日現在、約1.86兆米ドル(約262兆円<sup>※</sup>)の運用資産(関係会社からの受託分を含む)を有します。(※2023年12月末日現在の為替レート WMロイターレート 1米ドル=140.980円で換算)
- 米国をはじめ、ロンドン、ミュンヘン、日本、シンガポール、シドニー、トロント、香港等を拠点としてグローバルにビジネスを展開しています。

## PIMCOの運用に対する外部からの評価

### 年間最優秀債券マネージャー賞

米国モーニングスター社  
2012年、2013年、2015年

### 運用実績賞

アジア・インベスター誌  
[日本債券]  
2010年、2011年、2013年、2014年  
[グローバル債券(ヘッジ付)]  
2008年、2013年、2015年

The Morningstar Fixed-Income Fund Manager of the Year award (Jerome Schneider and Team, PIMCO Short Term (2015); Dan Ivascyn and Alfred Murata, PIMCO Income (2013); Mark Kiesel, PIMCO Investment Grade Corporate Bond (2012); U.S.) is based on the strength of the manager, performance, strategy, and firm's stewardship.

個別の商品への言及は当該商品の推奨や勧誘を意図するものではありません。

当該評価は過去の一定期間の実績を分析したものであり、将来の運用成果等を保証または示唆するものではありません。

### 3 投資リスク

#### リスクの管理体制

< 訂正前 >

（前略）

#### 各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク

##### PIMCO のリスク管理／監視体制



2023年9月末日現在

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

#### 各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク

##### PIMCO のリスク管理／監視体制



2023年12月末日現在

（後略）

#### 4 手数料等及び税金

##### （５）課税上の取扱い

##### （Ａ）日本

##### <訂正前>

2023年10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ります。

（後略）

##### <訂正後>

2024年１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ります。

（後略）