【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年6月14日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	日興スリートップ（隔月分配型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

日興スリートップ（隔月分配型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
※ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜３％）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2024年6月15日から2024年12月17日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

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】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的
世界の債券および株式に投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型投信		その他資産（　　）
	内外	資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信
一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

◇内外
目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

◇資産複合
目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

２）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年１回 年２回 年４回	グローバル（含む日本） 日本 北米	ファミリーファンド	あり （　　）
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　）	年６回（隔月） 年12回（毎月） 日々	欧州 アジア オセアニア		
不動産投信	その他 （　　）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 （　　）		アフリカ 中近東（中東）		
資産複合 （その他資産（投資信託証券（株式、債券）））		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
◇資産複合　資産配分固定型（その他資産（投資信託証券（株式、債券））
当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。
「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
◇年６回（隔月）
目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
◇グローバル（含む日本）
目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
◇ファンド・オブ・ファンズ
「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
◇為替ヘッジなし
目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

特色1

**世界の債券および株式に幅広く分散投資を行ない、
収益の源泉を分散するとともに、
高水準のインカムを追求します。**

特色2

**奇数月（原則15日）に決算を行ない、
安定的な分配を行なうことをめざします。**

◆組入債券や株式の利子･配当等収益を原資として分配を行ないます。
※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。

特色3

**各資産の運用については、各分野において
世界屈指のマネージャーを選抜しました。**

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

特色1 世界の債券および株式に幅広く分散投資を行ない、収益の源泉を分散するとともに、高水準のインカムを追求します。

◇世界の債券や株式などで運用を行なう投資信託証券などをバランスよく組み合わせることにより、マーケット環境などに左右されにくい、安定した資産の成長をめざします。
◇日興グローバルラップの助言に基づき、資産配分比率を随時見直します。
◇外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。

当ファンドの基本ポートフォリオ

※上記は基本ポートフォリオ（2023年9月末現在）であり、実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

【ご参考】各資産の特性

① 高格付債券 — 景気が後退する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

② 世界株式、世界高配当株式 — 景気が回復する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

③ 高利回り債券、新興国債券 — 景気が拡大する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

※上記はイメージ図であり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

特色2 奇数月（原則15日）に決算を行ない、安定的な分配を行なうことをめざします。

分配方針

隔月に安定的な分配を行なうことをめざします。

◇インカム収益（組入債券や組入株式の利子・配当等収益）を原資として、毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各15日（休業日の場合は翌営業日）の決算時に安定した収益を行なうことをめざします。
◇更に、毎年1月および7月の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、値上がり益を積極的に分配する場合があります。

分配のイメージ

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。
※上図はイメージであり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

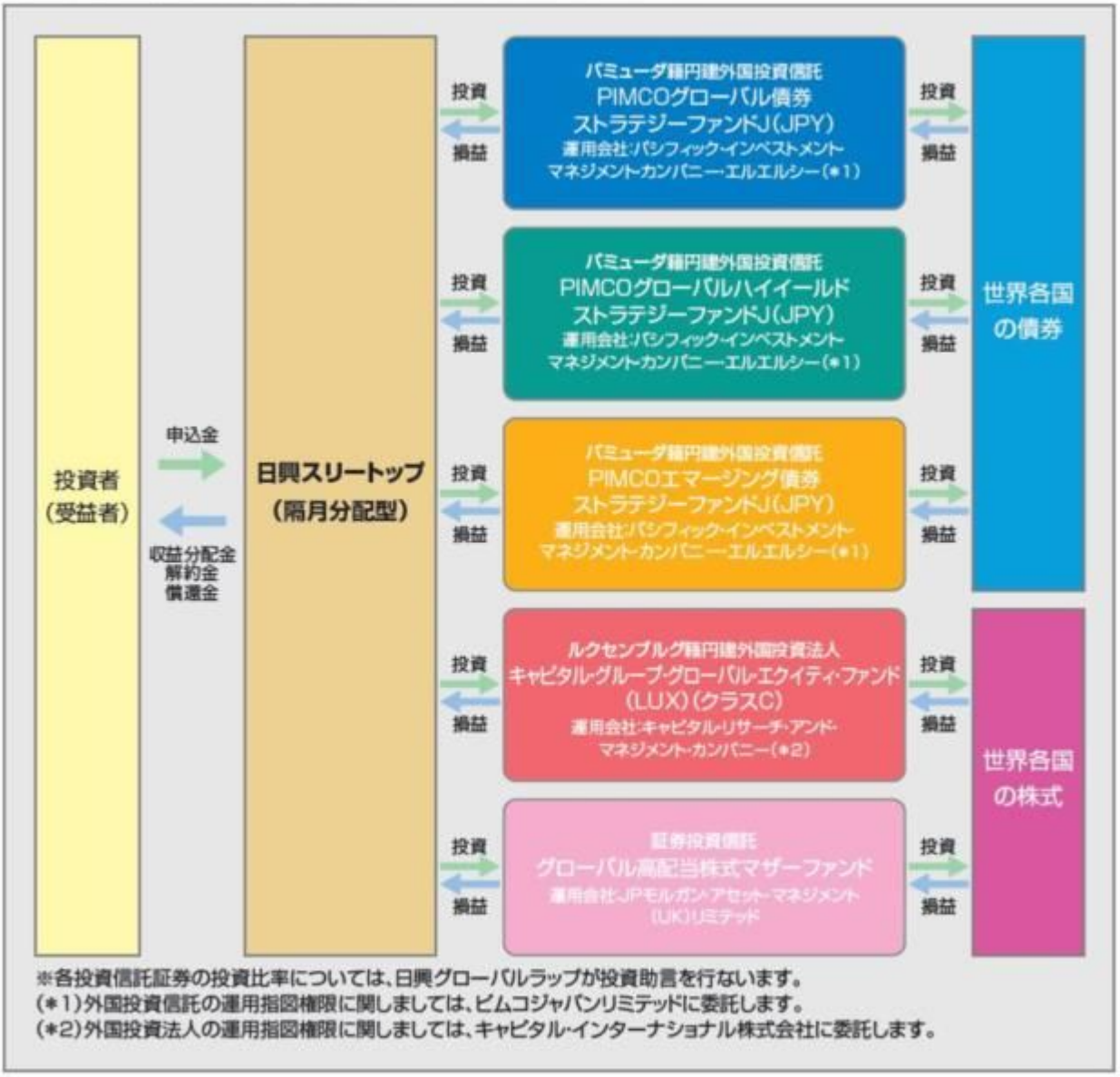
特色3 各資産の運用については、各分野において世界屈指のマネージャーを選抜しました。

各資産への投資比率については、
日興グローバルラップ株式会社*の助言をもとに、
日興アセットマネジメントが最適と考える資産配分を行ないます。

*「日興グローバルラップ株式会社」は、2024年10月1日付で「SMBCグローバル・インベストメント&コンサルティング株式会社」へ商号変更する予定です。

ファンドの仕組み

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※各投資信託証券の投資比率については、日興グローバルラップが投資助言を行ないます。
（＊1）外国投資信託の運用指図権限に関しましては、ピムコジャパンリミテッドに委託します。
（＊2）外国投資法人の運用指図権限に関しましては、キャピタル・インターナショナル株式会社に委託します。

（主な投資制限）
○投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
○外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

（分配方針）
○毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。
また、元本払戻金（特別分配金）部分は**非課税扱い**となります。

・普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
・元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

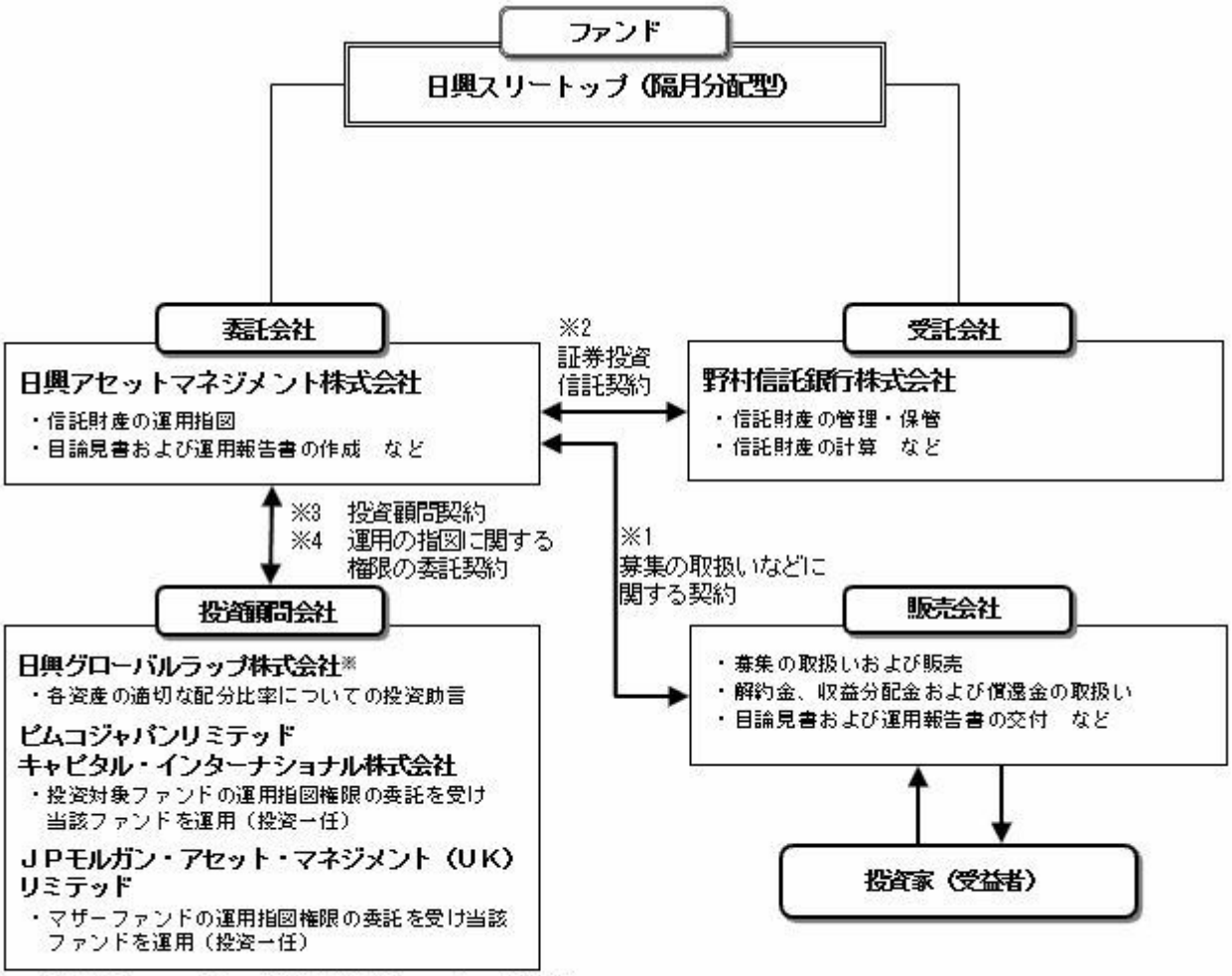
④　信託金限度額
・2兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

2006年10月31日
・ファンドの信託契約締結、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

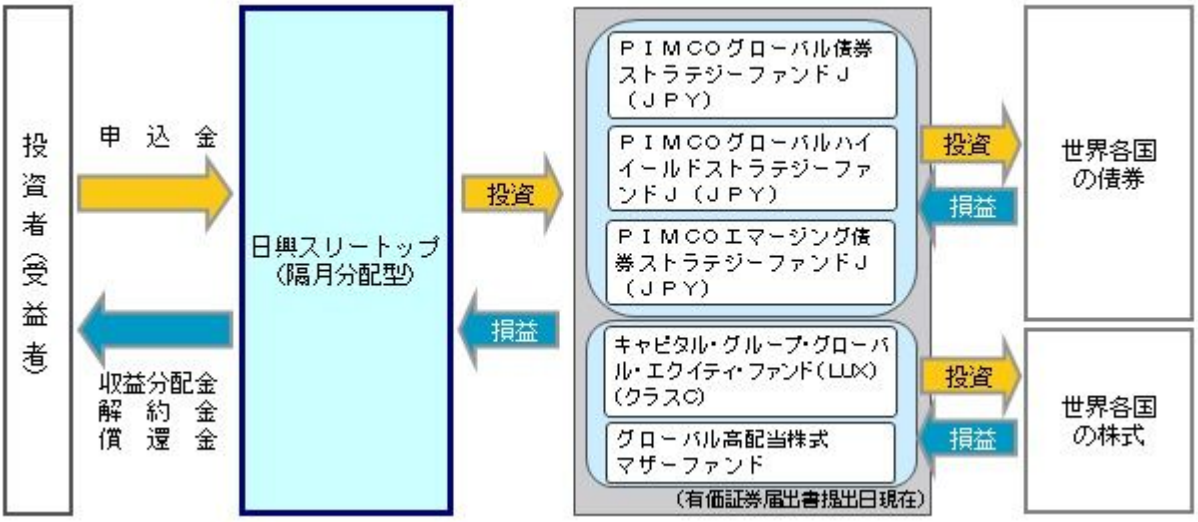
①　ファンドの仕組み



※「日興グローバルラップ株式会社」は、2024年10月1日付で
「ＳＭＢＣグローバル・インベストメント＆
コンサルティング株式会社」へ商号変更する予定です。

※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
※3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。
※4 投資顧問会社に運用の指図に関する権限を委託するにあたり、そのルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。委託する業務内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

＜ファンド・オブ・ファンズの仕組み＞
当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



② 委託会社の概況（2024年3月末現在）
1）資本金
17,363百万円
2）沿革
1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
3）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

・主として、別に定める投資信託証券の一部、またはすべてに分散投資を行ない、インカム収益の確保を図るとともに、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
・投資信託証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性などを勘案して決定します。なお、資金動向などによっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることもあります。
・別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価などを勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。
・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準になったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
1）有価証券
2）金銭債権
3）約束手形
4）為替手形
② 主として別に定めるマザーファンドの受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
1）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
2）外国または外国の者の発行する証券または証書で、１）の証券の性質を有するもの
3）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
1）預金
2）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3）コール・ローン
4）手形割引市場において売買される手形
④ 次の取引ができます。
1）外国為替予約取引
2）資金の借入

◆投資対象とする投資信託証券の概要
＜ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）＞（バミューダ籍円建外国投資信託）
＜ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）＞（バミューダ籍円建外国投資信託）
＜ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）＞（バミューダ籍円建外国投資信託）

名称	ＰＩＭＣＯ グローバル債券 ストラテジーファンドＪ （ＪＰＹ）	ＰＩＭＣＯ グローバルハイイールド ストラテジーファンドＪ （ＪＰＹ）	ＰＩＭＣＯ エマージング債券 ストラテジーファンドＪ （ＪＰＹ）
運用の基本方針			
基本方針	トータルリターンの最大化をめざして運用を行ないます。		

主な投資対象	通常、ファンドの純資産総額の90％以上を、日本を除く３ヵ国以上の発行体が発行する債券などに投資します。	通常、ファンドの純資産総額の３分の２以上を、ユーロ建やその他の欧州通貨建あるいは米ドル建のハイイールド債券などに投資します。	通常、ファンドの純資産総額の３分の２以上を、新興国（過去５年連続で高所得のＯＥＣＤ諸国として世界銀行に分類されている国々以外の各国。以下同じ。）の債券、通貨などに分散投資を行ないます。
	投資可能な債券は、以下のものを含みます。 ・各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ・社債 ・政府および企業が発行したインフレ連動債 ・仕組債 ・ローンおよびローン・パーティシペーション ・譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ・現先取引および逆現先取引 ・国際機関の債券　など		
投資方針	ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。	ICE BofAメリルリンチ米国ハイイールド・マスターⅡコンストレインド・インデックス50%＋ICE BofAメリルリンチ・ヨーロピアン・カレンシー・ハイイールド・コンストレインド・インデックス50%（ヘッジなし・円ベース）で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。	ＪＰモルガン・エマージング・ローカル・マーケット・インデックス・プラス50%＋ＪＰモルガン・ＧＢＩ-ＥＭグローバル・ディバーシファイド50%（ヘッジなし・円ベース）で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。
	外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。		
主な投資制限	・原則として投資時において、Ｂａａ格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード＆プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含みます。以下同じ。）以上の債券などに投資します。 ・ポートフォリオの平均格付は、原則としてＡａ格以上とします。	・原則として純資産総額の３分の２以上をＢａａ格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード＆プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含みます。以下同じ。）未満の債券などに投資します。 ・ポートフォリオの平均格付は、原則としてＢ格以上とします。	・純資産総額の３分の２以上を、新興国の債券、通貨などに分散投資を行ないます。 ・Ｂ格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード＆プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含みます。）未満の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の15%まで可能とします。 ・ファンドの平均デュレーションは、通常の環境では、０年から８年の範囲を超えないものとします。
	・ファンドの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーション±２年以内で変動させるものとします。 ・エマージング国の発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の10%まで可能とします。		
	・1つの発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の５％を限度として投資することができます。ただし、各国政府、その政府の部局、政府系機関、政府系企業が発行し、または保証した債券などは、この限りではありません。また、クレジットリンク債、クレジット・デリバティブなどについては、参照資産を基礎として上記投資割合を算出します。 ・ファンドは、全体のポートフォリオ運用戦略の一環として、または債券価格の下落を相殺するために、空売りを行なうことができます。 ・ファンドは、先物取引などの派生商品に投資をすることができます。 ・借入れの合計金額が各ファンドの純資産総額の10%を越える借入残高が生じる借入れは行なえないものとします。 ・流動性の乏しい証券への投資は、ファンドの純資産総額の15%までとします。 ・優先株式などの有価証券に投資を行なう場合があります。		
収益分配	毎月、利子収入および売買益などから分配を行なう方針です。ただし、分配対象		

		額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
ファンドに係る費用		
	信託報酬など	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用など。
その他		
	投資顧問会社	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
	管理会社	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
	信託期間	無期限（2006年10月31日設定）
	決算日	原則として、毎年６月末日

※上記の投資対象とする投資信託証券については、日々の基準価額が取得できるため、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、当ファンドにおいてデリバティブ取引等の投資制限に係る管理を行ないます。

＜キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（ＬＵＸ）（クラスＣ）＞（ルクセンブルグ籍円建外国投資法人）

運用の基本方針		
	基本方針	主として世界の株式に投資を行ない、長期的な元本の成長をめざします。
	主な投資対象	主として以下の譲渡性証券およびマネーマーケット商品に投資します。 ・適格国の金融商品取引所に上場しているもの。 （適格国：ＭＳＣＩワールドインデックスに随時組み入れられる国およびルクセンブルグ。以下同じ。） ・その他の規制ある市場で取引されているもの。 ・発行後１年以内に上記いずれかの要件を満たすもの。
	投資方針	・原則として、適格国の公の金融商品取引所に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている世界の様々な国々の普通株式または普通株式の特性を有する譲渡性証券に投資を行ないます。 ・また、経済、社会、政治的展開、為替変動リスク、諸国の市場の流動性に然るべき配慮をしながら、主として世界先進諸国の企業の株式などの証券に重点をおいて投資を行ないます。 ・市場環境に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	以下の投資は行ないません。 ・貴金属、市況商品あるいはそれらを表象する証券。 ・不動産またはこれに関わるオプション、権利もしくは権益。ただし、不動産もしくはその権益によって担保される証券または不動産もしくはその権益への投資を行なう企業によって発行される証券への投資は行ないます。 ・証券を信用で買い付けないものとします（組入れ証券売買の決済のため必要な短期与信を除きます。）。また、マネーマーケット商品、その他の金融資産においても、空売りまたはショート・ポジションによる投資を行ないません。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬など	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	事務管理費用、資産の保管費用、有価証券売買時の売買委託手数料、設立に係る費用、法律顧問費用、監査費用、信託財産に関する租税など。
その他		
	投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
	副投資顧問会社	キャピタル・インターナショナル・エス・エイ・アール・エル
	管理会社	キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル
	信託期間	無期限
	決算日	原則として、毎年12月末日

※上記の投資対象とする投資信託証券については、日々の基準価額が取得できるため、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、当ファンドにおいてデリバティブ取引等の投資制限に係る管理を行ないます。

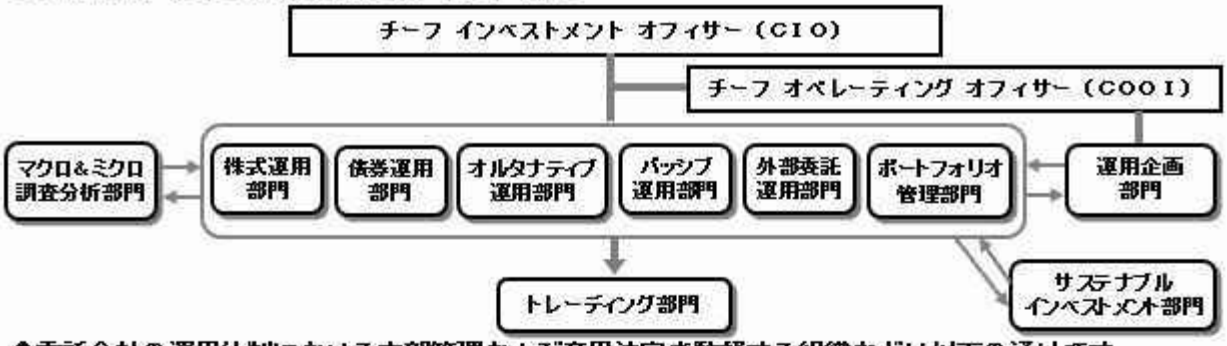
＜グローバル高配当株式マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界各国の株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・相対的に配当利回りが高く、かつ中長期的な増配および値上がりの期待できる世界各国（日本を含みます。）の株式に分散投資を行なうことで、安定的な配当収入の確保と信託財産の成長をめざします。 ・株式の銘柄選定にあたっては、各銘柄毎の配当利回り水準、配当余力に加えて、各国市況動向や、各銘柄毎のファンダメンタルズ、割安性、流動性などの分析も行ない投資を行ないます。 ・株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	投資顧問会社	ＪＰモルガン・アセット・マネジメント（ＵＫ）リミテッド（投資一任）
	信託期間	無期限（2006年10月31日設定）
	決算日	毎年９月15日（休業日の場合は翌営業日）

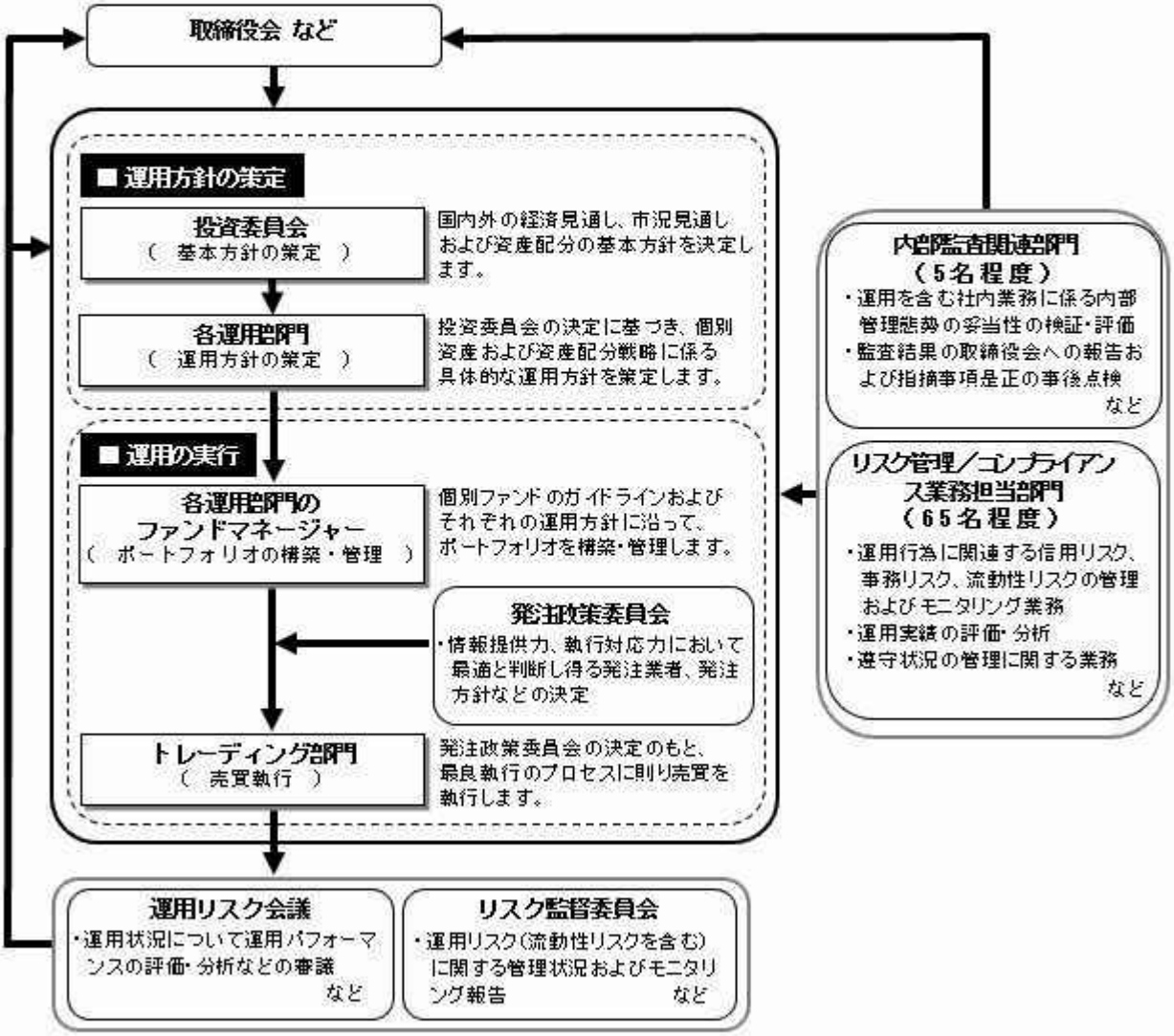
（３）【運用体制】

＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）における運用体制＞

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



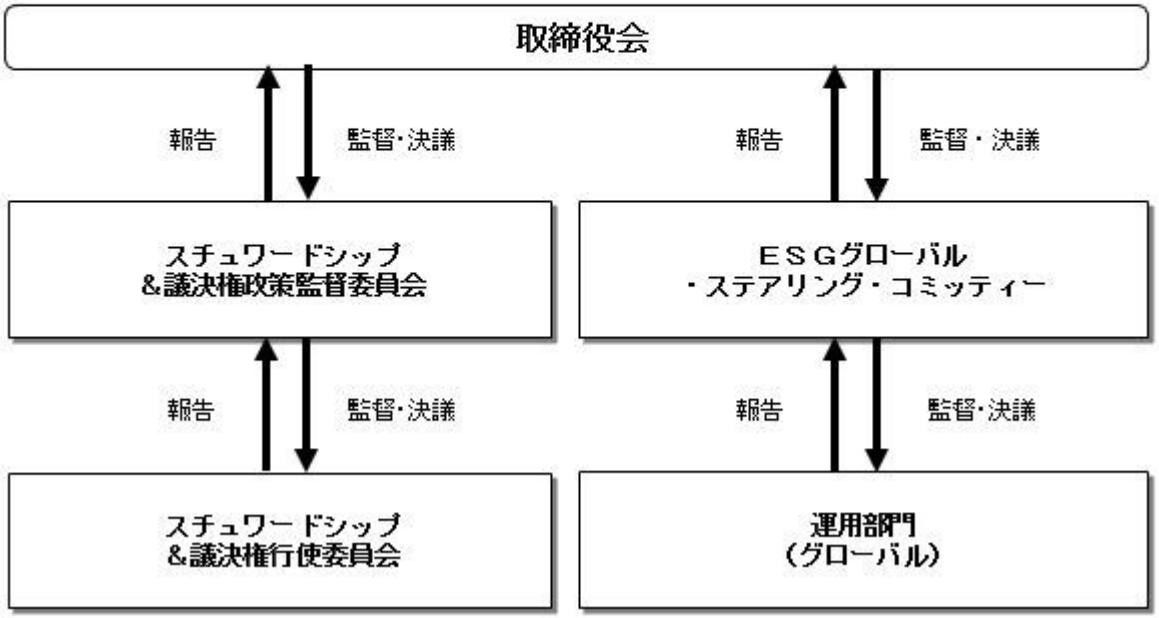
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行なっており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

ＥＳＧ（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。
（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は2024年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

② 収益分配金の支払い
＜分配金再投資コース＞
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
＜分配金受取りコース＞
毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
１）投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
２）有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
３）投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
５）信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券またはマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
６）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
ニ）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。
ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
７）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

①　価格変動リスク
・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

②　流動性リスク
・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

③　信用リスク
・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④　為替変動リスク
・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

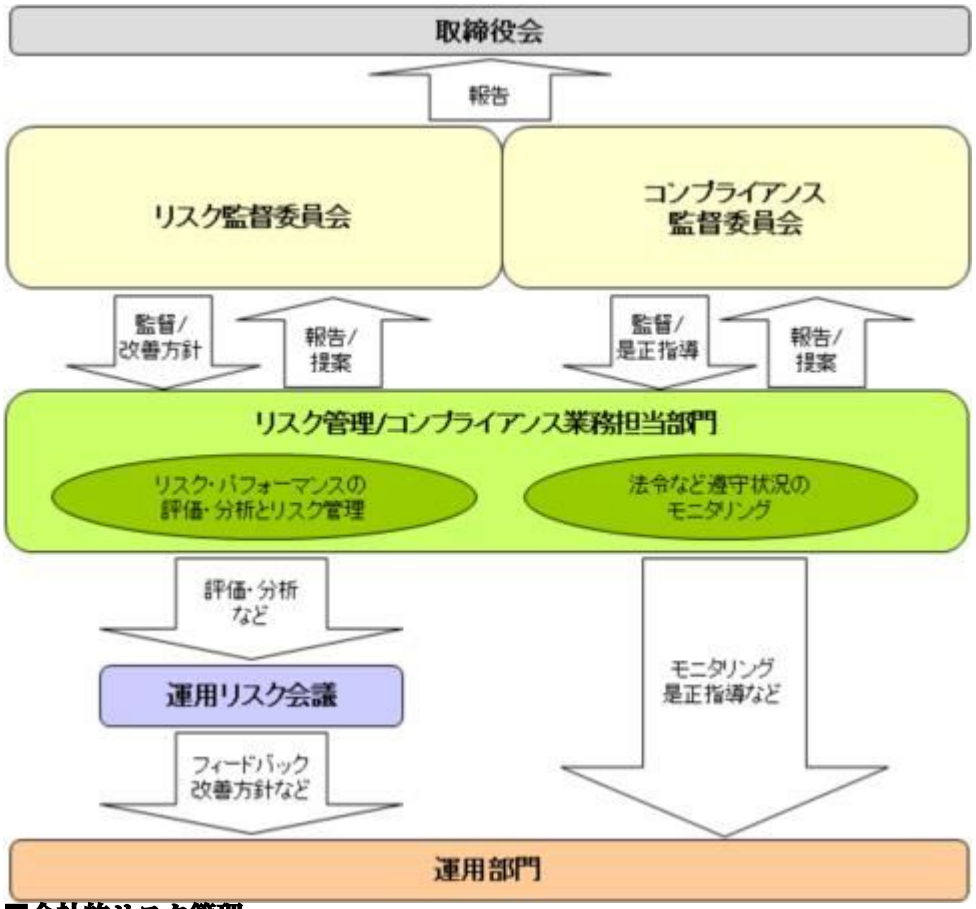
⑤　カントリー・リスク
・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延

する場合があります。
・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

※ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

＜その他の留意事項＞
・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
・投資対象とする投資信託証券に関する事項
◇諸事情により、投資対象とする投資信託証券にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。
◇ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社もしくは運用委託先またはこれらの関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社もしくは運用委託先またはこれらの関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（2）リスク管理体制
＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制＞



■全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理／コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

■法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は2024年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%)）

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.8%	10.7%	17.9%	8.4%	-0.8%	4.3%	5.9%
最大値	25.5%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	15.3%	21.5%
最小値	-7.7%	-11.4%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>
日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み
先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)
※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2019年4月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX（東証株価指数）配当込み
当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込み、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

NOMURA-BPI国債
当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜３％）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.4663%（税抜1.333%）の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合　計	委託会社	販売会社	受託会社
1.333%	0.793%	0.510%	0.030%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
※投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。
① 振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
② 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
③ 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
④ 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑤ 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含み

ます。）。
⑥　ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
⑦　格付の取得に要する費用。
⑧　ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
①　組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とする投資信託証券に係る費用＞
「ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」
「ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」
「ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」
・有価証券売買時の売買委託手数料
・先物・オプション取引に要する費用　など

「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（ＬＵＸ）（クラスＣ）」
・事務管理費用
・資産の保管費用
・有価証券売買時の売買委託手数料
・設立に係る費用
・法律顧問費用
・監査費用
・信託財産に関する租税　など

「グローバル高配当株式マザーファンド」
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
・当ファンドは、NISAの対象ではありません。

①　個人受益者の場合
１）収益分配金に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。
２）解約金および償還金に対する課税
解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。
＊解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益
※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

②　法人受益者の場合
１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
２）益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。
※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

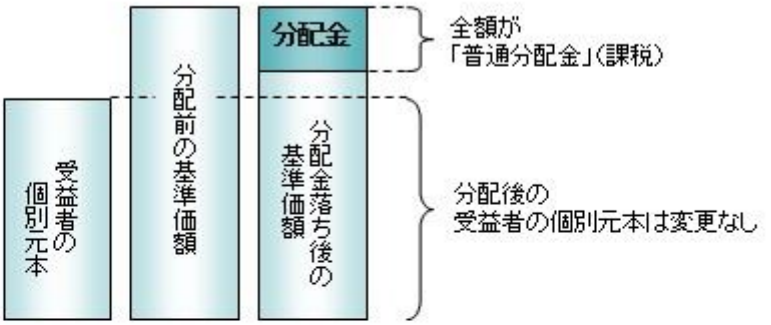
③　個別元本
１）各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれませ

ん。）が個別元本になります。
2）受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、１口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

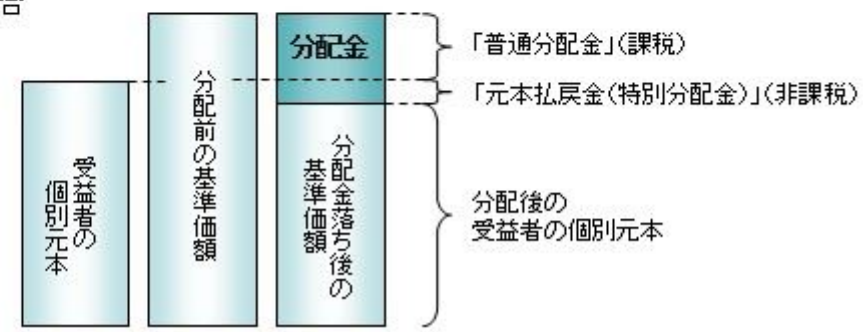
④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)
1）収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
2）受益者が収益分配金を受け取る際
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
ロ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は2024年6月14日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年9月16日～2024年3月15日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.53%	1.46%	0.07%

※対象期間の運用管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※その他費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みます。
※投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【日興スリートップ（隔月分配型）】

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。
・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。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）

投資信託受益証券	バミューダ	17,719,867,094	76.79
投資証券	ルクセンブルク	1,765,649,886	7.65
親投資信託受益証券	日本	3,279,731,397	14.21
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	309,849,426	1.34
合計（純資産総額）		23,075,097,803	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
バミューダ	投資信託受益証券	ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	1,627,462	4,718.11	7,678,557,656	4,818	7,841,111,916	33.98
バミューダ	投資信託受益証券	ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	1,568,623	3,122.06	4,897,345,344	3,206	5,029,005,338	21.79
バミューダ	投資信託受益証券	ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	2,168,940	2,196.01	4,763,018,274	2,236	4,849,749,840	21.02
日本	親投資信託受益証券	グローバル高配当株式マザーファンド	747,414,917	4.2677	3,189,742,641	4.3881	3,279,731,397	14.21
ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（ＬＵＸ）（クラスＣ）	190,223	9,030	1,717,713,690	9,282	1,765,649,886	7.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	76.79
投資証券	7.65
親投資信託受益証券	14.21
合　　計	98.66

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第16特定期間末　(2014年 9月16日)	49,689	50,175	0.7162	0.7232
第17特定期間末　(2015年 3月16日)	46,787	47,234	0.7330	0.7400
第18特定期間末　(2015年 9月15日)	40,950	41,365	0.6899	0.6969
第19特定期間末　(2016年 3月15日)	35,555	35,949	0.6315	0.6385
第20特定期間末　(2016年 9月15日)	31,061	31,438	0.5768	0.5838
第21特定期間末　(2017年 3月15日)	32,078	32,432	0.6338	0.6408
第22特定期間末　(2017年 9月15日)	30,740	31,074	0.6458	0.6528
第23特定期間末　(2018年 3月15日)	28,206	28,522	0.6253	0.6323

第24特定期間末	(2018年 9月18日)	26,554	26,859	0.6099	0.6169
第25特定期間末	(2019年 3月15日)	25,651	25,949	0.6027	0.6097
第26特定期間末	(2019年 9月17日)	23,977	24,265	0.5819	0.5889
第27特定期間末	(2020年 3月16日)	20,519	20,792	0.5248	0.5318
第28特定期間末	(2020年 9月15日)	21,671	21,941	0.5616	0.5686
第29特定期間末	(2021年 3月15日)	22,194	22,455	0.5953	0.6023
第30特定期間末	(2021年 9月15日)	21,504	21,757	0.5956	0.6026
第31特定期間末	(2022年 3月15日)	20,058	20,306	0.5651	0.5721
第32特定期間末	(2022年 9月15日)	21,079	21,322	0.6080	0.6150
第33特定期間末	(2023年 3月15日)	19,866	20,105	0.5825	0.5895
第34特定期間末	(2023年 9月15日)	21,776	22,015	0.6373	0.6443
第35特定期間末	(2024年 3月15日)	22,502	22,738	0.6676	0.6746
	2023年 3月末日	20,109	—	0.5871	—
	4月末日	20,501	—	0.5984	—
	5月末日	20,828	—	0.6083	—
	6月末日	21,811	—	0.6406	—
	7月末日	21,681	—	0.6295	—
	8月末日	22,114	—	0.6453	—
	9月末日	21,603	—	0.6312	—
	10月末日	21,223	—	0.6243	—
	11月末日	22,081	—	0.6484	—
	12月末日	21,941	—	0.6459	—
	2024年 1月末日	22,582	—	0.6619	—
	2月末日	22,966	—	0.6782	—
	3月末日	23,075	—	0.6826	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第16特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	0.0210
第17特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	0.0210
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	0.0210
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	0.0210
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	0.0210
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	0.0210
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	0.0210
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.0210
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.0210
第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	0.0210
第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.0210
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	0.0210
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	0.0210
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	0.0210

第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	0.0210
第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	0.0210
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	0.0210
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	0.0210
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	0.0210
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	0.0210

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第16特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	7.46
第17特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	5.28
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	△3.02
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	△5.42
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	△5.34
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	13.52
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	5.21
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.08
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.90
第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	2.26
第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.03
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	△6.20
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	11.01
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	9.74
第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	3.58
第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	△1.60
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	11.31
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	△0.74
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	13.01
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	8.05

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（4）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第16特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	700,006,550	6,126,877,740
第17特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	631,215,783	6,176,937,090
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	572,580,620	5,047,402,074
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	697,582,559	3,750,226,166
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	766,674,152	3,219,187,762
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	717,886,483	3,954,039,839
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	555,513,912	3,565,621,923
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	517,129,806	3,015,426,652
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	589,815,284	2,154,764,472

第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	749,727,050	1,729,004,466
第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	610,154,866	1,970,554,827
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	712,695,420	2,817,658,635
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	742,243,910	1,249,264,580
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	568,881,376	1,877,695,308
第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	600,603,484	1,777,249,821
第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	588,398,109	1,199,513,588
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	564,776,947	1,387,101,494
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	628,354,741	1,191,336,475
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	1,247,204,020	1,185,924,317
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	769,387,816	1,234,695,316

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。
・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	115,205,904	3.51
	アメリカ	1,927,440,080	58.77
	カナダ	20,136,449	0.61
	ドイツ	44,395,762	1.35
	フランス	313,633,757	9.56
	オランダ	114,328,621	3.49
	フィンランド	53,827,588	1.64
	アイルランド	18,653,439	0.57
	イギリス	117,270,128	3.58
	スイス	104,101,836	3.17
	スウェーデン	53,634,819	1.64
	デンマーク	23,467,221	0.72
	オーストラリア	46,475,743	1.42
	香港	17,277,389	0.53
	シンガポール	61,801,646	1.88
	台湾	118,446,150	3.61
	小計	3,150,096,532	96.05
投資証券	アメリカ	106,035,929	3.23
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	23,631,709	0.72
合計（純資産総額）		3,279,764,170	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	―	1,536,652	0.05
	売建	―	1,536,915	△0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,056	52,245.77	211,908,882	63,701.21	258,372,129	7.88
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	半導体・半導体製造装置	5,750	14,106.86	81,114,500	20,599.33	118,446,150	3.61
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	—	5,378	18,571.95	99,879,950	19,716.61	106,035,929	3.23
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,345	76,195.56	102,483,040	74,902.52	100,743,899	3.07
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,350	71,510.52	96,539,206	73,521.66	99,254,251	3.03
アメリカ	株式	CME GROUP INC	金融サービス	2,869	31,611.93	90,694,643	32,597.05	93,520,962	2.85
アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	9,527	10,012.82	95,392,156	9,676.61	92,189,093	2.81
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	642	118,987.26	76,389,827	136,093.18	87,371,827	2.66
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	9,429	8,807.51	83,046,103	9,263.26	87,343,314	2.66
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,007	23,262.63	69,950,735	27,571.76	82,908,285	2.53
フランス	株式	VINCI SA	資本財	4,116	17,491.88	71,996,619	19,386.38	79,794,350	2.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	4,488	17,907.26	80,367,786	17,599.89	78,988,344	2.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	12,384	4,428.74	54,845,547	5,741.46	71,102,330	2.17
アメリカ	株式	ANALOG DEVICES INC	半導体・半導体製造装置	2,245	29,960.47	67,261,263	29,947.38	67,231,877	2.05
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	1,462	42,355.43	61,923,643	42,690.04	62,412,852	1.90
シンガポール	株式	DBS GROUP HOLDINGS LTD	銀行	15,300	3,799.40	58,130,940	4,039.32	61,801,646	1.88
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,380	26,139.42	62,211,833	25,963.78	61,793,813	1.88
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,568	25,075.79	64,394,634	23,883.41	61,332,606	1.87
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	8,824	6,960.31	61,417,844	6,563.62	57,917,414	1.77
フランス	株式	MICHELIN (CGDE)	自動車・自動車部品	9,842	4,975.55	48,969,414	5,798.28	57,066,719	1.74
アメリカ	株式	DOW INC	素材	6,182	8,182.19	50,582,338	8,771.18	54,223,443	1.65
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,252	24,573.84	55,340,295	23,951.54	53,938,886	1.64
スウェーデン	株式	VOLVO AB-B SHS-B	資本財	13,066	3,181.76	41,572,993	4,104.91	53,634,819	1.64
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	364	100,071.01	36,425,850	145,642.72	53,013,953	1.62

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,061	24,504.04	50,502,833	24,566.27	50,631,088	1.54
イギリス	株式	RELX PLC	商業・専門サービス	7,635	5,310.17	40,543,219	6,547.37	49,989,191	1.52
ドイツ	株式	ALLIANZ SE-REG	保険	979	37,790.05	36,996,468	45,348.07	44,395,762	1.35
日本	株式	TOKIO MARINE HOLDINGS-ADR	保険	9,256	3,659.57	33,873,070	4,749.73	43,963,517	1.34
フランス	株式	LEGRAND SA	資本財	2,731	14,133.31	38,598,095	16,033.43	43,787,305	1.34
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,680	16,426.27	44,022,412	16,078.33	43,089,951	1.31

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	素材	1.19
		自動車・自動車部品	0.98
		保険	1.34
	国外	エネルギー	5.09
		素材	3.13
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	0.82
		自動車・自動車部品	1.74
		耐久消費財・アパレル	2.66
		消費者サービス	2.76
		メディア・娯楽	4.79
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.08
		食品・飲料・タバコ	3.98
		家庭用品・パーソナル用品	2.25
		ヘルスケア機器・サービス	3.07
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.34
		銀行	6.32
		金融サービス	6.04
		保険	3.64
		ソフトウェア・サービス	7.88
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.45
		電気通信サービス	1.32
		公益事業	5.50
		半導体・半導体製造装置	10.16
投資証券	—	—	3.23
合　　計			99.28

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)

為替予約取引	米ドル	買建	10,155.40	1,535,612	1,536,652	0.05
	英ポンド	売建	5,000.00	956,600	955,500	△0.03
	スイスフラン	売建	3,463.20	579,012	581,415	△0.02

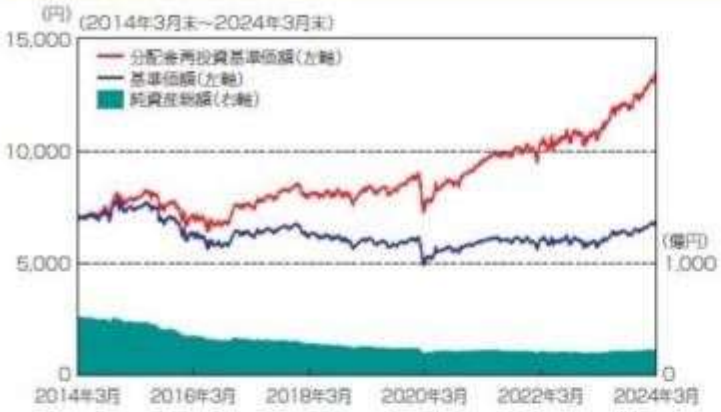
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2024年3月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 ……6,826円
純資産総額 ……230.75億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2014年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2023年7月	2023年9月	2023年11月	2024年1月	2024年3月	設定来累計
70円	70円	70円	70円	70円	8,360円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
高格付債券	21.8%
高利回り債券	34.0%
新興国債券	21.0%
世界株式	7.7%
世界高配当株式	14.2%
現金その他	1.3%

※対純資産総額比です。
各資産の内訳は以下の通りです。
・高格付債券:PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)
・高利回り債券:PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)
・新興国債券:PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)
・世界株式:キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)(クラスC)
・世界高配当株式:グローバル高配当株式マザーファンド

<通貨別構成比率>

通貨	比率
アメリカドル	42.1%
ユーロ	23.6%
イギリスポンド	3.8%
オーストラリアドル	0.5%
日本円	1.9%
エマージング通貨	26.1%
その他	1.9%

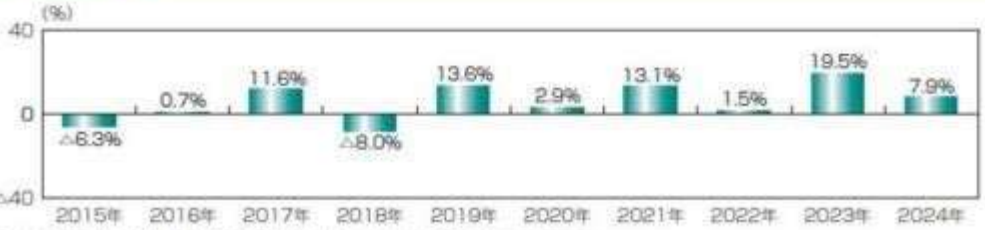
※上記の数値は各投資信託証券の通貨構成比率を基に計算した概算値です。

<予想利回り(年率)>

ファンド	6.10%
高格付債券	4.90%
高利回り債券	6.96%
新興国債券	10.01%
世界株式	1.82%
世界高配当株式	2.99%

※ファンドの予想利回りは、月末時点で組み入れている各投資信託証券の利回りを評価額のウェイトで加重平均したものです。「高格付債券」「高利回り債券」「新興国債券」については最終利回りです。「世界株式」「世界高配当株式」については予想配当利回りです。運用管理費用(信託報酬)等の費用および税金を控除したものではありません。
また、上記の数値は当ファンドの運用成果等について何ら約束をするものではありません。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2024年は、2024年3月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（1）申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
（2）コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の２通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
（3）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（4）取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
※2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とする予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（5）取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
●英国証券取引所の休業日
●ニューヨーク証券取引所の休業日
●ロンドンの銀行休業日
●ニューヨークの銀行休業日
（6）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
（7）申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
（8）申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
（9）受付の中止および取消
委託会社は、投資対象とする投資信託証券への投資ができない場合、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
(10) 償還乗換
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
(11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の１年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞
（1）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（2）取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
※2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とする予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（3）解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
●英国証券取引所の休業日
●ニューヨーク証券取引所の休業日
●ロンドンの銀行休業日
●ニューヨークの銀行休業日
（4）解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（5）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

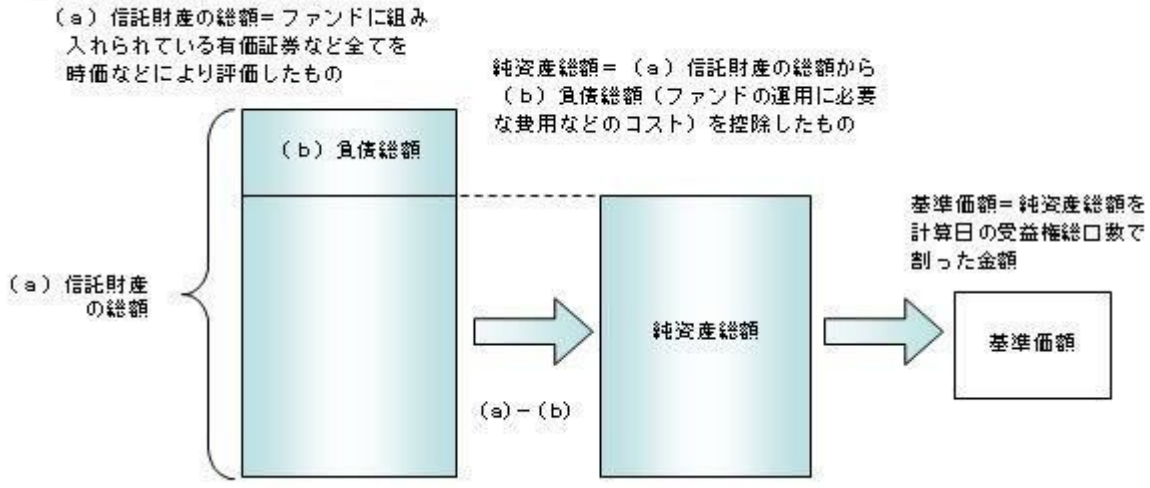
（６）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
（７）解約単位
１口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して６営業日目からお支払いします。
（９）受付の中止および取消
・委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出
・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額算出の流れ＞



② 有価証券などの評価基準
・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
＜主な資産の評価方法＞
◇投資信託証券（国内籍）
原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇投資信託証券（外国籍）
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。
③ 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2006年10月31日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

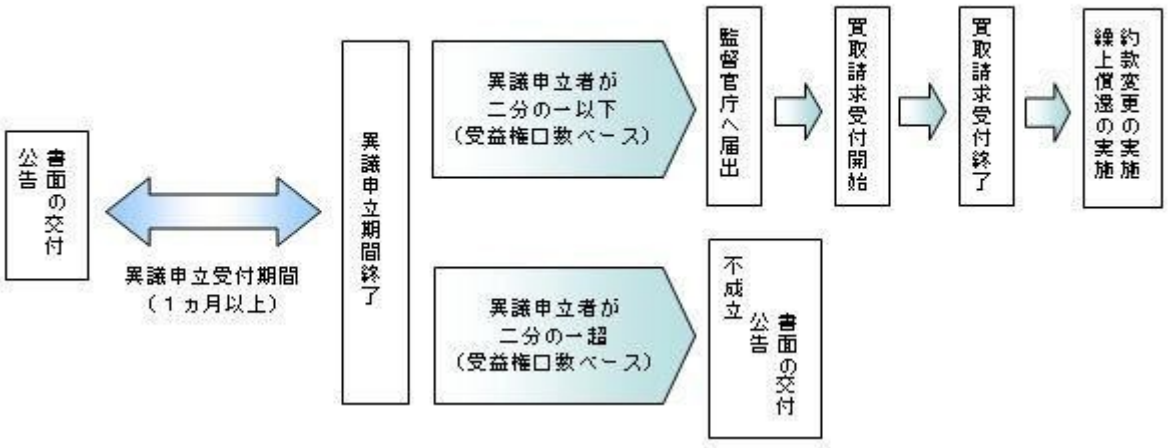
（４）【計算期間】

毎年１月16日から３月15日まで、３月16日から５月15日まで、５月16日から７月15日まで、７月16日から９月15日まで、９月16日から11月15日までおよび11月16日から翌年１月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）
１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
イ）受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ハ）やむを得ない事情が発生したとき
２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
３）この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
５）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
② 償還金について
・償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日まで）から受益者に支払います。
・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
③ 信託約款の変更
１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
２）この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
３）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
４）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。
④ 異議の申立て
１）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
２）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
３）なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告
公告は日本経済新聞に掲載します。
⑥　運用報告書の作成
・委託会社は、年２回（３月、９月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。
ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/
⑦　関係法人との契約について
・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より１年間とします。ただし、期間満了の３ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に１年間延長されるものとし、以後も同様とします。
・投資顧問会社との運用の指図に関する権限の委託契約または投資顧問契約は、ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。
（１）収益分配金・償還金受領権
・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。
（２）解約請求権
受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。
（３）帳簿閲覧権
受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

（３）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2023年 9月16日から2024年 3月15日までの特定期間の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【日興スリートップ（隔月分配型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2023年 9月15日現在	当期 2024年 3月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	744,552,441	740,529,791
投資信託受益証券	16,860,963,584	17,254,770,694
投資証券	1,586,509,309	1,717,713,690
親投資信託受益証券	2,999,555,856	3,189,742,641
未収入金	35,448,353	70,348,515
流動資産合計	22,227,029,543	22,973,105,331
資産合計	22,227,029,543	22,973,105,331
負債の部		
流動負債		
未払金	120,673,131	121,547,126
未払収益分配金	239,185,719	235,928,566
未払解約金	36,312,492	57,473,787
未払受託者報酬	1,165,116	1,227,057
未払委託者報酬	50,605,724	53,295,977
未払利息	558	26
その他未払費用	2,606,993	1,387,877
流動負債合計	450,549,733	470,860,416
負債合計	450,549,733	470,860,416
純資産の部		
元本等		
元本	34,169,388,429	33,704,080,929
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△12,392,908,619	△11,201,836,014
（分配準備積立金）	4,796,869,317	4,658,877,333
元本等合計	21,776,479,810	22,502,244,915
純資産合計	21,776,479,810	22,502,244,915
負債純資産合計	22,227,029,543	22,973,105,331

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2023年 3月16日 至　2023年 9月15日	当期 自　2023年 9月16日 至　2024年 3月15日
営業収益		
受取配当金	808,916,025	804,372,950
有価証券売買等損益	1,948,309,182	1,103,528,284
営業収益合計	2,757,225,207	1,907,901,234
営業費用		
支払利息	76,615	17,620
受託者報酬	3,512,926	3,633,348
委託者報酬	152,580,774	157,811,125
その他費用	1,880,958	1,708,684
営業費用合計	158,051,273	163,170,777
営業利益又は営業損失（△）	2,599,173,934	1,744,730,457
経常利益又は経常損失（△）	2,599,173,934	1,744,730,457
当期純利益又は当期純損失（△）	2,599,173,934	1,744,730,457
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	21,327,837	8,693,323
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△14,241,118,316	△12,392,908,619
剰余金増加額又は欠損金減少額	472,037,346	437,289,496
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	472,037,346	437,289,496
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	482,512,774	270,384,700
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	482,512,774	270,384,700
分配金	719,160,972	711,869,325
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△12,392,908,619	△11,201,836,014

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき当該投資証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		前期 2023年 9月15日現在	当期 2024年 3月15日現在
１．	期首元本額	34,108,108,726円	34,169,388,429円
	期中追加設定元本額	1,247,204,020円	769,387,816円
	期中一部解約元本額	1,185,924,317円	1,234,695,316円
２．	受益権の総数	34,169,388,429口	33,704,080,929口
３．	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	12,392,908,619円	11,201,836,014円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日		当期 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日	
１.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	57,444,356円	１.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	59,445,505円
２.分配金の計算過程		２.分配金の計算過程	
自 2023年 3月16日 至 2023年 5月15日		自 2023年 9月16日 至 2023年11月15日	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	271,185,524円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	254,743,363円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	1,803,575,282円	C 信託約款に定める収益調整金	1,942,122,264円
D 信託約款に定める分配準備積立金	4,836,556,881円	D 信託約款に定める分配準備積立金	4,737,516,728円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,911,317,687円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,934,382,355円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,021円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,042円
G 分配金額	239,336,082円	G 分配金額	237,626,694円
H 分配金額(1万口当たり)	70円	H 分配金額(1万口当たり)	70円
自 2023年 5月16日 至 2023年 7月18日		自 2023年11月16日 至 2024年 1月15日	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	272,034,379円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	229,999,614円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	1,910,171,618円	C 信託約款に定める収益調整金	1,996,777,502円
D 信託約款に定める分配準備積立金	4,799,475,962円	D 信託約款に定める分配準備積立金	4,719,809,983円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,981,681,959円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,946,587,099円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,030円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,040円
G 分配金額	240,639,171円	G 分配金額	238,314,065円
H 分配金額(1万口当たり)	70円	H 分配金額(1万口当たり)	70円
自 2023年 7月19日 至 2023年 9月15日		自 2024年 1月16日 至 2024年 3月15日	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	262,117,086円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	260,375,562円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	1,926,491,082円	C 信託約款に定める収益調整金	2,006,839,062円
D 信託約款に定める分配準備積立金	4,773,937,950円	D 信託約款に定める分配準備積立金	4,634,430,337円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,962,546,118円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	6,901,644,961円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,037円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,047円
G 分配金額	239,185,719円	G 分配金額	235,928,566円
H 分配金額(1万口当たり)	70円	H 分配金額(1万口当たり)	70円

（金融商品に関する注記）

Ｉ金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日	当期 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	前期 2023年 9月15日現在	当期 2024年 3月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

前期（2023年 9月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	288,149,367
投資証券	57,811,271
親投資信託受益証券	152,216,734
合計	498,177,372

当期（2024年 3月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	211,393,632
投資証券	132,014,762
親投資信託受益証券	254,569,520
合計	597,977,914

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

前期 2023年 9月15日現在		当期 2024年 3月15日現在	
1口当たり純資産額	0.6373円	1口当たり純資産額	0.6676円
(1万口当たり純資産額)	(6,373円)	(1万口当たり純資産額)	(6,676円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	1,560,597	4,872,183,834	
	ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	1,621,064	7,648,179,952	
	ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）	2,155,923	4,734,406,908	
投資信託受益証券 合計		5,337,584	17,254,770,694	
投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（ＬＵＸ）（クラスＣ）	190,223	1,717,713,690	
投資証券 合計		190,223	1,717,713,690	
親投資信託受益証券	グローバル高配当株式マザーファンド	747,414,917	3,189,742,641	
親投資信託受益証券 合計		747,414,917	3,189,742,641	
合計		752,942,724	22,162,227,025	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」「ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」「ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

また、当ファンドは、「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（ＬＵＸ）（クラスＣ）」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は同投資証券です。なお、同投資証券の財務書類は2023年12月15日提出の有価証券報告書に記載されております。

また、当ファンドは、「グローバル高配当株式マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）
ＰＩＭＣＯグローバル債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）
ＰＩＭＣＯグローバルハイイールドストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）
ＰＩＭＣＯエマージング債券ストラテジーファンドＪ（ＪＰＹ）

同投資信託はバミューダ籍のオープン・エンド契約型円建外国投資信託であります。同投資信託は、計算期間（2022年7月1日から2023年6月30日まで）が終了し、現地において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成され、独立の監査人による監査を受けております。

同投資信託の「資産・負債計算書」、「損益計算書」およびそれに続く「純資産変動計算書」などは、委託会社が同投資信託の投資顧問会社から入手した2023年6月30日現在の財務書類の原文の一部を翻訳したものであります。

資産・負債計算書
2023年6月30日

（金額単位：受益証券1口当たり金額を除き、千米ドル）	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド
資産：	
投資（公正価値）	
投資有価証券*	$ 32,164
金融デリバティブ商品	

上場または中央清算		124
店頭		935
現金		3
取引相手先預け金		567
外貨（公正価値）		605
投資売却に係る未収金		212
遅延引渡投資売却に係る未収金		4
TBA投資売却に係る未収金		0
未収利息および／または未収配当		518
		35,132
負債：		
借入および他の金融取引		
空売りに係る未払金	$	0
金融デリバティブ商品		
上場または中央清算		172
店頭		948
投資購入に係る未払金		44
遅延引渡投資購入に係る未払金		4
TBA投資購入に係る未払金		0
未払利息		3
取引相手先預かり金		60
ファンド受益証券買戻しに係る未払金		0
保管会社からの当座借越		0
未払投資顧問報酬		0
未払管理報酬		0
未払税金		130
		1,361
純資産	$	33,771
投資有価証券に係る費用	$	35,235
外国通貨保有に係る費用	$	606
売建に係る受取金	$	0
金融デリバティブ商品取得原価またはプレミアム（純額）	$	40
* 内レポ契約	$	4,900
純資産：		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 機関		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 小売		N/A
（日本円、為替ヘッジなし） — 小売		N/A
J（日本円）	$	33,771
J（日本円、為替ヘッジあり）		N/A
米ドル		N/A
発行済受益証券数：		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 機関		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 小売		N/A
（日本円、為替ヘッジなし） — 小売		N/A
J（日本円）		2,195
J（日本円、為替ヘッジあり）		N/A
米ドル		N/A
発行済受益証券1口当たりの純資産額および買戻価格：		
（機能通貨表示）		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 機関		
（機能通貨表示）		N/A
（報告通貨表示）		N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 小売		
（機能通貨表示）		N/A
（報告通貨表示）		N/A
（日本円、為替ヘッジなし） — 小売		
（機能通貨表示）		N/A
（報告通貨表示）		N/A
J（日本円）		
（機能通貨表示）	$	15.39
（報告通貨表示）	¥	2,224
J（日本円、為替ヘッジあり）		
（機能通貨表示）		N/A
（報告通貨表示）		N/A
米ドル		
（機能通貨表示）		N/A

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

資産・負債計算書
2023年6月30日

（金額単位：受益証券1口当たり金額を除き、千米ドル）	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド	PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド
資産：		
投資（公正価値）		
投資有価証券*	$ 174,375	$ 48,756
親投資信託受益証券	0	0
金融デリバティブ商品		
上場または中央清算	244	27
店頭	2,213	122
現金	2	0
取引相手先預け金	3,074	475
外貨（公正価値）	269	6
投資売却に係る未収金	52	1
親投資信託受益証券売却に係る未収金	0	0
TBA投資売却に係る未収金	53,312	0
ファンド受益証券売却に係る未収金	2	0
未収利息および／または未収配当	728	715
	234,271	50,102
負債：		
借入および他の金融取引		
空売りに係る未払金	$ 3,627	$ 0
金融デリバティブ商品		
上場または中央清算	391	10
店頭	1,742	32
投資購入に係る未払金	3,675	152
TBA投資購入に係る未払金	88,599	0
未払利息	2	0
取引相手先預かり金	920	0
ファンド受益証券買戻しに係る未払金	31	0
未払運用報酬	4	0
未払投資顧問報酬	28	0
	99,019	194
純資産	$ 135,252	$ 49,908
投資有価証券に係る費用	$ 185,363	$ 52,358
親投資信託受益証券（原価）	$ 0	$ 0
外国通貨保有に係る費用	$ 271	$ 6
売建に係る受取金	$ 3,643	$ 0
金融デリバティブ商品取得原価またはプレミアム（純額）	$ (18)	$ (2)
* 内レポ契約	$ 11,300	$ 0
純資産：		
C（日本円、為替ヘッジあり）	$ 10,047	N/A
J（豪ドル）	N/A	N/A
J（ブラジル・レアル）	N/A	N/A
J（日本円）	42,864	$ 49,908
J（メキシコ・ペソ）	N/A	N/A
J（ニュージーランド・ドル）	N/A	N/A
J（南アフリカ・ランド）	N/A	N/A
S（日本円）	82,341	N/A
発行済受益証券数：		
C（日本円、為替ヘッジあり）	165	N/A
J（豪ドル）	N/A	N/A
J（ブラジル・レアル）	N/A	N/A
J（日本円）	1,971	1,642
J（メキシコ・ペソ）	N/A	N/A
J（ニュージーランド・ドル）	N/A	N/A
J（南アフリカ・ランド）	N/A	N/A
S（日本円）	1,079	N/A
発行済受益証券1口当たりの純資産額および買戻価格：		
C（日本円、為替ヘッジあり）		
（機能通貨表示）	$ 60.75	N/A
（報告通貨表示）	¥ 8,780	N/A
J（豪ドル）		
（機能通貨表示）	N/A	N/A
（報告通貨表示）	N/A	N/A
J（ブラジル・レアル）		
（機能通貨表示）	N/A	N/A
（報告通貨表示）	N/A	N/A
J（日本円）		
（機能通貨表示）	$ 21.75	$ 30.39
（報告通貨表示）	¥ 3,143	¥ 4,393
J（メキシコ・ペソ）		
（機能通貨表示）	N/A	N/A
（報告通貨表示）	N/A	N/A

J（ニュージーランド・ドル）		
（機能通貨表示）	N/A	N/A
（報告通貨表示）	N/A	N/A
J（南アフリカ・ランド）		
（機能通貨表示）	N/A	N/A
（報告通貨表示）	N/A	N/A
S（日本円）		
（機能通貨表示）	$ 76.28	N/A
（報告通貨表示）	¥ 11,025	N/A

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

損益計算書
2023年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル）	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド
投資収益：	
受取利息（外国源泉税控除後）*	$ 1,823
雑収益	110
収益合計	1,933
費用：	
未払投資顧問報酬 — （日本円、為替ヘッジあり） — 機関	N/A
未払投資顧問報酬 — （日本円、為替ヘッジあり） — 小売	N/A
未払投資顧問報酬 — （日本円、為替ヘッジなし） — 小売	N/A
管理報酬 — （日本円、為替ヘッジあり） — 機関	N/A
支払利息	18
費用合計	18
投資純利益（費用）	1,915
実現純利益（損失）：	
投資有価証券（外国源泉税控除後）*	(2,739)
上場または中央清算金融デリバティブ商品	151
店頭金融デリバティブ商品	1,514
外国通貨	(78)
実現純利益（損失）	(1,152)
未実現評価損益の純変動額	
投資有価証券（外国源泉税控除後）*	4,559
上場または中央清算金融デリバティブ商品	22
店頭金融デリバティブ商品	(678)
外貨建資産および負債	5
未実現評価損益の純変動額	3,908
純利益（損失）	2,756
運用による純資産の純増加（減少）額	$ 4,671
* 外国源泉税	$ 0

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

(1) 2022年12月15日（設定日）から2023年6月30日までの期間。

(2) 2023年2月9日（設定日）から2023年6月30日までの期間。

損益計算書
2023年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル）	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド	PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド
投資収益：		
受取利息	$ 3,406	$ 2,916
雑収益	116	49
収益合計	3,522	2,965
費用：		
未払投資顧問報酬 — S（日本円）	362	N/A
運用報酬 — C（日本円、為替ヘッジあり）	57	N/A
支払利息	35	6
費用合計	454	6
投資純利益（費用）	3,068	2,959

実現純利益（損失）：		
投資有価証券	(13,274)	(2,603)
親投資信託受益証券	0	0
上場または中央清算金融デリバティブ商品	(2,794)	179
店頭金融デリバティブ商品	2,723	(102)
外国通貨	(306)	36
実現純利益（損失）	(13,651)	(2,490)
未実現評価損益の純変動額		
投資有価証券	5,077	4,936
親投資信託受益証券	0	0
上場または中央清算金融デリバティブ商品	1,142	(204)
店頭金融デリバティブ商品	(309)	351
外貨建資産および負債	133	13
未実現評価損益の純変動額	6,043	5,096
純利益（損失）	(7,608)	2,606
運用による純資産の純増加（減少）額	$ (4,540)	$ 5,565

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

純資産変動計算書
2023年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル） **純資産の増加（減少）の内訳：**	**PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド**
運用：	
投資純利益（費用）	$ 1,915
実現純利益（損失）	(1,152)
未実現評価損益の純変動額	3,908
運用による純増加（減少）額	4,671
受益者への分配金：	
分配	N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 機関	N/A
（日本円、為替ヘッジあり） — 小売	N/A
（日本円、為替ヘッジなし） — 小売	N/A
J（日本円）	(4,698)
J（日本円、為替ヘッジあり）	N/A
米ドル	N/A
分配金合計	(4,698)
ファンド受益証券取引：	
ファンド受益証券取引による純増加（減少）額*	2,278
純資産の増加（減少）額合計	2,251
純資産：	
期首残高	31,520
期末残高	$ 33,771

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

* 財務諸表の注記を参照のこと。

(1) 2022年12月15日（設定日）から2023年6月30日までの期間。

(2) 2023年2月9日（設定日）から2023年6月30日までの期間。

純資産変動計算書
2023年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル） **純資産の増加（減少）の内訳：**	**PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド**	**PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド**
運用：		

投資純利益（費用）	$ 3,068	$ 2,959
実現純利益（損失）	(13,651)	(2,490)
未実現評価損益の純変動額	6,043	5,096
運用による純増加（減少）額	(4,540)	5,565
受益者への分配金：		
分配	N/A	N/A
J（豪ドル）	N/A	N/A
J（ブラジル・レアル）	N/A	N/A
J（日本円）	(3,717)	(3,541)
J（メキシコ・ペソ）	N/A	N/A
J（ニュージーランド・ドル）	N/A	N/A
J（南アフリカ・ランド）	N/A	N/A
分配金合計	(3,717)	(3,541)
ファンド受益証券取引：		
ファンド受益証券取引による純増加（減少）額*	(25,727)	2,418
純資産の増加（減少）額合計	(33,984)	4,442
純資産：		
期首残高	169,236	45,466
期末残高	$ 135,252	$ 49,908

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

* 財務諸表の注記を参照のこと。

投資明細表
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド
(金額の単位は千*、ただし株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)
2023年6月30日現在

		元本金額（単位：千）	評価額（単位：千）
投資有価証券95.3%			
アルゼンチン0.0%			
ソブリン債0.0%			
Autonomous City of Buenos Aires Argentina			
95.317% due 03/29/2024	ARS	445	$ 1
アルゼンチン合計（取得原価$6）			**1**
アゼルバイジャン0.9%			
社債等0.9%			
SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC			
7.230% due 03/17/2026	$	300	293
アゼルバイジャン合計（取得原価$299）			**293**
ブラジル5.3%			
社債等5.0%			
Banco BTG Pactual S.A.			
8.300% due 08/15/2024	BRL	4,000	805
Oi S.A.			
1.913% due 02/25/2035		1	12
Swiss Insured Brazil Power Finance Sarl			
9.850% due 07/16/2032		4,587	877
			1,694
仕組債0.3%			
Vale S.A.			
1.641% due 03/30/2172 (a)		1,550	101
ブラジル合計（取得原価$2,451）			**1,795**
英領バージン諸島0.1%			
社債等0.1%			
Flourish Century Holdings Ltd.			
14.298% due 02/04/2049 (b)(c)(f)	$	200	22
英領バージン諸島合計（取得原価$194）			**22**

ケイマン諸島1.6%			
資産担保証券1.1%			
Anchorage Capital CLO 6 Ltd.			
6.310% due 07/15/2030	$	241	240
MidOcean Credit CLO II			
6.329% due 01/29/2030		146	145
			385
社債等0.5%			
Interoceanica IV Finance Ltd.			
0.000% due 11/30/2025		14	13
Poinsettia Finance Ltd.			
6.625% due 06/17/2031		177	146
			159
ケイマン諸島合計 **（取得原価＄573）**			**544**
チリ1.0%			
ソブリン債1.0%			
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos			
5.000% due 10/01/2028	CLP	45,000	56
6.000% due 04/01/2033		170,000	228
6.000% due 01/01/2043		40,000	55
チリ合計 **（取得原価＄327）**			**339**
中国2.6%			
ソブリン債2.6%			
China Government International Bond			
2.600% due 09/01/2032	CNY	1,280	175
2.750% due 02/17/2032		160	22
3.020% due 05/27/2031		2,000	283
3.120% due 10/25/2052		180	25
3.280% due 12/03/2027		1,740	249
3.810% due 09/14/2050		700	109
中国合計 **（取得原価＄904）**			**863**
コロンビア0.7%			
社債等0.6%			
Empresas Publicas de Medellin ESP			
7.625% due 09/10/2024	COP	961,000	215
ソブリン債0.1%			
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter			
7.875% due 08/12/2024		94,000	21
コロンビア合計 **（取得原価＄543）**			**236**
チェコ共和国3.7%			
ソブリン債3.7%			
Czech Republic Government Bond			
0.950% due 05/15/2030	CZK	7,700	282
1.200% due 03/13/2031		3,600	132
2.000% due 10/13/2033		9,500	354
2.750% due 07/23/2029		7,300	305
4.200% due 12/04/2036		1,100	50
4.900% due 04/14/2034		300	15
5.000% due 09/30/2030		2,500	119
チェコ共和国合計 **（取得原価＄1,286）**			**1,257**
ドミニカ共和国2.9%			
ソブリン債2.9%			
Dominican Republic Central Bank Notes			
13.000% due 12/05/2025	DOP	16,300	318
13.000% due 01/30/2026		6,700	131
Dominican Republic International Bond			
13.625% due 02/03/2033		18,800	423
13.625% due 02/10/2034		5,300	121
ドミニカ共和国合計			**993**

（取得原価＄832）			
ハンガリー3.3%			
ソブリン債3.3%			
Hungary Government Bond			
4.500% due 03/23/2028	HUF	20,600	53
4.750% due 11/24/2032		143,100	355
6.750% due 10/22/2028		183,700	516
MFB Magyar Fejlesztesi Bank Zrt			
6.500% due 06/29/2028	$	200	198
ハンガリー合計			**1,122**
（取得原価＄1,005）			
アイルランド0.5%			
社債等0.1%			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
9.350% due 08/06/2049 (b)	RUB	62,400	21
モーゲージ証券0.4%			
European Loan Conduit No.36 DAC			
4.358% due 02/17/2030	EUR	96	102
アイルランド合計			**123**
（取得原価＄994）			
イスラエル3.4%			
ソブリン債3.4%			
Israel Government Bond			
0.150% due 07/31/2023	ILS	3,600	968
1.500% due 11/30/2023		700	188
イスラエル合計			**1,156**
（取得原価＄1,207）			
チャンネル諸島ジャージー島0.6%			
社債等0.6%			
Corsair International Ltd.			
7.772% due 01/28/2027	EUR	100	109
8.122% due 01/28/2029		100	108
チャンネル諸島ジャージー島合計			**217**
（取得原価＄224）			
ルクセンブルク0.0%			
社債等0.0%			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
5.250% due 05/23/2049 (b)(d)	$	200	12
ルクセンブルク合計			**12**
（取得原価＄199）			
マレーシア6.7%			
ソブリン債6.7%			
Malaysia Government International Bond			
2.632% due 04/15/2031	MYR	330	65
3.465% due 10/15/2030		310	65
3.582% due 07/15/2032		70	15
3.733% due 06/15/2028		160	34
3.800% due 08/17/2023		2,200	472
3.885% due 08/15/2029		300	65
3.990% due 10/15/2025		1,378	299
4.065% due 06/15/2050		170	35
4.130% due 07/09/2029		2,689	589
4.193% due 10/07/2032		82	18
4.369% due 10/31/2028		2,025	449
4.417% due 09/30/2041		230	51
4.696% due 10/15/2042		40	9
4.762% due 04/07/2037		326	75
4.893% due 06/08/2038		50	12
マレーシア合計			**2,253**
（取得原価＄2,293）			
メキシコ9.7%			
社債等0.1%			
America Movil SAB de C.V.			
8.460% due 12/18/2036	MXN	1,000	52

ソブリン債9.6%			
Mexico Government International Bond			
5.500% due 03/04/2027		12,200	632
5.750% due 03/05/2026		5,000	266
7.000% due 09/03/2026		14,500	790
7.500% due 06/03/2027		6,800	376
7.750% due 05/29/2031		9,300	514
7.750% due 11/13/2042		3,600	189
8.000% due 11/07/2047		1,300	69
8.000% due 07/31/2053		1,500	79
8.500% due 05/31/2029		4,400	254
8.500% due 11/18/2038		1,200	68
			3,237
メキシコ合計 **（取得原価＄3,062）**			**3,289**
オランダ0.2%			
ソブリン債0.2%			
Republic of Angola Via Avenir II BV			
10.163% due 12/07/2023	$	15	15
12.772% due 07/03/2023		49	49
オランダ合計 **（取得原価＄64）**			**64**
ナイジェリア0.3%			
社債等0.3%			
BOI Finance BV			
7.500% due 02/16/2027	EUR	100	94
ナイジェリア合計 **（取得原価＄114）**			**94**
ペルー5.4%			
社債等0.4%			
Banco de Credito del Peru S.A.			
4.650% due 09/17/2024	PEN	530	140
ソブリン債5.0%			
Fondo MIVIVIENDA S.A.			
7.000% due 02/14/2024		430	117
Peru Government International Bond			
5.400% due 08/12/2034		900	220
5.940% due 02/12/2029		1,800	488
6.150% due 08/12/2032		300	80
6.950% due 08/12/2031		300	84
7.300% due 08/12/2033		2,400	684
			1,673
ペルー合計 **（取得原価＄1,897）**			**1,813**
ポーランド5.0%			
ソブリン債5.0%			
Poland Government International Bond			
1.250% due 10/25/2030	PLN	300	55
1.750% due 04/25/2032		200	36
2.500% due 07/25/2027		100	22
2.750% due 04/25/2028		3,400	739
2.750% due 10/25/2029		1,500	316
3.750% due 05/25/2027		1,000	230
6.000% due 10/25/2033		400	100
7.500% due 07/25/2028		700	186
ポーランド合計 **（取得原価＄1,483）**			**1,684**
ルーマニア3.7%			
ソブリン債3.7%			
Romania Government International Bond			
3.650% due 07/28/2025	RON	500	105
3.650% due 09/24/2031		800	143
4.150% due 01/26/2028		700	139
4.150% due 10/24/2030		700	132
4.250% due 04/28/2036		1,400	240

4.750% due 10/11/2034		500	93
4.850% due 04/22/2026		1,100	232
4.850% due 07/25/2029		200	40
5.000% due 02/12/2029		300	61
6.625% due 09/27/2029	EUR	50	57
ルーマニア合計			**1,242**
（取得原価＄1,216）			
ロシア0.2%			
ソブリン債0.2%			
Russia Government International Bond			
7.700% due 03/23/2033	RUB	15,200	61
ロシア合計			**61**
（取得原価＄258）			
南アフリカ9.4%			
社債等2.0%			
Development Bank of Southern Africa Ltd.			
8.600% due 10/21/2024 (f)	ZAR	3,900	203
Eskom Holdings SOC Ltd.			
0.000% due 08/18/2027		2,800	75
0.000% due 12/31/2032		6,900	77
7.850% due 04/02/2026		6,000	303
			658
ソブリン債7.4%			
South Africa Government CPI-Linked Bond			
2.000% due 01/31/2025 (e)		3,662	188
South Africa Government International Bond			
6.250% due 03/31/2036		7,600	257
8.000% due 01/31/2030		4,300	201
8.500% due 01/31/2037		3,200	130
9.000% due 01/31/2040		4,700	191
10.500% due 12/21/2026		28,100	1,545
			2,512
南アフリカ合計			**3,170**
（取得原価＄4,032）			
韓国2.1%			
ソブリン債2.1%			
Export-Import Bank of Korea			
4.890% due 08/09/2023	INR	41,800	509
Korea National Oil Corp.			
4.750% due 04/03/2026	＄	200	196
韓国合計			**705**
（取得原価＄712）			
国際機関0.5%			
社債等0.3%			
Asian Infrastructure Investment Bank			
4.250% due 01/27/2027	PHP	5,300	92
Inter-American Development Bank			
5.100% due 11/17/2026	IDR	80,000	5
			97
ソブリン債0.2%			
Asian Development Bank			
4.700% due 03/12/2024	MXN	1,000	55
International Bank for Reconstruction & Development			
5.000% due 12/01/2026	IDR	260,000	17
International Finance Corp.			
8.000% due 10/09/2023		100,000	7
			79
国際機関合計			**176**
（取得原価＄168）			
英国0.4%			
モーゲージ証券0.4%			
Harbour			
5.272% due 01/28/2054	GBP	100	125
英国合計			**125**

（取得原価＄129）

米国4.9%			
資産担保証券0.3%			
OneMain Financial Issuance Trust			
4.130% due 05/14/2035	$	100	96
モーゲージ証券4.6%			
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
5.230% due 05/25/2037		4	2
Banc of America Funding Trust			
5.617% due 02/20/2047		35	31
Banc of America Mortgage Trust			
3.896% due 02/25/2036 (b)		2	2
5.268% due 07/25/2034		10	9
Bear Stearns Alternative-A Trust			
5.470% due 02/25/2034		25	22
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust			
6.200% due 08/25/2037		23	19
Chase Mortgage Finance Trust			
4.086% due 03/25/2037 (b)		13	12
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4.132% due 07/25/2046 (b)		9	8
4.321% due 03/25/2034		2	2
5.210% due 07/25/2045		27	19
5.220% due 01/25/2037		6	6
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3.611% due 09/25/2047 (b)		5	5
Credit Suisse Mortgage Capital			
3.519% due 11/30/2037		195	179
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5.270% due 07/25/2037		121	80
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
5.270% due 11/25/2036		5	2
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
5.347% due 10/19/2036 (b)		112	92
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
4.732% due 11/25/2035 (b)		19	12
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
4.900% due 08/25/2037 (b)		52	17
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates			
4.725% due 10/25/2033		3	3
GSAMP Trust			
5.220% due 12/25/2036		17	8
HarborView Mortgage Loan Trust			
4.688% due 08/19/2036 (b)		1	1
Home Equity Asset Trust			
6.500% due 02/25/2033		73	68
HSI Asset Loan Obligation Trust			
4.194% due 12/25/2036		7	2
Impac CMB Trust			
5.790% due 03/25/2035		80	73
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust			
3.916% due 12/25/2034		5	5
JPMorgan Mortgage Trust			
4.035% due 04/25/2036 (b)		25	22
Luminent Mortgage Trust			
5.510% due 12/25/2036 (b)		6	6
Mastr Asset-Backed Securities Trust			
5.200% due 01/25/2037		21	6
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5.650% due 11/25/2035		20	19
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust			
3.673% due 04/25/2037 (b)		19	17
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			
5.210% due 05/25/2037		11	9
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6.115% due 06/25/2036		3	3

Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
5.790% due 05/25/2042		118	110
New Century Home Equity Loan Trust			
5.510% due 05/25/2036		20	20
New Residential Mortgage Loan Trust			
2.750% due 11/25/2059		96	89
New York Mortgage Trust			
5.690% due 04/25/2035		79	75
Option One Mortgage Loan Trust			
5.290% due 03/25/2037		175	157
Residential Asset Securitization Trust			
5.550% due 01/25/2046 (b)		56	17
Residential Funding Mortgage Securities I Trust			
4.149% due 09/25/2035 (b)		13	8
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust (b)			
5.270% due 12/25/2036		55	13
5.310% due 11/25/2036		30	9
Sequoia Mortgage Trust			
3.271% due 01/20/2047 (b)		6	4
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5.578% due 07/25/2034		98	93
Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
5.646% due 07/19/2035		31	30
5.806% due 10/19/2034		84	79
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
6.000% due 10/25/2036 (b)		43	42
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust (b)			
3.168% due 01/25/2037		16	14
3.754% due 09/25/2036		3	3
3.768% due 12/25/2036		34	31
			1,555
米国政府機関債0.0%			
Fannie Mae			
4.943% due 06/01/2043		8	7
4.944% due 07/01/2044		1	1
5.524% due 12/25/2036		4	4
			12
米国合計（取得原価＄1,926）			**＄ 1,663**
ウルグアイ0.5%			
ソブリン債0.5%			
Uruguay Government International Bond (e)			
3.700% due 06/26/2037	UYU	2,765	77
3.875% due 07/02/2040		3,874	109
ウルグアイ合計（取得原価＄180）			**186**
ザンビア0.2%			
ソブリン債0.2%			
Zambia Government International Bond			
13.000% due 01/25/2031	ZMW	2,300	77
ザンビア合計（取得原価＄64）			**77**
短期金融商品19.5%			
レポ契約(g) 14.5%			
			4,900
定期預金1.8%			
Bank of Nova Scotia			
4.570% due 07/03/2023		14	14
BNP Paribas Bank			
2.850% due 07/03/2023	NOK	25	2
3.020% due 07/03/2023	AUD	1	1
3.050% due 07/03/2023	SGD	1	1
Brown Brothers Harriman & Co.			
0.650% due 07/03/2023	CHF	1	1
Citibank N.A.			

4.570% due 07/03/2023	$	100	100
DBS Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		78	78
HSBC Bank PLC			
2.620% due 07/03/2023	EUR	1	1
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.570% due 07/03/2023	$	77	77
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
4.570% due 07/03/2023		152	152
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		177	177
			604
アルゼンチン短期国債(c)0.0%			
(32.423%) due 10/18/2023	ARS	1,839	4
(17.346%) due 11/23/2023		1,839	4
			8
ハンガリー短期国債3.2%			
15.998% due 07/06/2023 (c)	HUF	369,000	1,077
短期金融商品合計（取得原価＄6,593）			**6,589**
投資有価証券合計95.3%（取得原価＄35,235）			**$ 32,164**
金融デリバティブ商品(h)(i)（0.2%）（取得原価あるいはプレミアム（純額）＄40）			**(61)**
その他の資産および負債（純額）4.9%			**1,668**
純資産100.0%			**$ 33,771**

投資明細表に対する注記：

*** 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。**
(a) 永久債（記載日は次回の契約上の償還日）である。
(b) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
(c) クーポンは最終利回りである。
(d) 偶発転換社債
(e) 当有価証券の元本金額は、インフレの状況に合わせて調整される。

(f) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価額の対純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	$ 262	$ 203	0.60%
Flourish Century Holdings Ltd.	14.298%	02/04/2049	08/25/2021	194	22	0.07%
制限証券合計				**$ 456**	**$ 225**	**0.67%**

借入およびその他の金融取引

(g) レポ契約:

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	元本金額	担保	受入担保（公正価値）	レポ契約（公正価値）	レポ契約に係る未収金 (1)
SAL	5.100%	06/30/2023	07/03/2023	$ 4,900	U.S. Treasury Notes 0.250% due 10/31/2025	$ (4,999)	$ 4,900	$ 4,902
レポ契約合計						**$ (4,999)**	**$ 4,900**	**$ 4,902**

借入およびその他の金融取引要約

以下は、2023年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	レポ契約に係る未収金	リバース・レポ契約に係る未払金	売建に係る未払金	空売りに係る未払金	借入およびその他の金融取引合計	差入（受入）担保	ネット・エクスポージャー (2)

Global/Master Repurchase Agreement SAL	$ 4,902	$ 0	$ 0	$ 0	$ 4,902	$ (4,999)	$ (97)	
借入およびその他の金融取引合計	**$ 4,902**	**$ 0**	**$ 0**	**$ 0**				

(1)　未収利息を含む。
(2)　ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引からのエクスポージャーは同一の法主体との同一のマスター契約に基づく取引間でのみ相殺することができる。マスター・ネッティングの取決めの詳細に関しては財務諸表に対する注記を参照のこと。

2023年6月30日に終了した会計期間中の平均借入額は＄112で、加重平均金利は7.321%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(h)　金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

					変動証拠金	
銘柄	**種類**	**限月**	**契約件数**	**未実現評価（損）益**	**資産**	**負債**
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	売建	09/2023	5	$ 10	$ 0	$ (1)
先物契約合計				**$ 10**	**$ 0**	**$ (1)**

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの売り(1)

								変動証拠金	
参照債務	**受取固定金利**	**満期日**	**インプライド・クレジット・スプレッド（2023年6月30日現在）(2)**	**想定元本(3)**	**市場価格**	**未実現評価（損）益**	**資産**	**負債**
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	0.743%	$ 200	$ 2	$ 3	$ 0	$ 0
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.276%	300	1	(3)	0	0
					$ 3	$ 0	$ 0	$ 0

金利スワップ

							変動証拠金	
変動金利支払／受取	**変動金利インデックス**	**固定金利**	**満期日**	**想定元本**	**市場価格**	**未実現評価（損）益**	**資産**	**負債**
受取	3-Month TELBOR ILS-	3.590%	05/18/2028	ILS 400	$ 1	$ 0	$ 1	$ 0
受取	3-Month THOR	2.250%	03/15/2028	THB 17,860	4	9	9	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	ZAR 6,900	1	31	8	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.515%	03/07/2024	5,700	3	33	8	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2024	1,400	0	11	4	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	03/20/2024	8,200	3	50	13	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.600%	06/19/2024	13,700	(7)	(86)	0	(22)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.565%	03/22/2026	900	1	1	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.500%	09/16/2026	760	(1)	9	3	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.324%	12/21/2026	9,590	49	33	0	(4)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	6,100	2	61	20	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.205%	04/22/2027	1,800	4	4	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.210%	04/22/2027	1,400	3	3	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.510%	04/25/2028	6,500	(2)	8	0	(1)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.500%	12/19/2028	13,000	(9)	(126)	0	(33)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.750%	03/20/2029	4,200	(1)	(43)	0	(12)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.720%	06/11/2029	6,400	19	52	10	0

支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.800%	05/09/2032		2,400	(5)	2	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	10.150%	05/18/2033		1,100	2	2	0	0
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.611%	06/06/2028	CZK	37,800	5	(6)	0	(7)
支払	6-Month HUF-BUBOR	2.325%	07/20/2024	HUF	33,000	(14)	(14)	0	0
支払	6-Month HUF-BUBOR	0.995%	06/19/2025		250,800	(122)	22	0	(25)
支払	6-Month HUF-BUBOR	4.790%	01/17/2027		56,900	(27)	(25)	0	0
支払	6-Month HUF-BUBOR	6.280%	03/18/2027		206,700	(56)	(48)	0	(1)
受取	6-Month HUF-BUBOR	8.700%	01/16/2028		104,600	1	2	0	0
受取	6-Month HUF-BUBOR	8.740%	04/28/2028		24,300	(2)	(2)	0	0
支払	6-Month HUF-BUBOR	8.670%	05/23/2029		36,800	5	6	0	0
支払	6-Month HUF-BUBOR	1.760%	01/21/2030		41,600	(40)	(2)	0	(6)
受取	6-Month HUF-BUBOR	9.240%	09/02/2032		74,300	(35)	(28)	0	(1)
受取	6-Month PLN-WIBOR	1.790%	01/09/2024	PLN	3,700	46	68	1	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	1.942%	03/20/2024		700	8	13	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	2.250%	06/19/2024		2,400	24	(5)	0	(1)
受取	6-Month PLN-WIBOR	6.830%	08/19/2024		3,200	(31)	(31)	0	(1)
受取	6-Month PLN-WIBOR	6.890%	08/22/2024		2,800	(28)	(28)	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	0.655%	05/21/2025		1,500	36	28	0	(1)
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.520%	03/20/2026		1,000	0	0	1	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.620%	03/21/2026		1,700	1	1	1	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.350%	03/09/2027		300	3	3	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.175%	03/24/2027		400	0	0	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.285%	03/25/2027		700	0	0	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.290%	03/25/2027		600	0	0	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.575%	04/08/2027		600	(2)	(2)	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.870%	04/22/2027		400	(2)	(2)	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	6.210%	04/26/2027		300	(3)	(3)	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	6.480%	05/25/2027		500	(6)	(6)	0	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	6.940%	06/09/2027		200	3	3	0	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	0.663%	06/25/2027		500	(19)	2	1	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	6.745%	07/05/2027		900	20	20	1	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.430%	03/16/2028		300	1	1	0	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	3.250%	06/20/2028		800	(15)	(40)	0	(1)
受取	6-Month PLN-WIBOR	1.490%	08/29/2029		200	9	9	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	1.110%	01/12/2031		500	33	26	0	(1)
受取	6-Month PLN-WIBOR	2.920%	12/13/2031		300	9	9	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.220%	03/20/2033		500	(1)	(1)	0	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.310%	03/21/2033		600	(3)	(3)	0	(1)
支払	7-Day China Fixing Repo Rate	2.500%	03/16/2027	CNY	670	0	1	0	0
支払	7-Day China Fixing Repo Rate	2.250%	12/21/2027		1,480	(1)	3	1	0
支払	7-Day China Fixing Repo Rate	2.500%	03/15/2028		2,280	2	1	1	0
受取	BRL-CDI-Compounded	5.160%	01/02/2024	BRL	2,800	71	54	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.350%	07/01/2024		4,200	(2)	(2)	0	(1)
受取	BRL-CDI-Compounded	12.490%	07/01/2024		4,500	(4)	(4)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.595%	07/01/2024		3,700	4	4	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	13.080%	07/01/2024		8,400	17	17	2	0
受取	BRL-CDI-Compounded	7.160%	01/02/2025		200	5	4	0	0

支払	BRL-CDI-Compounded	10.330%	01/02/2025		7,530	207	(57)	3	0
受取	BRL-CDI-Compounded	11.244%	01/02/2026		2,500	(10)	(10)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.420%	01/02/2026		2,900	13	13	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	6.140%	01/04/2027		4,110	(117)	(76)	2	0
受取	BRL-CDI-Compounded	7.800%	01/04/2027		1,800	14	26	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	8.450%	01/04/2027		1,300	(21)	(21)	1	0
受取	BRL-CDI-Compounded	8.640%	01/04/2027		800	(1)	10	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.600%	01/04/2027		1,300	20	(12)	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.040%	01/04/2027		1,400	0	0	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.565%	01/04/2027		3,600	8	8	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.405%	01/02/2029		200	1	1	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.533%	01/02/2029		1,300	(17)	(17)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.684%	01/02/2029		1,500	21	21	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.746%	01/02/2029		1,700	24	24	2	0
受取	BRL-CDI-Compounded	13.218%	01/02/2029		3,300	(56)	(56)	0	(5)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.500%	02/15/2025	COP	365,000	3	3	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.855%	02/22/2025		20,070	0	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.450%	03/31/2025		87,000	2	2	0	(6)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.800%	05/05/2025		329,000	9	7	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.470%	07/01/2025		164,000	0	0	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.720%	11/18/2025		2,292,900	22	22	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.620%	05/11/2026		212,850	(5)	(5)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.055%	08/26/2026		291,600	(1)	(1)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	01/11/2027		1,328,600	17	17	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.040%	01/25/2027		142,500	1	1	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.130%	01/31/2027		255,000	2	2	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.140%	02/01/2027		515,000	4	4	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.080%	02/02/2027		190,900	2	2	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.585%	02/14/2027		580,000	(2)	(2)	1	0
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.200%	03/11/2027		570,000	1	1	1	0

支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.240%	03/15/2027	306,800	1	1	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.560%	03/30/2027	66,900	0	0	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.686%	03/30/2027	398,000	2	2	0	(5)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.320%	03/31/2027	158,000	0	0	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.890%	04/08/2027	350,200	1	1	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.913%	04/08/2027	539,000	1	1	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.940%	04/08/2027	271,300	1	1	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.360%	06/02/2027	746,820	2	2	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.325%	07/12/2027	748,000	8	8	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.050%	11/03/2027	105,000	1	1	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.790%	01/20/2028	929,400	16	16	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.060%	03/08/2028	1,185,000	26	26	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.305%	04/28/2028	663,700	4	4	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.150%	05/02/2028	903,000	12	12	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.950%	05/09/2028	119,600	1	1	0	0
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.940%	05/24/2028	127,400	2	2	0	0
受取 支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.820%	06/05/2028	529,700	(6)	(6)	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.390%	06/13/2028	349,300	3	3	1	0
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.005%	08/20/2028	846,300	(31)	(14)	1	0
受取 支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.380%	01/21/2029	320,000	1	1	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.890%	05/12/2029	457,000	7	7	1	0
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.190%	06/13/2029	960,600	7	7	2	0

受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.400%	11/21/2029		42,800	(1)	(1)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.370%	03/17/2030		229,900	(5)	(5)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.423%	03/17/2030		680,500	(16)	(16)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.393%	03/21/2030		541,600	(13)	(13)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.130%	03/23/2030		574,200	(12)	(12)	0	(1)
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.940%	03/24/2030		835,000	(15)	(15)	0	(2)
支払 受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.040%	05/05/2030		256,200	5	5	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.290%	06/05/2030		163,470	7	3	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.155%	01/15/2031		77,000	3	1	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	10/07/2031		147,000	(2)	(2)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.660%	10/07/2031		72,000	(1)	(1)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.690%	10/07/2031		72,000	(1)	(1)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.440%	06/30/2032		31,500	1	1	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.230%	03/06/2033		88,000	(4)	(4)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.245%	03/06/2033		220,000	(10)	(10)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.930%	03/07/2033		698,680	(28)	(28)	0	(2)
	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.407%	03/21/2033		431,400	(14)	(14)	0	(1)
支払 受取	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.750%	03/15/2028	INR	31,144	7	6	0	(1)
	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	03/16/2032		26,150	4	(23)	1	0
受取	IBMEXID	10.815%	12/04/2023	MXN	13,700	2	2	0	0
受取	IBMEXID	8.900%	05/21/2027		1,360	(1)	(1)	0	0
支払	IBMEXID	8.300%	06/16/2028		400	0	0	0	0
受取	IBMEXID	9.090%	11/09/2028		1,200	(2)	7	0	(2)
受取	IBMEXID	6.600%	02/26/2030		1,750	8	8	0	0
受取	IBMEXID	6.540%	05/31/2040		5,100	45	21	4	0
支払	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	2.665%	03/15/2028	KRW	201,300	(5)	(1)	2	0
支払 受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg Secured Overnight Financing Rate	3.250%	03/15/2033		1,049,708	(11)	(9)	0	0
		3.250%	06/21/2028	$	600	18	20	0	0

受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.070%	02/28/2028	CLP	279,200	(5)	(5)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.990%	07/06/2028		77,000	9	9	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.000%	07/06/2028		40,000	4	4	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.725%	07/19/2028		30,800	4	4	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.731%	07/20/2028		202,000	25	25	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.920%	08/06/2028		183,100	20	20	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.015%	09/13/2028		272,400	(10)	(10)	0	0
受取[4]	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	10/01/2028		40,000	(2)	(2)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.175%	10/01/2028		279,700	0	0	0	0
受取[4]	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.180%	10/01/2028		30,000	1	1	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.220%	10/01/2028		119,000	0	0	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.570%	10/01/2028		35,000	0	0	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.000%	10/01/2028		65,100	2	2	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.250%	10/01/2028		9,300	0	0	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.160%	10/01/2028		41,400	4	4	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.195%	10/01/2028		23,000	2	2	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.020%	03/02/2029		5,700	0	0	0	0
	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.370%	06/29/2029		91,000	7	7	0	(7)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.215%	01/14/2030		250,500	44	30	0	(1)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.120%	02/05/2030		40,000	(7)	(4)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.935%	05/27/2030		172,900	42	6	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.080%	06/01/2030		75,000	(17)	(3)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.110%	06/01/2030		25,000	(6)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.110%	09/01/2030		4,700	0	0	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.100%	11/15/2031		10,500	0	0	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.120%	11/15/2031		10,500	0	0	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.890%	03/17/2032		21,410	(1)	(1)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.100%	04/01/2032		19,000	(1)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.115%	04/01/2032		19,000	(1)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.550%	06/15/2032		40,100	5	5	0	0
	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.590%	06/16/2032		118,000	16	16	0	0

支払	Sinacofi Interbank Average	Chile Rate	6.140%	06/28/2032		14,500	1	1	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average	Chile Rate	5.030%	03/20/2033		163,300	4	4	0	(1)
支払	Singapore Overnight Average	Index	2.750%	03/15/2028	SGD	100	(2)	(1)	0	0
							$ 254	$ 111	$ 124	$ (171)
スワップ契約合計							**$ 257**	**$ 111**	**$ 124**	**$ (171)**

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約
以下は、2023年6月30日現在の上場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

2023年6月30日現在、上場および中央清算金融デリバティブ商品について＄557の現金が担保として差し入れられている。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	市場価格	変動証拠金資産			市場価格	変動証拠金負債		
	買建オプション	先物	スワップ契約	合計	売建オプション	先物	スワップ契約	合計
上場または中央清算合計	**$ 0**	**$ 0**	**$ 124**	**$ 124**	**$ 0**	**$ (1)**	**$ (171)**	**$ (172)**

(1)　ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
(2)　インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建／売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(3)　当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
(4)　この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(i)　金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

						未実現評価（損）益	
取引相手	**決済月**		**引渡通貨**		**受取通貨**	**資産**	**負債**
BOA	07/2023	ILS	294	$	85	$ 6	$ 0
BOA	07/2023	KES	6,940		49	0	0
BOA	07/2023	PEN	470		129	0	0
BOA	07/2023	$	65	EUR	60	1	0
BOA	07/2023		125	MXN	2,301	9	0
BOA	07/2023		6	PLN	23	0	0
BOA	08/2023	INR	42,013	$	511	0	(1)
BOA	08/2023	MXN	2,225		120	0	(8)
BOA	08/2023	NZD	109		69	2	0
BOA	08/2023	$	37	CNH	259	0	(1)
BOA	08/2023		423	CNY	2,902	0	(21)
BOA	08/2023		12	EGP	407	1	0
BOA	08/2023		29	ILS	98	0	(2)
BOA	08/2023	ZAR	2,812	$	150	2	0
BOA	09/2023	CLP	416,280		501	0	(14)
BOA	09/2023	NGN	4,057		7	2	0
BOA	09/2023	$	489	CLP	399,322	5	0
BOA	09/2023		34		27,310	0	0
BOA	09/2023		354	KRW	448,206	0	(12)
BOA	09/2023		168	MYR	769	0	(2)
BOA	09/2023		1	NGN	776	0	0
BOA	09/2023		354	TWD	10,735	0	(8)
BOA	10/2023		6	KES	943	0	0
BOA	10/2023	ZAR	1,429	$	77	2	0
BOA	11/2023	EUR	230	CZK	5,626	4	0
BPS	07/2023	BRL	1,102	$	226	0	(2)
BPS	07/2023	CZK	267		12	0	0
BPS	07/2023	PHP	12,914		230	0	(4)

BPS	07/2023	PLN	519		124	0	(3)
BPS	07/2023	$	225	BRL	1,102	3	0
BPS	07/2023		75	COP	338,936	6	0
BPS	07/2023		570	CZK	12,271	0	(7)
BPS	07/2023		277	EUR	253	0	(1)
BPS	07/2023		41	GBP	32	0	0
BPS	07/2023		44	JPY	6,132	0	(2)
BPS	07/2023		149	MYR	683	0	(2)
BPS	07/2023		37	PHP	2,087	1	0
BPS	07/2023		40	SGD	54	0	(1)
BPS	08/2023	CNH	310	$	45	2	0
BPS	08/2023	CNY	263		38	2	0
BPS	08/2023	MYR	2,232		481	1	0
BPS	08/2023	$	433	CLP	357,020	11	0
BPS	08/2023		547	CNY	3,743	0	(29)
BPS	08/2023		65	COP	292,035	4	0
BPS	08/2023		28	JPY	4,017	0	0
BPS	08/2023		176	TWD	5,373	0	(3)
BPS	08/2023		10	ZAR	181	0	0
BPS	09/2023	CLP	29,436	$	36	0	0
BPS	09/2023	PHP	9,410		168	0	(2)
BPS	09/2023	$	44	IDR	662,521	0	0
BPS	09/2023		229	PHP	12,914	4	0
BPS	10/2023	ZAR	428	$	23	1	0
BPS	11/2023	ILS	498		145	9	0
BPS	12/2023	NGN	810		1	0	0
BPS	12/2023	$	128	MXN	2,283	1	0
BPS	01/2024	EGP	749	$	20	0	0
BRC	07/2023	BRL	170		35	0	0
BRC	07/2023	CZK	1,526		70	0	0
BRC	07/2023	PLN	138		33	0	(1)
BRC	07/2023	RON	1,089		237	0	(3)
BRC	07/2023	$	35	BRL	170	0	0
BRC	07/2023		57	CZK	1,222	0	(1)
BRC	07/2023		45	MYR	206	0	(1)
BRC	07/2023		76	PLN	310	1	0
BRC	08/2023	COP	3,367,205	$	790	0	(5)
BRC	08/2023	$	12	ZAR	219	0	0
BRC	08/2023	ZAR	9,039	$	470	0	(6)
BRC	09/2023	CLP	71,985		88	0	(1)
BRC	09/2023	MXN	11,799		676	0	(2)
BRC	09/2023	$	81	ILS	290	0	(3)
BRC	09/2023		161	PEN	591	1	0
BRC	10/2023	MXN	5,570	$	297	0	(21)
BSS	08/2023	PEN	55		14	0	(1)
CBK	07/2023	BRL	628		130	0	0
CBK	07/2023	CLP	103,036		127	0	(1)
CBK	07/2023	EUR	168		180	0	(3)
CBK	07/2023	ILS	979		284	20	0
CBK	07/2023	MXN	756		44	0	0
CBK	07/2023	PEN	515		142	0	0
CBK	07/2023	PLN	1,187		284	0	(8)
CBK	07/2023	$	130	BRL	628	0	0
CBK	07/2023		112	COP	511,061	10	0
CBK	07/2023		403	CZK	8,675	0	(5)
CBK	07/2023		186	PHP	10,162	0	(3)
CBK	07/2023		83	PLN	343	2	0
CBK	07/2023		180	RON	812	0	(1)
CBK	07/2023		60	UYU	2,271	0	0
CBK	07/2023	UYU	1,884	$	49	0	(1)
CBK	07/2023		1,006		27	0	0
CBK	07/2023		2,271		57	0	(3)
CBK	08/2023	BRL	840		167	0	(7)
CBK	08/2023	CAD	31		23	0	0
CBK	08/2023	CLP	357,020		431	0	(12)
CBK	08/2023	EGP	1,009		29	0	(2)
CBK	08/2023	ILS	98		30	4	0
CBK	08/2023	$	17	CNH	119	0	(1)
CBK	08/2023		508	INR	42,013	4	0
CBK	08/2023		12	NOK	125	0	0
CBK	08/2023		183	TWD	5,594	0	(4)
CBK	09/2023	INR	42,013	$	507	0	(4)
CBK	09/2023	KRW	4,394		3	0	0
CBK	09/2023	MXN	3,152		169	0	(12)
CBK	09/2023	PEN	95		26	0	0
CBK	09/2023	PHP	9,036		160	0	(3)
CBK	09/2023	$	917	IDR	13,686,671	0	(8)
CBK	09/2023		341	INR	28,288	2	0
CBK	09/2023	ZMW	1,323	$	75	2	0
CBK	10/2023	CLP	1,522		2	0	0
CBK	10/2023	$	7	NGN	4,478	0	(2)
CBK	11/2023		251	EGP	8,094	0	(19)
CBK	02/2024	EGP	518	$	14	0	0
CBK	02/2024	$	25	EGP	884	0	(2)
CBK	02/2024		22		764	0	(1)
DUB	07/2023	BRL	1,752	$	364	0	0
DUB	07/2023	CZK	689		32	0	0
DUB	07/2023	ILS	2,060		588	33	0
DUB	07/2023	$	323	BRL	1,752	40	0
DUB	10/2023		20	NGN	11,997	0	(5)
DUB	10/2023	ZAR	2,772	$	152	7	0
DUB	11/2023	EGP	4,320		151	28	0
DUB	01/2024	NGN	6,150		10	3	0
DUB	02/2024	$	109	EGP	3,828	0	(7)
DUB	02/2024		90		3,132	0	(6)
GLM	07/2023	BRL	3,748	$	775	0	(2)

GLM	07/2023	COP	266,015		63	0	0
GLM	07/2023		76,005		18	0	0
GLM	07/2023		198,416		45	0	(3)
GLM	07/2023	DOP	7,692		133	0	(7)
GLM	07/2023		1,844		32	0	(2)
GLM	07/2023		5,703		98	0	(5)
GLM	07/2023		4,709		81	0	(5)
GLM	07/2023	ILS	196		58	5	0
GLM	07/2023	PLN	125		29	0	(2)
GLM	07/2023	RON	228		51	0	0
GLM	07/2023	$	749	BRL	3,748	28	0
GLM	07/2023		72	COP	303,048	0	0
GLM	07/2023		47		198,416	0	0
GLM	07/2023		62		262,880	1	0
GLM	07/2023		1,025	MXN	17,994	23	0
GLM	07/2023		12	PLN	52	0	0
GLM	07/2023		36	RON	164	0	0
GLM	08/2023	BRL	135	$	28	0	0
GLM	08/2023	CNH	3,533		505	18	0
GLM	08/2023	CNY	277		39	1	0
GLM	08/2023	DOP	13,667		241	0	(9)
GLM	08/2023		1,745		30	0	(1)
GLM	08/2023		1,745		30	0	(2)
GLM	08/2023		446		8	0	0
GLM	08/2023	$	405	BRL	2,069	22	0
GLM	08/2023		36	CNH	258	0	(1)
GLM	08/2023		55	DOP	3,039	1	0
GLM	08/2023		5	NOK	56	0	0
GLM	08/2023	ZAR	889	$	48	1	0
GLM	09/2023	TRY	2,805		110	6	0
GLM	09/2023	$	719	BRL	3,512	0	0
GLM	09/2023		341	THB	11,766	0	(7)
GLM	09/2023		41	TWD	1,258	0	(1)
GLM	10/2023	DOP	7,779	$	139	0	(2)
GLM	10/2023		1,512		27	0	0
GLM	10/2023	NGN	12,551		24	8	0
GLM	10/2023		10,258		17	4	0
GLM	10/2023	ZAR	890		48	1	0
GLM	10/2023		1,228		65	1	0
GLM	11/2023	DOP	812		15	0	0
GLM	11/2023	EGP	4,328		151	27	0
GLM	11/2023		291		8	0	0
GLM	11/2023	EUR	214	PLN	960	0	0
GLM	11/2023	$	13	EGP	393	0	(2)
GLM	12/2023	DOP	1,448	$	26	0	0
GLM	01/2024	ZAR	2,635		150	13	0
IND	07/2023	DKK	23		3	0	0
IND	08/2023	CNH	264		37	1	0
IND	08/2023	$	321	CNH	2,202	0	(17)
IND	08/2023		14	NOK	142	0	0
IND	11/2023	EUR	31	HUF	14,359	7	0
IND	06/2024	$	102	TWD	2,624	0	(15)
JPM	07/2023	BRL	360	$	75	0	0
JPM	07/2023	JPY	2,088		15	0	0
JPM	07/2023	RON	350		77	0	0
JPM	07/2023	$	72	BRL	360	2	0
JPM	07/2023		128	MXN	2,261	3	0
JPM	07/2023		6	NGN	3,306	0	(2)
JPM	07/2023		12	PHP	665	0	0
JPM	07/2023		841	RON	3,819	0	(2)
JPM	07/2023		1,276	SGD	1,685	0	(30)
JPM	08/2023	CAD	51	$	38	0	0
JPM	08/2023	CHF	34		37	0	0
JPM	08/2023	CNH	249		36	2	0
JPM	08/2023	CNY	2,108		296	5	0
JPM	08/2023	HUF	60,107		172	0	(1)
JPM	08/2023	MXN	5,419		313	0	(1)
JPM	08/2023	$	297	CNH	2,113	0	(5)
JPM	08/2023		526	CNY	3,600	0	(28)
JPM	08/2023		18	EGP	602	1	0
JPM	08/2023		5	HUF	1,656	0	0
JPM	08/2023		15	JPY	2,079	0	0
JPM	08/2023		82	ZAR	1,496	0	(3)
JPM	08/2023		102		2,008	3	0
JPM	08/2023		166		3,253	5	0
JPM	08/2023	UYU	159	$	4	0	0
JPM	08/2023	ZAR	2,408		124	0	(3)
JPM	09/2023	PEN	966		262	0	(3)
JPM	09/2023	TRY	1,920		72	1	0
JPM	09/2023	$	78	ILS	278	0	(3)
JPM	09/2023		41	INR	3,373	0	0
JPM	09/2023		6	NGN	3,521	0	(1)
JPM	09/2023		162	THB	5,549	0	(4)
JPM	10/2023	MXN	3,005	$	171	0	(1)
JPM	10/2023	$	9	NGN	5,522	0	(2)
JPM	10/2023		1		666	0	0
JPM	11/2023	HUF	14,372	EUR	31	0	(7)
JPM	12/2023	NGN	4,968	$	8	2	0
JPM	12/2023	$	10	NGN	6,067	0	(2)
JPM	01/2024		6	EGP	202	0	(1)
JPM	02/2024	EGP	1,364	$	36	0	0
JPM	04/2024	KES	5,719		37	0	(1)
JPM	04/2024		5,194		34	0	0
JPM	04/2024	TRY	2,539		81	1	0
JPM	06/2024	$	14	IDR	210,000	0	0
MBC	07/2023	EUR	87	$	94	0	(1)

MBC	07/2023	GBP	106		131	0	(4)
MBC	07/2023	PLN	165		38	0	(2)
MBC	07/2023	$	78	COP	329,224	1	0
MBC	07/2023		58		245,491	1	0
MBC	08/2023		115	TWD	3,582	0	0
MBC	09/2023		88	INR	7,259	0	0
MBC	09/2023		651	KRW	830,843	0	(18)
MBC	09/2023		6	THB	202	0	0
MBC	01/2024		8	EGP	253	0	(1)
MYI	07/2023	CZK	292	$	13	0	0
MYI	07/2023	MXN	1,022		57	0	(3)
MYI	07/2023	MYR	147		32	0	0
MYI	07/2023	PLN	346		83	0	(2)
MYI	07/2023	TRY	3,031		121	5	0
MYI	07/2023		814		33	2	0
MYI	07/2023	$	307	COP	1,296,454	1	0
MYI	07/2023		38	CZK	812	0	(1)
MYI	07/2023		156	MYR	725	0	0
MYI	07/2023		29	PLN	124	1	0
MYI	08/2023		0	TWD	3	0	0
MYI	08/2023		31	ZAR	611	1	0
MYI	09/2023	TRY	3,107	$	116	0	0
MYI	09/2023	$	34	IDR	505,866	0	0
MYI	09/2023		768	KRW	982,632	0	(19)
MYI	09/2023		783	THB	26,828	0	(21)
MYI	10/2023	CLP	34	$	0	0	0
MYI	10/2023	ZAR	37		2	0	0
MYI	11/2023	EGP	1,298		37	0	0
MYI	01/2024		461		12	0	0
MYI	01/2024		1,714		46	0	0
MYI	01/2024	NGN	3,075		5	1	0
MYI	01/2024	$	51	EGP	1,714	0	(5)
MYI	02/2024	EGP	344	$	9	0	0
NGF	08/2023	CNH	586		85	5	0
NGF	09/2023	SGD	341		256	3	0
RBC	07/2023	MXN	9,347		486	0	(58)
RBC	08/2023	$	1,438	MXN	24,918	3	0
RBC	09/2023	ZAR	622	$	35	2	0
SCX	07/2023	NGN	4,041		8	2	0
SCX	07/2023	TRY	1,559		67	8	0
SCX	07/2023	$	37	CZK	814	0	0
SCX	07/2023		60	KES	8,693	2	0
SCX	07/2023		150	MYR	688	0	(2)
SCX	07/2023		1	NGN	768	0	0
SCX	07/2023		38	RON	174	0	0
SCX	08/2023	CNH	118	$	17	1	0
SCX	08/2023	NZD	39		24	0	0
SCX	08/2023	$	1,400	CNY	9,559	0	(77)
SCX	09/2023		1,528	INR	126,649	12	0
SCX	09/2023		12	THB	407	0	0
SCX	09/2023		74	TRY	1,688	0	(12)
SCX	09/2023		294	TWD	8,970	0	(6)
SCX	10/2023		2	CLP	1,556	0	0
SCX	11/2023	EGP	475	$	13	0	(1)
SCX	11/2023	$	49	EGP	1,906	6	0
SCX	12/2023		11	KES	1,620	0	0
SCX	12/2023		23		3,381	0	0
SCX	01/2024		0	EGP	7	0	0
SCX	01/2024		11	NGN	9,042	0	0
SCX	02/2024	EGP	1,277	$	34	0	0
SCX	06/2024	KES	1,693		11	0	0
SCX	06/2024		3,531		23	0	0
SOG	07/2023	$	914	PLN	3,936	54	0
SOG	01/2024		23	EGP	749	0	(3)
SSB	07/2023	COP	200,766	$	48	0	0
SSB	07/2023		199,297		48	0	0
SSB	07/2023	$	128	CLP	103,184	0	0
SSB	07/2023		48	COP	199,297	0	0
SSB	08/2023	CLP	103,482	$	128	0	0
SSB	09/2023	BRL	860		170	0	(7)
SSB	09/2023	$	21	CLP	16,958	0	0
TOR	07/2023	COP	887	$	0	0	0
TOR	07/2023	$	0	COP	887	0	0
TOR	07/2023		0		894	0	0
TOR	07/2023		94	GBP	74	0	0
TOR	08/2023	GBP	74	$	94	0	0
TOR	08/2023	HUF	38,071		109	0	(1)
UAG	07/2023	COP	596,108		143	0	0
UAG	07/2023	TRY	1,430		61	6	0
UAG	07/2023	$	42	CZK	924	1	0
UAG	07/2023		53	MXN	935	2	0
UAG	07/2023		58	RON	261	0	0
UAG	07/2023		913	TRY	21,031	0	(112)
UAG	08/2023		43	CAD	59	1	0
UAG	08/2023		15	CNH	103	0	(1)
UAG	08/2023		143	COP	600,682	0	(1)
UAG	08/2023	ZAR	1,284	$	68	1	0
UAG	09/2023	SGD	100		75	1	0
UAG	09/2023	$	67	ILS	241	0	(2)
UAG	09/2023	ZAR	5,238	$	299	23	0
UAG	10/2023	$	79	ZAR	1,451	0	(3)
UAG	11/2023	CZK	5,627	EUR	230	0	(4)
UAG	11/2023	ILS	199	$	58	4	0
UAG	04/2024	$	84	TRY	2,539	0	(4)
外国為替先渡契約合計						**$ 579**	**$ (844)**

買建オプション：
外国為替オプション

取引相手	詳細		行使価格	満期日	想定元本[1]	取得原価	市場価格
BOA	Put - OTC Euro versus Czech koruna	CZK	23.830	11/01/2023	37	$ 4	$ 16
GLM	Put - OTC Euro versus Hungarian Forint	HUF	385.000	11/01/2023	14	2	8
GLM	Put - OTC Euro versus Polish zloty	PLN	4.560	11/01/2023	28	3	22
JPM	Put - OTC Euro versus Hungarian Forint	HUF	385.000	11/01/2023	28	3	17
MYI	Put - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL	4.820	08/22/2023	336	4	5
MYI	Put - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN	18.500	07/25/2023	333	8	25
RBC	Put - OTC U.S. dollar versus Canadian dollar	CAD	1.305	07/13/2023	331	1	0
UAG	Call - OTC Euro versus U.S. dollar	$	1.140	07/13/2023	301	2	0
UAG	Call - OTC U.S. dollar versus South African Rand	ZAR	20.500	10/09/2023	544	8	6
買建オプション合計						**$ 35**	**$ 99**

売建オプション：
金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払／受取	行使レート	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取）	市場価格
BRC	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.350%	07/27/2023	100	$ 0	$ 0
BRC	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.850%	07/27/2023	100	0	0
NGF	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.270%	07/24/2023	100	(1)	0
NGF	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.260%	07/26/2023	100	0	0
NGF	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.670%	07/24/2023	100	(1)	(1)
NGF	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.660%	07/26/2023	100	0	(1)
							$ (2)	$ (2)

外国為替オプション

取引相手	詳細		行使価格	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取）	市場価格
JPM	Call - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah	IDR	14,950.000	06/06/2024	98	$ (3)	$ (3)
JPM	Put - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah		14,950.000	06/06/2024	98	(3)	(3)
MYI	Call - OTC U.S. dollar versus Chilean peso	CLP	850.000	07/18/2023	191	(3)	0
MYI	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN	21.000	03/07/2024	336	(8)	(2)
MYI	Put - OTC U.S. dollar versus Mexican peso		17.750	07/25/2023	666	(4)	(22)
						$ (21)	$ (30)

ストラドル・オプション

取引相手	詳細	行使レベル[2]	満期日	想定元本[1]	プレミアム（受取）	市場価格
BOA	Call & Put- OTC 6 Month vs. 6 Month Forward Volatillity Agreement	12.600%	12/27/2023	200	$ 0	$ 0
BOA	Call & Put- OTC 6 Month vs. 6 Month Forward Volatillity Agreement	15.050	12/27/2023	200	0	0
CBK	Call & Put- OTC 6 Month vs. 6 Month Forward Volatillity Agreement	12.600	12/29/2023	200	0	0
CBK	Call & Put- OTC 6 Month vs. 6 Month Forward Volatillity Agreement	15.100	12/20/2023	600	0	0
MYI	Call & Put- OTC 6 Month vs. 6 Month Forward Volatillity Agreement	12.600	12/27/2023	300	0	0
					$ 0	$ 0
売建オプション合計					**$ (23)**	**$ (32)**

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの買い[3]

取引相手	参照債務	固定金利（支払）	満期日	インプライド・クレジット・スレッド（2023年6月30日現在）[5]	想定元本[6]	プレミアム支払額（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
BOA	Turkey Government International Bond	(1.000%)	06/20/2024	3.119%	$ 100	$ 6	$ (4)	$ 2	$ 0
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	06/20/2024	3.119%	500	23	(13)	10	0
						$ 29	$ (17)	$ 12	$ 0

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ － プロテクションの売り[4]

取引相手	参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・クレジット・スレッド（2023年6月30日現在）[5]	想定元本[6]	プレミアム支払額（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
CBK	Petroleos Mexicanos	1.000%	06/20/2024	2.999%	$ 100	$ (3)	$ 1	$ 0	$ (2)
GST	Poland Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.257%	100	0	0	0	0
JPM	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.596%	100	(2)	2	0	0
						$ (5)	$ 3	$ 0	$ (2)

クロス・カレンシー・スワップ

取引相手	受取	支払	満期日[7]		受取通貨の想定元本[8]	引渡通貨の想定元本[8]	プレミアム支払額／（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
GLM	Secured Overnight Financing Rateに相当する変動金利に引渡通貨の想定元本に基づく0.428%を加算した金利	受取通貨の想定元本に基づく33.000%に相当する固定金利	05/28/2024	ARS	4,507	$ 100	$ 0	$ 96	$ 96	$ 0
GLM	Secured Overnight Financing Rateに相当する変動金利に引渡通貨の想定元本に基づく0.428%を加算した金利	受取通貨の想定元本に基づく33.250%に相当する固定金利	05/30/2024		889	20	0	19	19	0
							$ 0	$ 115	$ 115	$ 0

金利スワップ

取引相手	変動金利支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日		想定元本	プレミアム支払額（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
BOA	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	03/15/2028	MYR	400	$ 0	$ (1)	$ 0	$ (1)

BOA	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	03/15/2028		1,949	3	0	3	0
BOA	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	03/15/2028		160	0	0	0	0
BOA		Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.340%	02/26/2024	COP	650,000	0	7	7	0
BPS	支払 受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.240%	04/29/2024		396,000	0	(6)	0	(6)
BPS	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.960%	01/11/2029		1,234,400	0	23	23	0
CBK	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.340%	02/26/2024		502,400	0	6	6	0
CBK	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.255%	04/29/2024		586,000	0	(8)	0	(8)
CBK	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.582%	06/18/2024		601,000	0	(9)	0	(9)
CBK	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.490%	07/05/2024		283,900	0	6	6	0
CBK	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.990%	01/14/2029		307,200	0	6	6	0
CBK	支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.770%	03/26/2029		378,300	0	(7)	0	(7)
CBK	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.763%	05/24/2029	CLP	19,300	0	(2)	0	(2)
DUB		Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.830%	04/23/2029	COP	51,800	0	(1)	0	(1)
GLM	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.545%	05/05/2028	MYR	868	0	1	1	0
GLM	支払 受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.310%	02/12/2024	COP	913,000	0	(11)	0	(11)
GLM	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.338%	02/14/2024		1,097,000	0	13	13	0
GLM	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.880%	06/07/2024		1,922,900	0	28	28	0
GLM	支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.880%	05/28/2029		330,800	0	(6)	0	(6)
GLM	受取	3-Month MYR - KLIBOR	4.275%	08/24/2028	CLP	76,200	0	(7)	0	(7)
GST	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.500%	03/15/2028	MYR	1,219	1	1	2	0
JPM		Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.880%	06/07/2024	COP	442,100	0	6	6	0
JPM	支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.607%	06/17/2024		806,000	0	(12)	0	(12)
JPM	受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.630%	02/07/2026		1,183,000	0	22	22	0
JPM	受取	Reference Rate	6.320%	12/10/2028		566,000	0	7	7	0
							$ 4	$ 56	$ 130	$ (70)
スワップ契約合計							**$ 28**	**$ 157**	**$ 257**	**$ (72)**

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2023年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

2023年6月30日現在、国際スワップ・デリバティブ協会のマスター契約に従い、金融デリバティブ商品について＄10の現金が担保として差し入れられている。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債						
取引相手	外国為替先渡契約	買建オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替先渡契約	売建オプション	スワップ契約	店頭合計	店頭デリバティブの純市場価格	差入（受取）担保	ネット・エクスポージャー(9)
BOA	$ 34	$ 16	$ 12	$ 62	$ (69)	$ 0	$ (1)	$ (70)	$ (8)	$ 0	$ (8)
BPS	45	0	23	68	(56)	0	(6)	(62)	6	0	6
BRC	2	0	0	2	(44)	0	0	(44)	(42)	0	(42)
BSS	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
CBK	44	0	18	62	(102)	0	(28)	(130)	(68)	0	(68)
DUB	111	0	0	111	(18)	0	(1)	(19)	92	0	92
GLM	160	30	157	347	(51)	0	(24)	(75)	272	(60)	212
GST	0	0	12	12	0	0	0	0	12	0	12
IND	8	0	0	8	(32)	0	0	(32)	(24)	0	(24)
JPM	25	17	35	77	(100)	(6)	(12)	(118)	(41)	0	(41)
MBC	2	0	0	2	(26)	0	0	(26)	(24)	0	(24)
MYI	11	30	0	41	(51)	(24)	0	(75)	(34)	10	(24)
NGF	8	0	0	8	0	(2)	0	(2)	6	0	6
RBC	5	0	0	5	(58)	0	0	(58)	(53)	0	(53)
SCX	31	0	0	31	(98)	0	0	(98)	(67)	0	(67)
SOG	54	0	0	54	(3)	0	0	(3)	51	0	51
SSB	0	0	0	0	(7)	0	0	(7)	(7)	0	(7)
TOR	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
UAG	39	6	0	45	(127)	0	0	(127)	(82)	0	(82)
店頭合計	$ 579	$ 99	$ 257	$ 935	$ (844)	$ (32)	$ (72)	$ (948)			

(1)　想定元本は契約数を表す。
(2)　先物期日に決定された行使レベルおよび最終コストは、インプライド・ボラティリティの変数に基づく。
(3)　ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）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額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。
(4)　ファンドがプロテクションの売り手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
(5)　インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建／売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(6)　当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
(7)　満期日において、受取通貨の想定元本は引渡通貨の想定元本に交換される。
(8)　受け取るまたは引き渡す想定元本は、クロス・カレンシー・スワップの効力発生日に基づき、決定され転換される。
(9)　ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2023年6月30日現在）：

ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品

	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品－資産						
上場または中央清算						
スワップ契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 124	$ 124
	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 124	$ 124
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 579	$ 0	$ 579
買建オプション	0	0	0	99	0	99
スワップ契約	0	12	0	115	130	257
	$ 0	$ 12	$ 0	$ 793	$ 130	$ 935
	$ 0	$ 12	$ 0	$ 793	$ 254	$ 1,059
金融デリバティブ商品－負債						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (1)	$ (1)
スワップ契約	0	0	0	0	(171)	(171)
	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (172)	$ (172)
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (844)	$ 0	$ (844)
売建オプション	0	0	0	(30)	(2)	(32)
スワップ契約	0	(2)	0	0	(70)	(72)
	$ 0	$ (2)	$ 0	$ (874)	$ (72)	$ (948)
	$ 0	$ (2)	$ 0	$ (874)	$ (244)	$ (1,120)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2023年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品に係る実現純利益（損失）						
上場または中央清算						
売建オプション	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 5	$ 5
先物	0	0	0	0	(6)	(6)
スワップ契約	0	(28)	0	0	180	152
	$ 0	$ (28)	$ 0	$ 0	$ 179	$ 151
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 1,257	$ 0	$ 1,257
買建オプション	0	0	0	22	0	22
売建オプション	0	4	0	14	3	21
スワップ契約	0	39	0	(1)	176	214
	$ 0	$ 43	$ 0	$ 1,292	$ 179	$ 1,514
	$ 0	$ 15	$ 0	$ 1,292	$ 358	$ 1,665
金融デリバティブ商品に係る未実現評価（損）益の純変動額						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 10	$ 10
スワップ契約	0	28	0	0	(16)	12
	$ 0	$ 28	$ 0	$ 0	$ (6)	$ 22
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (569)	$ 0	$ (569)
買建オプション	0	0	0	68	2	70
売建オプション	0	1	0	(10)	0	(9)
スワップ契約	0	(38)	0	12	(144)	(170)
	$ 0	$ (37)	$ 0	$ (499)	$ (142)	$ (678)
	$ 0	$ (9)	$ 0	$ (499)	$ (148)	$ (656)

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2023年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値（2023/06/30現在）
投資有価証券（公正価値）				
アルゼンチン				
ソブリン債	$ 0	$ 1	$ 0	$ 1
アゼルバイジャン				
社債等	0	293	0	293
ブラジル				
社債等	0	877	817	1,694
仕組債	0	101	0	101
英領バージン諸島				
社債等	0	0	22	22
ケイマン諸島				
資産担保証券	0	385	0	385
社債等	0	159	0	159
チリ				
ソブリン債	0	339	0	339
中国				
ソブリン債	0	863	0	863
コロンビア				
社債等	0	215	0	215
ソブリン債	0	21	0	21
チェコ共和国				
ソブリン債	0	1,257	0	1,257
ドミニカ共和国				

ソブリン債	0	993	0	993
ハンガリー				
ソブリン債	0	1,122	0	1,122
アイルランド				
社債等	0	0	21	21
モーゲージ証券	0	102	0	102
イスラエル				
ソブリン債	0	1,156	0	1,156
チャンネル諸島ジャージー島				
社債等	0	217	0	217
ルクセンブルク				
社債等	0	0	12	12
マレーシア				
ソブリン債	0	2,253	0	2,253
メキシコ				
社債等	0	52	0	52
ソブリン債	0	3,237	0	3,237
オランダ				
ソブリン債	0	64	0	64
ナイジェリア				
社債等	0	94	0	94
ペルー				
社債等	0	140	0	140
ソブリン債	0	1,673	0	1,673
ポーランド				
ソブリン債	0	1,684	0	1,684
ルーマニア				
ソブリン債	0	1,242	0	1,242
ロシア				
ソブリン債	0	61	0	61
南アフリカ				
社債等	0	455	203	658
ソブリン債	0	2,512	0	2,512
韓国				
ソブリン債	0	705	0	705
国際機関				
社債等	0	97	0	97
ソブリン債	0	79	0	79
英国				
モーゲージ証券	0	125	0	125
米国				
資産担保証券	0	96	0	96
モーゲージ証券	0	1,457	98	1,555
米国政府機関債	0	12	0	12
ウルグアイ				
ソブリン債	0	186	0	186
ザンビア				
ソブリン債	0	77	0	77
短期金融商品	0	6,589	0	6,589
投資合計	$ 0	$ 30,991	$ 1,173	$ 32,164
金融デリバティブ商品 － 資産				
上場または中央清算	0	124	0	124
店頭	0	935	0	935
	$ 0	$ 1,059	$ 0	$ 1,059
金融デリバティブ商品 － 負債				
上場または中央清算	0	(172)	0	(172)
店頭	0	(948)	0	(948)
	$ 0	$ (1,120)	$ 0	$ (1,120)
合計	**$ 0**	**$ 30,930**	**$ 1,173**	**$ 32,103**

以下は、2023年6月30日に終了した年度においてファンドのために重要な観察不能な情報(レベル3)を使用した公正価値の購入、発行および振替の要約である(該当する場合)。

カテゴリー	購入純額	発行	レベル3への振替	レベル3からの振替
投資有価証券（公正価値）				
ブラジル				
社債等	$ 0	$ 0	$ 805	$ 0
仕組債	0	0	0	(101)
アイルランド				
社債等	0	0	21	0
ルクセンブルク				
社債等	0	0	12	0
米国				
モーゲージ証券	0	0	97	0
	$ 0	$ 0	$ 935	$ (101)

以下は公正価値ヒエラルキーのレベル3に分類される資産および負債の公正価値に使用した重要な観察不能な情報の要約である。

カテゴリー	2023年6月30日の期末残高	評価手法	観察不能な情報	価値情報(別途注記のない限り%)
投資有価証券（公正価値）				
ブラジル				
社債等	$ 805	Proxy pricing	Base Price	96.31
	12	Indicative Market Quotation	Broker Quote	7.23
英領バージン諸島				
社債等	22	Expected Recovery	Discount rate	20.00
アイルランド				
社債等	21	Third Party Vendor	Expected Recovery	3.00

ルクセンブルク

社債等		12	Third Party Vendor	Expected Recovery	6.00
南アフリカ					
社債等		203	Discounted Cash Flow	Discount Rate	10.26
米国					
モーゲージ証券	$	98	Fair Valuation of odd lot positions	Adjustment factor	2.50
合計	**$**	**1,173**			

投資明細表
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド
(金額の単位は千*、ただし株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)
2023年6月30日現在

		元本金額（単位：千）		評価額（単位：千）
投資有価証券128.9%				
オーストラリア2.7%				
社債等0.1%				
Santos Finance Ltd.				
3.649% due 04/29/2031	$	100	$	83
モーゲージ証券1.3%				
AFG Trust				
4.810% due 03/10/2053	AUD	373		247
Bluestone Sapphire XXV				
5.145% due 09/21/2053		184		122
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4				
4.910% due 02/19/2053		419		275
La Trobe Financial Capital Markets Trust				
4.873% due 01/14/2053		307		203
Liberty PRIME				
4.815% due 01/25/2053		354		234
Pepper I-Prime Trust				
4.770% due 07/15/2053		188		124
Pepper Residential Securities Trust No.30				
4.870% due 01/15/2063		241		159
RedZed Trust				
4.858% due 06/09/2053		165		110
Resimac Premier				
4.740% due 02/13/2053		403		265
Securitised Australian Mortgage Trust				
4.894% due 02/20/2046		45		30
				1,769
ソブリン債1.3%				
Australia Government Bond				
3.250% due 04/21/2029		2,600		1,667
South Australian Government Financing Authority				
1.750% due 05/24/2032		100		53
Treasury Corp. of Victoria				
4.250% due 12/20/2032		100		65
				1,785
オーストラリア合計 **（取得原価$4,276）**				**3,637**
バミューダ0.1%				
社債等0.1%				
Bacardi Ltd.				
4.700% due 05/15/2028	$	100		97
バミューダ合計 **（取得原価$98）**				**97**
カナダ0.5%				
ソブリン債0.5%				
Canada Government Bond				
1.750% due 12/01/2053	CAD	100		56
Province of Ontario				
7.500% due 02/07/2024		800		613
カナダ合計 **（取得原価$720）**				**669**

ケイマン諸島2.5%			
資産担保証券2.1%			
Ammc CLO 20 Ltd.			
6.130% due 04/17/2029	$	49	49
Anchorage Capital CLO 9 Ltd.			
6.400% due 07/15/2032		500	493
Ares XXXIX CLO Ltd.			
6.312% due 04/18/2031		500	495
HERA Commercial Mortgage Ltd.			
6.207% due 02/18/2038		173	167
LoanCore Issuer Ltd.			
6.616% due 01/17/2037		500	492
Mountain View CLO LLC			
6.300% due 01/16/2031		495	489
Nassau Ltd.			
6.410% due 10/15/2029		103	102
Vibrant CLO IV Ltd.			
6.370% due 07/20/2032		500	491
			2,778
社債等0.4%			
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.			
4.600% due 03/27/2024 (a)		200	198
Tencent Holdings Ltd.			
2.390% due 06/03/2030		200	166
3.975% due 04/11/2029		200	186
			550
ケイマン諸島合計 **（取得原価＄3,404）**			**3,328**
チリ0.2%			
ソブリン債0.2%			
Chile Government International Bond			
2.450% due 01/31/2031		300	259
チリ合計 **（取得原価＄265）**			**259**
中国3.6%			
ソブリン債3.6%			
China Development Bank			
3.400% due 01/08/2028	CNY	4,300	612
China Government International Bond			
2.600% due 09/01/2032		8,400	1,146
2.750% due 02/17/2032		4,000	552
3.010% due 05/13/2028		5,300	750
3.190% due 04/15/2053		3,900	556
3.270% due 11/19/2030		4,700	679
3.390% due 03/16/2050		900	130
3.720% due 04/12/2051		1,200	185
3.810% due 09/14/2050		1,500	234
中国合計 **（取得原価＄5,014）**			**4,844**
デンマーク3.6%			
社債等3.6%			
Jyske Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2050	DKK	25	2
1.500% due 10/01/2050		124	13
1.500% due 10/01/2053		292	31
2.000% due 10/01/2050		8	1
2.500% due 10/01/2047		1	0
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
1.000% due 10/01/2050		27	3
1.500% due 10/01/2050		1,264	136
1.500% due 10/01/2053		392	42
2.000% due 10/01/2050		17	2
2.500% due 10/01/2047		5	1
3.000% due 10/01/2047		1	0
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2050		166	17
1.000% due 10/01/2053		95	10
1.500% due 10/01/2050		388	42

1.500% due 10/01/2053		2,199	242
2.000% due 10/01/2050		217	25
2.500% due 10/01/2047		2	0
3.000% due 10/01/2047		2	1
3.000% due 10/01/2053		18,383	2,367
Realkredit Danmark A/S			
1.000% due 10/01/2050		73	8
1.000% due 10/01/2053		195	20
1.500% due 10/01/2053		6,080	633
2.500% due 04/01/2036		25	3
2.500% due 04/01/2047		8	1
3.000% due 07/01/2046		1	0
5.000% due 10/01/2053		7,684	1,106
6.000% due 10/01/2053		1,414	210
デンマーク合計			**4,916**
（取得原価＄5,574）			
フランス1.4%			
社債等0.7%			
BNP Paribas S.A.			
2.871% due 04/19/2032	$	250	205
5.198% due 01/10/2030		200	193
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)		200	180
Societe Generale S.A.			
6.691% due 01/10/2034		400	407
			985
ソブリン債0.7%			
France Government Bond			
0.750% due 05/25/2052	EUR	420	250
2.000% due 05/25/2048		804	694
			944
フランス合計			**1,929**
（取得原価＄2,519）			
ドイツ0.5%			
社債等0.5%			
Deutsche Bank AG			
3.035% due 05/28/2032 (h)	$	600	473
3.961% due 11/26/2025		200	191
ドイツ合計			**664**
（取得原価＄776）			
ハンガリー0.1%			
ソブリン債0.1%			
Hungary Government International Bond			
0.125% due 09/21/2028	EUR	100	86
ハンガリー合計			**86**
（取得原価＄84）			
インドネシア0.1%			
ソブリン債0.1%			
Indonesia Government International Bond			
5.125% due 01/15/2045	$	200	199
インドネシア合計			**199**
（取得原価＄249）			
アイルランド3.6%			
資産担保証券3.5%			
Accunia European CLO I DAC			
4.127% due 07/15/2030	EUR	71	77
Aurium CLO IV DAC			
3.907% due 01/16/2031		300	321
Blackrock European CLO IV DAC			
4.027% due 07/15/2030		528	568
Cairn CLO IV DAC			
3.842% due 04/30/2031		197	211
Carlyle Euro CLO DAC			
4.213% due 08/15/2032		500	533
CIFC European Funding CLO III DAC			
4.227% due 01/15/2034		500	535
Contego CLO IV DAC			

3.851% due 01/23/2030		100	107
Dryden 35 Euro CLO DAC			
4.157% due 01/17/2033		250	266
GoldenTree Loan Management EUR CLO 1 DAC			
3.930% due 10/20/2030		386	414
Harvest CLO XXII DAC			
4.027% due 01/15/2032		200	213
Invesco Euro CLO I DAC			
3.827% due 07/15/2031		200	213
Jubilee CLO XI DAC			
3.787% due 04/15/2030		200	214
OCP Euro CLO DAC			
4.091% due 09/22/2034		500	531
Palmer Square European CLO DAC			
3.957% due 04/15/2031		488	523
			4,726
社債等0.1%			
AerCap Ireland Capital DAC			
2.450% due 10/29/2026	$	200	179
アイルランド合計			**4,905**
（取得原価＄5,122）			
イスラエル0.1%			
ソブリン債0.1%			
Israel Government International Bond			
3.375% due 01/15/2050		200	151
イスラエル合計			**151**
（取得原価＄219）			
イタリア1.6%			
社債等0.1%			
AMCO - Asset Management Co. SpA			
1.500% due 07/17/2023	EUR	100	109
ソブリン債1.5%			
Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5.750% due 05/05/2026	$	280	276
Italy Buoni Poliennali del Tesoro			
2.800% due 03/01/2067	EUR	46	36
4.350% due 11/01/2033		1,500	1,681
			1,993
イタリア合計			**2,102**
（取得原価＄2,066）			
日本1.3%			
社債等1.3%			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
2.309% due 07/20/2032	$	400	319
2.852% due 01/19/2033		400	330
3.407% due 03/07/2024		150	148
3.741% due 03/07/2029		200	183
5.242% due 04/19/2029		500	492
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
4.436% due 04/02/2024 (a)		300	295
日本合計			**1,767**
（取得原価＄1,881）			
マレーシア0.2%			
ソブリン債0.2%			
Malaysia Government International Bond			
3.899% due 11/16/2027	MYR	1,000	217
4.736% due 03/15/2046		200	46
マレーシア合計			**263**
（取得原価＄280）			
メキシコ0.2%			
ソブリン債0.2%			
Mexico Government International Bond			
6.350% due 02/09/2035	$	200	211
メキシコ合計			**211**
（取得原価＄213）			

多国籍0.3%				
社債等0.3%				
Delta Air Lines, Inc.				
4.750% due 10/20/2028		300		292
NXP BV				
5.000% due 01/15/2033		100		96
多国籍合計				**388**
（取得原価＄428）				
オランダ0.4%				
社債等0.4%				
ING Groep NV				
4.550% due 10/02/2028		200		192
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)		200		155
JT International Financial Services BV				
3.875% due 09/28/2028		200		186
				533
モーゲージ証券0.0%				
Dutch Property Finance BV				
3.892% due 07/28/2058	EUR	73		79
オランダ合計				**612**
（取得原価＄681）				
ノルウェー0.0%				
ソブリン債0.0%				
Norway Government Bond				
1.750% due 03/13/2025	NOK	600	＄	54
ノルウェー合計				**54**
（取得原価＄74）				
カタール0.3%				
社債等0.2%				
Qatar Energy				
3.125% due 07/12/2041	＄	300		230
ソブリン債0.1%				
Qatar Government International Bond				
4.625% due 06/02/2046		200		191
カタール合計				**421**
（取得原価＄559）				
ルーマニア0.4%				
ソブリン債0.4%				
Romania Government International Bond				
1.750% due 07/13/2030	EUR	300		250
3.875% due 10/29/2035		100		87
6.625% due 09/27/2029		200		227
ルーマニア合計				**564**
（取得原価＄577）				
サウジアラビア0.6%				
社債等0.2%				
Saudi Arabian Oil Co.				
2.250% due 11/24/2030	＄	400		333
ソブリン債0.4%				
Saudi Government International Bond				
4.875% due 07/18/2033		500		500
サウジアラビア合計				**833**
（取得原価＄897）				
シンガポール0.2%				
ソブリン債0.2%				
Singapore Government Bond				
2.625% due 08/01/2032	SGD	300		214
シンガポール合計				**214**
（取得原価＄216）				
韓国3.6%				
ソブリン債3.6%				

Korea Treasury Bond				
2.000% due 06/10/2031	KRW	680,250		458
2.125% due 06/10/2027		1,070,300		768
2.375% due 12/10/2027		270,000		194
2.625% due 06/10/2028		1,220,400		884
3.250% due 06/10/2033		253,390		186
4.250% due 12/10/2032		3,011,120		2,394
韓国合計				**4,884**
（取得原価＄5,325）				
スペイン1.0%				
ソブリン債1.0%				
Spain Government Bond				
1.450% due 04/30/2029	EUR	580	$	574
1.450% due 10/31/2071		397		210
3.450% due 07/30/2066		290		289
3.550% due 10/31/2033		200		220
スペイン合計				**1,293**
（取得原価＄1,679）				
国際機関0.2%				
ソブリン債0.2%				
European Investment Bank				
0.500% due 07/21/2023	AUD	300		199
0.500% due 08/10/2023		200		133
国際機関合計				**332**
（取得原価＄436）				
スイス1.1%				
社債等1.1%				
Credit Suisse AG				
6.500% due 08/08/2023 (a)	$	800		797
UBS Group AG				
4.194% due 04/01/2031		500		445
6.442% due 08/11/2028		300		302
スイス合計				**1,544**
（取得原価＄1,658）				
アラブ首長国連邦0.4%				
社債等0.1%				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3.750% due 02/15/2026		200		191
ソブリン債0.3%				
Abu Dhabi Government International Bond				
3.875% due 04/16/2050		400		337
アラブ首長国連邦合計				**528**
（取得原価＄655）				
英国7.1%				
社債等2.6%				
Barclays PLC				
5.501% due 08/09/2028		200		195
7.437% due 11/02/2033		300		325
HSBC Holdings PLC				
2.804% due 05/24/2032		200		162
2.848% due 06/04/2031		200		166
5.210% due 08/11/2028		200		196
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	EUR	200		217
6.254% due 03/09/2034	$	200		205
Imperial Brands Finance PLC				
3.500% due 07/26/2026		300		280
Lloyds Banking Group PLC				
5.871% due 03/06/2029		500		496
NatWest Group PLC				
4.445% due 05/08/2030		300		276
5.076% due 01/27/2030		200		191
Santander UK Group Holdings PLC				
6.534% due 01/10/2029		200		201
Standard Chartered PLC				
1.456% due 01/14/2027		400		355
Weir Group PLC				

2.200% due 05/13/2026		300	269
			3,534
モーゲージ証券2.9%			
Avon Finance No.2 PLC			
5.380% due 09/20/2048	GBP	359	457
Canada Square Funding PLC			
5.426% due 06/17/2058		63	80
Eurosail PLC			
3.766% due 12/15/2044	EUR	222	238
Finsbury Square PLC			
5.689% due 12/16/2071	GBP	452	572
Lanebrook Mortgage Transaction PLC			
5.141% due 07/20/2058		82	103
London Wall Mortgage Capital PLC			
5.452% due 05/15/2051		134	169
Pierpont Btl PLC			
0.000% due 09/21/2054		400	507
Pierpont BTL PLC			
5.714% due 12/22/2053		176	222
Polaris PLC			
5.631% due 12/23/2058		67	84
Towd Point Mortgage Funding Auburn 14 PLC			
5.801% due 05/20/2045		356	451
Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC			
5.635% due 10/20/2051		35	44
Tower Bridge Funding PLC			
5.527% due 11/20/2063		65	83
Trinity Square PLC			
5.316% due 07/15/2059		127	162
Twin Bridges PLC			
5.310% due 03/12/2055		70	89
5.410% due 06/12/2055		487	618
			3,879
ソブリン債1.6%			
United Kingdom Gilt			
1.125% due 01/31/2039		200	159
1.750% due 09/07/2037		150	136
3.750% due 01/29/2038		400	467
4.250% due 12/07/2040		1,152	1,418
			2,180
英国合計 **（取得原価＄10,672）**			**9,593**
米国54.1%			
資産担保証券1.8%			
Lendmark Funding Trust			
2.000% due 04/20/2032	$	700	597
Mariner Finance Issuance Trust			
2.100% due 11/20/2036		700	608
Navient Private Education Refi Loan Trust			
2.120% due 01/15/2069		48	44
Navient Student Loan Trust			
6.300% due 03/25/2066		468	462
Ready Capital Mortgage Financing LLC			
6.100% due 07/25/2036		377	366
SMB Private Education Loan Trust			
1.600% due 09/15/2054		457	406
			2,483
社債等6.9%			
AbbVie, Inc.			
3.200% due 11/21/2029		300	271
AES Corp.			
2.450% due 01/15/2031		200	162
American Tower Corp.			
2.900% due 01/15/2030		200	173
Amgen, Inc.			
3.350% due 02/22/2032		100	88
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.			
5.550% due 01/23/2049		100	106

Aviation Capital Group LLC			
4.125% due 08/01/2025		100	93
5.500% due 12/15/2024		100	98
Bank of America Corp.			
3.419% due 12/20/2028		415	381
4.571% due 04/27/2033		500	470
Black Hills Corp.			
2.500% due 06/15/2030		100	83
Boeing Co.			
3.600% due 05/01/2034		100	85
3.625% due 02/01/2031		50	45
British Airways 2018-1 Class A Pass-Through Trust			
4.125% due 09/20/2031		68	61
Broadcom, Inc.			
2.450% due 02/15/2031		50	41
3.419% due 04/15/2033		100	84
3.469% due 04/15/2034		300	246
4.300% due 11/15/2032		48	44
Charter Communications Operating LLC			
3.850% due 04/01/2061		24	15
3.900% due 06/01/2052		24	16
3.950% due 06/30/2062		150	92
Citigroup, Inc.			
2.976% due 11/05/2030		100	87
3.070% due 02/24/2028		600	552
Comcast Corp.			
2.937% due 11/01/2056		131	85
Crown Castle, Inc.			
2.250% due 01/15/2031		400	326
CVS Health Corp.			
5.875% due 06/01/2053		100	103
Energy Transfer LP			
5.300% due 04/01/2044		50	43
6.000% due 06/15/2048		138	131
Essential Utilities, Inc.			
3.351% due 04/15/2050		36	25
Evergy Metro, Inc.			
2.250% due 06/01/2030		100	83
Goldman Sachs Group, Inc.			
1.250% due 02/07/2029	EUR	100	93
2.383% due 07/21/2032	$	200	160
2.615% due 04/22/2032		100	82
3.691% due 06/05/2028		200	188
HCA, Inc.			
4.125% due 06/15/2029		100	93
4.500% due 02/15/2027		250	241
5.900% due 06/01/2053		100	99
JPMorgan Chase & Co.			
2.522% due 04/22/2031		250	212
2.739% due 10/15/2030		100	86
2.963% due 01/25/2033		300	253
JPMorgan Chase Bank N.A.			
6.375% due 04/19/2032	IDR	5,922,000	398
Mileage Plus Holdings LLC			
6.500% due 06/20/2027	$	160	161
Morgan Stanley			
1.512% due 07/20/2027		200	177
Oracle Corp.			
3.950% due 03/25/2051 (h)		100	76
Pacific Gas & Electric Co.			
3.150% due 01/01/2026		100	93
3.250% due 06/01/2031		200	163
5.450% due 06/15/2027		300	292
Santander Holdings USA, Inc.			
4.500% due 07/17/2025		200	194
Southern California Edison Co.			
3.600% due 02/01/2045		50	37
3.650% due 06/01/2051		100	74
Southern California Gas Co.			
2.550% due 02/01/2030		150	129
T-Mobile USA, Inc.			
3.300% due 02/15/2051		126	89
3.600% due 11/15/2060		176	124

Toyota Motor Credit Corp.		
5.810% due 12/11/2023	300	300
UMass Memorial Health Care Obligated Group		
5.363% due 07/01/2052	200	197
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 05/01/2028	85	74
VMware, Inc.		
2.200% due 08/15/2031	100	79
4.700% due 05/15/2030	100	96
Wells Fargo & Co.		
2.393% due 06/02/2028	200	178
2.572% due 02/11/2031	100	85
3.526% due 03/24/2028	300	280
3.584% due 05/22/2028	100	93
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.		
3.200% due 06/15/2025	300	285
		9,270

モーゲージ証券2.1%		
Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.395% due 09/25/2035 (c)	8	7
Alternative Loan Trust		
6.000% due 04/25/2037 (c)	115	55
Banc of America Funding Trust		
4.416% due 01/20/2047 (c)	15	14
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.033% due 11/25/2034	4	4
4.096% due 05/25/2034	11	9
4.403% due 10/25/2033	6	5
4.439% due 02/25/2034	1	1
4.635% due 07/25/2033	8	8
4.715% due 05/25/2033	30	28
4.996% due 05/25/2034	19	17
Bear Stearns Alternative-A Trust (c)		
3.950% due 02/25/2036	22	15
4.365% due 01/25/2036	82	75
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust		
3.484% due 12/26/2046 (c)	13	10
Benchmark Mortgage Trust		
4.470% due 07/15/2055	600	564
BSREP Commercial Mortgage Trust		
6.144% due 08/15/2038	500	454
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
6.080% due 09/25/2035	23	23
6.780% due 09/25/2035	15	14
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
3.810% due 11/25/2034	24	22
5.730% due 04/25/2035	5	4
5.790% due 03/25/2035	46	40
5.910% due 02/20/2036 (c)	10	8
6.537% due 02/20/2036 (c)	28	25
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
5.270% due 07/25/2037	189	125
CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates		
4.260% due 07/25/2033	1	1
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
5.677% due 08/19/2045	4	3
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust		
4.715% due 08/25/2035 (c)	8	6
Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates		
3.600% due 01/25/2029	200	189
GMACM Mortgage Loan Trust		
3.623% due 11/19/2035 (c)	6	5
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates		
4.725% due 10/25/2033	1	1
GSR Mortgage Loan Trust		
6.780% due 03/25/2033	4	3
HarborView Mortgage Loan Trust		
4.201% due 07/19/2035 (c)	6	5
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		

3.916% due 12/25/2034	8	8
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust		
3.723% due 03/15/2050	100	92
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust		
3.694% due 03/15/2050	100	92
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
2.812% due 01/16/2037	100	91
JPMorgan Mortgage Trust		
3.854% due 11/25/2033	10	9
4.086% due 02/25/2035	6	5
4.186% due 07/25/2035	22	21
Lehman Asset-Backed Securities Mortgage Loan Trust		
5.240% due 06/25/2037	22	14
Long Beach Mortgage Loan Trust		
5.710% due 10/25/2034	39	36
Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust		
5.633% due 12/15/2030	37	35
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
4.386% due 02/25/2033	12	11
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
3.102% due 11/15/2049	100	91
Morgan Stanley Capital I Trust		
3.530% due 06/15/2050	100	92
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
3.834% due 10/25/2035	17	10
Residential Asset Securitization Trust		
5.500% due 06/25/2033	38	35
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust		
5.280% due 05/25/2037 (c)	298	224
Sequoia Mortgage Trust		
4.601% due 04/20/2035	6	6
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
5.282% due 02/25/2034	11	10
5.590% due 05/25/2037	26	23
5.701% due 04/25/2034	8	8
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
5.570% due 05/25/2036	43	29
5.846% due 03/19/2034	6	6
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
6.670% due 04/25/2035	4	4
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
4.016% due 03/25/2033	54	51
4.280% due 03/25/2034	36	35
4.830% due 06/25/2033	7	7
5.770% due 01/25/2045	6	6
		2,791
地方債0.2%		
Illinois, Electric Agency Revenue Bonds, Series 2009		
6.832% due 02/01/2035	200	217
Oklahoma Development Finance Authority, Revenue Bonds, Series 2022		
5.087% due 02/01/2052	100	101
		318
米国政府機関債28.9%		
Fannie Mae		
4.000% due 12/01/2025	6	6
4.000% due 02/01/2026	11	11
4.000% due 06/01/2048	33	31
4.000% due 09/01/2048	57	55
4.287% due 02/01/2036	20	19
4.500% due 06/01/2038	41	41
6.000% due 12/01/2037	7	7
Fannie Mae, TBA (d)		
2.500% due 08/01/2053	1,280	1,087

3.000% due 08/01/2053		3,100	2,733
3.500% due 08/01/2053		3,600	3,284
4.000% due 08/01/2053		5,300	4,978
4.500% due 08/01/2053		8,100	7,792
5.000% due 09/01/2053		3,700	3,628
5.500% due 09/01/2053		6,300	6,269
6.000% due 08/01/2053		8,600	8,675
Freddie Mac			
6.000% due 12/01/2033		44	44
6.000% due 04/15/2036		77	80
Ginnie Mae			
3.000% due 04/20/2047		148	134
3.500% due 01/20/2048		160	150
5.000% due 02/15/2039		75	76
			39,100
米国財務省証券14.2%			
Treasury Inflation Protected Securities (e)			
0.375% due 07/15/2027		496	465
0.625% due 07/15/2032		209	192
0.750% due 02/15/2045 (k)		111	92
1.125% due 01/15/2033		1,324	1,269
1.625% due 10/15/2027		2,355	2,321
U.S. Treasury Bonds			
1.625% due 11/15/2050		232	144
1.875% due 02/15/2041		3,850	2,799
1.875% due 11/15/2051		400	264
2.000% due 11/15/2041		300	220
2.250% due 02/15/2052		300	217
2.375% due 02/15/2042		900	701
2.500% due 02/15/2045		134	104
2.875% due 05/15/2043		1	1
2.875% due 05/15/2052		400	332
3.625% due 08/15/2043		221	208
3.875% due 02/15/2043		220	215
4.000% due 11/15/2042		1,200	1,193
4.375% due 05/15/2041		237	249
U.S. Treasury Notes			
0.375% due 04/30/2025		50	46
2.750% due 08/31/2023		1,700	1,693
2.750% due 02/28/2025		6,800	6,552
			19,277
米国合計 **（取得原価＄77,409）**			**73,239**
短期金融商品36.9%			
コマーシャルペーパー2.2%			
Ameren Corp.			
5.426% due 07/24/2023 (f)		500	498
American Electric Power Co., Inc.			
5.526% due 08/14/2023 (f)		400	397
Constellation Brands, Inc.			
5.611% due 07/03/2023 (f)		500	500
Dominion Energy, Inc.			
5.483% due 07/26/2023 (f)		300	299
Electricite de France S.A. (f)			
5.547% due 08/03/2023		350	348
5.547% due 08/04/2023		350	348
Marriott International, Inc.			
5.443% due 07/18/2023 (f)		250	250
Mondelez International, Inc.			
5.468% due 08/01/2023 (f)		400	398
			3,038
レポ契約(i)8.4%			
			11,300
定期預金0.8%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.020% due 07/03/2023	AUD	53	35
Bank of Nova Scotia			
3.790% due 07/04/2023	CAD	38	29

4.570% due 07/03/2023	$	9		9
BNP Paribas Bank				
(0.370%) due 07/03/2023	¥	6		0
2.220% due 07/03/2023	DKK	4		0
2.470% due 07/03/2023	SEK	57		5
2.850% due 07/03/2023	NOK	587		55
3.020% due 07/03/2023	AUD	117		78
3.050% due 07/03/2023	SGD	4		3
3.720% due 07/03/2023	HKD	27		3
4.150% due 07/03/2023	NZD	85		52
Brown Brothers Harriman & Co.				
(0.370%) due 07/03/2023	¥	1		0
0.650% due 07/03/2023	CHF	7		8
4.170% due 07/03/2023	GBP	1		2
Citibank N.A.				
4.570% due 07/03/2023	$	66		66
DBS Bank Ltd.				
4.570% due 07/03/2023		52		52
DnB Bank ASA				
2.470% due 07/03/2023	SEK	18		2
3.020% due 07/03/2023	AUD	64		43
HSBC Bank				
3.050% due 07/03/2023	SGD	1		1
3.720% due 07/03/2023	HKD	117		15
HSBC Bank PLC				
2.620% due 07/03/2023	EUR	98		107
4.170% due 07/03/2023	GBP	17		22
JPMorgan Chase Bank N.A.				
4.570% due 07/03/2023	$	51		51
MUFG Bank Ltd.				
(0.370%) due 07/03/2023	¥	16		0
Royal Bank of Canada				
3.790% due 07/04/2023	CAD	21		16
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
(0.370%) due 07/03/2023	¥	159		1
2.620% due 07/03/2023	EUR	15		17
4.170% due 07/03/2023	GBP	45		57
4.570% due 07/03/2023	$	101		101
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
(0.370%) due 07/03/2023	¥	41		0
2.620% due 07/03/2023	EUR	25		27
4.170% due 07/03/2023	GBP	59		74
4.570% due 07/03/2023	$	118		118
				1,049
日本短期国債25.5%				
(0.244%) due 07/03/2023 (f)	¥	530,000		3,667
(0.200%) due 07/24/2023 (f)		160,000		1,107
(0.200%) due 07/18/2023 (g)		84,000		581
(0.196%) due 09/11/2023 (g)		953,000		6,595
(0.193%) due 08/14/2023 (g)		630,000		4,360
(0.192%) due 07/31/2023 (g)		27,000		187
(0.186%) due 08/28/2023 (g)		560,000		3,875
(0.183%) due 08/21/2023 (f)		420,000		2,906
(0.182%) due 09/04/2023 (f)		396,000		2,741
(0.150%) due 09/25/2023 (f)		690,000		4,775
(0.143%) due 10/02/2023 (d)(g)		530,000		3,668
				34,462
短期金融商品合計 **（取得原価＄51,337）**				**49,849**
投資有価証券合計128.9% **（取得原価＄185,363）**			**$**	**174,375**
金融デリバティブ商品(j)(l) 0.2% **（取得原価あるいはプレミアム（純額）＄(18)）**				**324**
その他の資産および負債（純額）(29.1%)				**(39,447)**
純資産100.0%			**$**	**135,252**

投資明細表に対する注記：
***　残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。**
(a)　個発転換社債

(b) 永久債（記載日は次回の契約上の償還日）である。
(c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
(d) 発行日前取引証券
(e) 当有価証券の元本金額は、インフレの状況にあわせて調整される。
(f) クーポンは最終利回りである。
(g) クーポンは加重平均最終利回りである。

(h) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価額の対純資産比率
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/27/2021	$ 571	$ 473	0.35%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	07/27/2021	111	76	0.06%
制限証券合計				**$ 682**	**$ 549**	**0.41%**

借入およびその他の金融取引

(i) レポ契約：

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受入担保（公正価値）	レポ契約（公正価値）	レポ契約に係る未収金(1)
BPS	5.160%	06/30/2023	07/03/2023	$ 11,300	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0.125% due 07/15/2031	$ (11,585)	$ 11,300	$ 11,305
レポ契約合計						**$ (11,585)**	**$ 11,300**	**$ 11,305**

売建有価証券：

取引相手	種別	クーポン	満期日	元本金額	手取金	売建に係る未払金
MSC	Fannie Mae, TBA	2.000%	08/01/2053	$ 4,440	$ (3,643)	$ (3,627)
売建有価証券合計 (2.7%)					$ (3,643)	**$ (3,627)**

借入およびその他の金融取引要約

以下は、2023年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	レポ契約に係る未収金	リバース・レポ契約に係る未払金	セール・バイバック取引に係る未払金	売建に係る未払金	借入およびその他の金融取引合計	差入（受入）担保	ネット・エクスポージャー(2)
グローバル／マスター・レポ契約							
BPS	$ 11,305	$ 0	$ 0	$ 0	$ 11,305	$ (11,585)	$ (280)
マスター有価証券先渡取引契約書							
MSC	0	0	0	(3,627)	(3,627)	0	(3,627)
借入およびその他の金融取引合計	**$ 11,305**	**$ 0**	**$ 0**	**$ (3,627)**			

(1) 未収利息を含む。
(2) ネット・エクスポージャーはデフォルト発生時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引から発生するエクスポージャーは、同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

2023年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は$99で、加重平均金利は1.026%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(j) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

売建オプション：

上場先物契約に係るオプション

詳細		権利行使価格	満期日	契約数	プレミアム（受取額）		市場価格
Call - U.S. Treasury Bond August 2023 Futures	$	131.000	07/21/2023	1	$ (1)	$	0
Put - U.S. Treasury Bond August 2023 Futures		123.000	07/21/2023	1	0		0
売建オプション合計					**$ (1)**	**$**	**0**

先物契約：

詳細	種類	限月	契約数	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
3-Month SOFR December Futures	売建	03/2024	46	$ 108	$ 0	$ (67)
Australia Government 3-Year Bond September Futures	売建	09/2023	37	15	13	0
Australia Government 10-Year Bond September Futures	売建	09/2023	14	5	13	0
Canada Government 10-Year Bond September Futures	買建	09/2023	17	(23)	12	0
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	売建	09/2023	54	44	30	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	買建	09/2023	3	3	0	(3)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	売建	09/2023	18	25	15	0
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	買建	09/2023	2	4	0	(2)
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	売建	09/2023	8	6	8	0
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	売建	09/2023	2	0	19	0
Japan Government 10-Year Bond September Futures	売建	09/2023	1	(4)	0	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	売建	09/2023	22	65	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	買建	09/2023	11	(23)	1	0
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	買建	09/2023	52	(97)	30	0
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	売建	09/2023	2	1	0	(2)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	売建	09/2023	21	28	0	(8)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	売建	09/2023	1	0	0	(2)
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September Futures	買建	09/2023	10	(11)	0	(9)
先物契約合計				**$ 146**	**$ 141**	**$ (93)**

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの売り(1)

参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・クレジット・スプレッド（2023年6月30日現在）(3)		想定元本(4)	市場価格	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	0.744%	$	100	$ 1	$ (1)	$ 0	$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2028	0.962%		100	0	1	0	0
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	1.224%	EUR	100	(1)	1	0	0
						$ 0	$ 1	$ 0	$ 0

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの買い(2)

指数／トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本(4)	市場価格(5)	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
CDX.IG-40 Index	(1.000%)	06/20/2033	$ 1,400	$ 5	$ (14)	$ 0	$ (5)

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの売り(1)

	変動証拠金

指数／トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本(4)	市場価格(5)	未実現評価（損）益	資産	負債
CDX.IG-40 Index	1.000%	06/20/2028	$ 13,200	$ 201	$ 92	$ 17	$ 0

金利スワップ

変動金利支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日		想定元本	市場価格	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
支払	3-Month Canadian Bank Bill	0.900%	03/10/2024	CAD	600	$ (20)	$ (20)	$ 0	$ 0
支払	3-Month Canadian Bank Bill	1.900%	12/18/2029		2,000	(174)	(137)	10	0
支払	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	12/18/2049		350	(66)	(53)	4	0
支払	3-Month Canadian Bank Bill	1.750%	06/17/2050		20	(5)	(6)	0	0
支払	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.000%	06/14/2024	NZD	10,600	(115)	(98)	0	(2)
支払	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024		2,800	(109)	(49)	0	0
支払	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	3.750%	06/15/2027		900	(22)	(16)	0	(1)
受取	3-Month THOR	2.000%	03/15/2025	THB	94,240	14	14	14	0
支払	3-Month THOR	2.750%	03/15/2033		12,440	2	(4)	0	(3)
支払	3-Month USD-LIBOR	1.665%	07/12/2023	$	1,900	(7)	(7)	0	0
支払	3-Month USD-LIBOR	0.000%	08/04/2023		12,700	(174)	(174)	0	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.500%	09/21/2023		2,400	25	24	0	(1)
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	AUD	400	(45)	(45)	0	(2)
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032		200	(23)	(5)	0	(1)
支払(6)	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	09/15/2032		600	(4)	(3)	0	(2)
支払(6)	6-Month Australian Bank Bill	4.500%	09/15/2032		7,000	5	29	0	(22)
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.000%	06/21/2033		3,000	(69)	(47)	0	(20)
支払	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	EUR	200	(10)	(10)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	0.500%	12/15/2026		460	(48)	(64)	0	(2)
支払(6)	6-Month EURIBOR	3.000%	03/19/2027		6,290	(1)	(34)	0	(14)
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027		1,050	(118)	(106)	0	(4)
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027		800	(89)	(81)	0	(3)
支払(6)	6-Month EURIBOR	3.000%	09/20/2028		15,800	(162)	21	0	(77)
支払	6-Month EURIBOR	2.547%	03/09/2033		550	(24)	(24)	0	(3)
支払	6-Month EURIBOR	1.750%	03/15/2033		100	(11)	(1)	0	(1)
受取(6)	6-Month EURIBOR	3.000%	03/15/2033		2,800	(37)	(15)	5	0
支払	6-Month EURIBOR	(0.175%)	03/17/2033		900	(269)	(269)	0	(5)
支払(6)	6-Month EURIBOR	3.000%	09/20/2033		11,400	19	79	0	(72)
受取	6-Month EURIBOR	0.000%	03/17/2053		300	171	171	1	0
受取(6)	6-Month EURIBOR	2.500%	09/20/2053		2,200	6	(69)	17	0
受取(6)	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.850%	09/20/2033	¥	570,000	(90)	(15)	8	0
支払(6)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	05/10/2025	CAD	19,700	(147)	(85)	15	0
支払	Euro Short-Term Rate	2.750%	06/21/2024	EUR	6,100	(70)	(70)	0	(2)
支払	IBMEXID	8.450%	01/24/2028	MXN	6,900	0	0	0	0
支払	IBMEXID	5.970%	05/06/2030		2,800	(19)	(16)	0	(1)
支払	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.500%	09/21/2027	KRW	4,454,900	(5)	12	0	(8)
受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.250%	03/15/2033		1,167,010	13	5	3	0
受取(6)	KRW-CD -KSDA-Bloomberg	3.250%	09/20/2033		523,170	5	1	2	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.000%	08/04/2023	$	12,700	175	175	0	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.270%	11/04/2023		12,700	(276)	(276)	1	0
受取(6)	Secured Overnight Financing Rate	1.500%	06/21/2024		2,400	71	144	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.050%	12/15/2024		1,000	76	42	0	0
受取(6)	Secured Overnight Financing Rate	3.200%	05/10/2025		15,300	170	32	0	(3)
受取(6)	Secured Overnight Financing Rate	4.250%	12/20/2025		6,800	13	28	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.196%	02/28/2027		3,250	125	125	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2027		1,300	112	24	0	(6)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	03/10/2028		1,400	15	38	0	(1)

支払[6]	Secured Overnight Financing Rate	1.665%	01/12/2029		1,900	(226)	(226)	1	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029		800	(119)	(46)	1	0
支払[6]	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2030		2,300	(4)	(25)	3	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.750%	09/21/2032		1,500	115	75	0	(3)
受取[6]	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033		1,000	(5)	5	0	(3)
支払	Singapore Overnight Index Average	3.000%	06/15/2027	SGD	1,100	(12)	(22)	0	(2)
受取	Singapore Overnight Index Average	3.000%	12/21/2032		300	3	6	1	0
支払[6]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.500%	09/20/2033	GBP	1,500	(121)	(87)	0	(13)
支払[6]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.250%	09/20/2053		200	(24)	(18)	0	(2)
支払	Swiss Overnight Rate Average	(0.500%)	09/15/2026	CHF	1,300	(125)	(13)	0	(12)
						$ (1,710)	$ (1,186)	$ 86	$ (293)
スワップ契約合計						**$ (1,504)**	**$ (1,107)**	**$ 103**	**$ (298)**

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2023年6月30日現在の上場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

(k) 2023年6月30日現在、合計市場価格＄19の有価証券と＄2,804の現金が上場および中央清算金融デリバティブ商品の担保として差し入れられている。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	市場価格 買建オプション	変動証拠金資産 先物	スワップ契約	合計	市場価格 売建オプション	変動証拠金負債 先物	スワップ契約	合計
上場または中央清算	$ 0	$ 141	$ 103	$ 244	$ 0	$ (93)	$ (298)	$ (391)

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
(2) ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）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額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または(ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。
(3) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建／売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(4) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
(5) クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済／売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務（または利益）の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(6) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(l) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨		受取通貨		未実現評価（損）益	
						資産	負債
AZD	07/2023	AUD	56	$	36	$ 0	$ (1)
AZD	07/2023	$	80	AUD	120	0	0
AZD	08/2023	AUD	120	$	80	0	0
BOA	07/2023	$	390	MXN	7,174	27	0
BOA	07/2023		42	NZD	69	0	0
BOA	08/2023	EUR	188	$	206	1	0
BOA	08/2023	JPY	109,192		792	30	0
BOA	08/2023	$	12	CAD	16	0	0
BOA	08/2023		1,298	CNY	8,907	0	(65)
BOA	09/2023	KRW	1,090,744	$	850	19	0
BOA	09/2023	TWD	5,199		171	4	0
BOA	09/2023	$	240	IDR	3,587,141	0	(1)
BOA	09/2023		353	INR	29,226	2	0
BPS	07/2023	AUD	57	$	38	0	0
BPS	07/2023	$	57	AUD	86	0	0
BPS	07/2023		121	CZK	2,605	0	(2)
BPS	07/2023		2,234	JPY	310,488	0	(86)
BPS	08/2023	AUD	86	$	57	0	0
BPS	08/2023	CNY	468		66	1	0
BPS	08/2023	EUR	169		183	0	(1)
BPS	08/2023	TWD	2,602		85	2	0
BPS	08/2023	$	28	AUD	43	1	0
BPS	08/2023		716	CNH	4,944	0	(34)
BPS	08/2023		1,601	CNY	10,956	0	(85)
BPS	08/2023		598	EUR	547	0	0
BPS	08/2023		1,386	JPY	199,434	1	0
BPS	08/2023		28	TWD	855	0	(1)
BPS	09/2023	THB	2	$	0	0	0
BPS	09/2023	$	27	IDR	403,191	0	0
BRC	07/2023	JPY	530,000	$	4,119	452	0
BRC	07/2023		84,000		649	67	0
BRC	07/2023	PHP	22,042		392	0	(6)
BRC	07/2023	$	1,034	MYR	4,745	0	(16)
BRC	07/2023		124	RON	560	0	(1)
BRC	08/2023	GBP	94	$	117	0	(2)
BRC	08/2023	$	155	COP	658,934	1	0
BRC	08/2023		259	EUR	239	2	0
BRC	09/2023	JPY	396,000	$	2,893	126	0
BRC	09/2023	PHP	37,125		662	0	(8)
BRC	09/2023	$	12	COP	51,396	0	0
BRC	09/2023		58	ILS	208	0	(2)
BRC	10/2023	JPY	530,000	$	3,711	0	(8)
CBK	07/2023	$	107	CZK	2,299	0	(1)
CBK	08/2023	AUD	14	$	9	0	0
CBK	08/2023	CAD	93		71	0	0
CBK	08/2023	CNY	1,001		140	1	0
CBK	08/2023	DKK	32,100		4,637	0	(80)
CBK	08/2023	EUR	899		983	0	0
CBK	08/2023	GBP	344		427	0	(10)
CBK	08/2023	JPY	60,808		441	17	0
CBK	08/2023	TWD	2,504		82	2	0
CBK	08/2023	$	1,347	CAD	1,797	11	0
CBK	08/2023		65	CLP	53,023	1	0
CBK	08/2023		355	CNY	2,483	0	(12)
CBK	08/2023		266	EUR	248	5	0
CBK	08/2023		369	NOK	3,854	0	(9)
CBK	08/2023		584	SEK	5,925	0	(35)
CBK	09/2023	KRW	64,315	$	49	0	0
CBK	09/2023	$	4	KRW	4,789	0	0
DUB	08/2023	CNH	4,962	$	723	38	0
DUB	08/2023	$	73	DKK	500	0	0
FAR	07/2023		25	CLP	19,965	0	0
GLM	07/2023	NZD	847	AUD	778	0	(1)
GLM	08/2023	CNH	2,429	$	348	13	0
GLM	08/2023	$	314	CHF	278	0	(2)
GLM	08/2023		162	NOK	1,723	0	(1)
GLM	09/2023		358	THB	12,331	0	(7)
IND	08/2023	CNH	326	$	47	2	0
IND	08/2023	JPY	390,000		2,834	112	0
IND	08/2023	$	417	NOK	4,372	0	(8)
JPM	07/2023	JPY	36,782	EUR	247	15	0
JPM	07/2023		103,658	$	725	8	0
JPM	07/2023	KRW	1,206,363		943	27	0
JPM	07/2023	SGD	21		16	0	0
JPM	08/2023	CNH	8,072		1,132	19	0
JPM	08/2023	$	2,209	CAD	2,953	24	0
JPM	08/2023		473	CHF	416	0	(6)
JPM	08/2023		574	CNH	3,969	0	(27)
JPM	08/2023		1,483	CNY	10,142	0	(80)
JPM	08/2023		106	EUR	97	0	0
JPM	08/2023		297	GBP	234	1	0
JPM	08/2023		67	HUF	23,375	1	0
JPM	08/2023		725	JPY	103,218	0	(7)
JPM	08/2023		60	NOK	636	0	(1)
JPM	09/2023		100	IDR	1,500,538	0	0
JPM	09/2023		1		7,881	0	0
JPM	09/2023		56	ILS	200	0	(2)
JPM	09/2023		85	PEN	314	1	0
JPM	09/2023		340	THB	11,661	0	(9)
JPM	12/2023		676	INR	55,784	0	0

MBC	07/2023	JPY	160,000	$	1,225	115		0
MBC	07/2023		6,100		43	1		0
MBC	08/2023	CAD	96		72	0		(1)
MBC	08/2023	CNH	2,104		302	12		0
MBC	08/2023	CNY	468		66	1		0
MBC	08/2023	JPY	420,000		3,074	146		0
MBC	08/2023	TWD	249		8	0		0
MBC	08/2023	$	25,199	EUR	22,836	0		(230)
MBC	09/2023	JPY	953,000	$	6,942	277		0
MBC	09/2023	KRW	905,698		710	20		0
MYI	07/2023	IDR	945,619		63	0		0
MYI	07/2023	PLN	28		7	0		0
MYI	07/2023	$	63	IDR	945,619	0		0
MYI	07/2023		327	MYR	1,506	0		(4)
MYI	08/2023	AUD	152	$	101	0		0
MYI	08/2023	CAD	93		70	0		0
MYI	08/2023	CHF	13		15	0		0
MYI	08/2023	CNH	529		73	0		0
MYI	08/2023	DKK	104		15	0		0
MYI	08/2023	EUR	1,672		1,809	0		(19)
MYI	08/2023	GBP	52		66	0		0
MYI	08/2023	NOK	782		73	0		0
MYI	08/2023	NZD	9		6	0		0
MYI	08/2023	SEK	188		17	0		0
MYI	08/2023	TWD	17,061		560	12		0
MYI	08/2023	$	83	CAD	113	2		0
MYI	08/2023		28	CHF	25	0		0
MYI	08/2023		42	DKK	289	1		0
MYI	08/2023		121	EUR	111	0		0
MYI	08/2023		28	JPY	3,866	0		(1)
MYI	08/2023		117		16,775	0		0
MYI	08/2023		112	NOK	1,244	4		0
MYI	08/2023		14	SEK	151	0		0
MYI	09/2023	KRW	1,017,857	$	795	20		0
MYI	09/2023	MXN	104		6	0		0
MYI	09/2023	$	63	IDR	946,441	0		0
MYI	09/2023		15		221,852	0		0
MYI	09/2023		155	THB	5,316	0		(4)
NGF	08/2023		884	CNH	6,067	0		(47)
NGF	09/2023	SGD	704	$	528	7		0
RBC	08/2023	$	57	GBP	45	0		0
RBC	08/2023		87	MXN	1,516	0		0
SCX	07/2023		117	AUD	177	0		0
SCX	07/2023		110	NZD	181	1		0
SCX	08/2023	AUD	177	$	117	0		0
SCX	08/2023	CNY	305		43	1		0
SCX	08/2023	TWD	11,243		368	7		0
SCX	08/2023	$	273	CNH	1,881	0		(14)
SCX	08/2023		3,945	CNY	26,930	0		(218)
SCX	09/2023	TWD	4,368	$	143	3		0
SCX	09/2023	$	46	IDR	684,986	0		0
SCX	09/2023		525		7,804,101	0		(6)
SCX	09/2023		349	THB	12,068	0		(6)
SOG	07/2023	AUD	367	$	240	0		(4)
SOG	07/2023	$	278	PLN	1,198	17		0
SOG	07/2023		140	SGD	185	0		(3)
SSB	07/2023	CLP	19,994	$	25	0		0
SSB	07/2023	JPY	27,000		205	17		0
SSB	08/2023		630,000		4,746	359		0
SSB	08/2023	$	25	CLP	20,052	0		0
TOR	07/2023	AUD	194	$	127	0		(2)
TOR	07/2023	NZD	250		152	0		(1)
TOR	07/2023	$	144	AUD	217	1		0
TOR	08/2023	AUD	217	$	144	0		(1)
TOR	08/2023	$	42	HUF	14,805	0		0
TOR	08/2023		152	NZD	250	1		0
TOR	09/2023	JPY	690,000	$	4,897	60		0
UAG	07/2023	AUD	44		29	0		0
UAG	07/2023	$	69	AUD	105	0		0
UAG	08/2023	AUD	105	$	69	0		0
UAG	08/2023	CAD	66		49	0		(1)
UAG	08/2023	$	259	GBP	205	2		0
UAG	09/2023	SGD	205	$	154	1		0
UAG	09/2023	$	48	ILS	173	0		(2)
UAG	09/2023		334	INR	27,648	2		0
						$ 2,124	$	(1,181)

Cクラス（日本円、為替ヘッジあり）の外国為替先渡契約残高：

						未実現評価（損）益	
取引相手	決済月		引渡通貨		受取通貨	資産	負債
BOA	07/2023	AUD	76	$	49	$ 0	$ (1)
BOA	07/2023	CAD	487		358	0	(10)
BOA	07/2023	CLP	5,630		7	0	0
BOA	07/2023	COP	45,955		10	0	(1)
BOA	07/2023	DKK	40		6	0	0
BOA	07/2023	HUF	2,798		8	0	0
BOA	07/2023	JPY	4,446		32	1	0
BOA	07/2023	KRW	645		0	0	0
BOA	07/2023	NOK	53		5	0	0
BOA	07/2023	NZD	7		4	0	0
BOA	07/2023	PEN	25		7	0	0
BOA	07/2023	SEK	10		1	0	0
BOA	07/2023	$	3	AUD	4	0	0

BOA	07/2023		7	CLP	5,630	0	0
BOA	07/2023		11	COP	45,955	0	0
BOA	07/2023		11	DKK	73	0	0
BOA	07/2023		5	EUR	5	0	0
BOA	07/2023		3	JPY	439	0	0
BOA	07/2023		7	PEN	25	0	0
BOA	07/2023		19	PLN	79	0	0
BOA	07/2023		47	SEK	505	0	0
BOA	07/2023		0	SGD	0	0	0
BOA	08/2023	CLP	5,630	$	7	0	0
BOA	08/2023	DKK	73		11	0	0
BOA	08/2023	PEN	25		7	0	0
BOA	08/2023	PLN	79		19	0	0
BOA	08/2023	SEK	505		47	0	0
BOA	08/2023	SGD	0		0	0	0
BPS	07/2023	CZK	310		14	0	0
BPS	07/2023	DKK	0		0	0	0
BPS	07/2023	JPY	48,912		339	1	0
BPS	07/2023		3,320		23	0	0
BPS	07/2023	NZD	1		0	0	0
BPS	07/2023	$	35	AUD	53	0	0
BPS	07/2023		60	CHF	54	0	0
BPS	07/2023		385	CNY	2,777	0	(2)
BPS	07/2023		2,623	EUR	2,394	0	(11)
BPS	07/2023		23	JPY	3,320	0	0
BPS	07/2023		3,482		483,803	0	(135)
BPS	07/2023		1	NOK	13	0	0
BPS	08/2023	AUD	28	$	19	0	0
BPS	08/2023	CHF	53		60	0	0
BPS	08/2023	CNY	2,666		370	1	0
BPS	08/2023	EUR	2,302		2,526	11	0
BPS	08/2023	NOK	13		1	0	0
BPS	08/2023	$	11	CNY	77	0	0
BPS	08/2023		331	JPY	47,599	0	0
BRC	07/2023	PLN	79	$	19	0	(1)
BRC	07/2023	$	1	JPY	110	0	0
BRC	07/2023		136	KRW	179,132	0	0
BRC	08/2023	KRW	178,907	$	136	0	0
CBK	07/2023	JPY	772		5	0	0
CBK	07/2023	MXN	748		42	0	(2)
CBK	07/2023	NOK	5		0	0	0
CBK	07/2023	$	20	CNY	144	0	0
CBK	07/2023		89	EUR	82	1	0
CBK	07/2023		43	MXN	745	0	0
CBK	08/2023	MXN	745	$	43	0	0
GLM	07/2023	COP	45,955		11	0	0
GLM	07/2023	MYR	204		46	2	0
GLM	07/2023	$	11	COP	45,955	0	0
GLM	07/2023		7	NOK	80	0	0
GLM	08/2023	COP	45,955	$	11	0	0
GLM	08/2023	NOK	80		7	0	0
IND	07/2023	DKK	119		17	0	0
IND	07/2023	$	2	CHF	1	0	0
IND	08/2023	CHF	1	$	2	0	0
JPM	07/2023	JPY	68,810		477	1	0
JPM	07/2023	$	1	SGD	2	0	0
JPM	08/2023	SGD	2	$	1	0	0
JPM	08/2023	$	477	JPY	68,520	0	(1)
MBC	07/2023	CNY	22	$	3	0	0
MBC	07/2023	GBP	402		498	0	(14)
MBC	07/2023	JPY	601,535		4,169	7	0
MBC	07/2023	SGD	32		24	0	0
MBC	07/2023	$	31	CAD	41	1	0
MBC	07/2023		6	EUR	6	0	0
MBC	07/2023		42	GBP	34	1	0
MBC	07/2023		1,249	JPY	173,638	0	(48)
MBC	08/2023		3,970		570,863	0	(2)
MYI	07/2023	CHF	1	$	1	0	0
MYI	07/2023	ILS	57		15	0	0
MYI	07/2023	JPY	3,583		25	0	0
MYI	07/2023	KRW	317		0	0	0
MYI	07/2023	SEK	495		46	0	0
MYI	07/2023	$	22	CAD	29	0	0
MYI	07/2023		14	CZK	310	0	0
MYI	07/2023		10	DKK	65	0	0
MYI	07/2023		21	GBP	17	0	0
MYI	07/2023		60	IDR	901,800	0	0
MYI	07/2023		3,008	JPY	417,688	0	(119)
MYI	07/2023		44	MYR	204	0	0
MYI	07/2023		25	SGD	34	0	0
MYI	08/2023	CZK	311	$	14	0	0
MYI	08/2023	DKK	65		10	0	0
MYI	08/2023	IDR	902,141		60	0	0
MYI	08/2023	MYR	204		44	0	0
MYI	08/2023	SGD	34		25	0	0
MYI	08/2023	$	0	KRW	317	0	0
RBC	07/2023		5	CAD	6	0	0
RBC	07/2023		3,008	JPY	417,688	0	(118)
SCX	07/2023	AUD	72	$	47	0	(1)
SCX	07/2023	CHF	52		58	0	0
SCX	07/2023	NZD	19		12	0	0
SCX	07/2023	$	38	AUD	58	0	0
SCX	07/2023		1	CNY	7	0	0
SCX	07/2023		0	IDR	1,273	0	0
SCX	07/2023		4	JPY	488	0	0
SCX	08/2023	AUD	58	$	38	0	0

SCX	08/2023	CNY	7		1	0		0
SOG	07/2023	AUD	81		53	0		(1)
SOG	07/2023	EUR	2,463		2,650	0		(38)
SOG	07/2023	HKD	15		2	0		0
SOG	07/2023	IDR	4,723		0	0		0
SOG	07/2023	$	41	CNY	294	0		0
SOG	08/2023		0	IDR	4,725	0		0
TOR	07/2023	AUD	43	$	28	0		(1)
TOR	07/2023	JPY	483,704		3,359	12		0
TOR	07/2023	$	47	AUD	71	0		0
TOR	07/2023		332	CAD	439	0		0
TOR	07/2023		468	GBP	369	0		0
TOR	07/2023		8	HUF	2,804	0		0
TOR	07/2023		16	NZD	27	0		0
TOR	08/2023	AUD	71	$	47	0		0
TOR	08/2023	CAD	439		332	0		0
TOR	08/2023	GBP	369		468	0		0
TOR	08/2023	HUF	2,825		8	0		0
TOR	08/2023	NZD	27		16	0		0
TOR	08/2023	$	3,359	JPY	481,653	0		(11)
UAG	07/2023	AUD	15	$	10	0		0
UAG	07/2023	CHF	3		4	0		0
UAG	07/2023	CNY	3,200		455	14		0
UAG	07/2023	CZK	0		0	0		0
UAG	07/2023	IDR	898,375		60	0		0
UAG	07/2023	JPY	285,575		1,980	4		0
UAG	07/2023	KRW	194,217		147	0		0
UAG	07/2023	NOK	39		4	0		0
UAG	07/2023	SGD	3		2	0		0
UAG	07/2023	$	67	AUD	100	0		0
UAG	07/2023		1	CHF	1	0		0
UAG	07/2023		3	DKK	21	0		0
UAG	07/2023		16	ILS	57	0		0
UAG	07/2023		12	KRW	16,046	0		0
UAG	07/2023		0	MXN	3	0		0
UAG	08/2023	AUD	100	$	67	0		0
UAG	08/2023	CHF	1		1	0		0
UAG	08/2023	CNY	4,575		665	32		0
UAG	08/2023	DKK	21		3	0		0
UAG	08/2023	ILS	57		16	0		0
UAG	08/2023	$	1,980	JPY	284,372	0		(3)
						$ 89	$	(520)
外国為替先渡契約合計						**$ 2,213**	**$**	**(1,701)**

売建オプション：

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払／受取	行使レート	満期日	想定元本(1)	プレミアム（受取額）	市場価格
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.200%	07/06/2023	100	$ 0	$ 0
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	07/06/2023	100	0	0
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.300%	07/10/2023	105	(1)	0
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.250%	07/20/2023	200	(1)	0
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	07/10/2023	105	(1)	0
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	07/20/2023	200	(1)	(1)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.200%	07/06/2023	100	0	0
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.300%	07/10/2023	105	0	0
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.270%	07/24/2023	400	(1)	(1)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.650%	07/06/2023	100	0	0
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.750%	07/10/2023	105	(1)	0
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.670%	07/24/2023	400	(1)	(2)
NGF	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.270%	07/24/2023	400	(1)	(1)

NGF	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	3.670%	07/24/2023	400	(1)	(2)
売建オプション合計							$ (9)	$ (7)

スワップ契約：

金利スワップ

取引相手	変動金利支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日		想定元本	プレミアム支払額／（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
BOA	受取	3-Month MYR-KLIBOR	4.000%	06/15/2027	MYR	11,000	$ (6)	$ (26)	$ 0	$ (32)
MYC	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	12/21/2027		2,400	(2)	0	0	(2)
スワップ契約合計							$ (8)	$ (26)	$ 0	$ (34)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2023年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債						
取引相手	外国為替先渡契約	買建オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替先渡契約	売建オプション	スワップ契約	店頭合計	店頭デリバティブの純市場価格	差入（受取）担保	ネット・エクスポージャー(2)
AZD	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (1)	$ 0	$ 0	$ (1)	$ (1)	$ 0	$ (1)
BOA	84	0	0	84	(78)	0	(32)	(110)	(26)	0	(26)
BPS	18	0	0	18	(357)	0	0	(357)	(339)	0	(339)
BRC	648	0	0	648	(44)	0	0	(44)	604	(380)	224
CBK	38	0	0	38	(149)	0	0	(149)	(111)	0	(111)
DUB	38	0	0	38	0	0	0	0	38	0	38
FAR	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
GLM	15	0	0	15	(11)	0	0	(11)	4	0	4
IND	114	0	0	114	(8)	0	0	(8)	106	0	106
JPM	97	0	0	97	(133)	(1)	0	(134)	(37)	0	(37)
MBC	581	0	0	581	(295)	0	0	(295)	286	(210)	76
MYC	0	0	0	0	0	(3)	(2)	(5)	(5)	0	(5)
MYI	39	0	0	39	(147)	0	0	(147)	(108)	0	(108)
NGF	7	0	0	7	(47)	(3)	0	(50)	(43)	0	(43)
RBC	0	0	0	0	(118)	0	0	(118)	(118)	0	(118)
SCX	12	0	0	12	(245)	0	0	(245)	(233)	0	(233)
SOG	17	0	0	17	(46)	0	0	(46)	(29)	0	(29)
SSB	376	0	0	376	0	0	0	0	376	(330)	46
TOR	74	0	0	74	(16)	0	0	(16)	58	0	58
UAG	55	0	0	55	(6)	0	0	(6)	49	0	49
店頭合計	$ 2,213	$ 0	$ 0	$ 2,213	$ (1,701)	$ (7)	$ (34)	$ (1,742)			

(1)　想定元本は契約件数を表す。
(2)　ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2023年6月30日現在）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品 － 資産						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 141	$ 141
スワップ契約	0	17	0	0	86	103
	$ 0	$ 17	$ 0	$ 0	$ 227	$ 244

店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 2,213	$ 0	$ 2,213
	$ 0	$ 17	$ 0	$ 2,213	$ 227	$ 2,457
金融デリバティブ商品 － 負債						
上場または中央清算						
売建オプション	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
先物	0	0	0	0	(93)	(93)
スワップ契約	0	(5)	0	0	(293)	(298)
	$ 0	$ (5)	$ 0	$ 0	$ (386)	$ (391)
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (1,701)	$ 0	$ (1,701)
売建オプション	0	0	0	0	(7)	(7)
スワップ契約	0	0	0	0	(34)	(34)
	$ 0	$ 0	$ 0	$ (1,701)	$ (41)	$ (1,742)
	$ 0	$ (5)	$ 0	$ (1,701)	$ (427)	$ (2,133)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2023年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品に係る実現純利益（損失）						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (16)	$ (16)
売建オプション	0	0	0	0	19	19
スワップ契約	0	20	0	0	(2,817)	(2,797)
	$ 0	$ 20	$ 0	$ 0	$ (2,814)	$ (2,794)
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 2,646	$ 0	$ 2,646
買建オプション	0	0	0	14	(77)	(63)
売建オプション	0	3	0	4	203	210
スワップ契約	0	16	0	0	(86)	(70)
	$ 0	$ 19	$ 0	$ 2,664	$ 40	$ 2,723
	$ 0	$ 39	$ 0	$ 2,664	$ (2,774)	$ (71)
金融デリバティブ商品に係る未実現評価（損）益の純変動額						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 300	$ 300
売建オプション	0	0	0	0	1	1
スワップ契約	0	279	0	0	562	841
	$ 0	$ 279	$ 0	$ 0	$ 863	$ 1,142
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (624)	$ 0	$ (624)
買建オプション	0	0	0	(2)	(113)	(115)
売建オプション	0	(1)	0	0	448	447
スワップ契約	0	(12)	0	0	(5)	(17)
	$ 0	$ (13)	$ 0	$ (626)	$ 330	$ (309)
	$ 0	$ 266	$ 0	$ (626)	$ 1,193	$ 833

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2023年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値（2023/06/30現在）
投資有価証券（公正価値）				
オーストラリア				
社債等	$ 0	$ 83	$ 0	$ 83
モーゲージ証券	0	1,769	0	1,769
ソブリン債	0	1,785	0	1,785
バミューダ				
社債等	0	97	0	97
カナダ				
ソブリン債	0	669	0	669
ケイマン諸島				
資産担保証券	0	2,778	0	2,778
社債等	0	550	0	550
チリ				
ソブリン債	0	259	0	259
中国				
ソブリン債	0	4,844	0	4,844
デンマーク				
社債等	0	4,916	0	4,916
フランス				
社債等	0	985	0	985
ソブリン債	0	944	0	944
ドイツ				
社債等	0	664	0	664
ハンガリー				
ソブリン債	0	86	0	86
インドネシア				
ソブリン債	0	199	0	199
アイルランド				
資産担保証券	0	4,726	0	4,726
社債等	0	179	0	179
イスラエル				

ソブリン債		0		151		0		151
イタリア								
社債等		0		109		0		109
ソブリン債		0		1,993		0		1,993
日本								
社債等		0		1,767		0		1,767
マレーシア								
ソブリン債		0		263		0		263
メキシコ								
ソブリン債		0		211		0		211
多国籍								
社債等		0		388		0		388
オランダ								
社債等		0		533		0		533
モーゲージ証券		0		79		0		79
ノルウェー								
ソブリン債		0		54		0		54
カタール								
社債等		0		230		0		230
ソブリン債		0		191		0		191
ルーマニア								
ソブリン債		0		564		0		564
サウジアラビア								
社債等		0		333		0		333
ソブリン債		0		500		0		500
シンガポール								
ソブリン債		0		214		0		214
韓国								
ソブリン債		0		4,884		0		4,884
スペイン								
ソブリン債		0		1,293		0		1,293
国際機関								
ソブリン債		0		332		0		332
スイス								
社債等		0		1,544		0		1,544
アラブ首長国連邦								
社債等		0		191		0		191
ソブリン債		0		337		0		337
英国								
社債等		0		3,534		0		3,534
モーゲージ証券		0		3,879		0		3,879
ソブリン債		0		2,180		0		2,180
米国								
資産担保証券		0		2,483		0		2,483
社債等		0		9,270		0		9,270
モーゲージ証券		0		2,649		142		2,791
地方債		0		318		0		318
米国政府機関債		0		39,100		0		39,100
米国財務省証券		0		19,277		0		19,277
短期金融商品		0		49,849		0		49,849
投資合計	$ 0	$	174,233	$	142	$	174,375	
売建有価証券（公正価値）	**$ 0**	**$**	**(3,627)**	**$**	**0**	**$**	**(3,627)**	
金融デリバティブ商品 － 資産								
上場または中央清算	110		134		0		244	
店頭	0		2,213		0		2,213	
	$ 110	$	2,347	$	0	$	2,457	
金融デリバティブ商品 － 負債								
上場または中央清算	(72)		(319)		0		(391)	
店頭	0		(1,742)		0		(1,742)	
	$ (72)	$	(2,061)	$	0	$	(2,133)	
合計	**$ 38**	**$**	**170,892**	**$**	**142**	**$**	**171,072**	

2023年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

投資明細表
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド
(金額の単位は千*、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)
2023年6月30日現在

		元本金額（単位：千）		評価額（単位：千）
投資有価証券97.7%				
ベルギー0.2%				
社債等0.2%				
Ontex Group NV				
3.500% due 07/15/2026	EUR	100	$	96
ベルギー合計（取得原価＄100）				**96**
バミューダ0.4%				
社債等0.4%				
NCL Corp. Ltd.				
5.875% due 02/15/2027	$	100		97
Valaris Ltd.				
8.375% due 04/30/2030		125		126
バミューダ合計				**223**

（取得原価＄225）			
カナダ3.8%			
社債等3.8%			
Air Canada			
3.875% due 08/15/2026		400	371
Bombardier, Inc.			
7.125% due 06/15/2026		500	497
Garda World Security Corp.			
6.000% due 06/01/2029		500	410
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.			
6.000% due 09/15/2028		75	64
Northriver Midstream Finance LP			
5.625% due 02/15/2026		250	234
Parkland Corp.			
4.625% due 05/01/2030		350	304
カナダ合計			**1,880**
（取得原価＄2,063）			
ケイマン諸島0.2%			
バンク・ローン債務0.2%			
AAdvantage Loyality IP Ltd.			
10.000% due 04/20/2028		100	102
ケイマン諸島合計			**102**
（取得原価＄103）			
チェコ共和国0.9%			
社債等0.9%			
EP Infrastructure A/S			
1.816% due 03/02/2031	EUR	600	460
チェコ共和国合計			**460**
（取得原価＄474）			
フランス5.8%			
社債等5.8%			
Accor S.A.			
2.625% due 01/30/2025 (a)		300	309
Altice France S.A.			
2.500% due 01/15/2025		235	238
5.125% due 01/15/2029	$	600	429
BNP Paribas S.A.			
7.750% due 08/16/2029 (a)(b)		200	194
CAB SELAS			
3.375% due 02/01/2028	EUR	200	178
Chrome Bidco SASU			
3.500% due 05/31/2028		300	276
Electricite de France S.A.			
6.000% due 01/29/2026 (a)	GBP	300	348
Eramet S.A.			
7.000% due 05/22/2028	EUR	100	112
Forvia			
2.750% due 02/15/2027		100	99
Iliad Holding SASU			
6.500% due 10/15/2026	$	325	307
Loxam SAS			
5.750% due 07/15/2027	EUR	100	100
Renault S.A.			
2.500% due 04/01/2028		100	97
Vallourec S.A.			
8.500% due 06/30/2026		200	219
フランス合計			**2,906**
（取得原価＄2,959）			
ドイツ4.5%			
社債等4.5%			
Bayer AG			
5.375% due 03/25/2082		300	304
Cheplapharm Arzneimittel GmbH			
3.500% due 02/11/2027		300	298
CT Investment GmbH			
5.500% due 04/15/2026		200	203
Deutsche Bank AG			
4.000% due 06/24/2032		200	192

IHO Verwaltungs GmbH (c)			
3.750% due 09/15/2026		100	102
8.750% due 05/15/2028		200	226
Nidda Healthcare Holding GmbH			
7.500% due 08/21/2026		400	436
Schaeffler AG			
3.375% due 10/12/2028		300	299
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH			
2.000% due 07/15/2025		200	208
ドイツ合計			**2,268**
（取得原価＄2,352）			
アイルランド0.4%			
社債等0.4%			
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC			
5.000% due 07/15/2028	$	200	175
アイルランド合計			**175**
（取得原価＄200）			
イタリア4.5%			
社債等4.5%			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
2.625% due 04/28/2025	EUR	200	205
6.750% due 03/02/2026		200	218
10.500% due 07/23/2029		200	217
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA			
5.625% due 08/01/2027		100	98
Inter Media & Communication SpA			
6.750% due 02/09/2027		100	106
Mundys SpA			
1.875% due 02/12/2028		300	280
Nexi SpA			
1.625% due 04/30/2026		160	159
2.125% due 04/30/2029		500	456
Telecom Italia SpA			
1.625% due 01/18/2029		200	168
6.875% due 02/15/2028		300	327
イタリア合計			**2,234**
（取得原価＄2,344）			
チャンネル諸島ジャージー島1.4%			
社債等1.4%			
Adient Global Holdings Ltd.			
7.000% due 04/15/2028	$	100	101
G City Europe Ltd.			
4.250% due 09/11/2025	EUR	100	96
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3.250% due 11/12/2025		500	484
チャンネル諸島ジャージー島合計			**681**
（取得原価＄678）			
リベリア0.9%			
社債等0.9%			
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
5.500% due 08/31/2026	$	450	427
リベリア合計			**427**
（取得原価＄397）			
ルクセンブルク5.9%			
バンク・ローン債務0.2%			
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
9.443% due 02/01/2029		104	104
		株数	
普通株0.3%			
Intelsat S.A. (g)		5,610	129
		元本金額（単位：千）	
社債等5.4%			
Albion Financing 1 SARL			
6.125% due 10/15/2026	$	200	188
Altice Financing S.A.			
2.250% due 01/15/2025	EUR	150	153

3.000% due 01/15/2028		200	170
Cidron Aida Finco Sarl			
5.000% due 04/01/2028		300	297
Cirsa Finance International Sarl			
4.500% due 03/15/2027		200	200
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6.500% due 03/15/2030	$	422	385
LHMC Finco 2 Sarl			
7.250% due 10/02/2025 (c)	EUR	104	112
Loarre Investments Sarl			
6.500% due 05/15/2029		300	312
Logicor Financing Sarl			
0.625% due 11/17/2025		300	287
2.250% due 05/13/2025		200	203
Matterhorn Telecom S.A.			
3.125% due 09/15/2026		300	306
Signa Development Finance SCS			
5.500% due 07/23/2026		100	74
			2,687
		株数	
株式リンク証券0.0%			
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
12/31/2049		1	7
ルクセンブルク合計 **（取得原価＄3,307）**			**2,927**
		元本金額（単位：千）	
多国籍1.1%			
社債等1.1%			
American Airlines, Inc.			
5.500% due 04/20/2026	$	25	25
5.750% due 04/20/2029		425	413
Clarios Global LP			
4.375% due 05/15/2026	EUR	100	104
多国籍合計 **（取得原価＄593）**			**542**
オランダ4.5%			
社債等4.5%			
Dufry One BV			
2.000% due 02/15/2027		300	286
IPD 3 BV			
8.000% due 06/15/2028		100	112
LeasePlan Corp. NV			
7.375% due 05/29/2024 (a)(b)		300	322
OI European Group BV			
6.250% due 05/15/2028		100	112
Summer BidCo BV			
9.000% due 11/15/2025 (c)		181	177
Telefonica Europe BV			
2.875% due 06/24/2027 (a)		400	376
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV			
1.875% due 03/31/2027		400	373
4.375% due 05/09/2030		100	93
7.375% due 09/15/2029		100	111
United Group BV			
3.125% due 02/15/2026		100	95
4.000% due 11/15/2027		200	180
オランダ合計 **（取得原価＄2,268）**			**2,237**
パナマ0.4%			
社債等0.4%			
Carnival Corp.			
4.000% due 08/01/2028	$	200	178
パナマ合計 **（取得原価＄200）**			**178**
スペイン3.2%			
社債等3.2%			
Banco Santander S.A.			
4.375% due 01/14/2026 (a)(b)	EUR	200	183
Cellnex Finance Co. S.A.			

1.500% due 06/08/2028		100	93
2.000% due 09/15/2032		300	258
Cellnex Telecom S.A.			
1.750% due 10/23/2030		100	88
Grifols Escrow Issuer S.A.			
3.875% due 10/15/2028		400	375
Grifols S.A.			
3.200% due 05/01/2025		100	107
Lorca Telecom Bondco S.A.			
4.000% due 09/18/2027		500	499
スペイン合計			**1,603**
（取得原価＄1,627）			
スウェーデン0.9%			
社債等0.9%			
Akelius Residential Property AB			
2.249% due 05/17/2081		300	270
Intrum AB			
9.250% due 03/15/2028		200	185
スウェーデン合計			**455**
（取得原価＄465）			
英国6.9%			
社債等6.9%			
Barclays PLC			
7.750% due 09/15/2023 (a)(b)	$	200	196
BCP V Modular Services Finance II PLC			
4.750% due 11/30/2028	EUR	200	187
BCP V Modular Services Finance PLC			
6.750% due 11/30/2029		500	416
Bellis Acquisition Co. PLC			
3.250% due 02/16/2026	GBP	200	213
Harbour Energy PLC			
5.500% due 10/15/2026	$	300	276
Heathrow Finance PLC			
4.125% due 09/01/2029	GBP	168	173
HSBC Holdings PLC			
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	EUR	200	217
Jaguar Land Rover Automotive PLC			
4.500% due 07/15/2028		400	382
Market Bidco Finco PLC			
5.500% due 11/04/2027	GBP	200	199
Rolls-Royce PLC			
3.375% due 06/18/2026		350	394
Santander UK Group Holdings PLC			
6.750% due 06/24/2024 (a)(b)		50	60
Thames Water Kemble Finance PLC			
4.625% due 05/19/2026		100	71
Travis Perkins PLC			
3.750% due 02/17/2026		200	229
Vmed O2 UK Financing I PLC			
3.250% due 01/31/2031	EUR	200	180
4.000% due 01/31/2029	GBP	100	101
4.250% due 01/31/2031	$	200	162
英国合計			**3,456**
（取得原価＄3,726）			
米国45.9%			
バンク・ローン債務2.5%			
BK LC Lux SPV Sarl			
8.555% due 04/28/2028		184	183
Diamond Sports Group LLC			
13.064% due 05/25/2026		53	41
Getty Images, Inc.			
9.702-9.842% due 02/19/2026		143	144
iHeartCommunications, Inc.			
8.217% due 05/01/2026		28	24
LifePoint Health, Inc.			
9.023% due 11/16/2025		385	357
Shutterfly LLC			
10.273% due 09/25/2026		400	248
11.538% due 10/01/2027		44	44
Team Health Holdings, Inc.			

7.943% due 02/06/2024	146	130
TransDigm, Inc.		
8.492% due 02/22/2027	100	100
		1,271
	株数	
普通株0.0%		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,022	7
iHeartMedia, Inc. Class A	1,198	4
iHeartMedia, Inc. Class B	938	3
		14
	元本金額（単位：千）	
社債等43.4%		
ADT Security Corp.		
4.125% due 08/01/2029	200	173
Advantage Sales & Marketing, Inc.		
6.500% due 11/15/2028	300	254
Albertsons Cos., Inc.		
6.500% due 02/15/2028	100	100
Allegiant Travel Co.		
7.250% due 08/15/2027	450	449
AMC Networks, Inc.		
4.250% due 02/15/2029	300	162
5.000% due 04/01/2024	80	79
Armor Holdco, Inc.		
8.500% due 11/15/2029	250	208
ASP Unifrax Holdings, Inc.		
5.250% due 09/30/2028	100	72
Avantor Funding, Inc.		
3.875% due 11/01/2029	350	307
4.625% due 07/15/2028	100	93
Ball Corp.		
6.000% due 06/15/2029	100	99
BCPE Empire Holdings, Inc.		
7.625% due 05/01/2027	250	233
Buckeye Partners LP		
4.500% due 03/01/2028	100	90
Burford Capital Global Finance LLC		
6.250% due 04/15/2028	200	184
Cable One, Inc.		
4.000% due 11/15/2030	200	156
Caesars Entertainment, Inc.		
7.000% due 02/15/2030	350	352
Capstone Borrower, Inc.		
8.000% due 06/15/2030	50	49
CCO Holdings LLC		
4.500% due 06/01/2033	450	354
Chesapeake Energy Corp.		
6.750% due 04/15/2029	250	248
Churchill Downs, Inc.		
6.750% due 05/01/2031	250	247
Cinemark USA, Inc.		
5.250% due 07/15/2028	150	132
Clarivate Science Holdings Corp.		
3.875% due 07/01/2028	100	89
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		
7.750% due 04/15/2028	200	157
Clearway Energy Operating LLC		
3.750% due 01/15/2032	100	82
Cloud Software Group, Inc.		
6.500% due 03/31/2029	225	201
9.000% due 09/30/2029	100	87
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.		
8.750% due 04/15/2030	400	354
Coherent Corp.		
5.000% due 12/15/2029	100	90
CommScope, Inc.		
4.750% due 09/01/2029	150	118
Community Health Systems, Inc.		
6.125% due 04/01/2030	425	254
Conduent Business Services LLC		
6.000% due 11/01/2029	225	184

Coty, Inc.			
3.875% due 04/15/2026	EUR	100	106
Crestwood Midstream Partners LP			
6.000% due 02/01/2029	$	100	93
7.375% due 02/01/2031		100	99
CrownRock LP			
5.000% due 05/01/2029		100	94
5.625% due 10/15/2025		100	99
DaVita, Inc.			
3.750% due 02/15/2031		225	180
DCP Midstream Operating LP			
3.250% due 02/15/2032		150	127
Diamond Sports Group LLC			
5.375% due 08/15/2026 (d)		300	10
Directv Financing LLC			
5.875% due 08/15/2027		100	91
DISH DBS Corp.			
5.250% due 12/01/2026		200	161
5.750% due 12/01/2028		100	75
DISH Network Corp.			
11.750% due 11/15/2027		200	195
Emerald Debt Merger Sub LLC			
6.625% due 12/15/2030		100	99
EnLink Midstream LLC			
6.500% due 09/01/2030		100	100
EQM Midstream Partners LP			
4.500% due 01/15/2029		175	156
4.750% due 01/15/2031		250	219
Ford Motor Credit Co. LLC			
3.625% due 06/17/2031		750	615
Fortrea Holdings, Inc.			
7.500% due 07/01/2030		25	26
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
6.500% due 10/01/2025		173	171
Foundation Building Materials, Inc.			
6.000% due 03/01/2029		250	209
Freedom Mortgage Corp.			
6.625% due 01/15/2027		300	260
Full House Resorts, Inc.			
8.250% due 02/15/2028		100	94
Genesis Energy LP			
8.000% due 01/15/2027		300	293
Global Infrastructure Solutions, Inc.			
7.500% due 04/15/2032		275	234
Graham Packaging Co., Inc.			
7.125% due 08/15/2028		150	128
Graphic Packaging International LLC			
3.750% due 02/01/2030		250	216
Harvest Midstream I LP			
7.500% due 09/01/2028		175	174
HAT Holdings I LLC			
3.375% due 06/15/2026		100	90
3.750% due 09/15/2030		50	39
HealthEquity, Inc.			
4.500% due 10/01/2029		100	88
Hertz Corp.			
5.000% due 12/01/2029		100	83
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC			
5.000% due 06/01/2029		100	89
Howard Hughes Corp.			
4.125% due 02/01/2029		100	83
4.375% due 02/01/2031		60	48
Howard Midstream Energy Partners LLC			
6.750% due 01/15/2027		100	95
8.875% due 07/15/2028 (e)		25	25
HUB International Ltd.			
7.250% due 06/15/2030		200	207
iHeartCommunications, Inc.			
4.750% due 01/15/2028		300	227
Illuminate Buyer LLC			
9.000% due 07/01/2028		100	87
IQVIA, Inc.			

2.250% due 03/15/2029	EUR	200	187
Jane Street Group			
4.500% due 11/15/2029	$	150	129
Kronos International, Inc.			
3.750% due 09/15/2025	EUR	300	299
LABL, Inc.			
5.875% due 11/01/2028	$	100	91
Leeward Renewable Energy Operations LLC			
4.250% due 07/01/2029		375	335
LFS Topco LLC			
5.875% due 10/15/2026		100	88
Lindblad Expeditions LLC			
6.750% due 02/15/2027		200	191
MPH Acquisition Holdings LLC			
5.500% due 09/01/2028		325	277
Newell Brands, Inc.			
6.375% due 09/15/2027		100	96
NGL Energy Operating LLC			
7.500% due 02/01/2026		150	148
Noble Finance II LLC			
8.000% due 04/15/2030		100	102
Novelis Corp.			
3.250% due 11/15/2026		100	91
OneMain Finance Corp.			
3.500% due 01/15/2027		375	322
Organon & Co.			
2.875% due 04/30/2028	EUR	300	285
5.125% due 04/30/2031	$	200	165
Owens & Minor, Inc.			
6.625% due 04/01/2030		100	91
Owens -Brockway Glass Container, Inc.			
7.250% due 05/15/2031		50	51
Oxford Finance LLC			
6.375% due 02/01/2027		100	93
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC			
4.375% due 10/15/2028		100	87
PennyMac Financial Services, Inc.			
4.250% due 02/15/2029		300	241
PGT Innovations, Inc.			
4.375% due 10/01/2029		400	374
Post Holdings, Inc.			
4.625% due 04/15/2030		200	175
5.750% due 03/01/2027		106	104
PRA Group, Inc.			
7.375% due 09/01/2025		300	285
8.375% due 02/01/2028		125	113
Prime Security Services Borrower LLC			
3.375% due 08/31/2027		200	177
Radiate Holdco LLC			
4.500% due 09/15/2026		150	120
Rand Parent LLC			
8.500% due 02/15/2030		175	159
Ritchie Bros Holdings, Inc.			
6.750% due 03/15/2028		100	101
Rockcliff Energy II LLC			
5.500% due 10/15/2029		400	369
Sabre GLBL, Inc.			
9.250% due 04/15/2025		13	12
Sealed Air Corp.			
6.125% due 02/01/2028		100	99
Southwestern Energy Co.			
4.750% due 02/01/2032		100	88
5.375% due 02/01/2029		280	264
Spirit AeroSystems, Inc.			
4.600% due 06/15/2028		125	105
7.500% due 04/15/2025		50	49
Standard Industries, Inc.			
2.250% due 11/21/2026	EUR	300	291
4.375% due 07/15/2030	$	125	108
Starwood Property Trust, Inc.			
3.750% due 12/31/2024		100	94
Station Casinos LLC			
4.625% due 12/01/2031		100	84

Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP			
5.875% due 05/15/2025		300	290
Targa Resources Partners LP			
4.000% due 01/15/2032		25	22
4.875% due 02/01/2031		400	370
Tenet Healthcare Corp.			
4.875% due 01/01/2026		400	390
Thor Industries, Inc.			
4.000% due 10/15/2029		300	255
TopBuild Corp.			
4.125% due 02/15/2032		100	85
Travel + Leisure Co.			
4.500% due 12/01/2029		250	213
Trident TPI Holdings, Inc.			
12.750% due 12/31/2028		250	260
Triumph Group, Inc.			
9.000% due 03/15/2028		100	102
U.S. Acute Care Solutions LLC			
6.375% due 03/01/2026		125	107
Univision Communications, Inc.			
6.625% due 06/01/2027		200	194
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3.875% due 08/15/2029		100	87
4.125% due 08/15/2031		100	86
Venture Global LNG, Inc.			
8.375% due 06/01/2031		300	303
Viavi Solutions, Inc.			
3.750% due 10/01/2029		100	85
White Cap Parent LLC			
8.250% due 03/15/2026 (c)		300	288
WMG Acquisition Corp.			
3.000% due 02/15/2031		200	162
3.750% due 12/01/2029		100	87
XPO, Inc.			
7.125% due 06/01/2031		100	101
ZF North America Capital, Inc.			
6.875% due 04/14/2028		200	203
7.125% due 04/14/2030		200	204
ZipRecruiter, Inc.			
5.000% due 01/15/2030		100	85
			21,661
米国合計 **（取得原価＄25,318）**			**22,946**
短期金融商品5.9%			
定期預金0.6%			
Bank of Nova Scotia			
4.570% due 07/03/2023		4	4
Citibank N.A.			
4.570% due 07/03/2023		31	31
DBS Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		24	24
HSBC Bank PLC			
2.620% due 07/03/2023	EUR	55	60
4.170% due 07/03/2023	GBP	1	1
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.570% due 07/03/2023	＄	24	24
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
2.620% due 07/03/2023	EUR	9	9
4.170% due 07/03/2023	GBP	2	2
4.570% due 07/03/2023	＄	47	47
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
2.620% due 07/03/2023	EUR	14	15
4.170% due 07/03/2023	GBP	2	3
4.570% due 07/03/2023	＄	55	55
			275
米国短期国債(f)5.3%			
5.082% due 08/03/2023		400	399
5.108% due 08/15/2023		1,600	1,590
5.136% due 08/10/2023		700	696
			2,685
短期金融商品合計			**2,960**

（取得原価＄2,959）

投資有価証券合計97.7% （取得原価＄52,358）	**$**	**48,756**
金融デリバティブ商品(h)(i)0.2% （取得原価あるいはプレミアム（純額）＄(2)）		**107**
その他の資産および負債（純額）2.1%		**1,045**
純資産100.0%	**$**	**49,908**

投資明細表に対する注記：

*** 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。**

(a) 永久債（記載日は次回の契約上の償還日）である。
(b) 偶発転換社債
(c) 現物配当証券
(d) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
(e) 発行日前取引証券
(f) クーポンは最終利回りである。

(g) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価額の対純資産比率
Intelsat S.A.	N/A	N/A	09/06/2019	$ 433	$ 129	0.26%

借入およびその他の金融取引

2023年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は＄69で、加重平均金利は2.330%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(h) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

詳細	種類	限月	契約数	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
Euro-Bobl 5- Year Note September Futures	買建	09/2023	5	$ (9)	$ 0	$ (3)
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	買建	09/2023	15	(5)	12	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	売建	09/2023	9	13	0	0
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	売建	09/2023	7	14	0	(2)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	売建	09/2023	3	3	0	(1)
先物契約合計				**$ 16**	**$ 12**	**$ (6)**

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの売り(1)

参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・クレジット・スプレッド（2023年6月30日現在）(2)	想定元本(3)	市場価格	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
Newell Brands, Inc.	1.000%	06/20/2028	4.555%	$ 100	$ (14)	$ 1	$ 0	$ 0

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ ― プロテクションの売り(1)

	変動証拠金

指数／トランシェ	受取固定金利	満期日		想定元本(3)	市場価格(4)	未実現評価（損）益	資産	負債
iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	5.000%	06/20/2028	EUR	2,000	$ 90	$ 68	$ 14	$ 0

金利スワップ

変動金利支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日		想定元本	市場価格	未実現評価（損）益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
受取(5)	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/20/2028	$	400	$ (1)	$ 3	$ 0	$ 0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052		50	(13)	(1)	1	0
支払(5)	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.000%	09/20/2025	GBP	500	(23)	(20)	0	(2)
支払(5)	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.750%	09/20/2028		300	(21)	(19)	0	(2)
						$ (58)	$ (37)	$ 1	$ (4)
スワップ契約合計						$ 18	$ 32	$ 15	$ (4)

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2023年6月30日現在の上場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

2023年6月30日現在、上場および中央清算金融デリバティブ商品について＄475の現金が担保として差し入れられている。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	市場価格	変動証拠金資産			市場価格	変動証拠金負債		
	買建オプション	先物	スワップ契約	合計	売建オプション	先物	スワップ契約	合計
上場または中央清算	$ 0	$ 12	$ 15	$ 27	$ 0	$ (6)	$ (4)	$ (10)
合計								

(1)　ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
(2)　インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建／売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(3)　当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
(4)　クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済／売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務（または利益）の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
(5)　当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(i)　金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月		引渡通貨		受取通貨	未実現評価（損）益 資産	負債
BOA	07/2023	EUR	131	$	142	$ 0	$ (1)
BOA	08/2023	GBP	67		84	0	(1)
BOA	08/2023	$	99	GBP	80	2	0
BPS	07/2023	EUR	5,542	$	6,072	26	0
BPS	07/2023	$	74	EUR	68	0	0
BPS	08/2023		5,987		5,456	0	(25)
BRC	08/2023		40	GBP	32	0	0
CBK	07/2023		58	EUR	54	1	0
CBK	08/2023	GBP	58	$	73	0	(1)
CBK	08/2023	$	77	GBP	62	1	0
JPM	08/2023		451		356	2	0
MBC	07/2023	EUR	214	$	232	0	(1)
MBC	07/2023	$	191	EUR	178	3	0
MBC	08/2023	EUR	91	$	99	0	(1)
RBC	08/2023	GBP	78		97	0	(2)
RBC	08/2023	$	87	GBP	69	1	0
SCX	08/2023	GBP	8	$	10	0	0
SOG	07/2023	$	5,788	EUR	5,380	82	0
UAG	08/2023		394	GBP	312	2	0
外国為替先渡契約合計						$ 120	$ (32)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ － プロテクションの売り(1)

取引相手	参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・クレジット・スプレッド（2023年6月30日現在）(2)		想定元本(3)	プレミアム支払額／（受取額）	未実現評価（損）益	スワップ契約（公正価値） 資産	負債
GST	EP Infrastructure A/S	5.000%	06/20/2028	4.635%	EUR	100	$ (2)	$ 4	$ 2	$ 0

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2023年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	金融デリバティブ資産 外国為替先渡契約	買建プション	スワップ契約	店頭合計	金融デリバティブ負債 外国為替先渡契約	売建プション	スワップ契約	店頭合計	店頭デリバティブの純市場価格	差入（受取）担保	ネッエスポージャー(4)
BOA	$ 2	$ 0	$ 0	$ 2	$ (2)	$ 0	$ 0	$ (2)	$ 0	$ 0	$ 0
BPS	26	0	0	26	(25)	0	0	(25)	1	0	1
BRC	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
CBK	2	0	0	2	(1)	0	0	(1)	1	0	1
GST	0	0	2	2	0	0	0	0	2	0	2
JPM	2	0	0	2	0	0	0	0	2	0	2
MBC	3	0	0	3	(2)	0	0	(2)	1	0	1
RBC	1	0	0	1	(2)	0	0	(2)	(1)	0	(1)
SCX	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
SOG	82	0	0	82	0	0	0	0	82	0	82
UAG	2	0	0	2	0	0	0	0	2	0	2
店頭合計	$ 120	$ 0	$ 2	$ 122	$ (32)	$ 0	$ 0	$ (32)			

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは（i）プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または（ii）スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
(2) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建／売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(3)　当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
(4)　ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネッティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2023年6月30日現在）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品				
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品 － 資産						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 12	$ 12
スワップ契約	0	14	0	0	1	15
	$ 0	$ 14	$ 0	$ 0	$ 13	$ 27
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 120	$ 0	$ 120
スワップ契約	0	2	0	0	0	2
	$ 0	$ 2	$ 0	$ 120	$ 0	$ 122
	$ 0	$ 16	$ 0	$ 120	$ 13	$ 149
金融デリバティブ商品 － 負債						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (6)	$ (6)
スワップ契約	0	0	0	0	(4)	(4)
	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (10)	$ (10)
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (32)	$ 0	$ (32)
	$ 0	$ 0	$ 0	$ (32)	$ (10)	$ (42)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2023年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品				
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
金融デリバティブ商品に係る実現純利益（損失）						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ (49)	$ (49)
スワップ契約	0	320	0	0	(92)	228
	$ 0	$ 320	$ 0	$ 0	$ (141)	$ 179
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ (104)	$ 0	$ (104)
スワップ契約	0	2	0	0	0	2
	$ 0	$ 2	$ 0	$ (104)	$ 0	$ (102)
	$ 0	$ 322	$ 0	$ (104)	$ (141)	$ 77
金融デリバティブ商品に係る未実現評価（損）益の純変動額						
上場または中央清算						
先物	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 11	$ 11
スワップ契約	0	(207)	0	0	(8)	(215)
	$ 0	$ (207)	$ 0	$ 0	$ 3	$ (204)
店頭						
外国為替先渡契約	$ 0	$ 0	$ 0	$ 347	$ 0	$ 347
スワップ契約	0	4	0	0	0	4
	$ 0	$ 4	$ 0	$ 347	$ 0	$ 351
	$ 0	$ (203)	$ 0	$ 347	$ 3	$ 147

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2023年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値（2023/06/30現在）
投資有価証券（公正価値）				
ベルギー				
社債等	$ 0	$ 96	$ 0	$ 96
バミューダ				
社債等	0	223	0	223
カナダ				
社債等	0	1,880	0	1,880
ケイマン諸島				
バンク・ローン債務	0	102	0	102

チェコ共和国				
社債等	0	460	0	460
フランス				
社債等	0	2,906	0	2,906
ドイツ				
社債等	0	2,268	0	2,268
アイルランド				
社債等	0	175	0	175
イタリア				
社債等	0	2,234	0	2,234
チャンネル諸島ジャージー島				
社債等	0	681	0	681
リベリア				
社債等	0	427	0	427
ルクセンブルク				
バンク・ローン債務	0	104	0	104
普通株	0	0	129	129
社債等	0	2,687	0	2,687
株式リンク証券	0	0	7	7
多国籍				
社債等	0	542	0	542
オランダ				
社債等	0	2,237	0	2,237
パナマ				
社債等	0	178	0	178
スペイン				
社債等	0	1,603	0	1,603
スウェーデン				
社債等	0	455	0	455
英国				
社債等	0	3,456	0	3,456
米国				
バンク・ローン債務	0	1,271	0	1,271
普通株	11	0	3	14
社債等	0	21,661	0	21,661
短期金融商品	0	2,960	0	2,960
投資合計	$ 11	$ 48,606	$ 139	$ 48,756
金融デリバティブ商品 － 資産				
上場または中央清算	12	15	0	27
店頭	0	122	0	122
	$ 12	$ 137	$ 0	$ 149
金融デリバティブ商品 － 負債				
上場または中央清算	(3)	(7)	0	(10)
店頭	0	(32)	0	(32)
	$ (3)	$ (39)	$ 0	$ (42)
合計	**$ 20**	**$ 48,704**	**$ 139**	**$ 48,863**

2023年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

財務諸表に対する注記
2023年6月30日

重要な会計方針

以下は、ピムコ・バミューダ・トラストIV（以下「トラスト」という）が米国において一般に公正妥当と認められる会計原則（以下「米国GAAP」という）に準拠した財務諸表を作成するにあたって、継続して従っている重要な会計方針の要約である。各ファンドは米国GAAPの報告規定に該当する投資会社として扱われている。米国GAAPに従い財務諸表を作成するにあたって、経営陣は、財務報告日現在の資産および負債の報告金額ならびに偶発資産および負債の開示事項、ならびに報告期間中における運用による純資産の増加および減少の報告金額に影響を与える見積りおよび仮定を行う必要がある。実際の結果は、このような見積りとは異なることがある。

(a) 被取得ファンド

受託会社およびマネージャーは、「ファンド・オブ・ファンズ」または「取得ファンド」（他のファンドに投資するファンド）の資産の全部あるいは一部を、それぞれ「被取得ファンド」に振り替えることができる。そのように振り替えられた資産は当該被取得ファンドにおいて直接受領されたかのように保有される。資産がそのように振り替えられた場合、被取得ファンドは、対応する取得ファンドへの受益証券の発行を当該受益証券の1口当たりの発行価格で計上し、当該受益証券の買戻し時には、受益証券1口当たり買戻価格で当該受益証券の買戻しを行う。財務ハイライトに記載の比率には被取得ファンドの費用は含まれていない。ファンドの報酬に関しては、「注記9 報酬および費用」を適宜参照のこと。

(b) 有価証券取引および投資収益

有価証券取引は、財務報告上、約定日基準で計上される。発行日取引または遅延引渡基準で売買された有価証券は、約定日後かかる有価証券の標準決済期間以上の期間が経過した後で決済されることがある。有価証券売却に係る実現損益は個別原価法で計上されている。受取配当金は配当落ち日に計上される。ただし、外国有価証券からの配当で配当落ち日を過ぎたと思われる一部配当金については、ファンドが配当落ち日の通知を受領次第計上される。受取利息は、ディスカウントの増額およびプレ

ミアムの償却が反映され、決済日から発生基準で計上される。例外は先日付の効力発生日を有する有価証券で、この場合の受取利息は効力発生日から発生基準で計上される。転換型証券の転換権に係るプレミアムは償却されない。特定の外国有価証券に係る見積税金負債は発生基準で計上され、損益計算書において場合に応じて受取利息または投資に係る未実現評価（損）益の純変動額の構成要素として反映される。かかる有価証券売却の結果実現する税金債務は損益計算書において投資に係る実現純損益の構成要素として反映される。モーゲージ証券およびその他の資産担保証券の元本返済による損益があれば、損益計算書において受取利息の構成要素として計上される。

継続して適用している手続きに基づき利息の全部または一部の回収が疑わしくなった場合、債務証券は不良債権に分類することができ、関連する受取利息は、経過利息の計上を停止し、未収利息を償却することによって減額できる。発行体が利払いを再開した場合または利息の回収可能性が高まった場合、債務証券は不良債権から正常債権に再分類される。

(c) 現金および外国通貨

各ファンドの財務諸表は、主たる営業の場所において使用されている通貨（以下「機能通貨」という）で表示されている。各ファンドの機能通貨は下記の表に列挙されている。

外国有価証券、保有通貨ならびにその他の資産および負債の市場価格は、各営業日現在の為替レートに基づき各ファンドの機能通貨に換算される。外貨建ての有価証券の売買または外貨建ての収益もしくは費用の項目があれば、取引日に有効な為替レートで各ファンドの機能通貨に換算される。ファンドでは、為替レートの変動による影響と保有有価証券の市場価格の変動による影響は分けて報告されない。かかる変動は、損益計算書において投資に係る実現純損益および未実現評価損益の純変動額に含まれる。ファンドは、為替市場でその時の実勢レートによるスポット（直物）取引または外国為替先渡契約により、外貨建て有価証券への投資および外国為替取引を行うことがある。スポットでの外貨の売却から生じる実現為替損益、有価証券取引の約定日と決済日との間に実現した為替損益、ならびに配当、受取利息および外国の源泉徴収税の計上額と実際に受領した、または支払った額の機能通貨換算額との差は、損益計算書における外国為替取引に係る実現純損益に含まれる。報告期間末日現在に保有する証券投資以外の外貨建て資産および負債に関し、外国為替レートの変動から生じる外国為替の未実現純損益は、損益計算書における外貨建て資産および負債に係る未実現評価損益の純変動額に含まれる。

特定のファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の純資産価額およびトータル・リターンは、各ファンドの目論見書（以下、「目論見書」という）に詳述されているとおり、純資産価額が報告される通貨（以下、「報告通貨」という）で表示されている。純資産価額およびトータル・リターンの報告通貨による表示目的のため、期首および期末の純資産価額は期首と期末日それぞれの為替レートで換算され、分配額は分配日の為替レートで換算される。各ファンドの報告通貨は下表のとおり。

ファンド／クラス	報告通貨	機能通貨
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド A	日本円	米ドル
・ J (日本円)		
・ J (米ドル)		
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド C	日本円	米ドル
・ J (C-米ドル)		
PIMCOバミューダエマージングカレンシーハイインカムファンド	日本円	米ドル
・ J (日本円)*		
・ N (米ドル)		
・ S (日本円)		
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド A	日本円	米ドル
・ J (日本円)		
・ J (米ドル)		
・ N (米ドル)		
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド B	日本円	米ドル
・ J (豪ドル)		
・ J (ブラジル・レアル)		
・ J (インドネシア・ルピア)		
・ J (インド・ルピー)		
・ J (韓国ウォン)		
・ J (メキシコ・ペソ)		
・ J (トルコ・リラ)		
・ J (南アフリカ・ランド)		
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド A		

・　Ｊ(日本円)	日本円	米ドル
・　Ｊ(米ドル)	日本円	米ドル
・　米ドル	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド B	日本円	米ドル
・　Ｊ(豪ドル)		
・　Ｊ(ブラジル・レアル)		
・　Ｊ(人民元)		
・　Ｊ(インドネシア・ルピア)		
・　Ｊ(インド・ルピー)		
・　Ｊ(南アフリカ・ランド)		
PIMCOバミューダトレンズマネージドフューチャーズストラテジーファンド		
・　米ドル	米ドル	米ドル
・　(日本円、為替ヘッジあり) ― 機関	日本円	米ドル
・　(日本円、為替ヘッジあり) ― 小売	日本円	米ドル
・　(日本円、為替ヘッジなし) ― 小売	日本円	米ドル
PIMCOバミューダ米国コアファンド	日本円	米ドル
・　Ｊ(日本円、為替ヘッジあり)		
・　米ドル		
PIMCOバミューダ米国ハイイールドストラテジーファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOクレジットバイアンドホールドファンド2021-06		
・　Ｊ(日本円)	日本円	米ドル
・　米ドル	米ドル	米ドル
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド	日本円	米ドル
・　Ｊ(日本円)		
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド	日本円	米ドル
・　C(日本円、為替ヘッジあり)		
・　Ｊ(日本円)		
・　S(日本円)		
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド	日本円	米ドル
・　Ｊ(日本円)		
PIMCO米国ハイイールドストラテジーファンド A	日本円	米ドル
・　Ｊ(日本円)		
PIMCO米国ハイイールドストラテジーファンド B	日本円	米ドル
・　Ｊ(豪ドル)		
・　Ｊ(ブラジル・レアル)		
・　Ｊ(メキシコ・ペソ)		
・　Ｊ(ニュージーランド・ドル)		
・　Ｊ(南アフリカ・ランド)		

* 当クラスは決算期間中に清算された。

(d)　複数のクラスによる運用

トラストが募集するそれぞれのファンドの各クラスは、該当する場合為替ヘッジに関連するクラスに割り当てられた特定の資産ならびにキャピタル・ゲインおよびキャピタル・ロスを除き、同じファンドの他のクラスがファンドに対して有する権利と同じ権利を有する。収益、クラス特有ではない費用、実現および未実現のキャピタル・ゲインおよびキャピタル・ロスは、該当する場合、それぞれのファンドの各クラスの純資産価額に応じて受益証券の各クラスに按分される。クラス特有の費用は現在、場合に応じて、運用報酬、投資顧問報酬、管理報酬、販売会社報酬などである。

(e)　分配方針

次の表は、各ファンドの予定分配頻度を表示している。各ファンドからの分配は、マネージャーにより承認された場合のみ公表されかつ受益者に分配され、また、マネージャーの裁量により承認が保留されることもある。

毎月分配

PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド A
・　Ｊ(日本円)
・　Ｊ(米ドル)
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド C
・　Ｊ(C-米ドル)
PIMCOバミューダエマージングカレンシーハイインカムファンド
・　Ｊ(日本円)*
・　N(米ドル)
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド A
・　Ｊ(日本円)
・　Ｊ(米ドル)
・　N(米ドル)
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド B
・　Ｊ(豪ドル)
・　Ｊ(ブラジル・レアル)

・　Ｊ(インドネシア・ルピア)
・　Ｊ(インド・ルピー)
・　Ｊ(韓国ウォン)
・　Ｊ(メキシコ・ペソ)
・　Ｊ(トルコ・リラ)
・　Ｊ(南アフリカ・ランド)
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド A
・　Ｊ(日本円)
・　Ｊ(米ドル)
・　米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド B
・　Ｊ(豪ドル)
・　Ｊ(ブラジル・レアル)
・　Ｊ(人民元)
・　Ｊ(インドネシア・ルピア)
・　Ｊ(インド・ルピー)
・　Ｊ(南アフリカ・ランド)
PIMCOバミューダトレンズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
・　（日本円、為替ヘッジあり） ― 小売
・　（日本円、為替ヘッジなし） ― 小売
PIMCOバミューダ米国コア債券ファンド
・　Ｊ(日本円、為替ヘッジあり)
・　米ドル
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド
・　Ｊ(日本円)
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド
・　Ｊ(日本円)
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド
・　Ｊ(日本円)
PIMCO米国ハイイールドストラテジーファンド A
・　Ｊ(日本円)
PIMCO米国ハイイールドストラテジーファンド B
・　Ｊ(豪ドル)
・　Ｊ(ブラジル・レアル)
・　Ｊ(メキシコ・ペソ)
・　Ｊ(ニュージーランド・ドル)
・　Ｊ(南アフリカ・ランド)

半年毎の分配

PIMCOバミューダトレンズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
・　（日本円、為替ヘッジあり） ― 機関

毎年分配

PIMCOクレジットバイアンドホールドファンド2021-06
・　Ｊ(日本円)
・　米ドル

マネージャーは下記ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）について分配の公表を予定していない。ただし、その裁量でいつでも受益者に分配することができる。

PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド (M)
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド (M)
PIMCOバミューダエマージングマーケッツアンドインフラストラクチャーボンドファンド (M)
PIMCOバミューダトレンズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
・　米ドル
PIMCOバミューダ米国ハイイールドストラテジーファンド (M)
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド
・　C(日本円、為替ヘッジあり)
・　S(日本円)
* 当クラスは決算期間中に清算された。

分配（もしあれば）は、通常、関連したファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の投資純利益から行われる。また、マネージャーは、分配に使用可能な実現純キャピタル・ゲインの支払いを認めることもある。追加分配は、マネージャーが適切と考えた場合に公表されることがある。ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）に関連して支払われた分配は、ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の純資産価額を減少させる。受益証券保有者はその裁量で、ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）からの分配金をファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の受益証券に追加して再投資するか、あるいは現金で受領することができる。現金による支払いは、ファンドの報告通貨にて行われる。各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）が、ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の妥当な分配水準を維持するため必要と考えた場合は、追加分配を公表することができる。目論見書により要求されているファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の分配金を支払うのに十分な純利益および実現純キャピタル・ゲインがない場合、マネージャーは、そのファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の資本金の一部を分配金として支払うことができる。分配期日から6年以内に受取が行われなかった分配金については無効となり、当該ファンド（あるいは、該当する場合にはそのクラス）の利益として計上される。

(f)　受益証券の発行および買戻し

ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の運用開始後は、マネージャーは各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の受益証券を、その発行時におけるファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の受益証券1口当たりの純資産価額で継続的に発行することができる（ただし、マネージャーまたはその指定代理人が、マネージャー単独の裁量により、当該発行を一時的に停止できる権利が付されている）。関連する目論見書に別に記載がある場合を除き、各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の当該受益証券の受益証券1口当たりの発行価格は、各取引日に決定された受益証券1口当たりの純資産価額（後述の「純資産価額の決定」に基づき算定）とされる（ただし、仮にBBHが許容できる形での受益証券の購入依頼が正午12時（東部時間）までにBBHに受領されなかった場合、関連ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の受益証券1口当たりの発行価格は、翌取引日に決定された受益証券1口当たりの純資産価額とされる）。受益証券が買い戻される場合または日本での直接分配のために日本で登録されたトラストの各ファンドが終了した場合、当該各ファンドの受益証券は現金で受益者から買い戻される。当該各ファンドにおいて、現物での買戻しは認められない。関連する目論見書に別に記載されている場合を除き、買戻金額の支払いは、通常、BBHが買戻通知を受領した、または受領したとみなされる取引日から2営業日以内に、受託会社またはその指定代理人により銀行振込で支払われる（ただし、一定の状況下では、支払われるまでに当該取引日から最大8営業日を要する場合がある）。関連する目論見書に別に記載されている場合を除き、各ファンドは申込または買戻手数料が発生しない（ただし、ファンドが販売される司法管轄区域の指定販売代理業者は、マネージャーおよび受託会社と合意した金額で申込または買戻手数料を請求することができる）。

(g) 新しい会計原則および規制上のアップデート

2020年3月、米国財務会計基準審議会（以下、「FASB」という）は、廃止される見込みのロンドン銀行間取引金利（以下、「LIBOR」という）およびその他の参照金利からの移行に伴う潜在的な会計上の負担を軽減するための任意のガイダンスを提供する、会計基準アップデート（以下、「ASU」という）ASU 2020-04を発行した。ASU 2020-04は、2020年3月12日から2022年12月31日までの期間中に発生する一定の参照金利関連の契約の修正に関して効力が発生する。2021年3月、LIBORの運営機関は米ドルLIBORの設定の大半の公表を2023年6月30日まで延長すると発表した。2022年12月、FASBは、LIBORからの移行に伴う負担の軽減期間を2024年12月31日まで延長する修正を盛り込んだASU 2020-06を発行した（2024年同日以降、事業体は参照金利改革に伴う負担の軽減を受けることができなくなる）。経営陣はLIBORの停止がファンドの投資に与え得る潜在的影響を継続的に評価しており、ASUの採用がファンドの財務諸表に重大な影響を与える可能性は低いと結論付けた。

2022年6月、FASBは、契約上の売却制限が付された公正価値で測定される持分証券に投資するすべての事業体に影響を及ぼすASU 2022-03「公正価値測定（トピック820）」を発行した。ASU 2022-03の修正は、持分証券に関する契約上の売却制限は当該持分証券の会計単位の一部とみなされず、したがってその公正価値測定において考慮されないことを明確化している。また、同修正は、契約上の売却制限が付されたトピック820に基づき公正価値で測定される持分証券について追加の開示を要求している。ASU 2022-03の修正の効力発生日は、2024年12月15日より後に開始する会計年度および当該会計年度内の中間期間となる。現在、経営陣は、当該変更による財務諸表への影響について評価している。

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 9月15日現在	2024年 3月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	33,786,504	76,154,207
コール・ローン	9,988,556	10,000,442
株式	2,866,043,371	3,032,875,307
投資証券	107,475,893	104,484,550
派生商品評価勘定	-	69,185
未収入金	-	163,575,787
未収配当金	5,226,294	6,015,170
流動資産合計	3,022,520,618	3,393,174,648
資産合計	3,022,520,618	3,393,174,648
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,628	253,116

	2023年 9月15日現在	2024年 3月15日現在
未払金	-	158,132,342
未払解約金	22,901,885	45,012,198
未払利息	7	-
流動負債合計	22,945,520	203,397,656
負債合計	22,945,520	203,397,656
純資産の部		
元本等		
元本	784,218,112	747,414,917
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,215,356,986	2,442,362,075
元本等合計	2,999,575,098	3,189,776,992
純資産合計	2,999,575,098	3,189,776,992
負債純資産合計	3,022,520,618	3,393,174,648

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 9月15日現在	2024年 3月15日現在
1．	期首	2023年 3月16日	2023年 9月16日
	期首元本額	809,246,795円	784,218,112円
	期首からの追加設定元本額	76,700,614円	－円
	期首からの一部解約元本額	101,729,297円	36,803,195円
	元本の内訳　※		
	日興スリートップ（隔月分配型）	784,218,112円	747,414,917円
	計	784,218,112円	747,414,917円
2．	受益権の総数	784,218,112口	747,414,917口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日	自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2023年 3月16日 至 2023年 9月15日	自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月15日現在	2024年 3月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年 9月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	198,471,855
投資証券	8,411,135
合計	206,882,990

（2024年 3月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	233,794,701
投資証券	6,464,857
合計	240,259,558

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2023年 9月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,901,946	－	22,945,574	△43,628
	米ドル	22,901,946	－	22,945,574	△43,628
合計		22,901,946	－	22,945,574	△43,628

（2024年 3月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	18,122,541	－	18,131,211	8,670
	米ドル	11,861,008	－	11,842,295	△18,713
	スイスフラン	6,261,533	－	6,288,916	27,383
	売建	63,134,740	－	63,327,341	△192,601
	米ドル	51,273,732	－	51,499,970	△226,238
	ユーロ	3,816,011	－	3,814,640	1,371
	英ポンド	2,774,769	－	2,777,468	△2,699
	スウェーデンクローナ	5,270,228	－	5,235,263	34,965
合計		81,257,281	－	81,458,552	△183,931

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。

・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2023年 9月15日現在		2024年 3月15日現在	
1口当たり純資産額	3.8249円	1口当たり純資産額	4.2677円
(1万口当たり純資産額)	(38,249円)	(1万口当たり純資産額)	(42,677円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	CHEVRON CORP	2,164	155.70	336,934.80	

	CONOCOPHILLIPS	902	119.78	108,041.56	
	EOG RESOURCES INC	1,024	123.79	126,760.96	
	EXXON MOBIL CORP	4,488	111.47	500,277.36	
	DOW INC	6,182	57.32	354,352.24	
	SHIN-ETSU CHEM-UNSPON ADR	11,782	21.47	252,959.54	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	840	196.35	164,934.00	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,200	153.89	184,668.00	
	BRIDGESTONE CORP-UNSPONS ADR	9,614	20.70	199,009.80	
	DARDEN RESTAURANTS INC	630	171.77	108,215.10	
	MCDONALD'S CORP	1,717	281.73	483,730.41	
	YUM! BRANDS INC	1,679	137.16	230,291.64	
	COMCAST CORP-CLASS A	8,824	42.82	377,843.68	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	1,350	491.83	663,970.50	
	BEST BUY CO INC	2,110	77.46	163,440.60	
	LOWE'S COS INC	1,090	244.63	266,646.70	
	COCA-COLA CO/THE	9,429	60.50	570,454.50	
	KENVUE INC	7,118	20.07	142,858.26	
	PROCTER & GAMBLE CO	2,061	161.50	332,851.50	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	1,345	489.00	657,705.00	
	ABBVIE INC	3,007	181.20	544,868.40	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,911	52.49	100,308.39	
	JOHNSON & JOHNSON	2,252	159.21	358,540.92	
	MERCK & CO. INC.	1,792	120.51	215,953.92	
	BANK OF AMERICA CORP	12,384	35.69	441,984.96	
	TRUIST FINANCIAL CORP	3,416	35.02	119,628.32	
	BLACKROCK INC	183	808.80	148,010.40	
	CME GROUP INC	2,755	219.41	604,474.55	
	MORGAN STANLEY	2,920	89.10	260,172.00	
	TOKIO MARINE HOLDINGS-ADR	9,256	30.05	278,142.80	
	MICROSOFT CORP	4,056	425.22	1,724,692.32	
	APPLE INC	1,577	173.00	272,821.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	1,324	85.76	113,546.24	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,917	39.77	116,009.09	
	DOMINION ENERGY INC	1,347	47.61	64,130.67	
	NEXTERA ENERGY INC	8,093	59.54	481,857.22	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	3,714	63.99	237,658.86	
	ANALOG DEVICES INC	1,604	194.43	311,865.72	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,807	243.73	440,420.11	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	5,750	139.62	802,815.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,019	171.14	345,531.66	
米ドル小計		149,633		14,209,378.70 (2,111,371,581)	
加ドル	TORONTO-DOMINION BANK	2,203	81.27	179,037.81	

加ドル小計		2,203		179,037.81 (19,654,770)	
ユーロ	UPM-KYMMENE OYJ	3,942	29.32	115,579.44	
	LEGRAND SA	2,731	97.64	266,654.84	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	754	215.15	162,223.10	
	VINCI SA	4,116	117.00	481,572.00	
	MICHELIN (CGDE)	9,842	34.45	339,056.90	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	642	872.80	560,337.60	
	ALLIANZ SE-REG	979	264.60	259,043.40	
	KONINKLIJKE KPN NV	43,855	3.40	149,238.56	
	ENGIE	7,824	15.29	119,628.96	
	ASML HOLDING NV	364	881.00	320,684.00	
ユーロ小計		75,049		2,774,018.80 (448,503,359)	
英ポンド	RELX PLC	7,635	33.91	258,902.85	
	ASTRAZENECA PLC	1,973	104.02	205,231.46	
	SSE PLC	8,556	15.84	135,527.04	
英ポンド小計		18,164		599,661.35 (113,515,893)	
スイスフラン	NESTLE SA-REG	2,680	95.08	254,814.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	555	232.40	128,982.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	485	486.60	236,001.00	
スイスフラン小計		3,720		619,797.40 (104,101,171)	
スウェーデンクローナ	VOLVO AB-B SHS-B	13,066	305.10	3,986,436.60	
	NORDEA BANK ABP	20,136	126.92	2,555,661.12	
スウェーデンクローナ小計		33,202		6,542,097.72 (93,879,102)	
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	1,217	924.50	1,125,116.50	
デンマーククローネ小計		1,217		1,125,116.50 (24,392,525)	
豪ドル	RIO TINTO LTD	1,839	119.19	219,190.41	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	10,086	17.34	174,891.24	
豪ドル小計		11,925		394,081.65 (38,470,250)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	17,000	62.25	1,058,250.00	
香港ドル小計		17,000		1,058,250.00 (20,096,167)	
シンガポールドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	15,300	34.62	529,686.00	
シンガポールドル小計		15,300		529,686.00 (58,890,489)	
合　　計		327,413		3,032,875,307 (3,032,875,307)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	PROLOGIS INC	5,378	703,173.50	
米ドル小計			5,378	703,173.50 (104,484,550)	
合計				104,484,550 (104,484,550)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	41銘柄	95.3%	—	67.4%
	投資証券	1銘柄	—	4.7%	3.3%
加ドル	株式	1銘柄	100.0%	—	0.6%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%	—	14.3%
英ポンド	株式	3銘柄	100.0%	—	3.6%
スイスフラン	株式	3銘柄	100.0%	—	3.3%
スウェーデンクローナ	株式	2銘柄	100.0%	—	3.0%
デンマーククローネ	株式	1銘柄	100.0%	—	0.8%
豪ドル	株式	2銘柄	100.0%	—	1.2%
香港ドル	株式	1銘柄	100.0%	—	0.6%
シンガポールドル	株式	1銘柄	100.0%	—	1.9%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 3月29日現在です。

【日興スリートップ（隔月分配型）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	23,094,242,668円
Ⅱ　負債総額	19,144,865円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,075,097,803円
Ⅳ　発行済口数	33,805,077,231口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6826円

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	3,425,676,943円
Ⅱ　負債総額	145,912,773円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,279,764,170円
Ⅳ　発行済口数	747,414,917口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3881円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2024年3月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（2024年3月末現在）

・株主総会
株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。
当社は、毎年３月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年３月31日（事業年度の終了）から３ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会
取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。
当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会
当社の監査等委員会は、５名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

（３）運用の意思決定プロセス（2024年3月末現在）

１．投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
２．各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
３．各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
４．トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
５．運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2024年3月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類			ファンド本数	純資産額（単位：億円）
投資信託総合計			802	311,686
	株式投資信託		756	271,707
		単位型	291	9,045
		追加型	465	262,662
	公社債投資信託		46	39,979
		単位型	33	996
		追加型	13	38,983

３【委託会社等の経理状況】

１．　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）

並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
　また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第64期事業年度（2022年４月１日から2023年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
　また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第65期中間会計期間（2023年４月１日から2023年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第63期 (2022年３月31日)		第64期 (2023年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,427		42,036
有価証券		170		1,025
前払費用		932		908
未収入金		96	※4	410
未収委託者報酬		25,193		21,336
未収収益	※3	1,048	※3	589
関係会社短期貸付金		5,005		3,318
立替金		1,056		1,015
その他	※2	998	※2	1,233
流動資産合計		76,928		71,875
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	244	※1	245
器具備品	※1	153	※1	122
有形固定資産合計		397		367
無形固定資産				
ソフトウエア		335		390
無形固定資産合計		335		390
投資その他の資産				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448
投資その他の資産合計		50,667		46,465
固定資産合計		51,399		47,224
資産合計		128,328		119,099

（単位：百万円）

	第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	651	433
未払金	9,693	7,557

未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,783		6,586
その他未払金		831		892
未払費用	※3	5,572	※3	4,227
未払法人税等		2,354		-
未払消費税等	※4	3,669		-
賞与引当金		3,958		2,563
役員賞与引当金		5		218
訴訟損失引当金		7,847		-
その他		1,330		647
流動負債合計		35,083		15,648
固定負債				
退職給付引当金		1,395		1,424
賞与引当金		423		437
役員賞与引当金		-		16
その他		390		181
固定負債合計		2,209		2,059
負債合計		37,292		17,708
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		68,901		79,307
利益剰余金合計		68,901		79,307
自己株式		△2,067		△2,067
株主資本合計		89,417		99,823
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,350		2,056
繰延ヘッジ損益		△731		△488
評価・換算差額等合計		1,618		1,567
純資産合計		91,035		101,391
負債純資産合計		128,328		119,099

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第63期 (自　2021年４月１日 至　2022年３月31日)	第64期 (自　2022年４月１日 至　2023年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	94,938	73,998
その他営業収益	4,743	3,479
営業収益合計	99,682	77,477
営業費用		
支払手数料	42,026	30,699
広告宣伝費	987	755
公告費	1	3

調査費	23,000	17,479
調査費	1,042	1,170
委託調査費	21,932	16,282
図書費	25	26
委託計算費	598	581
営業雑経費	1,014	948
通信費	143	139
印刷費	308	309
協会費	52	56
諸会費	13	16
その他	494	427
営業費用計	67,628	50,469
一般管理費		
給料	11,759	9,818
役員報酬	156	314
役員賞与引当金繰入額	5	234
給料・手当	7,229	6,544
賞与	143	147
賞与引当金繰入額	4,225	2,577
交際費	22	56
寄付金	29	24
旅費交通費	66	205
租税公課	429	433
不動産賃借料	937	938
退職給付費用	394	383
退職金	169	155
固定資産減価償却費	172	183
福利費	1,171	1,097
諸経費	3,888	4,291
一般管理費計	19,042	17,588
営業利益	13,010	9,420

（単位：百万円）

		第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）		第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
営業外収益				
受取利息		71		107
受取配当金	※１	5,257	※１	9,255
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		1,548		－
その他		58		236
営業外収益合計		6,936		9,601
営業外費用				
支払利息		177		407
デリバティブ費用		49		389
有価証券償還損		－		6
時効成立後支払分配金・償還金		9		1
為替差損		－		342
その他		39		15
営業外費用合計		275		1,163
経常利益		19,672		17,858
特別利益				

投資有価証券売却益		253		427
子会社有償減資払戻益		1,445		―
訴訟損失引当金戻入額		―	※3	4,481
特別利益合計		1,699		4,909
特別損失				
投資有価証券売却損		132		347
固定資産処分損		0		0
訴訟損失引当金繰入額		7,847		―
特別損失合計		7,980		347
税引前当期純利益		13,391		22,420
法人税、住民税及び事業税		3,435		1,340
法人税等還付税額	※2	△329		―
法人税等調整額		△1,851		3,252
法人税等合計		1,255		4,593
当期純利益		12,136		17,826

（3）【株主資本等変動計算書】

第63期（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	△2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				△5,191	△5,191		△5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	―	―	―	6,944	6,944	―	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	△2,067	89,417

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				△5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	889	△847	41	41
当期変動額合計	889	△847	41	6,985
当期末残高	2,350	△731	1,618	91,035

第64期（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本

	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	△2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				△7,420	△7,420		△7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	10,406	10,406	－	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	△2,067	99,823

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,350	△731	1,618	91,035
当期変動額				
剰余金の配当				△7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△294	242	△51	△51
当期変動額合計	△294	242	△51	10,355
当期末残高	2,056	△488	1,567	101,391

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

	(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4 収益の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。 (2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。 (3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。
5 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

（会計方針の変更）

第64期 （自 2022年４月１日 至 2023年３月31日）
（時価の算定に関する会計基準の適用） 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。本会計基準適用指針の適用が当財務諸表に与える影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

第64期 （自 2022年４月１日 至 2023年３月31日）

その他有価証券の為替リスクヘッジに係るヘッジ損益について、ヘッジ対象の損益認識時に繰延ヘッジ損益を純損益に計上するに当たり、前事業年度において、「為替差損益」に含めていましたが、金額的重要性が高まったことから、ヘッジの効果をより明瞭に表示するため当事業年度よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である投資有価証券売却益あるいは投資有価証券売却損として表示することとしております。

（重要な会計上の見積り）

第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)

１　当事業年度の財務諸表に計上した金額

訴訟損失引当金を7,847百万円計上しております。

２　会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報

(1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法

訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。

(2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定

原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。

(3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響

当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,390百万円 器具備品　823百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,437百万円 器具備品　879百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益　233百万円 (流動負債) 未払費用　2,314百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益　263百万円 (流動負債) 未払費用　1,778百万円
※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。
※５　保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大５百万豪ドルを提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。	※５　保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大448百万円(５百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（損益計算書関係）

第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　5,194百万円	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　9,241百万円

※２　法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。	※３　訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）
第63期（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）
１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	－	－	2,860,000

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	432,300	－	432,300	－	－
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	1,016,000	－	928,000	88,000	－
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	1,772,000	－	956,000	816,000	－
2017年度ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	－	1,071,000	1,536,000	－
合計		5,827,300	－	3,387,300	2,440,000	－

(注) １　当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
２　2016年度ストックオプション(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

４　配当に関する事項
(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年５月25日取締役会	普通株式	5,191	26.74	2021年３月31日	2021年６月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年５月27日取締役会	普通株式	利益剰余金	7,420	38.22	2022年３月31日	2022年６月27日

第64期（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式(株)	2,860,000	―	―	2,860,000

3　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	88,000	―	88,000	―	―
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	816,000	―	599,000	217,000	―
2017年度ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	―	784,000	752,000	―
合計		2,440,000	―	1,391,800	969,000	―

(注) 1　当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
2　2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年５月27日取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年３月31日	2022年６月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年５月26日取締役会	普通株式	利益剰余金	5,092	26.23	2023年３月31日	2023年６月27日

(リース取引関係)

第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）		第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	
オペレーティング・リース取引		オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	911百万円	１年内	899百万円
１年超	4,324百万円	１年超	3,425百万円
合計	5,236百万円	合計	4,324百万円

（金融商品関係）
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
１　金融商品の状況に関する事項
(1) 金融商品に対する取組方針
当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。
また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク
預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重

要な会計方針「５　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。
　営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが１年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。
　上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制
① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理
　当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。
② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理
　当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。
③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理
　当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

２ 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
　貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2019年７月４日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託及び市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。
　また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。
　レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
　レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
　レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

　時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*4）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
デリバティブ取引(*1)				
株式関連（*2）	△262	－	－	△262
通貨関連（*3）	－	△1,066	－	△1,066
デリバティブ取引計	△262	△1,066	－	△1,329

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。
（※２）株式関連のデリバティブ取引のうち△262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
（※３）通貨関連のデリバティブ取引の△1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
（※４）時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債
　現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明
デリバティブ取引
株式関連
　株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベ

ル１に分類しております。
通貨関連
為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル２の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

３　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１ 金融商品の状況に関する事項
(1) 金融商品に対する取組方針
当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。
また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク
預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「５　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。
営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが１年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。
上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制
① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理
当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。
② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理
当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目

的でデリバティブ取引を行っております。
③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理
当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。
また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。
レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	6,238	18,045	－	24,283
資産計	6,238	18,045	－	24,283
デリバティブ取引(*1)				
株式関連（*2）	△246	－	－	△246
通貨関連（*3）	－	△352	－	△352
デリバティブ取引計	△246	△352	－	△599

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。
（※２）株式関連のデリバティブ取引のうち△246百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。
（※３）通貨関連のデリバティブ取引の△352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債
現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明
資　産
有価証券
上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル１の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル２の時価に分類しております。

デリバティブ取引
株式関連
株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。
通貨関連
為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル２の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,036			
未収委託者報酬	21,336			

未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

（有価証券関係）
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
１　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

２　その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	△180
	小計	3,188	3,369	△180
合計		24,123	20,735	3,387

(注) １　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。
２　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３　当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,079	253	△132
合計	3,079	253	△132

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

２　その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	7,063	7,459	△395
	小計	7,063	7,459	△395

合計	24,283	21,319	2,963

(注) 1　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。
2　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	11,194	1,349	△221
合計	11,194	1,349	△221

（デリバティブ取引関係）
第63期(2022年３月31日)
1　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,306	-	△ 262	△ 262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	△ 262	△ 262

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	4,708	-	△ 293	△ 293
合計		4,708	-	△ 293	△ 293

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	5,445	-	△367
	豪ドル		222	-	△20
	香港ドル		1,097	-	△59
	人民元		5,185	-	△324
	ユーロ		35	-	△0
合計			11,986	-	△772

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第64期(2023年３月31日)
1　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	10,970	-	△ 246	△ 246
合計		10,970	-	△ 246	△ 246

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
　　2　時価の算定方法
　　金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 シンガポールドル	3,275	-	△ 24	△ 24
合計		3,275	-	△ 24	△ 24

(注) 1　時価の算定方法
　　取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	6,132	-	△280
	豪ドル		105	-	0
	香港ドル		699	-	△34
	人民元		5,822	-	△1
	ユーロ		234	-	△10
合計			12,994	-	△328

(注) 1　時価の算定方法
　　取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1)関連会社に対する投資の金額　5,312	(1)関連会社に対する投資の金額　5,326
(2)持分法を適用した場合の投資の金額　15,942	(2)持分法を適用した場合の投資の金額　16,722
(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,964	(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,185

(退職給付関係)
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
1　採用している退職給付制度の概要
　　当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2　確定給付制度
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	△12
退職給付の支払額	△211
退職給付債務の期末残高	1,352

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.3%

3　確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
1　採用している退職給付制度の概要
当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2　確定給付制度
（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	△16
退職給付の支払額	△107
退職給付債務の期末残高	1,366

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	△1
確定給付制度に係る退職給付費用	136

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.6%

3　確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

（ストックオプション等関係）
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
1　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況
(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月７日	2016年７月15日

権利確定条件	2013年10月７日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年７月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月７日から 2021年10月６日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株	普通株式　4,422,000株
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日
権利確定条件	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月７日	2016年７月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	－	88,000
権利確定後(株)		
期首	－	－
権利確定	－	－
権利行使	－	－
失効	－	－
権利未行使残	－	－

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日
権利確定前(株)		

期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月７日	2016年７月15日
権利行使価格(円)	737(注)３	558
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

(注)　１　公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　1,222百万円
３　株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況
(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　16名	当社及び関係会社の取締役・従業員　31名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,437,000株	普通株式　4,409,000株
付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利確定条件	2018年７月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2018年7月15日から2026年7月31日まで	2019年4月27日から2027年4月30日まで

	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式　4,422,000株
付与日	2018年４月27日
権利確定条件	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	539,000
権利確定	0	0
権利未確定残	－	217,000
権利確定後(株)		
期首	－	－
権利確定	－	－
権利行使	－	－
失効	－	－
権利未行使残	－	－

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年４月27日
権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
権利確定後(株)	
期首	－
権利確定	－
権利行使	－

失効	―
権利未行使残	―

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年７月15日	2017年４月27日
権利行使価格(円)	558	553
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年４月27日
権利行使価格(円)	694
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0

(注)　１　公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
　　２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
　　当事業年度末における本源的価値の合計額　　344百万円

(税効果会計関係)

第63期 (2022年３月31日)		第64期 (2023年３月31日)	
１　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		１　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,341	賞与引当金	918
投資有価証券評価損	97	投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	52	関係会社株式評価損	52
退職給付引当金	427	退職給付引当金	436
固定資産減価償却費	87	固定資産減価償却費	83
繰延ヘッジ損益	322	繰延ヘッジ損益	215
訴訟損失引当金	2,403	その他	672
その他	1,039	繰延税金資産小計	2,478
繰延税金資産小計	5,772	評価性引当金	△52
評価性引当金(注)	△52	繰延税金資産合計	2,425
繰延税金資産合計	5,719		
		繰延税金負債	
繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	1,028
その他有価証券評価差額金	1,092	その他	948
その他	948	繰延税金負債合計	1,977
繰延税金負債合計	2,041	繰延税金資産の純額	448
繰延税金資産の純額	3,678		
(注)関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円減少しております。			

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△10.9%
評価性引当金の減少	△10.3%
その他	△0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	9.4%

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△12.0%
その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	20.5%

（関連当事者情報）
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
１　関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引
(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369(SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	―	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	2,019(USD 16,500 千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44(USD 397千)	未収収益	10(USD 86 千)
							資金の返済(円貨建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	―
							貸付金利息(円貨建)(注1)	3	未収収益	―
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	2,788(SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985(SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	23(SGD 266千)	未収収益	23(SGD 266千)
							減資(注2)	9,149(SGD 110,000千)	―	―
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079(USD 千)(注 3)	アセットマネジメント業	直接100.00	―	配当の受取	3,788(USD 34,000千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等
1　融資枠5,300百万円（若しくは5,300百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2　Nikko Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
3　Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記
(1) 親会社情報
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報
当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計　　34,450百万円
負債合計　　6,257百万円
純資産合計　　28,192百万円

営業収益　　18,176百万円
税引前当期純利益　　5,587百万円
当期純利益　　3,956百万円

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引
(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369(SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	―	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	3,318(SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	103(SGD 1,043千)	未収収益	55(SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貨建)(注2)	2,019(USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	―
							貸付金利息(米国ドル貨建)(注2)	3(USD 26千)	未収収益	―
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079(USD千)(注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	―	配当の受取	7,795(USD 58,000千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等
1．融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2．融資枠5,300百万円（若しくは5,300百万円相当額の外国通貨）、返済期間１年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しておりました（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております）。
3．Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記
(1) 親会社情報
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報
当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2022年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計　　34,828百万円
負債合計　　5,655百万円
純資産合計　　29,173百万円

営業収益　　15,864百万円
税引前当期純利益　　4,191百万円
当期純利益　　3,159百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
１　製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

２　地域ごとの情報
（１）営業収益
国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

２　地域ごとの情報
（１）営業収益
国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
該当事項はありません。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
該当事項はありません。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
該当事項はありません。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
該当事項はありません。

(収益認識関係)
第63期(自　2021年４月１日　至　2022年３月31日)
１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

２　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針)　４　収益の計上基準」に記載のとおりです。

３　顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針)　４　収益の計上基準」に記載のとおりです。

３　顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（１株当たり情報）

項目	第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
１株当たり純資産額	468円88銭	522円22銭
１株当たり当期純利益金額	62円50銭	91円81銭

(注)１　潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	第64期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）
当期純利益（百万円）	12,136	17,826
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－	－
普通株式に係る当期純利益（百万円）	12,136	17,826
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション（1）　88,000株、2016年度ストックオプション（2）816,000株、2017年度ストックオプション（1）1,536,000株	2016年度ストックオプション（2）　217,000株、2017年度ストックオプション（1）752,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (2022年３月31日)	第64期 (2023年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	91,035	101,391
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－	－
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	91,035	101,391
１株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

（重要な後発事象）

当社は2022年12月21日付け株式売買契約書に基づき、星州子会社の日興アセットマネジメントインターナショナルが保有する関連会社AHAMアセットマネジメントBerhadの20%の株式を、2023年４月19日に13,412百万円で取得しました。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

(単位：百万円)

	第65期中間会計期間 (2023年９月30日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,751
金銭の信託		2,500
有価証券		78
未収委託者報酬		16,602
未収収益		940
その他	※２	3,797
流動資産合計		55,670
固定資産		
有形固定資産	※１	330
無形固定資産		389
投資その他の資産		
投資有価証券		24,116
関係会社株式		37,647
長期差入保証金		338
繰延税金資産		240
投資その他の資産合計		62,343
固定資産合計		63,063
資産合計		118,734

（単位：百万円）

		第65期中間会計期間 （2023年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		8,446
未払費用		3,085
未払法人税等		1,334
未払消費税等	※３	575
賞与引当金		1,383
役員賞与引当金		162
その他		1,230
流動負債合計		16,218
固定負債		
退職給付引当金		1,458
賞与引当金		397
役員賞与引当金		40
その他		170
固定負債合計		2,067
負債合計		18,286
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	77,549
利益剰余金合計	77,549
自己株式	△2,067
株主資本合計	98,066
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,457
繰延ヘッジ損益	△1,075
評価・換算差額等合計	2,381
純資産合計	100,447
負債純資産合計	118,734

（２）中間損益計算書

(単位：百万円)

		第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		37,779
その他営業収益		1,652
営業収益合計		39,431
営業費用及び一般管理費	※１	35,014
営業利益		4,416
営業外収益	※２	1,245
営業外費用	※３	1,458
経常利益		4,203
特別利益	※４	501
特別損失	※５	99
税引前中間純利益		4,605
法人税等	※６	1,270
中間純利益		3,335

（３）中間株主資本等変動計算書

第65期中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	△ 2,067	99,823
当中間期変動額							
剰余金の配当				△ 5,092	△ 5,092		△ 5,092
中間純利益				3,335	3,335		3,335
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	－	－	－	△ 1,757	△ 1,757	－	△ 1,757

当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	77,549	77,549	△ 2,067	98,066

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,056	△ 488	1,567	101,391
当中間期変動額				
剰余金の配当				△ 5,092
中間純利益				3,335
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	1,400	△ 587	813	813
当中間期変動額合計	1,400	△ 587	813	△ 943
当中間期末残高	3,457	△ 1,075	2,381	100,447

注記事項
（重要な会計方針）

項目	第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
３　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

	① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4 収益の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。 (2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。 (3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。
5 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。 (2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。

（中間貸借対照表関係）

第65期中間会計期間 (2023年９月30日)
※１ 有形固定資産の減価償却累計額 2,354百万円

※２　信託資産
　　流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　消費税等の取扱い
　　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

※４　保証債務
　　ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興ＡＭエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大480百万円（５百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（中間損益計算書関係）

第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)	
※１　減価償却実施額	
有形固定資産	46百万円
無形固定資産	50百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	16百万円
受取配当金	1,205百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	255百万円
為替差損	184百万円
デリバティブ費用	1,017百万円
※４　特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	501百万円
※５　特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	97百万円
※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第65期中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	2,860,000	－	－	2,860,000

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	

2016年度 ストックオプション（2）	普通株式	217,000	―	96,000	121,000	―
2017年度 ストックオプション（1）	普通株式	752,000	―	406,000	346,000	―
合計		969,000	―	502,000	467,000	―

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
2 2016年度ストックオプション(2)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円
1年超	3,049百万円
合計	3,961百万円

(金融商品関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（1）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	―	2,500	―	2,500
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	6,821	17,357	―	24,178
資産計	6,821	19,857	―	26,678
デリバティブ取引(※1、2)				
株式関連	242	―	―	242
通貨関連	―	△685	―	△685
デリバティブ取引計	242	△685	―	△442

（※1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

（※2）株式関連のデリバティブ取引のうち242百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち685百万円は、流動負債のその他に含まれております。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資　産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル２の時価に分類しております。

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル１の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル２の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル２の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

（有価証券関係）

第65期中間会計期間(2023年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

(注)子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であり、（金融商品関係）金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項（注２）に記載のとおりであります。

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	22,320	17,117	5,202
	小計	22,320	17,117	5,202
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,858	2,078	△220
	小計	1,858	2,078	△220
合計		24,178	19,195	4,982

(注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。

2 非上場株式（中間貸借対照表計上額16百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第65期中間会計期間(2023年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
	株価指数先物取引				

市場取引	売建	13,289	-	242	242
合計		13,289	-	242	242

(注)１　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	6,055	－	△528
	豪ドル		124	－	△2
	ユーロ		344	－	△7
	香港ドル		527	－	△53
	人民元		2,876	－	△93
合計			9,928	－	△685

（持分法損益等）

第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,339百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	16,494百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,148百万円

（収益認識関係）

第65期中間会計期間(2023年９月30日)

１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針　４．収益の計上基準」に記載の通りです。

３　顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

［関連情報］

第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)

１　製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しており

ます。

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３ 主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第65期中間会計期間(自　2023年４月１日　至　2023年９月30日)
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)
１株当たり純資産額	517円36銭
１株当たり中間純利益金額	17円17銭

(注)　１　潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額については、新株予約権等の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第65期中間会計期間 (自　2023年４月１日 至　2023年９月30日)
中間純利益（百万円）	3,335
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,335
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2)121,000株、 2017年度ストックオプション(1)346,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第65期中間会計期間 (2023年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	100,447
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	100,447
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,152

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

（１）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項
委託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訴訟事件などは発生していません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （2023年3月末現在）	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （2023年3月末現在）	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	

（３）投資顧問会社

名　　称	資本金の額	事業の内容
日興グローバルラップ株式会社※	1,499百万円 （2023年12月末現在）	資産運用に関する業務を営んでいます。
ピムコジャパンリミテッド	13,411,674.44米ドル （2023年12月末現在）	
キャピタル・インターナショナル株式会社	450百万円 （2023年6月末現在）	
ＪＰモルガン・アセット・マネジメント（ＵＫ）リミテッド	24百万ポンド （2023年9月末現在）	

※「日興グローバルラップ株式会社」は、2024年10月1日付で「ＳＭＢＣグローバル・インベストメント＆コンサルティング株式会社」へ商号変更する予定です。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

（２）販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

（３）投資顧問会社

・各資産の適切な配分比率についての投資助言

日興グローバルラップ株式会社※

※「日興グローバルラップ株式会社」は、2024年10月1日付で「ＳＭＢＣグローバル・インベストメント＆コンサルティング株式会社」へ商号変更する予定です。

・委託会社から、投資対象ファンドの運用指図権限の委託を受け当該ファンドの運用（投資一任）を行ないます。

ピムコジャパンリミテッド

キャピタル・インターナショナル株式会社

・委託会社から、マザーファンドの運用指図権限の委託を受け当該ファンドの運用（投資一任）を行ないます。

ＪＰモルガン・アセット・マネジメント（ＵＫ）リミテッド

３【資本関係】

（１）受託会社

該当事項はありません。

（２）販売会社

該当事項はありません。

（３）投資顧問会社

該当事項はありません。

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。

（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

① 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
② ファンドの基本的性格など
③ 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④ 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
⑤ 目論見書の使用開始日

（３）目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

① 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
② 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
③ 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
④ 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
⑤ 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
⑥ 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
⑦ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨ 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
⑩ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
⑪ 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
⑫ 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

（４）有価証券届出書本文「第一部　証券情報」、「第二部　ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

（５）目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部　ファンド情報」中「第１　ファンドの状況」「２　投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

（６）投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

（７）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

（８）交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

① ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
② 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
③ ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
④ 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2023年６月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　秋　宗　勝　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2022年４月１日から2023年３月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容
その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連

する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年6月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　辻村　和之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興スリートップ（隔月分配型）の2023年9月16日から2024年3月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興スリートップ（隔月分配型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2023年12月５日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　秋 宗 勝 彦

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年４月１日から2024年３月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年４月１日から2023年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年４月１日から2023年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付け

る。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。