

【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3月29日

【発行者名】

アリアンツ・グローバル・インベスターズ・
ゲーエムベーハー
(Allianz Global Investors GmbH)

【代表者の役職氏名】

業務執行役員 アレクサンドラ・アウアー
(Alexandra Auer)
業務執行役員 ルドヴィク・ロンバード
(Ludovic Lombard)
業務執行役員 インゴ・マイネルト
(Ingo Mainert)
業務執行役員 ロバート・シュミット
(Robert Schmidt)
業務執行役員 ペトラ・トラウツショルド
(Petra Trautschold)
業務執行役員 ビルテ・トレンクナー
(Birte Trenkner)

【本店の所在の場所】

ドイツ連邦共和国 60323 フランクフルト・アム・マイン
ボッケンハイマー ラントシュトラッセ 42-44
(Bockenheimer Landstraße 42-44, 60323 Frankfurt am
Main, The Federal Republic of Germany)

【代理人の氏名又は名称】

弁護士 竹 野 康 造
弁護士 大 西 信 治

【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 竹 野 康 造
弁護士 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】	アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ ファンド (Allianz PIMCO High Yield Income Fund)
【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】	20億3,600万米ドル(約3,044億円)を上限とする。 (注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)の円貨換算は、2023年10月31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=149.51円)による。
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2023年12月28日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により更新および追加するとともにその他一部情報の時点を更新するため、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。

_____の部分は訂正箇所を示します。ただし、全文修正（更新）の場合は下線を付しておりません。

2 【訂正の内容】

2－1. 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 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 ③ 管理会社の概況	(iii) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	① 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新

* 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

(アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ファンド(Allianz PIMCO High Yield Income Fund)(以下「ファンド」という。))

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(2024年1月末日現在)

資産の種類	国名(発行地)	時価合計(アメリカ合衆国ドル)	投資比率(%)
債券	南アフリカ	12,527,661.40	6.47
	トルコ	11,458,604.78	5.92
	メキシコ	11,383,415.24	5.88
	コロンビア	10,563,028.72	5.46
	アメリカ合衆国	10,387,292.80	5.37
	ドミニカ共和国	10,362,601.30	5.35
	ケイマン諸島	9,558,434.07	4.94
	パナマ	7,882,282.29	4.07
	アルゼンチン	7,367,998.68	3.81
	ハンガリー	6,911,244.55	3.57
	エクアドル	5,315,768.60	2.75
	ルクセンブルグ	5,017,641.83	2.59
	ルーマニア	4,822,721.43	2.49
	ブラジル	4,132,493.65	2.13
	チリ	3,967,401.14	2.05
	ベネズエラ	3,723,004.67	1.92
	イスラエル	3,693,713.67	1.91
	コートジボワール	3,364,933.58	1.74
	フィリピン	3,274,552.99	1.69
	ペルー	3,150,520.35	1.63
	セルビア	2,386,327.50	1.23
	アラブ首長国連邦	2,317,587.55	1.20
	ウクライナ	2,138,505.96	1.10
	インドネシア	2,011,746.66	1.04
	アルバニア	1,997,415.61	1.03
	インド	1,871,586.21	0.97
	イギリス	1,773,398.50	0.92
	アイルランド	1,703,277.00	0.88
	サウジアラビア	1,599,214.14	0.83
	スリランカ	1,505,157.38	0.78
	カタール	1,347,325.46	0.70
	アンゴラ	1,279,098.50	0.66
	韓国	1,205,539.45	0.62
	ポーランド	1,199,021.22	0.62
	ナイジェリア	1,194,767.91	0.62
	アゼルバイジャン	1,184,455.90	0.61
	オランダ	1,166,536.46	0.60
	ブルガリア	1,149,844.23	0.59
	チュニジア	1,070,356.11	0.55
	パキスタン	935,297.16	0.48
	モロッコ	927,507.75	0.48
	英領ヴァージン諸島	894,717.56	0.46
	グアテマラ	886,295.12	0.46

資産の種類	国名(発行地)	時価合計(アメリカ合衆国ドル)	投資比率(%)
債券	ウズベキスタン	811,314.30	0.42
	マレーシア	744,289.95	0.38
	バハマ	666,185.63	0.34
	ジャージー	659,251.96	0.34
	ヨルダン	648,960.05	0.34
	カメルーン	600,516.20	0.31
	パラグアイ	569,691.66	0.29
	北マケドニア	567,852.16	0.29
	カザフスタン	533,229.76	0.28
	ガーナ	518,883.76	0.27
	オマーン	493,825.00	0.26
	バミューダ	460,180.00	0.24
	シンガポール	385,353.31	0.20
	国際機関	347,609.04	0.18
	コスタリカ	313,555.50	0.16
	ロシア	307,567.56	0.16
	トリニダード・トバゴ	305,278.74	0.16
	ケニア	292,235.40	0.15
	マン島	261,478.96	0.14
	モンゴル	206,177.30	0.11
	オーストリア	105,290.06	0.05
	マーシャル諸島	85,777.94	0.04
	セネガル	78,778.96	0.04
	スイス	0.02	0.00
小計		182,573,578.30	94.32
現金・その他の資産 (負債控除後)		10,989,596.91	5.68
合計 (純資産総額)		193,563,175.21 (約28,560百万円)	100.00

(注1) 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の比率をいう。

(注2) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という)の円貨換算は、2024年1月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=147.55円)による。以下同じ。

(注3) 本書の中で、金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ必要な場合四捨五入してある。従って、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合がある。

(2) 運用実績

① 純資産の推移

2024年1月末日および同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次のとおりである。

	純資産総額		一口当りの純資産価格	
	千米ドル	百万円	米ドル	円
2023年2月末日	195,654	28,869	5.98	882.35
3月末日	195,664	28,870	6.02	888.25
4月末日	196,299	28,964	6.02	888.25
5月末日	196,833	29,043	5.92	873.50
6月末日	197,807	29,186	6.00	885.30
7月末日	198,481	29,286	6.07	895.63
8月末日	194,083	28,637	5.97	880.87
9月末日	184,127	27,168	5.73	845.46
10月末日	183,264	27,041	5.70	841.04
11月末日	191,801	28,300	6.00	885.30
12月末日	197,853	29,193	6.26	923.66
2024年1月末日	193,563	28,560	6.16	908.91

② 分配の推移

管理会社は、ファンドの純投資収益、純実現・純未実現キャピタル・ゲインおよび分配可能な資本の中から分配金を毎月1回支払う予定である。分配は、毎月15日の営業終了日に登録されている受益者に対し支払われる予定である。日本では、分配金は毎月末または日程により翌月初めに支払われる予定である。

	一口当りの支払分配金	
	米ドル	円
2023年2月	0.025	3.69
3月	0.025	3.69
4月	0.025	3.69
5月	0.025	3.69
6月	0.025	3.69
7月	0.025	3.69
8月	0.025	3.69
9月	0.025	3.69
10月	0.025	3.69
11月	0.025	3.69
12月	0.025	3.69
2024年1月	0.025	3.69

③ 収益率の推移

計算期間	収益率(%) (注)
2023年2月1日～2024年1月31日	4.98

(注) 収益率(%) = $100 \times \left(\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right)$

A = 計算期間中の各月についての「一口当り分配額 / 分配落NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値

ただし、期首NAVとは、2023年1月末日現在の一口当り純資産価格をいい、期末NAVとは2024年1月末日現在の一口当り純資産価格をいう。

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2024年1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2024年1月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

販売口数	買戻し口数	発行済口数
1,713,820 (1,713,820)	3,184,086 (3,184,086)	31,419,360 (31,419,360)

(注) ()の数値は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[前へ](#)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、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、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2024年1月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝147.55円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

[前へ](#)

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ファンド

純資産計算書

2023年12月31日現在

	(米ドル)	(千円)
有価証券および短期金融商品 (原価225,440,359.52米ドル)	187,570,450.81	27,676,020
現金預金	9,779,048.95	1,442,899
スワップ取引に係る支払済前払金	1,205,216.95	177,830
未収利息		
— 債券	3,410,499.28	503,219
— スワップ取引	211,900.73	31,266
未収金		
— ファンド証券発行	43,820.00	6,466
その他の未収金	2,169.01	320
未実現利益		
— 先物取引	2,423,392.83	357,572
— スワップ取引	2,665,772.72	393,335
— 先物為替取引	324,774.82	47,921
資産合計	207,637,046.10	30,636,846
銀行に対する債務	-2,483,382.15	-366,423
スワップ取引に係る受領済前払金	-2,661,385.30	-392,687
スワップ取引に係る利息債務	-401,974.48	-59,311
未払金		
— ファンド証券買戻	-38,367.00	-5,661
その他の未払金	-409,913.14	-60,483
未実現損失		
— 先物取引	-725,535.73	-107,053
— スワップ取引	-2,402,190.31	-354,443
— 先物為替取引	-661,557.80	-97,613
負債合計	-9,784,305.91	-1,443,674
純資産	197,852,740.19	29,193,172

添付の注記は当財務書類の一部である。

純資産変動計算書

2023年7月1日から2023年12月31日までの期間

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	197,806,525.31	29,186,353
発行受取額	2,868,501.70	423,247
買戻支払額	-10,892,099.60	-1,607,129
分配金	-4,833,159.75	-713,133
運用実績	12,902,972.53	1,903,834
期末現在純資産	197,852,740.19	29,193,172

受益証券変動計算書

	2023年7月1日～ 2023年12月31日 (口)	2022年7月1日～ 2023年6月30日 (口)
期首現在発行済受益証券数	32,952,409	35,061,041
－発行受益証券数	494,610	1,494,070
－買戻受益証券数	-1,832,864	-3,602,702
期末現在発行済受益証券数	31,614,155	32,952,409

ファンドのパフォーマンス

	クラス(米ドル) (分配型) % ¹⁾
当期 (2023年6月30日～2023年12月31日)	7.01
1年 (2022年6月30日～2023年6月30日)	6.06
2年 (2021年6月30日～2023年6月30日)	-18.68
3年 (2020年6月30日～2023年6月30日)	-14.58
5年 (2018年6月30日～2023年6月30日)	-3.35
10年 (2013年6月30日～2023年6月30日)	12.93
設定来 ²⁾ (1997年12月16日～2023年6月30日)	255.85

¹⁾ 計算は、分配金を再投資したと仮定し、(販売手数料を除く)1口当り純資産価格に基づいている。実績は、ドイツのBVI (Bundesverband Investment und Asset Management e.V.)が推奨する方法に従って計算される。

²⁾ 運用開始日：1997年12月16日。当初1口当り純資産価格：10.00米ドル。

過去の実績は、現在または将来の実績の指標とはならない。

実績データは、受益証券の発行・買戻しで生じる手数料および費用を考慮していない。

添付の注記は当財務書類の一部である。

[前へ](#)

[次へ](#)

アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ファンド

財務書類に対する注記

2023年12月31日

会計方針

会計基準

財務書類は、ルクセンブルグの投資信託に関する規則に準拠して作成される。

アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ファンドの基準通貨は、米ドル（USD）である。

資産の評価

証券取引所に公的に上場されている資産は、入手可能な直近の支払価格により評価される。

証券取引所に公式に上場されていないが規制ある市場またはその他の組織的な市場で取引されている資産は、評価時にかかる値が資産の売却のため最も好ましい取引値であるとの管理会社による判断を条件に、入手可能な直近の支払価格により評価される。

取引価格が公正な市場価格でない資産およびすべてのその他の資産は、推定実現価格で評価される。管理会社は、別の評価方法が資産の公正価格をより反映すると考える場合には、その単独の裁量により、当該方法の使用を許可することができる。

通貨、証券、金融指標、金利その他の許容される金融商品に関する金融先物取引ならびにそれらのオプションおよび関連ワラントは、証券取引所に上場されている場合、当該証券取引所の最新価格で評価される。証券取引所に上場されていない場合、特にすべての店頭市場取引に関して、評価は推定実現価格で行われる。

金利スワップは、適用される金利曲線を基準とする市場価格で評価される。指数および金融商品と結びついたスワップは、該当指標または該当金融商品を基準に算定される市場価格に基づいて評価される。

譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託（UCITS）またはその他の投資信託（UCI）における受益証券は、算定された入手可能な直近の買戻価格で評価される。

現金および定期預金は、額面価額に経過利息を付して評価される。

ファンドの基準通貨（以下「ファンド基準通貨」という。）以外の通貨建て資産は、直近の為替相場の仲値でファンド基準通貨に換算される。

有価証券価格

純資産額の計算は、目論見書の規定に従って、評価日の直近の有価証券価格を基準にしている。

年次報告書の財務書類は、有価証券価格に基づき報告期間の直近で計算され公表された純資産額に基づいて作成されている。

外貨

外貨建ての資産および負債は、下記の為替レートにより換算されている。

オーストラリアドル	(AUD)	1米ドル= AUD	1.469400
ブラジル・レアル	(BRL)	1米ドル= BRL	4.857600
英ポンド	(GBP)	1米ドル= GBP	0.787030
カナダドル	(CAD)	1米ドル= CAD	1.325300
チェコ・コルナ	(CZK)	1米ドル= CZK	22.375350
ドミニカ・ペソ	(DOP)	1米ドル= DOP	57.990000
ユーロ	(EUR)	1米ドル= EUR	0.905059
ハンガリー・フォリント	(HUF)	1米ドル= HUF	346.411450
日本円	(JPN)	1米ドル= JPY	141.900000
メキシコ・ペソ	(MXN)	1米ドル= MXN	16.951000
イスラエル・シェケル	(ILS)	1米ドル= ILS	3.618750
ノルウェー・クローネ	(NOK)	1米ドル= NOK	10.178750
ペルー・ヌエボ・ソル	(PEN)	1米ドル= PEN	3.692850
ポーランド・ズロチ	(PLN)	1米ドル= PLN	3.935200
ロシア・ルーブル	(RUB)	1米ドル= RUB	89.725000
シンガポール・ドル	(SGD)	1米ドル= SGD	1.320800
南アフリカ・ランド	(ZAR)	1米ドル= ZAR	18.525000
スウェーデン・クローナ	(SEK)	1米ドル= SEK	10.040250
スイス・フラン	(CHF)	1米ドル= CHF	0.840000

税制

ファンドは、それ自身が年次税 ("Taxe d'Abonnement") を課されるルクセンブルグのファンドにその資産が投資されない限り、各四半期末日現在のファンドの純資産総額に対して計算され支払われるルクセンブルグ大公国の年次税を課されている。ファンドの収益に対して、ルクセンブルグの税金は課されていない。

受益証券の収益の分配金および累積に対して、ルクセンブルグの源泉税は現在課されていない。

一括報酬

ファンドが負担するすべての費用は、ファンドの資産から支払われる。

ファンドは、特定の受益証券クラスの条件に基づいて受益者に直接請求されない限り、ファンドの資産から管理会社に報酬（以下「一括報酬」という。）を支払う。

管理会社により任命された投資運用会社の報酬は、管理会社により一括報酬および該当する場合には成功報酬から支払われる。

特定の受益証券クラスの条件に基づいて受益者に直接請求されない場合、一括報酬は、毎月後払いで支払われ、関連する受益証券クラスの日々の平均純資産総額に基づき比例配分して計算される。

管理会社は、一括報酬の支払の見返りとして、ファンドに対して以下の報酬および費用を免除する。

－管理報酬および中央管理事務代行報酬

－販売報酬

－保管報酬

－登録事務・名義書換事務代行会社に対する報酬

- －目論見書、重要投資家情報書類、約款、年次報告書、半期報告書および（もしある場合には）中間報告書、その他の報告書および受益者宛通知の作成（翻訳を含む。）ならびに送付費用
- －目論見書、重要投資家情報書類、約款、年次報告書、半期報告書および（もしある場合には）中間報告書、その他の報告書および受益者宛通知、課税情報、申込みおよび買戻し価格の公表に掛かる費用ならびに受益者宛正式告知の費用
- －外部監査人によるファンドの監査費用
- －公衆に対する販売のための受益証券の登録費用および／または当該登録の維持費用
- －券面および（もしある場合には）クーポン発行ならびにクーポン更新費用
- －支払事務代行および情報提供代行報酬
- －国内外で認められている格付け会社によるファンド評価の費用。
- －インデックス名の使用に関連する費用、特にライセンス料
- －ファンド・マネージャーおよび投資顧問会社が使用する社内または外部のITシステムの取得、使用および保守に関してファンドおよびファンドの管理会社が承認した第三者が負担する費用および経費
- －管理会社による国内資産への直接投資を許可し、または管理会社が国内市場において契約上のパートナーとして直接行為する地位の取得および維持に関連する費用
- －投資限度および投資制限の監視に関連してファンド、保管受託銀行およびファンドまたは保管受託銀行のために行う第三者に生じた費用および経費
- －指名された第三者によるリスクおよびパフォーマンス数値の計算ならびに管理会社に対する成功報酬の計算に係る費用
- －会社の受益者総会または資産の所有者の他の会合についての情報の取得に関連する費用、およびかかる会合への直接参加または承認された第三者による参加に関連する費用
- －郵便料金、電話料金、ファックス料金、テレックス料金

報酬の構成

	一括報酬 年率 %	年次税 年率 %
アリアンツ・ビムコ・ハイ・イールド ・インカム・ファンド	1.50	0.05

証券現先取引契約および証券貸付取引契約

証券現先取引契約および証券貸付取引契約（総称して、以下「証券金融取引」という。）は、2008年6月4日付の金融監督委員会告示08/356および2014年9月30日付金融監督委員会告示14/592ならびに規制(EU)No 648/2012を改正する、証券金融取引および再利用の透明性に関する欧州議会および理事会の2015年11月25日付規制(EU)2015/2365（以下「証券金融取引規制」という。）の要件を満たさなくてはならない。

ファンドは、買い手および売り手として証券現先取引契約を締結することができ、また借り手または貸し手として証券貸付取引契約を締結することができる。ただし、取引相手方は、かかる取引を専門とし、かつ、広く認識された格付機関（ムーディーズ、S&Pグローバル・レーティングまたはフィッチなど）からBaa3（ムーディーズ）またはBBB-（S&Pグローバル・レーティングまたはフィッチ）以上を取得した一流の金融機関でなければならない。上記以外に、取引相手方の法的地位または本社所在地国に関する規制はない。

証券現先取引契約においては、売り手は、買い手に対し、証券およびマネー・マーケット商品を売却するものとし、また、

- ・売り手および買い手は、既に、契約が締結された時点で設定された価格で、合意された期間内に、証券またはマネー・マーケット商品を売却および買戻す義務を負っているか、または
- ・売り手または買い手は、契約が締結された時点で設定された価格で、合意された期間内に、証券またはマネー・マーケット商品を契約の他方当事者に売却する権利を有するか、または契約の他方当事者に売却することを要求する権利を有するものとする。

かかる証券およびマネー・マーケット商品は、証券現先契約の期間中は売却することはできないものとし、また、ファンドは、常に、買戻しの約定に応じるポジションをとっていなければならないものとする。ファンドは、逆現先取引に合意する場合（ファンドは証券現先取引契約における買い手である。）、いつでも現金の全額を返還請求できること、または発生した総額もしくは値洗い価額で逆現先取引を終了させることができることを確保しなければならない。いずれかの時点で、現金を値洗い価額で返還請求することができる場合、逆現先取引の値洗い価額は、ファンドの純資産価額を算出するために使用されなければならない。ファンドは、現先取引に合意する場合（ファンドは証券現先取引契約における売り手である。）、いつでも現先取引の裏付証券を返還請求できること、または合意された現先取引を終了させることができることを確保しなければならない。契約期間が7日間を超えない証券現先契約は、ファンドがいつでも資産を返還請求することができる契約とみなされる。

証券貸付取引契約の場合、証券およびマネー・マーケット商品は、第三者が証券貸付取引契約の終了時に証券を返還しなければならないという条件で、手数料と引き換えに第三者に貸し付けられる。ファンドは、証券貸付取引契約において貸し付けられたすべての証券がいつでも返還されること、また、締結されたすべての証券貸付契約がいつでも終了され得ることを確保しなければならない。

ファンドが行うことができる証券現先取引契約および証券貸付取引契約に関するリスクの概要は以下の通りである（すべてを網羅するものではない。）。

- ・ファンドは、証券またはマネー・マーケット商品を貸し付ける場合、証券貸付期間内にかかる資産を売却することはできない。ファンドは、資産の市場パフォーマンスに完全に関与することになり、資産を売却することによって市場パフォーマンスへの関与を終了させることはできない。
- ・上記の規定は、現先契約に従って売却される証券およびマネー・マーケット商品に関するファンドの買戻し義務にも適用される。

- ・証券貸付取引契約の期間中に現金で提供された担保が他の資産に投資された場合、受取人は、通常、かかる期間中に投資に損失が生じた場合でも担保を提供した当事者に対し、少なくとも担保として提供された現金を貸付期間終了後に支払う義務を免れることはないものとする。
- ・上記の規定は、ファンドが現先契約に従って証券およびマネー・マーケット商品を売却した場合に、ファンドが受取り、その後に投資した流動性資産にも同様に適用される。
- ・証券またはマネー・マーケット商品が貸し付けられる場合、ファンドは、少なくとも貸し付けられた資産の取引締結時の価額に相当する価額の担保物を受け取るものとする。ただし、かかる担保は、その形態によって、その価値が減少する場合があります、借り手の買戻し義務の不履行またはデフォルトの場合、かかる損失は担保を清算することによって完全に補償されない可能性がある。
- ・上記の規定は、転売契約に基づき購入された証券およびマネー・マーケット商品にも、かかる証券およびマネー・マーケット商品の価格が減少した場合に取引相手方によって支払われる買戻価格に関し、同様に適用される。
- ・ファンドが証券またはマネー・マーケット商品を貸し付ける場合、借り手は、通常、その後短期間でかかる証券またはマネー・マーケット商品を転売するか、または既に事前に転売してしまっている場合もある。借り手は、通常、ファンドによって貸し付けられた資産の価格に関連する証券およびマネー・マーケット商品の価格は低下すると推測する。その結果、ファンドによって行われた証券貸付取引契約は、証券の価格のパフォーマンスにマイナスの影響を及ぼす可能性があり、これによりファンドの一口当り価格にも取引から得られる証券貸付収益によって相殺できない程のマイナスの影響を及ぼす可能性がある。

[前へ](#)[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

アリアンツ・ピムコ・ハイ・イールド・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

2023年12月31日現在

ISIN	証券銘柄			株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	
公認の証券取引所への上場を認可されている証券および短期金融商品							180,042,932.92	91.00	
債券							180,042,932.92	91.00	
アルバニア									
XS2636412210	5.9000	%	Albania Government EUR Bonds 23/28	EUR	1,800.0	%	102.531	2,039,152.70	1.03
アンゴラ							1,294,905.25	0.65	
XS1318576086	9.5000	%	Angola Government USD Bonds 15/25	USD	200.0	%	98.493	196,986.34	0.10
XS1819680288	8.2500	%	Angola Government USD Bonds 18/28	USD	900.0	%	92.301	830,707.02	0.42
XS2083302419	8.0000	%	Angola Government USD MTN 19/29	USD	300.0	%	89.071	267,211.89	0.13
アルゼンチン							7,341,117.91	3.71	
US040114HX11	1.0000	%	Argentina Government USD Bonds 20/29	USD	2,142.1	%	40.370	864,756.26	0.44
US040114HS26	0.7500	%	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/30	USD	131.8	%	40.651	53,563.09	0.03
US040114HT09	3.6250	%	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/35	USD	4,787.5	%	34.747	1,663,490.08	0.84
US040114HU71	4.2500	%	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/38	USD	7,070.2	%	39.991	2,827,412.72	1.43
US040114HV54	3.5000	%	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/41	USD	4,266.0	%	34.622	1,476,965.94	0.74
XS2385150334	6.3750	%	Provincia de Buenos Aires USD FLR-MTN 21/37	USD	700.0	%	39.088	273,612.50	0.14
USP79171AD96	6.8750	%	Provincia de Cordoba USD FLR-Notes 16/25	USD	101.8	%	91.520	93,159.16	0.05
USP7169GAA78	6.7500	%	Provincia de Neuquen Argentina USD FLR-Notes 17/30	USD	103.3	%	85.358	88,158.16	0.04
オーストリア							107,382.50	0.05	
XS1961852248	3.1250	%	Sappi Papier Holding EUR Notes 19/26	EUR	100.0	%	97.188	107,382.50	0.05
アゼルバイジャン							1,196,017.26	0.60	
XS1678623734	3.5000	%	Azerbaijan Government USD Bonds 17/32	USD	200.0	%	87.384	174,767.26	0.09
XS1319820897	6.8750	%	Southern Gas Corridor USD Notes 16/26	USD	1,000.0	%	102.125	1,021,250.00	0.51
バハマ							665,090.63	0.34	
USP06518AG23	6.0000	%	Bahamas Government USD Bonds 17/28	USD	750.0	%	88.679	665,090.63	0.34
バミューダ							458,898.11	0.23	
USG8438NAB31	4.8500	%	Star Energy Geothermal Darajat II Via Star Energy Geothermal Salak USD Notes 20/38	USD	500.0	%	91.780	458,898.11	0.23
ブラジル							3,819,677.63	1.93	
USP2000TAA36	3.2500	%	Banco do Brasil USD Notes 21/26	USD	900.0	%	95.092	855,828.54	0.43
XS2034834064	8.5000	%	Banco do Brasil (London) MXN MTN 19/26	MXN	16,000.0	%	94.563	892,577.43	0.45
BRSTNCNTB3D4	6.0000	%	Brazil Notas do Tesouro Nacional BRL Bonds 10/50	BRL	1,300.0	%	458.034	1,225,798.59	0.62
BRVALEDBS028	1.0000	%	Vale BRL FLR-Notes 97/undefined	BRL	11,480.0	%	35.775	845,473.07	0.43
英領ヴァージン諸島							856,381.56	0.43	
XS2357132849	3.9500	%	Fortune Star EUR Notes 21/26	EUR	300.0	%	66.029	218,864.94	0.11
XS2132420758	6.8500	%	Fortune Star USD Notes 20/24	USD	200.0	%	96.753	193,506.62	0.10
XS2001732283	4.5000	%	Huarong Finance 2019 USD MTN 19/29	USD	500.0	%	88.802	444,010.00	0.22
ブルガリア							587,262.74	0.30	
XS2716887760	4.3750	%	Bulgaria Government EUR Bonds 23/31	EUR	200.0	%	105.147	232,353.16	0.12
XS2716887844	4.8750	%	Bulgaria Government EUR Bonds 23/36	EUR	300.0	%	107.071	354,909.58	0.18
カメルーン							613,435.64	0.31	
XS2360598630	5.9500	%	Cameroon Government EUR Bonds 21/32	EUR	750.0	%	74.026	613,435.64	0.31
ケイマン諸島							8,455,141.73	4.27	
USG13201AA91	5.3330	%	Brazil Minas Via State of Minas Gerais USD Notes 13/28	USD	1,602.5	%	98.472	1,578,013.80	0.80
USG2176DAB40	3.3750	%	CK Hutchison International 19 II USD Notes 19/49	USD	700.0	%	76.804	537,629.26	0.27
XS2051371222	6.1500	%	Country Garden Holdings USD Notes 19/25	USD	300.0	%	8.704	26,112.30	0.01
USG2583XAB76	6.7500	%	CSN Inova Ventures USD Notes 20/28	USD	200.0	%	97.640	195,279.76	0.10
XS2542162321	5.0000	%	Gaci First Investment USD Notes 22/27	USD	1,500.0	%	101.114	1,516,710.30	0.77
XS2585988145	5.1250	%	Gaci First Investment USD Notes 23/53	USD	900.0	%	90.888	817,992.18	0.41
USP52715AB80	0.0000	%	Interoceanica IV Finance USD Zero-Coupon Notes 30.11.2025	USD	19.7	%	88.358	17,415.62	0.01
XS1627598094	9.3750	%	Kaisa Group Holdings USD Notes 17/24	USD	300.0	%	3.804	11,412.00	0.01
XS2078247983	11.9500	%	Kaisa Group Holdings USD Defaulted Notes 19/23	USD	200.0	%	3.591	7,182.00	0.00
XS2338398253	11.7000	%	Kaisa Group Holdings USD Notes 21/25	USD	200.0	%	3.621	7,242.00	0.01
USG5975LAC03	5.2500	%	Melco Resorts Finance USD Notes 19/26	USD	300.0	%	96.546	289,637.82	0.15
USG60744AG74	4.7500	%	MGM China Holdings USD Notes 21/27	USD	400.0	%	95.279	381,116.36	0.19
USG7150PAA87	6.6250	%	Poinsettia Finance USD Notes 16/31	USD	767.3	%	84.780	650,474.55	0.33
US80007RAF29	5.3750	%	Sands China USD Notes 19/25	USD	200.0	%	98.700	197,400.22	0.10
XS2706163131	6.0000	%	Suci Second Investment USD Notes 23/28	USD	900.0	%	105.915	953,237.61	0.48
XS2708721233	6.0000	%	Sunac China Holdings USD Notes 23/25	USD	14.5	%	12.599	1,821.69	0.00
XS2708721589	6.2500	%	Sunac China Holdings USD Notes 23/26	USD	14.5	%	11.140	1,610.73	0.00
XS2708721829	6.5000	%	Sunac China Holdings USD Notes 23/27	USD	28.9	%	9.499	2,746.92	0.00
XS2708722397	6.7500	%	Sunac China Holdings USD Notes 23/28	USD	43.4	%	8.217	3,564.29	0.00
XS2708722637	7.0000	%	Sunac China Holdings USD Notes 23/29	USD	43.4	%	7.758	3,365.19	0.00

ISIN	証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
XS2708722983	7.2500 % Sunac China Holdings USD Notes 23/30	USD	20.4 %	6.553	1,335.37	0.00
XS2708723791	1.0000 % Sunac China Holdings USD Notes 23/32	USD	13.1 %	8.044	1,053.28	0.00
US91911TAK68	6.8750 % Vale Overseas USD Notes 06/36	USD	290.0 %	109.083	316,339.98	0.16
US91911TAK97	6.8750 % Vale Overseas USD Notes 09/39	USD	600.0 %	109.540	657,241.50	0.33
XS2278364075	3.0000 % Zhongsheng Group Holdings USD Notes 21/26	USD	300.0 %	93.069	279,207.00	0.14
チリ						2,518,569.69
US168863DU93	3.2500 % Chile Government USD Bonds 21/71	USD	1,000.0 %	67.435	674,353.00	0.34
US168863DV76	3.5000 % Chile Government USD Bonds 22/34	USD	200.0 %	89.701	179,401.20	0.09
US168863DY16	4.3400 % Chile Government USD Bonds 22/42	USD	400.0 %	89.903	359,613.76	0.18
USP3143NB89	5.1250 % Corporacion Nacional del Cobre de Chile USD Notes 23/33	USD	300.0 %	97.226	291,676.89	0.15
USP3143NBQ62	5.9500 % Corporacion Nacional del Cobre de Chile USD Notes 23/34	USD	300.0 %	101.730	305,191.47	0.15
USP3143NBR46	6.3000 % Corporacion Nacional del Cobre de Chile USD Notes 23/53	USD	300.0 %	101.910	305,729.37	0.16
USP37110AS59	6.1500 % Empresa Nacional del Petroleo USD Notes 23/33	USD	400.0 %	100.651	402,604.00	0.20
コロンビア						10,942,089.12
US195325BK01	7.3750 % Colombia Government USD Bonds 06/37	USD	600.0 %	104.204	625,222.02	0.31
US195325BM66	6.1250 % Colombia Government USD Bonds 09/41	USD	1,700.0 %	91.534	1,556,073.58	0.79
US195325CX13	4.5000 % Colombia Government USD Bonds 15/26	USD	2,200.0 %	98.363	2,163,986.44	1.09
US195325DS19	3.1250 % Colombia Government USD Bonds 20/31	USD	500.0 %	81.741	408,703.45	0.21
US195325DT91	4.1250 % Colombia Government USD Bonds 20/51	USD	1,400.0 %	66.916	936,825.26	0.47
US195325DZ51	3.2500 % Colombia Government USD Bonds 21/32	USD	2,500.0 %	80.004	2,000,100.50	1.01
US195325EA91	4.1250 % Colombia Government USD Bonds 21/42	USD	300.0 %	71.866	215,597.94	0.11
US195325DX04	3.8750 % Colombia Government USD Bonds 21/61	USD	1,100.0 %	62.809	690,895.48	0.35
US195325EG61	7.5000 % Colombia Government USD Bonds 23/34	USD	700.0 %	105.802	740,612.74	0.37
US195325EL56	8.0000 % Colombia Government USD Bonds 23/35	USD	300.0 %	109.717	329,151.75	0.17
US195325EM30	8.7500 % Colombia Government USD Bonds 23/53	USD	200.0 %	115.513	231,026.00	0.12
US279158AP43	4.6250 % Ecopetrol USD Notes 21/31	USD	600.0 %	84.949	509,696.46	0.26
US279158AT64	8.6250 % Ecopetrol USD Notes 23/29	USD	500.0 %	106.840	534,197.50	0.27
コスタリカ						534,834.71
USP3699PGM34	6.5500 % Costa Rica Government USD Bonds 23/34	USD	200.0 %	103.994	207,987.50	0.10
USP3699PGN17	7.3000 % Costa Rica Government USD Bonds 23/54	USD	300.0 %	108.949	326,847.21	0.17
ドミニカ共和国						10,501,469.10
USP3579ECD78	9.7500 % Dominican Government DOP Bonds 19/26	DOP	11,400.0 %	100.735	198,030.52	0.10
USP3579ECQ81	13.6250 % Dominican Government DOP Bonds 23/33	DOP	20,700.0 %	120.500	430,134.51	0.22
XS2587319729	13.6250 % Dominican Government DOP Bonds 23/34	DOP	30,100.0 %	118.459	614,867.37	0.31
USP3579ECS48	11.2500 % Dominican Government DOP Bonds 23/35	DOP	10,000.0 %	107.700	185,721.68	0.09
USP3579EBK21	6.8750 % Dominican Government USD Bonds 16/26	USD	1,100.0 %	102.269	1,124,953.94	0.57
USP3579EBV85	5.9500 % Dominican Government USD Bonds 17/27	USD	800.0 %	100.708	805,666.40	0.41
USP3579ECES1	6.4000 % Dominican Government USD Bonds 19/49	USD	900.0 %	94.669	852,018.75	0.43
USP3579ECG00	5.8750 % Dominican Government USD Bonds 20/60	USD	900.0 %	86.980	782,820.00	0.39
USP3579ECP09	5.5000 % Dominican Government USD Bonds 22/29	USD	500.0 %	98.192	490,958.05	0.25
USP3579ECN50	6.0000 % Dominican Government USD Bonds 22/33	USD	800.0 %	98.799	790,390.00	0.40
USP3579ECR64	7.0500 % Dominican Government USD Bonds 23/31	USD	2,800.0 %	105.385	2,950,782.80	1.49
XS2543286004	12.0000 % Dominican Republic Central Bank DOP Notes 22/25	DOP	3,300.0 %	102.306	58,218.46	0.03
US25714PER55	13.0000 % Dominican Republic Central Bank DOP Notes 23/25	DOP	48,900.0 %	104.936	884,871.60	0.45
US25714PEU84	13.0000 % Dominican Republic Central Bank DOP Notes 23/26	DOP	18,300.0 %	105.217	332,035.02	0.17
エクアドル						4,586,805.29
XS2214237807	6.0000 % Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/30	USD	3,700.0 %	46.570	1,723,108.13	0.87
XS2214238441	3.5000 % Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/35	USD	8,020.0 %	35.349	2,834,976.17	1.43
XS2214239175	2.5000 % Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/40	USD	90.0 %	31.912	28,720.99	0.02
ガーナ						510,400.60
XS2325747637	8.8750 % Ghana Government USD Bonds 21/42	USD	1,000.0 %	43.301	433,014.60	0.22
XS2325742166	0.0000 % Ghana Government USD Zero-Coupon Bonds 07.04.2025	USD	200.0 %	38.693	77,386.00	0.04
グアテマラ						905,790.54
USP5015VAN66	4.6500 % Guatemala Government USD Bonds 21/41	USD	600.0 %	82.187	493,122.18	0.25
USP5015VAQ97	6.6000 % Guatemala Government USD Bonds 23/36	USD	400.0 %	103.167	412,668.36	0.21
ハンガリー						7,072,462.49
XS2161992511	1.6250 % Hungary Government EUR Bonds 20/32	EUR	100.0 %	81.550	90,104.21	0.04
XS2181689659	1.7500 % Hungary Government EUR Bonds 20/35	EUR	2,300.0 %	77.005	1,956,894.14	0.99
XS2388586401	2.1250 % Hungary Government USD Bonds 21/31	USD	1,000.0 %	80.952	809,518.40	0.41
XS2388586583	3.1250 % Hungary Government USD Bonds 21/51	USD	200.0 %	68.233	136,466.94	0.07
XS2010026305	5.2500 % Hungary Government USD Bonds 22/29	USD	1,100.0 %	100.826	1,109,083.14	0.56
XS2574267261	6.2500 % Hungary Government USD Bonds 23/32	USD	500.0 %	106.997	534,985.75	0.27
XS2574267188	6.1250 % Hungary Government USD Bonds 23/28	USD	200.0 %	104.117	208,234.86	0.10
XS2719137965	6.0000 % Magyar Export-Import Bank EUR Notes 23/29	EUR	400.0 %	106.124	469,024.58	0.24
XS2630760796	6.5000 % MFB Magyar Fejlesztési Bank USD Notes 23/28	USD	900.0 %	103.190	928,705.59	0.47
XS2634075399	7.5000 % MVM Energetika USD Notes 23/28	USD	300.0 %	104.676	314,028.03	0.16
XS2586007036	8.7500 % OTP Bank USD FLR-MTN 23/33	USD	500.0 %	103.083	515,416.85	0.26
インド						1,558,453.45
XS2109438205	3.9490 % Adani Electricity Mumbai USD Notes 20/30	USD	262.0 %	82.261	215,522.85	0.11
XS2080214864	4.2500 % Adani Transmission USD Notes 19/36	USD	235.5 %	78.964	185,959.14	0.09
US30216KAC62	3.8750 % Export-Import Bank of India USD Notes 18/28	USD	400.0 %	96.069	384,275.20	0.20
USY72570AS69	2.8750 % Reliance Industries USD Notes 22/32	USD	900.0 %	85.855	772,696.26	0.39
インドネシア						5,163,077.14
USY7141BAB90	5.3150 % Freeport Indonesia USD MTN 22/32	USD	400.0 %	98.493	393,971.00	0.20

ISIN	証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
US455780BR67	6.7500 % Indonesia Government USD Bonds 14/44	USD	200.0	122.827	245,653.84	0.12
USY7133MAC39	4.2500 % Pelabuhan Indonesia USD Notes 15/25	USD	800.0	98.252	786,012.40	0.40
USV7133MAB55	5.3750 % Pelabuhan Indonesia USD Notes 15/45	USD	200.0	97.435	194,869.64	0.10
US69370RAA59	6.4500 % Pertamina USD MTN 14/44	USD	300.0	109.031	327,093.75	0.16
US69370RAK32	1.4000 % Pertamina USD Notes 21/26	USD	2,500.0	92.269	2,306,728.25	1.17
US71568QAD97	5.2500 % Perusahaan Perseroan Perusahaan Listrik Negara USD MTN 17/47	USD	800.0	94.032	752,253.76	0.38
US71568QAP28	4.0000 % Perusahaan Perseroan Perusahaan Listrik Negara USD MTN 20/50	USD	200.0	78.247	156,494.50	0.08
アイルランド					1,693,318.00	0.86
XS2063279959	5.9500 % Alfa Bank Via Alfa Bond Issuance USD FLR-Notes 19/30	USD	400.0	1.806	7,224.00	0.01
XS2477752260	7.2300 % SOCAR Turkey Enerji via Steas Funding 1 USD Notes 22/26	USD	1,700.0	99.182	1,686,094.00	0.85
マン島					261,281.69	0.13
US03512TAE10	3.7500 % AngloGold Ashanti Holdings USD Notes 20/30	USD	300.0	87.094	261,281.69	0.13
イスラエル					3,759,424.05	1.90
IL0060004004	3.7500 % Israel Electric USD MTN 22/32	USD	1,500.0	85.060	1,275,895.35	0.64
XS2711443932	5.0000 % Israel Government EUR MTN 23/26	EUR	2,200.0	102.170	2,483,528.70	1.26
コートジボワール					2,614,944.14	1.32
XS1793329225	5.2500 % Ivory Coast Government EUR Bonds 18/30	EUR	1,200.0	90.055	1,194,021.61	0.60
XS2064786754	5.8750 % Ivory Coast Government EUR Bonds 19/31	EUR	200.0	89.943	198,756.83	0.10
XS2264871828	4.8750 % Ivory Coast Government EUR Bonds 20/32	EUR	100.0	84.574	93,445.41	0.05
XS0496488395	5.7500 % Ivory Coast Government USD FLR-Bonds 10/32	USD	1,190.6	94.804	1,128,720.29	0.57
ジャージー島					662,422.63	0.34
XS2412044302	8.8020 % Corsair International EUR FLR-MTN 22/27	EUR	400.0	100.077	442,302.46	0.23
XS2412055415	9.1520 % Corsair International EUR FLR-MTN 22/29	EUR	200.0	99.611	220,120.17	0.11
ヨルダン					673,997.40	0.34
XS1577950311	7.3750 % Jordan Government USD Bonds 17/47	USD	300.0	89.263	267,788.76	0.14
XS2602742285	7.5000 % Jordan Government USD Bonds 23/29	USD	400.0	101.552	406,208.64	0.20
カザフスタン					542,776.34	0.27
XS1595714087	5.7500 % KazMunayGas National USD Notes 17/47	USD	400.0	88.283	353,133.40	0.18
XS1807299331	6.3750 % KazMunayGas National USD Notes 18/48	USD	200.0	94.821	189,642.94	0.09
ケニア					183,487.50	0.09
XS1781710543	7.2500 % Kenya Government USD Bonds 18/28	USD	200.0	91.744	183,487.50	0.09
ルクセンブルグ					5,093,586.07	2.57
XS2010030919	3.1000 % ALROSA Finance USD Notes 20/27	USD	200.0	5.900	11,800.00	0.00
USL15669AA91	6.0100 % Chile Electricity Lux MPC USD Notes 23/33	USD	500.0	102.695	513,476.25	0.26
USL21779AJ97	4.6250 % CSN Resources USD Notes 21/31	USD	700.0	81.235	568,645.63	0.29
XS2106053551	0.0000 % Ecuador Social USD Zero-Coupon Bonds 30.01.2035	USD	414.4	76.733	317,962.74	0.16
XS1911645049	2.9490 % Gazprom Via Gaz Capital EUR Notes 18/24	EUR	1,000.0	78.000	861,822.27	0.43
XS2542166231	6.1290 % Greensaif Pipelines Bidco USD Notes 23/38	USD	300.0	105.180	315,539.07	0.16
XS2542166744	6.5100 % Greensaif Pipelines Bidco USD Notes 23/42	USD	200.0	105.659	211,317.24	0.11
USL4R02QAA86	5.1980 % Guara Norte USD Notes 21/34	USD	1,456.5	91.100	1,326,903.39	0.67
USL75833AA88	6.1250 % Petrorio Luxembourg Trading USD Notes 21/26	USD	400.0	98.294	393,177.64	0.20
XS0848530977	5.1250 % Sberbank of Russia Via SB Capital USD Defaulted Notes 12/22	USD	200.0	33.120	66,240.00	0.03
XS2568343672	5.7800 % TMS Issuer USD Notes 23/32	USD	300.0	104.687	314,059.83	0.16
USL9467UAB37	8.7500 % Unigel Luxembourg USD Notes 19/26	USD	700.0	27.520	192,642.01	0.10
マレーシア					764,418.45	0.39
XS2629043691	4.8760 % Khazanah Capital USD MTN 23/33	USD	300.0	100.810	302,431.20	0.15
USY68856AV83	4.5500 % Petronas Capital USD MTN 20/50	USD	500.0	92.397	461,987.25	0.24
マーシャル諸島					88,614.82	0.05
USY62014AA64	6.0670 % Nakilat USD Notes 06/33	USD	86.3	102.719	88,614.82	0.05
メキシコ					10,847,262.43	5.48
USP1401KAB72	6.6250 % Banco Mercantil del Norte (Grand Cayman) USD FLR-Notes 21/undefined	USD	500.0	84.795	423,975.00	0.21
USP30179BR86	6.2640 % Comision Federal de Electricidad USD Notes 22/52	USD	800.0	87.950	703,600.00	0.36
MXOSG00000FO	4.0000 % Mexican Udibonos MXN Bonds 17/28	MXN	6,381.2	97.774	368,066.49	0.19
MXOSG00000KO	2.7500 % Mexican Udibonos MXN Bonds 21/31	MXN	15,155.2	88.220	788,739.13	0.40
MXOSG00000M6	3.0000 % Mexican Udibonos MXN Bonds 22/26	MXN	46,263.3	92.865	2,534,518.72	1.28
US91087BAM28	2.6590 % Mexico Government USD Bonds 20/31	USD	1,200.0	84.978	1,019,737.56	0.52
US91087BAK61	4.7500 % Mexico Government USD Bonds 20/32	USD	300.0	96.710	290,128.89	0.15
US91087BAL45	5.0000 % Mexico Government USD Bonds 20/51	USD	1,700.0	87.395	1,485,711.09	0.75
US91087BAN01	3.7710 % Mexico Government USD Bonds 20/61	USD	500.0	68.490	342,450.10	0.17
US91087BAV27	6.3500 % Mexico Government USD Bonds 23/35	USD	1,000.0	105.246	1,052,463.30	0.53
US71643VAB18	6.7000 % Petróleos Mexicanos USD Notes 22/32	USD	1,244.0	83.273	1,035,920.85	0.52
USPOR80BAG79	5.3750 % Sitios Latinoamerica USD Notes 22/32	USD	600.0	93.006	558,037.38	0.28
USP9401CAB83	6.3900 % Trust Fibra Uno USD Notes 19/50	USD	300.0	81.305	243,913.92	0.12
モンゴル					206,026.96	0.10
USY6142NAH18	7.8750 % Mongolia Government USD Bonds 23/29	USD	200.0	103.013	206,026.96	0.10
モロッコ					965,356.74	0.49
XS2355149316	3.7500 % OCP USD Notes 21/31	USD	500.0	86.361	431,804.70	0.22
XS2355172482	5.1250 % OCP USD Notes 21/51	USD	700.0	76.222	533,552.04	0.27
ナイジェリア					1,214,732.97	0.61
XS1910827887	8.7470 % Nigeria Government USD Bonds 18/31	USD	200.0	95.652	191,303.92	0.10
XS1717011982	6.5000 % Nigeria Government USD MTN 17/27	USD	800.0	91.780	734,239.04	0.37

ISIN	証券銘柄	株(口)数/ 通貨(単位:千) Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
XS2445169985	8.3750 % Nigeria Government USD MTN 22/29	USD	300.0	% 96.397	289,190.01	0.14
北マケドニア					580,034.95	0.29
XS2582522681	6.9600 % North Macedonia Government EUR Bonds 23/27	EUR	500.0	% 104.993	580,034.95	0.29
オマーン					494,926.90	0.25
XS1405777589	4.7500 % Oman Government USD Bonds 16/26	USD	500.0	% 98.985	494,926.90	0.25
パキスタン					710,758.54	0.36
XS1056560920	8.2500 % Pakistan Government USD Bonds 14/24	USD	200.0	% 95.369	190,737.50	0.10
XS1729875598	6.8750 % Pakistan Government USD Bonds 17/27	USD	600.0	% 68.755	412,530.00	0.21
XS2348591707	7.5000 % Pakistan Water & Power Development Authority USD Notes 21/31	USD	200.0	% 53.746	107,491.04	0.05
パナマ					8,091,652.50	4.09
USP0092AAG42	5.1250 % Aeropuerto Internacional de Tocumen USD Notes 21/61	USD	500.0	% 75.666	378,328.15	0.19
USP12651AD05	5.2500 % Banco General USD FLR-Notes 21/undefined	USD	1,100.0	% 86.189	948,083.18	0.48
USP1559LA72	2.5000 % Banco Nacional de Panamá USD Notes 20/30	USD	800.0	% 74.704	597,630.00	0.30
US698299AK07	9.3750 % Panama Government USD Bonds 99/29	USD	2,415.0	% 113.909	2,750,897.76	1.39
US698299AW45	6.7000 % Panama Government USD Bonds 06/36	USD	900.0	% 99.846	898,611.75	0.45
US698299BB98	4.3000 % Panama Government USD Bonds 13/53	USD	300.0	% 67.679	203,037.93	0.10
US698299BN37	2.2520 % Panama Government USD Bonds 20/32	USD	500.0	% 73.585	367,924.30	0.19
US698299BM53	4.5000 % Panama Government USD Bonds 20/56	USD	1,000.0	% 67.733	677,331.90	0.34
US698299BT07	6.4000 % Panama Government USD Bonds 22/35	USD	900.0	% 98.065	882,585.81	0.45
US698299BS24	4.5000 % Panama Government USD Bonds 22/63	USD	300.0	% 66.288	198,862.50	0.10
US698299BV52	6.8530 % Panama Government USD Bonds 23/54	USD	200.0	% 94.180	188,359.22	0.10
パラグアイ					579,499.56	0.29
USP75744AE59	4.7000 % Paraguay Government USD Bonds 17/27	USD	200.0	% 98.723	197,446.04	0.10
USP75744AL92	3.8490 % Paraguay Government USD Bonds 22/33	USD	200.0	% 88.848	177,696.88	0.09
USP75744AM75	5.8500 % Paraguay Government USD Bonds 23/33	USD	200.0	% 102.178	204,356.64	0.10
ペルー					2,244,958.50	1.14
USP56236AB16	3.2500 % InRetail Consumer USD Notes 21/28	USD	700.0	% 89.898	629,286.42	0.32
US715638DR09	3.2300 % Peru Government USD Bonds 20/undefined	USD	1,100.0	% 62.777	690,543.04	0.35
US715638DU38	3.0000 % Peru Government USD Bonds 21/34	USD	800.0	% 84.763	678,107.04	0.34
USP7808BAB38	5.6250 % Petróleos del Perú USD Notes 17/47	USD	400.0	% 61.756	247,022.00	0.13
フィリピン					3,367,311.61	1.70
US718286BG11	6.3750 % Philippine Government USD Bonds 09/34	USD	2,000.0	% 113.608	2,272,162.40	1.15
US718286CA32	3.7000 % Philippine Government USD Bonds 16/41	USD	1,100.0	% 86.512	951,632.33	0.48
US718286CL96	2.6500 % Philippine Government USD Bonds 20/45	USD	200.0	% 71.758	143,516.88	0.07
ポーランド					829,753.36	0.42
XS2711511795	6.2500 % Bank Gospodarstwa Krajowego USD Notes 23/28	USD	400.0	% 105.938	423,752.24	0.21
XS2625207571	5.3750 % Bank Gospodarstwa Krajowego USD MTN 23/33	USD	400.0	% 101.500	406,001.12	0.21
カタール					1,401,670.90	0.71
XS2357494322	2.2500 % Qatar Energy USD Notes 21/31	USD	200.0	% 85.202	170,404.18	0.09
XS2359548935	3.1250 % Qatar Energy USD Notes 21/41	USD	1,600.0	% 76.954	1,231,266.72	0.62
ルーマニア					5,415,606.58	2.74
XS2258400162	2.6250 % Romania Government EUR Bonds 20/40	EUR	500.0	% 67.427	372,499.09	0.19
XS2027596530	2.1240 % Romania Government EUR MTN 19/31	EUR	740.0	% 80.028	654,325.85	0.33
XS2364200514	2.8750 % Romania Government EUR MTN 21/42	EUR	700.0	% 67.884	525,038.32	0.27
XS2434895558	2.1250 % Romania Government EUR MTN 22/28	EUR	1,500.0	% 90.950	1,507,363.61	0.76
XS2434895806	3.7500 % Romania Government EUR MTN 22/34	EUR	1,400.0	% 86.447	1,337,215.41	0.68
XS2201851685	4.0000 % Romania Government USD Bonds 20/51	USD	1,400.0	% 72.797	1,019,164.30	0.51
ロシア					300,105.65	0.15
RU000A0ZZVE6	2.8750 % Russian Foreign Bond - Eurobond EUR Bonds 18/25	EUR	200.0	% 72.000	159,105.65	0.08
RU000A0JWHA4	4.7500 % Russian Foreign Bond - Eurobond USD Bonds 16/26	USD	200.0	% 70.500	141,000.00	0.07
サウジアラビア					2,135,975.77	1.08
XS2262853265	2.2500 % Saudi Arabian Oil USD Notes 20/30	USD	500.0	% 86.123	430,614.00	0.22
XS2159975700	3.2500 % Saudi Government USD MTN 20/30	USD	200.0	% 92.921	185,842.72	0.09
XS257134401	4.7500 % Saudi Government USD MTN 23/28	USD	1,500.0	% 101.301	1,519,519.05	0.77
セネガル					81,921.94	0.04
XS2333676133	5.3750 % Senegal Government EUR Bonds 21/37	EUR	100.0	% 74.144	81,921.94	0.04
セルビア					2,413,373.58	1.22
XS2015296465	1.5000 % Serbia Government EUR Bonds 19/29	EUR	600.0	% 84.300	558,861.64	0.28
XS2170186923	3.1250 % Serbia Government EUR Bonds 20/27	EUR	100.0	% 95.805	105,854.98	0.06
XS2580269426	6.2500 % Serbia Government USD Bonds 23/28	USD	700.0	% 102.677	718,738.16	0.36
XS2580270275	6.5000 % Serbia Government USD Bonds 23/33	USD	1,000.0	% 102.992	1,029,918.80	0.52
シンガポール					388,239.62	0.20
USY51478AA66	6.8750 % LLPL Capital USD Notes 19/39	USD	402.3	% 96.505	388,239.62	0.20
スロベニア					715,698.20	0.36
XS2635185437	5.0000 % Slovenia Government USD Bonds 23/33	USD	700.0	% 102.243	715,698.20	0.36
南アフリカ					11,190,445.59	5.66
XS1864523300	6.3500 % Eskom Holdings USD Notes 18/28	USD	3,400.0	% 97.632	3,319,501.26	1.68
XS1864522757	8.4500 % Eskom Holdings USD Notes 18/28	USD	200.0	% 101.793	203,585.00	0.10
US836205AX27	5.6500 % South Africa Government USD Bonds 17/47	USD	200.0	% 80.000	159,999.76	0.08
US836205BA15	4.8500 % South Africa Government USD Bonds 19/29	USD	1,600.0	% 94.110	1,505,761.60	0.76
US836205BB97	5.7500 % South Africa Government USD Bonds 19/49	USD	2,400.0	% 79.884	1,917,204.00	0.97
US836205BC70	5.8750 % South Africa Government USD Bonds 22/32	USD	800.0	% 95.172	761,376.64	0.39
ZAG000016320	10.5000 % South Africa Government ZAR Bonds 98/26	ZAR	58,800.0	% 104.692	3,323,017.33	1.68
韓国					1,003,707.21	0.51
USY52758AE20	1.3750 % LG Chem USD Notes 21/26	USD	1,100.0	% 91.246	1,003,707.21	0.51

ISIN	証券銘柄		株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)		
スリランカ							1,483,163.17	0.75	
USY8137FAH11	6.2000	%	Sri Lanka Government USD Bonds 17/27	USD	300.0	%	50.949	152,847.87	0.08
USY8137FAK40	5.7500	%	Sri Lanka Government USD Defaulted Bonds 18/23	USD	1,200.0	%	51.458	617,501.28	0.31
USY8137FAN88	6.8500	%	Sri Lanka Government USD Bonds 19/24	USD	200.0	%	51.157	102,313.04	0.05
USY8137FAQ10	6.3500	%	Sri Lanka Government USD Bonds 19/24	USD	400.0	%	51.030	204,120.00	0.10
USY8137FAP37	7.8500	%	Sri Lanka Government USD Bonds 19/29	USD	200.0	%	50.803	101,606.00	0.05
USY8137FAR92	7.5500	%	Sri Lanka Government USD Bonds 19/30	USD	600.0	%	50.796	304,774.98	0.16
国際機関							347,610.12	0.18	
XS2356571559	4.1250	%	Eastern & Southern African Trade & Development Bank USD MTN 21/28	USD	400.0	%	86.903	347,610.12	0.18
スイス							0.02	0.00	
USH3698DDQ46	9.7500	%	Credit Suisse Group USD FLR-Notes 22/undefined	USD	200.0	%	0.000	0.02	0.00
オランダ							1,175,445.33	0.59	
XS2348767083	7.5000	%	BOI Finance EUR Notes 22/27	EUR	700.0	%	92.411	714,736.55	0.36
XS2211183244	1.5390	%	Prosus EUR MTN 20/28	EUR	200.0	%	86.332	190,777.53	0.10
XS2211183756	2.0310	%	Prosus EUR MTN 20/32	EUR	100.0	%	76.556	84,587.15	0.04
USN7163RAW36	3.2570	%	Prosus USD Notes 22/27	USD	200.0	%	92.672	185,344.10	0.09
トリニダード・トバゴ							311,818.74	0.16	
USP93960AJ47	5.9500	%	Trinidad & Tobago Government USD Bonds 23/31	USD	300.0	%	103.940	311,818.74	0.16
チュニジア							842,268.65	0.43	
XSI175223699	5.7500	%	Banque Centrale de Tunisie USD Notes 15/25	USD	500.0	%	82.815	414,075.00	0.21
XSI567439689	5.6250	%	Tunisia Government EUR Bonds 17/24	EUR	400.0	%	96.885	428,193.65	0.22
トルコ							12,641,188.09	6.39	
XS2689091846	8.5091	%	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama USD Notes 23/29	USD	2,000.0	%	106.548	2,130,956.60	1.08
US900123AY60	6.8750	%	Turkey Government USD Bonds 06/36	USD	2,000.0	%	96.245	1,924,899.80	0.97
US900123CB40	4.8750	%	Turkey Government USD Bonds 13/43	USD	2,500.0	%	73.332	1,833,300.00	0.92
US900123CM05	5.7500	%	Turkey Government USD Bonds 17/47	USD	2,000.0	%	78.856	1,577,112.80	0.80
US900123CP36	5.1250	%	Turkey Government USD Bonds 18/28	USD	2,000.0	%	95.679	1,913,588.40	0.97
US900123CQ19	6.1250	%	Turkey Government USD Bonds 18/28	USD	200.0	%	98.709	197,418.26	0.10
US900123DA57	5.9500	%	Turkey Government USD Bonds 20/31	USD	600.0	%	94.674	568,041.36	0.29
US900123DC14	5.8750	%	Turkey Government USD Bonds 21/31	USD	300.0	%	93.742	281,227.47	0.14
US900123DJ66	9.1250	%	Turkey Government USD Bonds 23/30	USD	2,000.0	%	110.732	2,214,643.40	1.12
ウクライナ							2,137,793.00	1.08	
XS2404309754	6.8750	%	NPC Ukrenergo USD Notes 21/28	USD	1,400.0	%	27.525	385,350.00	0.19
XS2357277149	6.2500	%	State Agency of Roads of Ukraine USD Bonds 21/30	USD	600.0	%	25.567	153,399.72	0.08
XSI303925470	7.7500	%	Ukraine Government USD Bonds 15/27	USD	300.0	%	27.906	83,718.75	0.04
XSI577952952	7.3750	%	Ukraine Government USD Bonds 17/34	USD	1,750.0	%	23.917	418,541.73	0.21
XS2010030836	7.2530	%	Ukraine Government USD Bonds 20/35	USD	2,200.0	%	23.917	526,166.74	0.27
XS2010028699	6.8760	%	Ukraine Government USD Bonds 21/31	USD	700.0	%	23.313	163,187.50	0.08
XSI303929894	7.7500	%	Ukraine Government USD FLR-Bonds 15/41	USD	900.0	%	45.270	407,428.56	0.21
アラブ首長国連邦							2,947,966.75	1.49	
XS2600248335	4.6960	%	Abu Dhabi National Energy USD Notes 23/33	USD	300.0	%	101.501	304,502.76	0.15
XS2615919284	4.7740	%	First Abu Dhabi Bank USD MTN 23/28	USD	600.0	%	99.979	599,875.02	0.30
XS2651619285	4.8750	%	Masdar Abu Dhabi Future Energy USD MTN 23/33	USD	800.0	%	98.752	790,018.56	0.40
XS2623206187	5.0840	%	MDGH GMTN RSC USD MTN 23/53	USD	200.0	%	98.866	197,732.80	0.10
XS2707149600	5.8750	%	MDGH GMTN RSC USD Notes 23/34	USD	300.0	%	109.564	328,692.57	0.17
XS2386563469	1.6250	%	NBK USD FLR-Notes 21/27	USD	800.0	%	90.893	727,145.04	0.37
イギリス							1,883,527.11	0.95	
US06738EBZ79	5.3040	%	Barclays USD FLR-Notes 22/26	USD	500.0	%	99.468	497,338.80	0.25
US06738ECA10	5.7460	%	Barclays USD FLR-Notes 22/33	USD	400.0	%	101.431	405,723.64	0.20
XS2301292400	1.5000	%	Gazprom Via Gaz Capital EUR MTN 21/27	EUR	800.0	%	60.000	530,352.16	0.27
US404280DG12	5.2100	%	HSBC Holdings USD FLR-Notes 22/28	USD	200.0	%	99.990	199,980.36	0.10
US53944YATO1	4.7160	%	Lloyds Banking Group USD FLR-Notes 22/26	USD	200.0	%	98.664	197,327.46	0.10
XSI261825621	9.7500	%	Ukreximbank Via Biz Finance USD Notes 15/25	USD	56.3	%	93.875	52,804.69	0.03
アメリカ合衆国							7,687,500.27	3.89	
XSI891174341	2.5000	%	Digital Euro Finco EUR Notes 19/26	EUR	100.0	%	97.467	107,691.70	0.06
US5252M0FD44	6.8750	%	Lehman Brothers Holdings USD Defaulted MTN 08/18	USD	3,200.0	%	0.175	5,600.00	0.00
US80386WAA36	5.8750	%	Sasol Financing USA USD Notes 18/24	USD	500.0	%	99.493	497,463.95	0.25
USU8035UAC63	8.7500	%	Sasol Financing USA USD Notes 23/29	USD	500.0	%	102.102	510,512.32	0.26
US912810TF57	0.0000	%	United States Government USD Zero-Coupon Bonds 15.02.2042	USD	1,600.0	%	77.006	1,232,094.88	0.62
US912828J272	2.0000	%	United States Government USD Bonds 15/25	USD	2,300.0	%	97.070	2,232,617.13	1.13
US91282CFJ53	3.1250	%	United States Government USD Bonds 22/29	USD	2,300.0	%	96.093	2,210,145.44	1.12
US912797GQ49	0.0000	%	United States Government USD Zero-Coupon Bonds 07.03.2024	USD	900.0	%	99.042	891,374.85	0.45
ウズベキスタン							843,759.40	0.43	
XS2365195978	3.9000	%	Uzbekistan Government USD Bonds 21/31	USD	1,000.0	%	84.376	843,759.40	0.43
ベネズエラ							4,495,185.33	2.27	
US922646AS37	9.2500	%	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 97/27*	USD	1,810.0	%	20.021	362,379.01	0.18
USP97475AD26	7.0000	%	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 03/18*	USD	500.0	%	14.247	71,236.70	0.04
US922646BL74	9.3750	%	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 04/34*	USD	800.0	%	18.200	145,600.00	0.07
USP97475AG56	6.0000	%	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 05/20*	USD	1,130.0	%	14.115	159,494.75	0.08

ISIN	証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	価格	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
XS0217249126	7.6500 % Venezuela Government USD Defaulted Bonds 05/25*	USD	1,400.0 %	15.421	215,894.56	0.11
USP97475AJ95	7.0000 % Venezuela Government USD Defaulted Bonds 07/38*	USD	100.0 %	15.508	15,508.33	0.01
USP17625AB33	9.2500 % Venezuela Government USD Defaulted Bonds 08/28*	USD	18,005.0 %	17.938	3,229,646.88	1.63
USP97475AN08	7.7500 % Venezuela Government USD Defaulted Bonds 09/19*	USD	2,080.0 %	14.203	295,425.10	0.15
他の規制ある市場で取引される証券および短期金融商品					5,905,049.99	2.98
債券					2,354,628.86	1.19
アルゼンチン US64131GA04	6.7500 % Provincia de Neuquen Argentina USD FLR-Notes 17/30	USD	206.6 %	85.358	176,316.31	0.09
ケイマン諸島 US46062JAA43	7.8600 % Interocéanica V Finance USD Notes 08/30	USD	228.2 %	102.276	233,412.02	0.12
ペルー US05971U2B27	4.6500 % Banco de Crédito del Perú PEN Notes 19/24	PEN	2,500.0 %	97.063	657,097.50	0.33
US224939AA67	10.1000 % Credicorp Capital Sociedad Titulizadora PEN Notes 23/43	PEN	700.0 %	100.000	189,555.49	0.10
スイス US225401AY40	6.3730 % UBS Group USD FLR-Notes 22/26	USD	250.0 %	101.165	252,912.80	0.13
アメリカ合衆国 US76716XAC65	8.2000 % Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 USD Notes 18/28	USD	825.2 %	102.438	845,334.74	0.42
アセット・バック証券					451,477.60	0.23
アメリカ合衆国 US61749BAD55	5.5674 % Morgan Stanley Capital I Trust 2006-NC5 ABS USD FLR-Notes 06/36 Cl.A2B	USD	865.5 %	52.165	451,477.60 ¹⁾	0.23
モーゲージ・バック証券					3,098,943.53	1.56
イギリス XS2419722678	6.0704 % Canada Square Funding 6 MBS GBP FLR-Notes 22/59 Cl.A	GBP	165.1 %	99.415	208,547.37 ¹⁾	0.10
XS2348602835	5.9197 % Rochester Financing No 3 MBS GBP FLR-Notes 21/44 Cl.A	GBP	174.5 %	99.258	220,112.37 ¹⁾	0.11
XS2215921748	6.1197 % Stratton Mortgage Funding 2020-1 MBS GBP FLR-Notes 20/52 Cl.A	GBP	57.3 %	100.000	72,755.09 ¹⁾	0.04
XS2432286115	5.9395 % Tower Bridge Funding 2022-1 MBS GBP FLR-Notes 22/63 Cl.A	GBP	98.6 %	99.445	124,616.86 ¹⁾	0.06
アメリカ合衆国 US05539BAQ77	3.6708 % BCAP 2012-RR3 Trust MBS USD FLR-Notes 12/37 Cl.2A8	USD	1,627.6 %	89.096	1,450,141.62 ¹⁾	0.73
US08162PAX96	3.6660 % Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust MBS USD FLR-Notes 18/51 Cl.B0FA	USD	1,000.0 %	93.562	935,617.30 ¹⁾	0.47
US86360NAG79	4.5149 % Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust MBS USD FLR-Notes 06/36 Cl.1A1	USD	96.3 %	90.503	87,152.92 ¹⁾	0.05
その他の証券および短期金融商品					1,622,467.90	0.82
債券					1,622,467.90	0.82
南アフリカ XS2395714418	8.6000 % Development Bank of Southern Africa ZAR Notes 21/24	ZAR	30,200.0 %	99.524	1,622,467.90	0.82
投資有価証券および短期金融商品					187,570,450.81	94.80
金融機関への預金					9,779,048.95	4.94
一貫払い預金					9,779,048.95	4.94
	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	USD			3,661,404.67	1.85
	Cash at Broker and Deposits for collateralisation of derivatives	USD			6,117,644.28	3.09
金融機関への預金					9,779,048.95	4.94

証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	通貨	価格	期末現 損／益 (米ドル)	純資産 比率 (%)
デリバティブ						
持高のマイナスはショート・ポジションを表す。						
上場デリバティブ					1,697,857.10	0.86
先物取引					1,697,857.10	0.86
購入債券先物					2,423,392.83	1.23
10-Year US Treasury Bond (CBT) Futures 03/24	Ctr	256	USD	112.891	1,042,672.00	0.53
5-Year German Government Bond (Bobl) Futures 03/24	Ctr	22	EUR	119.340	48,494.08	0.03
5-Year US Treasury Bond (CBT) Futures 03/24	Ctr	377	USD	108.688	850,914.23	0.43
Ultra Long US Treasury Bond (CBT) Futures 03/24	Ctr	36	USD	134.125	481,312.52	0.24
売却債券先物					-725,535.73	-0.37
10-Year German Government Bond (Bund) Futures 03/24	Ctr	-63	EUR	137.390	-300,345.06	-0.15
2-Year US Treasury Bond (CBT) Futures 03/24	Ctr	-156	USD	102.895	-290,171.85	-0.15
30-Year German Government Bond (Buxl) Futures 03/24	Ctr	-11	EUR	141.380	-135,018.82	-0.07
店頭取引のデリバティブ					-73,200.57	-0.04
先物為替取引					-336,782.98	-0.17
Sold BRL / Bought USD - 03 Jan 2024	BRL	-1,914,035.06			-922.56	0.00
Sold BRL / Bought USD - 02 Feb 2024	BRL	-4,663,386.83			-49,313.23	-0.02
Sold CAD / Bought USD - 09 Jan 2024	CAD	-1,076,000.00			-15,122.61	-0.01
Sold CHF / Bought USD - 09 Jan 2024	CHF	-529,661.20			-25,676.62	-0.01
Sold CLP / Bought USD - 20 Mar 2024	CLP	-313,348,170.00			2,635.71	0.00
Sold COP / Bought USD - 09 Jan 2024	COP	-1,213,338,782.24			4,378.05	0.00
Sold CZK / Bought USD - 20 Mar 2024	CZK	-20,174,001.65			6,463.26	0.00
Sold DOP / Bought USD - 11 Jan 2024	DOP	-11,421,000.00			2,983.77	0.00
Sold DOP / Bought USD - 16 Jan 2024	DOP	-10,798,000.00			3,096.04	0.00
Sold DOP / Bought USD - 17 Jan 2024	DOP	-15,412,664.71			5,887.39	0.00
Sold DOP / Bought USD - 19 Jan 2024	DOP	-16,133,883.10			4,474.08	0.00
Sold DOP / Bought USD - 24 Jan 2024	DOP	-3,436,200.00			747.00	0.00
Sold DOP / Bought USD - 25 Jan 2024	DOP	-7,691,000.00			2,183.45	0.00
Sold DOP / Bought USD - 26 Jan 2024	DOP	-30,083,516.50			8,065.65	0.00
Sold DOP / Bought USD - 22 Feb 2024	DOP	-29,722,219.62			2,577.24	0.00
Sold DOP / Bought USD - 06 Mar 2024	DOP	-1,089,100.90			219.81	0.00
Sold DOP / Bought USD - 07 Mar 2024	DOP	-10,810,325.40			2,589.37	0.00
Sold EUR / Bought USD - 09 Jan 2024	EUR	-26,004,135.00			-173,458.43	-0.08
Sold GBP / Bought USD - 09 Jan 2024	GBP	-909,000.00			-4,441.91	0.00
Sold HUF / Bought USD - 24 Jan 2024	HUF	-68,584,000.00			-14,701.02	0.00
Sold IDR / Bought USD - 05 Jan 2024	IDR	-7,263,850,000.00			-1,761.28	0.00
Sold IDR / Bought USD - 20 Mar 2024	IDR	-11,634,580,865.00			-5,547.83	0.00
Sold ILS / Bought USD - 20 Mar 2024	ILS	-350,000.00			-813.00	0.00
Sold JPY / Bought USD - 09 Jan 2024	JPY	-64,800,000.00			-6,207.89	0.00
Sold KRW / Bought USD - 20 Jun 2024	KRW	-47,642,041.00			-372.05	0.00
Sold MXN / Bought USD - 31 Jan 2024	MXN	-77,533,836.60			-173,965.33	-0.08
Sold MXN / Bought USD - 19 Apr 2024	MXN	-57,609.08			-83.17	0.00
Sold MYR / Bought USD - 17 Jan 2024	MYR	-179,091.00			-633.10	0.00
Sold NGN / Bought USD - 29 Jan 2024	NGN	-27,060,000.00			14,047.12	0.01
Sold NOK / Bought USD - 09 Jan 2024	NOK	-615,000.00			-1,048.59	0.00
Sold NZD / Bought USD - 09 Jan 2024	NZD	-652,000.00			-14,251.48	-0.01
Sold PEN / Bought USD - 22 Jan 2024	PEN	-702,492.93			-882.44	0.00
Sold PEN / Bought USD - 20 Mar 2024	PEN	-3,338,758.50			-12,673.52	-0.01
Sold PHP / Bought USD - 20 Mar 2024	PHP	-9,013,963.06			-1,664.06	0.00
Sold PLN / Bought USD - 22 Jan 2024	PLN	-3,336,635.15			-63,778.25	-0.02
Sold SGD / Bought USD - 20 Mar 2024	SGD	-71,737.08			-406.16	0.00
Sold THB / Bought USD - 20 Mar 2024	THB	-13,807,534.96			-12,583.49	0.00
Sold TWD / Bought USD - 29 Feb 2024	TWD	-2,283,373.00			-3,114.18	0.00
Sold TWD / Bought USD - 20 Mar 2024	TWD	-3,747,595.00			-2,655.75	0.00
Sold USD / Bought AUD - 09 Jan 2024	USD	-298,827.86			8,158.89	0.00
Sold USD / Bought BRL - 03 Jan 2024	USD	-429,000.00			5,249.35	0.00
Sold USD / Bought BRL - 02 Feb 2024	USD	-544,700.19			4,367.19	0.00
Sold USD / Bought BRL - 02 Apr 2024	USD	-393,106.40			1,639.19	0.00
Sold USD / Bought CAD - 09 Jan 2024	USD	-527,282.19			8,507.43	0.00
Sold USD / Bought CHF - 09 Jan 2024	USD	-248,605.54			9,282.38	0.00
Sold USD / Bought COP - 09 Jan 2024	USD	-301,656.73			11,177.97	0.01
Sold USD / Bought COP - 20 Mar 2024	USD	-351,635.60			-3,470.34	0.00
Sold USD / Bought EUR - 09 Jan 2024	USD	-2,217,326.79			40,504.68	0.02
Sold USD / Bought GBP - 09 Jan 2024	USD	-208,830.77			825.09	0.00
Sold USD / Bought HUF - 04 Jan 2024	USD	-119,880.09			-506.24	0.00
Sold USD / Bought HUF - 24 Jan 2024	USD	-1,459,066.88			74,979.68	0.04
Sold USD / Bought IDR - 05 Jan 2024	USD	-469,396.00			2,166.99	0.00
Sold USD / Bought IDR - 20 Mar 2024	USD	-721,000.00			6,085.07	0.00
Sold USD / Bought ILS - 20 Mar 2024	USD	-138,398.65			361.37	0.00
Sold USD / Bought INR - 20 Mar 2024	USD	-883,529.54			1,502.38	0.00
Sold USD / Bought JPY - 09 Jan 2024	USD	-1,440,511.19			12,835.15	0.01
Sold USD / Bought MXN - 31 Jan 2024	USD	-116,314.19			1,089.49	0.00
Sold USD / Bought NGN - 29 Jan 2024	USD	-33,000.00			-2,974.06	0.00
Sold USD / Bought NOK - 09 Jan 2024	USD	-318,837.77			19,019.94	0.01
Sold USD / Bought NZD - 09 Jan 2024	USD	-198,155.61			-602.03	0.00
Sold USD / Bought PEN - 20 Mar 2024	USD	-592,000.00			4,636.48	0.00
Sold USD / Bought PLN - 22 Jan 2024	USD	-1,050,441.24			39,208.52	0.00
Sold USD / Bought THB - 20 Mar 2024	USD	-59,000.00			1,462.30	0.00
Sold USD / Bought TRY - 05 Jan 2024	USD	-19,615.00			-65.76	0.00
Sold USD / Bought TRY - 08 Jan 2024	USD	-168,527.69			-452.95	0.00
Sold USD / Bought TRY - 11 Jan 2024	USD	-299,565.94			-960.00	0.00
Sold USD / Bought TRY - 12 Jan 2024	USD	-38,038.81			-116.40	0.00
Sold USD / Bought TRY - 16 Jan 2024	USD	-38,397.36			612.24	0.00
Sold USD / Bought TRY - 18 Jan 2024	USD	-222,619.44			3,464.46	0.00
Sold USD / Bought TRY - 13 Feb 2024	USD	-45,435.88			-266.68	0.00
Sold USD / Bought TRY - 14 Feb 2024	USD	-39,398.00			-285.83	0.00
Sold USD / Bought TRY - 01 Mar 2024	USD	-345,592.11			444.22	0.00
Sold USD / Bought TRY - 15 Mar 2024	USD	-98,990.80			-1,218.97	0.00
Sold USD / Bought TRY - 20 Mar 2024	USD	-24,101.00			-294.98	0.00
Sold USD / Bought TRY - 21 Mar 2024	USD	-13,406.00			-152.16	0.00
Sold USD / Bought TRY - 22 Mar 2024	USD	-48,122.00			-633.51	0.00
Sold USD / Bought TRY - 27 Mar 2024	USD	-57,015.00			-765.98	0.00
Sold USD / Bought TRY - 29 Mar 2024	USD	-14,384.00			-174.49	0.00

証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	通貨	価格	未実現 -損／益 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Sold USD / Bought TRY - 08 Apr 2024	USD	-481,516.45			-6,290.08	0.00
Sold USD / Bought TRY - 09 Apr 2024	USD	-60,419.00			-878.06	0.00
Sold USD / Bought TRY - 15 Apr 2024	USD	-19,699.00			-226.71	0.00
Sold USD / Bought TRY - 22 Apr 2024	USD	-39,404.00			-531.28	0.00
Sold USD / Bought TRY - 24 Apr 2024	USD	-80,142.60			-1,226.74	0.00
Sold USD / Bought TRY - 26 Apr 2024	USD	-54,557.00			-859.56	0.00
Sold USD / Bought TRY - 30 Apr 2024	USD	-252,307.16			4,214.31	0.00
Sold USD / Bought ZAR - 17 Jan 2024	USD	-169,186.10			-1,622.11	0.00
Sold USD / Bought ZAR - 19 Jan 2024	USD	-116,075.66			2,632.11	0.00
Sold ZAR / Bought USD - 17 Jan 2024	ZAR	-19,614,203.74			-31,258.42	-0.02
Sold ZAR / Bought USD - 19 Jan 2024	ZAR	-72,310,132.54			-19,646.51	-0.01
スワップ取引					263,582.41	0.13
クレジット・デフォルト・スワップ					540,212.51	0.27
プロテクションの買い手					-345,757.86	-0.18
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	200,000.00			-399.64	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	500,000.00			-1,113.61	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	120,000.00			-291.54	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	80,000.00			-212.69	0.00
Dubai Government 7.76% 05 Oct 2020 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	500,000.00			-3,332.98	0.00
Korea Government 2.75% 19 Jan 2027 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	3,900,000.00			-14,704.14	-0.01
Markit CDX Emerging Markets Index - 1.00% - 20 Dec 2027	USD	1,000,000.00			-41,251.00	-0.02
Markit CDX North America Investment Grade Index - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	6,300,000.00			-45,556.17	-0.02
Oman Government 4.75% 15 Jun 2026 - 1.00% - 20 Dec 2027	USD	100,000.00			-3,399.16	0.00
Oman Government 4.75% 15 Jun 2026 - 1.00% - 20 Dec 2027	USD	100,000.00			-3,399.16	0.00
Saudi Arabia Government 4.00% 17 Apr 2025 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	1,700,000.00			-11,067.18	-0.01
South Africa Government 5.88% 16 Sep 2025 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	2,300,000.00			-103,860.92	-0.05
Turkey Government 11.88% 15 Jan 2030 - 1.00% - 20 Dec 2025	USD	300,000.00			-26,179.73	-0.02
Turkey Government 11.88% 15 Jan 2030 - 1.00% - 20 Dec 2025	USD	1,000,000.00			-90,989.94	-0.05
プロテクションの売り手					885,970.37	0.45
Banco do Brasil 4.63% 15 Jan 2025 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	600,000.00			9,171.01	0.01
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	100,000.00			6,357.70	0.00
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Jun 2027	USD	2,100,000.00			140,934.73	0.07
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Dec 2027	USD	500,000.00			37,288.96	0.02
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Dec 2030	USD	600,000.00			49,801.73	0.03
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Jun 2031	USD	1,800,000.00			150,338.87	0.08
Brazil Government 4.25% 07 Jan 2025 - 1.00% - 20 Jun 2031	USD	700,000.00			61,960.09	0.03
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Jun 2024	USD	300,000.00			553.22	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Jun 2024	USD	2,100,000.00			2,774.88	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	300,000.00			2,232.19	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	200,000.00			1,277.79	0.00
Chile Government 3.24% 06 Feb 2028 - 1.00% - 20 Jun 2028	USD	100,000.00			2,129.60	0.00
Indonesia Government 4.13% 15 Jan 2025 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	2,000,000.00			26,579.39	0.01
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Jun 2024	USD	100,000.00			2,037.72	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	100,000.00			1,636.79	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	700,000.00			11,584.15	0.01
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2025	USD	100,000.00			2,800.98	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	400,000.00			9,142.11	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2026	USD	1,000,000.00			13,822.81	0.01
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2026	USD	9,000,000.00			156,009.53	0.08
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Jun 2027	USD	300,000.00			5,281.68	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Jun 2028	USD	300,000.00			9,391.30	0.01
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	200,000.00			3,129.78	0.00
Mexico Government 4.15% 28 Mar 2027 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	1,100,000.00			17,213.77	0.01
Panama Government 8.88% 30 Sep 2027 - 1.00% - 20 Jun 2024	USD	200,000.00			251.51	0.00
Panama Government 8.88% 30 Sep 2027 - 1.00% - 20 Dec 2024	USD	300,000.00			1,342.08	0.00
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	1,100,000.00			11,443.49	0.01
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	900,000.00			6,087.41	0.00
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	2,200,000.00			32,493.90	0.02
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	3,600,000.00			44,381.50	0.02
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	200,000.00			1,506.05	0.00
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	200,000.00			1,609.69	0.00
Peru Government 8.75% 21 Nov 2033 - 1.00% - 20 Jun 2026	USD	3,000,000.00			26,789.48	0.01
Poland Government 1.38% 22 Oct 2027 - 1.00% - 20 Jun 2028	USD	100,000.00			1,922.42	0.00
Qatar Government 9.75% 15 Jun 2030 - 1.00% - 20 Dec 2026	USD	300,000.00			1,415.41	0.00
Qatar Government 9.75% 15 Jun 2030 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	200,000.00			1,848.13	0.00
Qatar Government 9.75% 15 Jun 2030 - 1.00% - 20 Dec 2028	USD	3,300,000.00			18,704.72	0.01
Serbia Government 3.13% 15 May 2027 - 1.00% - 20 Dec 2027	USD	200,000.00			12,723.80	0.01
金利スワップ (IRS)					-276,630.10	-0.14
IRS AUD Receive 4.50% / Pay 6M BBSW - 20 Mar 2034	AUD	3,700,000.00			56,669.86	0.03
IRS AUD Receive 4.75% / Pay 6M BBSW - 20 Dec 2028	AUD	3,300,000.00			88,932.45	0.04
IRS BRL Pay 11.97% / Receive 1M BRCDI - 02 Jan 2024	BRL	19,000,000.00			69,831.33	0.04
IRS BRL Receive 9.15% / Pay 1M BRCDI - 02 Jan 2024	BRL	7,900,000.00			-97,541.63	-0.05
IRS BRL Receive 9.15% / Pay 1M BRCDI - 02 Jan 2024	BRL	900,000.00			-11,124.97	-0.01
IRS BRL Receive 9.20% / Pay 1M BRCDI - 02 Jan 2024	BRL	10,100,000.00			-122,486.76	-0.06
IRS CZK Receive 4.18% / Pay 6M PRIBOR - 07 Nov 2028	CZK	101,200,000.00			129,600.57	0.07
IRS EUR Pay 2.75% / Receive 6M EURIBOR - 20 Mar 2034	EUR	900,000.00			-55,902.86	-0.03
IRS EUR Receive 3.00% / Pay 6M EURIBOR - 20 Mar 2034	EUR	2,000,000.00			58,562.35	0.03
IRS EUR Receive 3.25% / Pay 6M EURIBOR - 20 Mar 2029	EUR	3,800,000.00			197,571.70	0.10
IRS EUR Receive 3.30% / Pay 6M EURIBOR - 03 Oct 2033	EUR	200,000.00			16,816.47	0.01
IRS EUR Receive 3.37% / Pay 6M EURIBOR - 09 Oct 2028	EUR	400,000.00			19,041.85	0.01
IRS EUR Receive 3.45% / Pay 6M EURIBOR - 20 Oct 2028	EUR	400,000.00			20,715.90	0.01
IRS GBP Receive 4.32% / Pay 12M SONIA - 20 Oct 2033	GBP	100,000.00			11,400.98	0.01
IRS MXN Pay 9.77% / Receive 1M TIIE - 27 Sep 2028	MXN	5,640,000.00			-15,141.20	-0.01
IRS PLN Pay 5.46% / Receive 6M WIBOR - 10 Jan 2028	PLN	1,400,000.00			-13,055.27	-0.01
IRS PLN Pay 5.49% / Receive 6M WIBOR - 10 Jan 2028	PLN	1,400,000.00			-13,503.21	-0.01
IRS USD Pay 3.00% / Receive 3M SOFR - 19 Dec 2028	USD	9,400,000.00			810,503.25	0.41
IRS USD Receive 1.00% / Pay 3M SOFR - 16 Dec 2025	USD	20,300,000.00			-409,058.19	-0.21
IRS USD Receive 1.50% / Pay 3M SOFR - 15 Dec 2028	USD	2,400,000.00			-141,097.70	-0.07
IRS USD Receive 1.75% / Pay 12M SOFR - 15 Jun 2024	USD	6,000,000.00			90,436.73	0.05
IRS USD Receive 3.00% / Pay 3M SOFR - 19 Dec 2048	USD	4,700,000.00			-1,177,520.66	-0.60
IRS USD Receive 3.73% / Pay 12M SOFR - 03 Aug 2033	USD	200,000.00			4,312.11	0.00
IRS USD Receive 3.74% / Pay 12M SOFR - 07 Aug 2033	USD	200,000.00			4,398.93	0.00
IRS USD Receive 3.83% / Pay 12M SOFR - 12 Oct 2053	USD	100,000.00			10,036.79	0.01

証券銘柄	株(口)数／ 通貨(単位：千)／ Ctr:契約	2023年12月31日 持高	通貨	価格	未実現 -損／益 (米ドル)	純資産 比率 (%)
IRS USD Receive 3.87% / Pay 12M SOFR - 17 Oct 2053	USD	100,000.00			10,789.30	0.01
IRS USD Receive 3.88% / Pay 12M SOFR - 16 Oct 2053	USD	100,000.00			10,973.92	0.01
IRS USD Receive 4.03% / Pay 12M SOFR - 04 Oct 2033	USD	100,000.00			4,660.73	0.00
IRS USD Receive 4.15% / Pay 12M SOFR - 12 Oct 2033	USD	200,000.00			11,317.72	0.01
IRS USD Receive 4.17% / Pay 12M SOFR - 27 Sep 2033	USD	400,000.00			23,041.16	0.01
IRS USD Receive 4.17% / Pay 12M SOFR - 03 Oct 2033	USD	900,000.00			52,293.33	0.03
IRS USD Receive 4.18% / Pay 12M SOFR - 10 Oct 2033	USD	300,000.00			17,589.96	0.01
IRS USD Receive 4.22% / Pay 12M SOFR - 20 Oct 2033	USD	200,000.00			12,497.74	0.01
IRS USD Receive 4.23% / Pay 12M SOFR - 23 Oct 2033	USD	100,000.00			6,337.64	0.00
IRS USD Receive 4.26% / Pay 12M SOFR - 23 Oct 2033	USD	100,000.00			6,544.20	0.00
IRS USD Receive 4.45% / Pay 12M SOFR - 31 Oct 2033	USD	100,000.00			8,170.11	0.00
IRS ZAR Pay 5.95% / Receive 3M JIBAR - 30 Nov 2024	ZAR	36,600,000.00			26,755.27	0.01
デリバティブの投資					1,624,656.53	0.82
純流動資産／負債	USD				-1,121,416.10	-0.56
ファンドの純資産	USD				197,852,740.19	100.00
1) 時価は、最終純資産価格算出日の入手可能な直近の価格に基づいて算定された。 * ベネズエラ政権および国営石油会社に対する米国の制裁により、ベネズエラ債券の取引は制限されている。						
1口当り純資産価格						6.26米ドル
発行済受益証券数						31,614,155.00口

当期中の投資有価証券の変動明細表は、請求により無料でアリアンツ・グローバル・インベスターズ・ゲーエムベーハーのルクセンブルグ事務所から入手可能である。

添付の注記は当財務書類の一部である。

[前へ](#)

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

2024年1月末日現在、管理会社の払込済資本金は49,900,900ユーロ（約80億円）、株主資本金は398,280,492.95ユーロ（約637億円）である。

（注）ユーロの円貨換算は便宜上、2024年1月31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＝159.97円）による。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社の目的は投資信託の設定および管理ならびに個別ポートフォリオの管理ならびに投資助言である。管理会社の目的は、ポートフォリオ全体に関して、投資信託の資産を、管理会社の資産とは別にリスク分散の原則にもとづき投資家の共同預金口座のために、有価証券およびその他の許可された資産にその名義で投資することならびにその資産から生じる投資家(受益者)の権利に関する受益証券または確認証を発行することである。管理会社はその受益証券の販売促進および投資信託資産の管理の目的であらゆる必要かつ適切なことを実施することができる。管理会社はその取引または措置が、UCITSに関する欧州議会の2009/65/EC指令(改正済)に従う限り、その法人としての目的に関し利益をもたらし、役に立ちまたは適切なあらゆる取引を行い、あらゆる措置を取ることができる。

管理会社は、投資運用を投資運用会社であるピムコ・ヨーロッパGmbHに、ファンド資産の保管業務、支払事務および情報提供業務ならびに登録・名義書換事務をステート・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いる。

2024年1月末日現在、管理会社は、以下の1,543の公募ファンド(合計純資産総額4,140億5,898万ユーロ)および754の私募ファンドであるスペシャライズド・ファンド(合計純資産総額2,273億7,964万ユーロ)の管理・運用を行っている。

基本的性格(投資対象)	運用が行われている国	ファンドの本数	純資産総額 (単位：百万ユーロ)
株式	フランス、ドイツ、イギリス	364	100,669.53
債券	フランス、ドイツ、イギリス、イタリア、オランダ	623	166,512.34
マルチアセットインベストメント	フランス、ドイツ、イギリス、香港、イタリア、日本、シンガポール	556	146,877.12
合計		1,543	414,058.98

(3) その他

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実および与えることが予想される事実はない。

[前へ](#)

[次へ](#)

2-2. その他の訂正

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

2023年11月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（中略）

- III 2023年11月末日現在では、ファンドは、税法上、公募外国株式投資信託として取り扱われる。ただし、将来における税務当局の判断によりこれと異なる取扱いがなされる可能性もある。

（後略）

<訂正後>

2024年2月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（中略）

- III 2024年2月末日現在では、ファンドは、税法上、公募外国株式投資信託として取り扱われる。ただし、将来における税務当局の判断によりこれと異なる取扱いがなされる可能性もある。

（後略）

5 運用状況

(2) 投資資産

<訂正前>

① 投資有価証券の主要銘柄

(2023年10月末日現在)

順位	銘柄	国名 (発行地)	種類	数量	利率 (%)	償還日	取得価格		時価		投資 比率 (%)
							単価 (米ドル)	合計 (米ドル)	単価 (米ドル)	合計 (米ドル)	
1	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 08/28	ベネズエラ	外国政府債	18,005,000.00	9.250	2028/ 5 / 7	0.934	16,821,417.50	0.203	3,646,012.50	1.99
2	Colombia Government USD Bonds 15/26	コロンビア	外国政府債	3,500,000.00	4.500	2026/ 1 /28	1.101	3,852,000.00	0.959	3,355,160.90	1.83
3	South Africa Government ZAR Bonds 98/26	南アフリカ	外国政府債	58,800,000.00	10.500	2026/12/21	0.062	3,650,954.44	0.055	3,229,390.77	1.76
4	Eskom Holdings USD Notes 18/28	南アフリカ	社債	3,400,000.00	6.350	2028/ 8 /10	1.073	3,649,500.00	0.904	3,074,362.62	1.68
5	Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/35	エクアドル	外国政府債	8,020,000.00	3.500	2035/ 7 /31	0.422	3,382,764.50	0.376	3,012,671.30	1.64
6	Panama Government USD Bonds 99/29	パナマ	外国政府債	2,415,000.00	9.375	2029/ 4 / 1	1.106	2,670,140.93	1.115	2,692,828.36	1.47
7	Dominican Government USD Bonds 23/31	ドミニカ共和国	外国政府債	2,800,000.00	7.050	2031/ 2 / 3	1.000	2,800,000.00	0.957	2,680,713.00	1.46
8	Israel Government EUR Bonds 23/26	イスラエル	外国政府債	2,200,000.00	5.000	2026/10/30	1.051	2,312,276.65	1.065	2,342,648.42	1.28
9	Pertamina USD Notes 21/26	インドネシア	社債	2,500,000.00	1.400	2026/ 2 / 9	0.975	2,436,750.00	0.903	2,258,406.00	1.23
10	Saudi Government USD MTN 23/28	サウジアラビア	外国政府債	2,300,000.00	4.750	2028/ 1 /18	0.997	2,292,019.00	0.970	2,230,436.50	1.22
11	United States Government USD Bonds 15/25	アメリカ合衆国	外国政府債	2,300,000.00	2.000	2025/ 2 /15	1.018	2,342,509.84	0.959	2,206,508.45	1.20
12	United States Government USD Bonds 22/29	アメリカ合衆国	外国政府債	2,300,000.00	3.125	2029/ 8 /31	0.967	2,225,200.93	0.911	2,095,857.06	1.14
13	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/38	アルゼンチン	外国政府債	6,770,188.00	4.250	2038/ 1 / 9	0.621	4,205,234.79	0.304	2,056,402.63	1.12
14	Philippine Government USD Bonds 09/34	フィリピン	外国政府債	2,000,000.00	6.375	2034/10/23	1.449	2,897,500.00	1.024	2,047,455.00	1.12
15	Turkey Government USD Notes 23/30	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	9.125	2030/ 7 /13	0.991	1,982,340.00	1.000	1,999,279.40	1.09
16	Albania Government EUR Bonds 23/28	アルバニア	外国政府債	1,800,000.00	5.900	2028/ 6 / 9	1.060	1,907,710.38	1.033	1,859,174.12	1.01
17	Colombia Government USD Bonds 21/32	コロンビア	外国政府債	2,500,000.00	3.250	2032/ 4 /22	0.990	2,475,800.00	0.715	1,787,609.25	0.98
18	Turkey Government USD Bonds 18/28	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	5.125	2028/ 2 /17	0.994	1,988,220.00	0.887	1,773,005.60	0.97
19	Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/30	エクアドル	外国政府債	3,460,000.00	6.000	2030/ 7 /31	0.567	1,961,221.00	0.507	1,755,501.58	0.96
20	Hungary Government EUR Bonds 20/35	ハンガリー	外国政府債	2,300,000.00	1.750	2035/ 6 / 5	0.771	1,774,063.39	0.726	1,669,704.49	0.91
21	Turkey Government USD Bonds 06/36	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	6.875	2036/ 3 /17	1.167	2,333,650.00	0.823	1,646,174.40	0.90
22	SOCAR Turkey Enerji via Steas Funding I USD Notes 22/26	アイルランド	社債	1,700,000.00	7.230	2026/ 3 /17	0.995	1,690,650.00	0.963	1,636,624.00	0.89
23	Development Bank of Southern Africa ZAR Notes 21/24	南アフリカ	社債	30,200,000.00	8.600	2024/10/21	0.067	2,025,139.90	0.053	1,591,487.67	0.87
24	Brazil Minas Via State of Minas Gerais USD Notes 13/28	ケイマン諸島	社債	1,602,500.00	5.333	2028/ 2 /15	1.055	1,690,366.26	0.972	1,558,150.81	0.85
25	South Africa Government USD Bonds 19/49	南アフリカ	外国政府債	2,400,000.00	5.750	2049/ 9 /30	0.923	2,216,000.00	0.647	1,553,132.88	0.85
26	Turkey Government USD Bonds 13/43	トルコ	外国政府債	2,500,000.00	4.875	2043/ 4 /16	0.729	1,823,470.00	0.608	1,519,525.00	0.83
27	Gaci First Investment USD Notes 22/27	ケイマン諸島	社債	1,500,000.00	5.000	2027/10/13	0.991	1,486,035.00	0.971	1,456,252.05	0.79
28	BCAP 2012-RR3 Trust MBS USD FLR-Notes 12/37 Cl.2A8	アメリカ合衆国	不動産抵当 証券担保債 券	1,634,995.97	3.671	2037/ 5 /26	0.801	1,310,163.79	0.867	1,417,843.65	0.77
29	Mexico Government MXN Bonds 21/26	メキシコ	外国政府債	27,658,242.50	3.000	2026/12/ 3	0.053	1,463,467.06	0.050	1,394,530.95	0.76
30	Romania Government EUR MTN 22/28	ルーマニア	外国政府債	1,500,000.00	2.125	2028/ 3 / 7	1.117	1,675,351.89	0.927	1,389,890.00	0.76

② 投資不動産物件

該当なし(2023年10月末日現在)。

③ その他投資資産の主要なもの

該当なし(2023年10月末日現在)。

<訂正後>

① 投資有価証券の主要銘柄

(2024年1月末日現在)

順位	銘柄	国名 (発行地)	種類	数量	利率 (%)	償還日	取得価格		時価		投資 比率 (%)
							単価 (米ドル)	合計 (米ドル)	単価 (米ドル)	合計 (米ドル)	
1	Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/35	エクアドル	外国政府債	8,020,000.00	3.500	2035/ 7 /31	0.422	3,382,764.50	0.414	3,321,322.60	1.72
2	Eskom Holdings USD Notes 18/28	南アフリカ	社債	3,400,000.00	6.350	2028/ 8 /10	1.073	3,649,500.00	0.971	3,300,942.02	1.71
3	South Africa Government ZAR Bonds 98/26	南アフリカ	外国政府債	58,800,000.00	10.500	2026/12/21	0.062	3,650,954.44	0.056	3,281,759.29	1.70
4	Venezuela Government USD Defaulted Bonds 08/28	ベネズエラ	外国政府債	18,005,000.00	9.250	2028/ 5 / 7	0.897	16,148,733.93	0.162	2,920,538.84	1.51
5	Dominican Government USD Bonds 23/31	ドミニカ共和国	外国政府債	2,800,000.00	7.050	2031/ 2 / 3	1.000	2,800,000.00	1.041	2,915,992.24	1.51
6	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/38	アルゼンチン	外国政府債	7,070,188.00	4.250	2038/ 1 / 9	0.611	4,318,934.79	0.390	2,755,544.26	1.42
7	Panama Government USD Bonds 99/29	パナマ	外国政府債	2,415,000.00	9.375	2029/ 4 / 1	1.101	2,658,580.29	1.119	2,702,532.80	1.40
8	Mexico Government MXN Bonds 21/26	メキシコ	外国政府債	46,736,446.40	3.000	2026/12/ 3	0.053	2,459,981.35	0.054	2,533,431.59	1.31
9	Israel Government EUR Bonds 23/26	イスラエル	外国政府債	2,200,000.00	5.000	2026/10/30	1.051	2,312,276.65	1.106	2,433,263.82	1.26
10	Philippine Government USD Bonds 09/34	フィリピン	外国政府債	2,000,000.00	6.375	2034/10/23	1.449	2,897,500.00	1.114	2,227,967.00	1.15
11	United States Government USD Bonds 22/29	アメリカ合衆国	外国政府債	2,300,000.00	3.125	2029/ 8 /31	0.967	2,225,200.93	0.957	2,201,531.25	1.14
12	Colombia Government USD Bonds 15/26	コロンビア	外国政府債	2,200,000.00	4.500	2026/ 1 /28	1.101	2,421,257.14	0.981	2,158,300.32	1.12
13	United States Government USD Bonds 15/25	アメリカ合衆国	外国政府債	2,200,000.00	2.000	2025/ 2 /15	1.021	2,246,435.16	0.972	2,138,640.68	1.10
14	Turkey Government USD Notes 23/30	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	9.125	2030/ 7 /13	0.991	1,982,340.00	1.069	2,138,125.00	1.10
15	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS USD Bonds 23/29	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	8.509	2029/ 1 /14	1.000	2,000,000.00	1.040	2,079,021.00	1.07
16	Albania Government EUR Bonds 23/28	アルバニア	外国政府債	1,800,000.00	5.900	2028/ 6 / 9	1.060	1,907,710.38	1.110	1,997,415.61	1.03
17	Ecuador Government USD FLR-Bonds 20/30	エクアドル	外国政府債	3,700,000.00	6.000	2030/ 7 /31	0.560	2,072,281.00	0.530	1,960,733.97	1.01
18	Colombia Government USD Bonds 21/32	コロンビア	外国政府債	2,500,000.00	3.250	2032/ 4 /22	0.990	2,475,800.00	0.781	1,953,434.50	1.01
19	Hungary Government EUR Bonds 20/35	ハンガリー	外国政府債	2,300,000.00	1.750	2035/ 6 / 5	0.772	1,774,950.43	0.814	1,871,851.17	0.97
20	Turkey Government USD Bonds 18/28	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	5.125	2028/ 2 /17	0.994	1,988,220.00	0.933	1,865,426.00	0.96
21	Turkey Government USD Bonds 06/36	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	6.875	2036/ 3 /17	1.057	2,113,251.81	0.913	1,826,134.80	0.94
22	South Africa Government USD Bonds 19/49	南アフリカ	外国政府債	2,400,000.00	5.750	2049/ 9 /30	0.939	2,252,800.00	0.746	1,790,106.48	0.92
23	SOCAR Turkey Enerji via Steas Funding 1 USD Notes 22/26	アイルランド	社債	1,700,000.00	7.230	2026/ 3 /17	0.995	1,690,650.00	0.996	1,694,033.00	0.88
24	Argentina Government USD FLR-Bonds 20/35	アルゼンチン	外国政府債	4,787,504.00	3.625	2035/ 7 / 9	0.721	3,452,485.60	0.337	1,614,585.72	0.83
25	Development Bank of Southern Africa ZAR Notes 21/24	南アフリカ	社債	30,200,000.00	8.600	2024/10/21	0.067	2,025,139.90	0.053	1,606,122.63	0.83
26	Brazil Minas Via State of Minas Gerais USD Notes 13/28	ケイマン諸島	社債	1,602,500.00	5.333	2028/ 2 /15	1.031	1,652,545.32	0.987	1,581,683.53	0.82
27	Romania Government EUR MTN 22/28	ルーマニア	外国政府債	1,500,000.00	2.125	2028/ 3 / 7	1.117	1,675,351.89	0.988	1,481,472.99	0.77
28	GACI First Investment Company USD Notes 23/30	ケイマン諸島	社債	1,500,000.00	4.750	2030/ 2 /14	0.977	1,465,950.00	0.981	1,471,458.30	0.76
29	Turkey Government USD Bonds 17/47	トルコ	外国政府債	2,000,000.00	5.750	2047/ 5 /11	0.633	1,265,375.00	0.732	1,464,851.00	0.76
30	South Africa Government USD Bonds 19/29	南アフリカ	外国政府債	1,600,000.00	4.850	2029/ 9 /30	1.000	1,600,000.00	0.914	1,461,810.72	0.76

② 投資不動産物件

該当なし(2024年1月末日現在)。

③ その他投資資産の主要なもの

該当なし(2024年1月末日現在)。

(3) 運用実績

③ 収益率の推移

<訂正前>

(前略)

また、ファンドの暦年ベースでの収益率は次のとおりである。

期間	収益率(%)
2013年	-7.30
2014年	3.07
2015年	-1.44
2016年	11.26
2017年	8.10
2018年	-4.47
2019年	13.14
2020年	7.01
2021年	-4.41
2022年	-19.53
2023年	-0.10

(注)：収益率(%) = $100 \times \left(\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right)$

A = 計算期間中の各月についての「一口当り分配額 / 分配落NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値。

ただし、期首NAVとは、当該期間の直前の期間末の一口当り純資産価格をいい、期末NAVとは当該期間末の一口当り純資産価格をいう。2023年については、期末NAVとは2023年10月末の一口当り純資産価格をいう。

<訂正後>

(前略)

また、ファンドの暦年ベースでの収益率は次のとおりである。

期間	収益率(%)
2014年	3.07
2015年	-1.44
2016年	11.26
2017年	8.10
2018年	-4.47
2019年	13.14
2020年	7.01
2021年	-4.41
2022年	-19.53
2023年	<u>10.63</u>
2024年	<u>-1.20</u>

(注)：収益率(%) = $100 \times \left(\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right)$

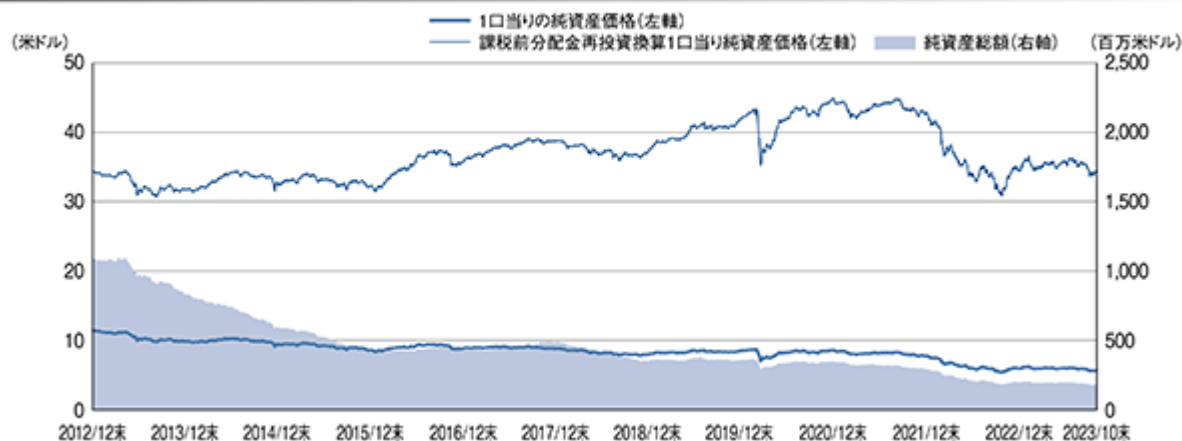
A = 計算期間中の各月についての「一口当り分配額 / 分配落NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値。

ただし、期首NAVとは、当該期間の直前の期間末の一口当り純資産価格をいい、期末NAVとは当該期間末の一口当り純資産価格をいう。2024年については、期末NAVとは2024年1月末の一口当り純資産価格をいう。

(参考情報)

<訂正前>

純資産総額および1口当りの純資産価格の推移



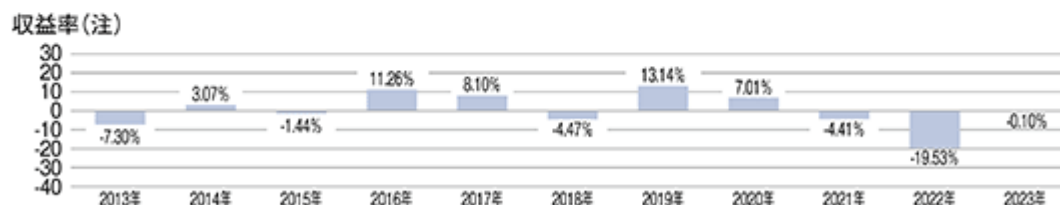
(注1)課税前分配金再投資換算1口当り純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものである。
 (注2)ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を保証または示唆するものではない。以下同じ。

分配の推移

(税引前/米ドル)	
会計年度	一口当りの支払分配金
第十七会計年度(2013年7月1日-2014年6月30日)	0.72
第十八会計年度(2014年7月1日-2015年6月30日)	0.72
第十九会計年度(2015年7月1日-2016年6月30日)	0.72
第二十会計年度(2016年7月1日-2017年6月30日)	0.72
第二十一会計年度(2017年7月1日-2018年6月30日)	0.60
第二十二会計年度(2018年7月1日-2019年6月30日)	0.48
第二十三会計年度(2019年7月1日-2020年6月30日)	0.48
第二十四会計年度(2020年7月1日-2021年6月30日)	0.44
第二十五会計年度(2021年7月1日-2022年6月30日)	0.39
第二十六会計年度(2022年7月1日-2023年6月30日)	0.30
設定来累計(2023年10月末まで)	16.830

(税引前/米ドル)	
月	一口当りの支払分配金
2023年6月	0.025
2023年7月	0.025
2023年8月	0.025
2023年9月	0.025
2023年10月	0.025
直近1年間累計	0.300

年間収益率の推移



(注)：収益率(%) = $100 \times \left(\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right)$

A = 計算期間中の各月についての「一口当り分配額/分配前NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値。
 ただし、期首NAVとは、当該期間の直前の期間末の一口当り純資産価格をいい、期末NAVとは当該期間末の一口当り純資産価格をいう。2023年については、期末NAVとは2023年10月末の一口当り純資産価格をいう。

<訂正後>

純資産総額および1口当りの純資産価格の推移



（注1）課税前分配金再投資換算1口当り純資産価格は、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ある。

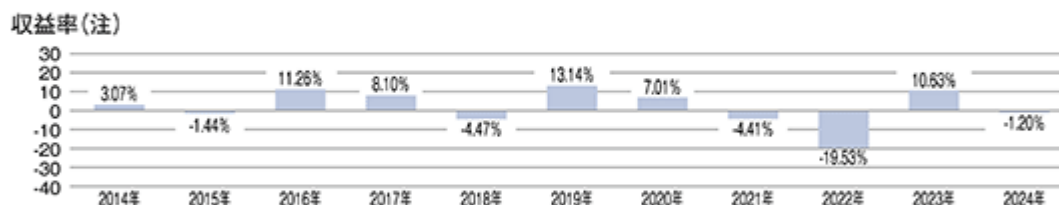
（注2）ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を保証または示唆するものではない。以下同じ。

分配の推移

(税引前/米ドル)	
会計年度	一口当りの支払分配金
第十七会計年度(2013年7月1日-2014年6月30日)	0.72
第十八会計年度(2014年7月1日-2015年6月30日)	0.72
第十九会計年度(2015年7月1日-2016年6月30日)	0.72
第二十会計年度(2016年7月1日-2017年6月30日)	0.72
第二十一会計年度(2017年7月1日-2018年6月30日)	0.60
第二十二会計年度(2018年7月1日-2019年6月30日)	0.48
第二十三会計年度(2019年7月1日-2020年6月30日)	0.48
第二十四会計年度(2020年7月1日-2021年6月30日)	0.44
第二十五会計年度(2021年7月1日-2022年6月30日)	0.39
第二十六会計年度(2022年7月1日-2023年6月30日)	0.30
設定来累計(2024年1月末まで)	16.905

(税引前/米ドル)	
月	一口当りの支払分配金
2023年9月	0.025
2023年10月	0.025
2023年11月	0.025
2023年12月	0.025
2024年1月	0.025
直近1年間累計	0.300

年間収益率の推移



(注)：収益率(%) = $100 \times \left(\frac{\text{期末NAV} \times A}{\text{期首NAV}} - 1 \right)$

A = 計算期間中の各月についての「一口当り分配額/分配前NAV + 1」を計算して掛け合わせた数値。
ただし、期首NAVとは、当該期間の直前の期間末の一口当り純資産価格をいい、期末NAVとは当該期間末の一口当り純資産価格をいう。2024年については、期末NAVとは2024年1月末の一口当り純資産価格をいう。

[前へ](#)