

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年4月30日
【発行者名】	ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. (Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.)
【代表者の役職氏名】	エグゼクティブ・ディレクター ファブリス・マス (Fabrice Mas)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L-1150、アーロン通 り 287-289番 (287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三浦 健
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三浦 健 同 青山 正幸
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【届出の対象とした募集（売出）	外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション (Emerging Bond Fund Currency Selection) －米ドル・ポートフォリオ (USD Portfolio) －ユーロ・ポートフォリオ (EUR Portfolio) －豪ドル・ポートフォリオ (AUD Portfolio) －南アフリカランド・ポートフォリオ (ZAR Portfolio)
【届出の対象とした募集（売出）	外国投資信託受益証券の金額】 －米ドル・ポートフォリオ受益証券：100億アメリカ合衆国ドル （約1兆4,707億円）を上限とする。 －ユーロ・ポートフォリオ受益証券：80億ユーロ（約1兆2,921億 円）を上限とする。 －豪ドル・ポートフォリオ受益証券：140億オーストラリア・ドル （約1兆3,643億円）を上限とする。 －南アフリカランド・ポートフォリオ受益証券：960億南アフリカ ランド（約7,536億円）を上限とする。

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

米ドル・ポートフォリオ：アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）

ユーロ・ポートフォリオ：ユーロ

豪ドル・ポートフォリオ：オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）

南アフリカランド・ポートフォリオ：南アフリカランド

（注2）米ドル、ユーロ、豪ドルおよび南アフリカランドの円貨換算は、2023年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、1米ドル＝147.07円、1ユーロ＝161.51円、1豪ドル＝97.45円および1南アフリカランド＝7.85円による。
以下同じ。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2024年1月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、「第二部 ファンド情報」の「第1 ファンドの状況、5 運用状況」および「第3 ファンドの経理状況」、ならびに「第三部 特別情報、第1 管理会社の概況」の「1 管理会社の概況」、「2 事業の内容及び営業の概況」および「5 その他」を新たな情報により訂正および追加するため、また、「第二部 ファンド情報」の「第1 ファンドの状況」の「1 ファンドの性格、(3) ファンドの仕組み、③ 管理会社の概況」、「2 投資方針、(3) 運用体制」、「3 投資リスク、(2) リスクに対する管理体制」、「4 手数料等及び税金、(5) 課税上の取扱い」および「5 運用状況、(2) 投資資産」を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

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

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

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

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション (Emerging Bond Fund Currency Selection)（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドである米ドル・ポートフォリオ (USD Portfolio)、ユーロ・ポートフォリオ (EUR Portfolio)、豪ドル・ポートフォリオ (AUD Portfolio) および南アフリカランド・ポートフォリオ (ZAR Portfolio) の運用状況は以下のとおりである。

(1) 投資状況（資産別および地域別の投資状況）（2024年2月末日現在）
＜米ドル・ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（%）
外国投資信託	ケイマン諸島	15,721,276.37	99.44
現金・その他の資産 （負債控除後）		88,384.24	0.56
合計（純資産総額）		15,809,660.61 (約2,382百万円)	100.00

- (注1) 投資比率とは、各サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。
- (注2) 各サブ・ファンドは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各サブ・ファンドの参照通貨は以下の通りである。
米ドル・ポートフォリオ：アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）
ユーロ・ポートフォリオ：ユーロ
豪ドル・ポートフォリオ：オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）
南アフリカランド・ポートフォリオ：南アフリカランド
- (注3) 別途定める場合を除き、米ドル、ユーロ、豪ドルおよび南アフリカランドの円貨換算は、2024年2月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、1米ドル＝150.67円、1ユーロ＝163.25円、1豪ドル＝97.88円および1南アフリカランド＝7.81円による。以下同じ。
- (注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。従って、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

＜ユーロ・ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（ユーロ）	投資比率（%）
外国投資信託	ケイマン諸島	2,124,308.53	99.68
現金・その他の資産 （負債控除後）		6,781.70	0.32
合計（純資産総額）		2,131,090.23 (約348百万円)	100.00

＜豪ドル・ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（豪ドル）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	7,135,503.15	99.52
現金・その他の資産 （負債控除後）		34,156.06	0.48
合計（純資産総額）		7,169,659.21 （約702百万円）	100.00

＜南アフリカランド・ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計 （南アフリカランド）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン諸島	136,674,835.02	99.58
現金・その他の資産 （負債控除後）		571,773.13	0.42
合計（純資産総額）		137,246,608.15 （約1,072百万円）	100.00

（２）運用実績**① 純資産の推移**

2024年2月末日までの1年間における各月末の純資産の推移は、以下のとおりである。

<米ドル・ポートフォリオ>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2023年3月末日	17,670,188.66	2,662,367	65.00	9,794
4月末日	16,867,382.80	2,541,409	64.42	9,706
5月末日	16,582,466.01	2,498,480	63.73	9,602
6月末日	16,662,048.31	2,510,471	65.10	9,809
7月末日	16,758,745.69	2,525,040	65.85	9,922
8月末日	16,356,717.67	2,464,467	64.59	9,732
9月末日	15,759,789.36	2,374,527	62.46	9,411
10月末日	15,479,526.39	2,332,300	61.81	9,313
11月末日	15,974,875.85	2,406,935	64.72	9,751
12月末日	16,303,495.65	2,456,448	67.46	10,164
2024年1月末日	16,037,849.66	2,416,423	66.52	10,023
2月末日	15,809,660.61	2,382,042	66.57	10,030

<ユーロ・ポートフォリオ>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	ユーロ	千円	ユーロ	円
2023年3月末日	2,340,300.04	382,054	42.56	6,948
4月末日	2,312,479.34	377,512	42.23	6,894
5月末日	2,282,292.84	372,584	41.77	6,819
6月末日	2,325,118.12	379,576	42.64	6,961
7月末日	2,345,060.91	382,831	43.20	7,052
8月末日	2,258,767.86	368,744	42.35	6,914
9月末日	2,180,723.45	356,003	40.94	6,683
10月末日	2,158,589.36	352,390	40.53	6,617
11月末日	2,123,154.25	346,605	42.47	6,933
12月末日	2,188,910.44	357,340	44.14	7,206
2024年1月末日	2,133,194.24	348,244	43.56	7,111
2月末日	2,131,090.23	347,900	43.58	7,114

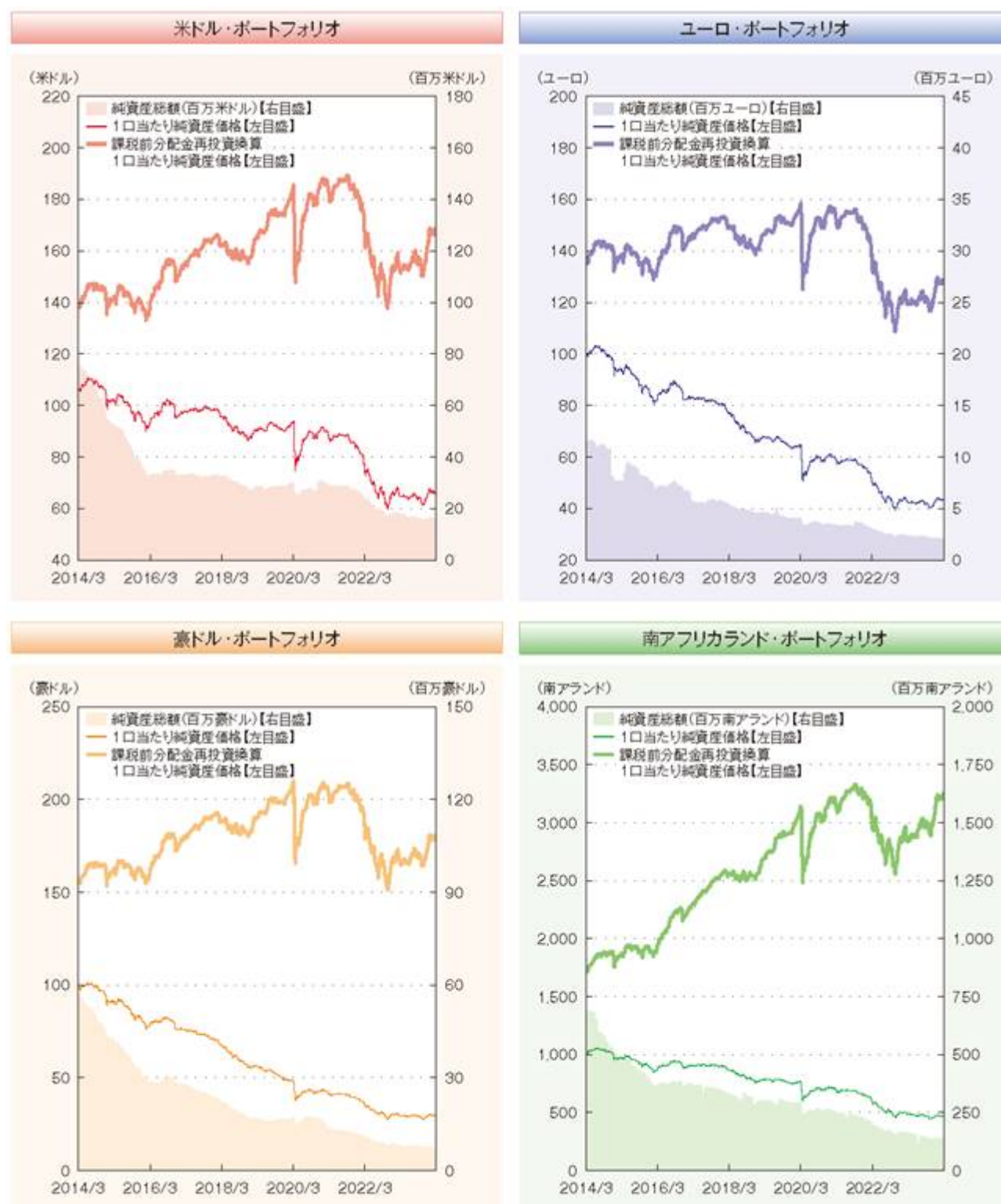
<豪ドル・ポートフォリオ>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2023年3月末日	7,702,857.88	753,956	29.67	2,904
4月末日	7,581,798.24	742,106	29.36	2,874
5月末日	7,824,838.83	765,895	29.01	2,839
6月末日	8,011,947.17	784,209	29.83	2,920
7月末日	8,083,466.05	791,210	30.12	2,948
8月末日	7,879,793.61	771,274	29.47	2,885
9月末日	7,562,754.52	740,242	28.53	2,793
10月末日	7,399,312.53	724,245	28.18	2,758
11月末日	7,517,011.91	735,765	29.39	2,877
12月末日	7,659,966.27	749,757	30.42	2,978
2024年1月末日	7,502,806.87	734,375	30.00	2,936
2月末日	7,169,659.21	701,766	29.96	2,932

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	南アフリカランド	千円	南アフリカランド	円
2023年3月末日	157,508,271.38	1,230,140	483.07	3,773
4月末日	154,678,467.85	1,208,039	476.67	3,723
5月末日	120,945,385.30	944,583	469.33	3,665
6月末日	146,937,008.87	1,147,578	481.01	3,757
7月末日	147,356,348.27	1,150,853	484.11	3,781
8月末日	143,408,843.07	1,120,023	472.96	3,694
9月末日	136,597,613.14	1,066,827	456.13	3,562
10月末日	133,631,237.25	1,043,660	449.09	3,507
11月末日	137,591,501.02	1,074,590	467.17	3,649
12月末日	141,077,698.64	1,101,817	482.43	3,768
2024年1月末日	138,515,757.17	1,081,808	473.83	3,701
2月末日	137,246,608.15	1,071,896	471.50	3,682

<参考情報>



- 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各サブ・ファンドの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金(課税前)をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。
- グラフの計算の基礎となる1口当たり純資産価格は、2021年10月12日以降、小数点以下第8位までの数値を使用しています。

② 分配の推移

2024年2月末日までの1年間の1口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

＜米ドル・ポートフォリオ＞

計算期間	1口当たり分配金	
	米ドル	円
2023年3月1日～2024年2月末日	4.68	705

＜ユーロ・ポートフォリオ＞

計算期間	1口当たり分配金	
	ユーロ	円
2023年3月1日～2024年2月末日	2.04	333

＜豪ドル・ポートフォリオ＞

計算期間	1口当たり分配金	
	豪ドル	円
2023年3月1日～2024年2月末日	2.16	211

＜南アフリカランド・ポートフォリオ＞

計算期間	1口当たり分配金	
	南アフリカランド	円
2023年3月1日～2024年2月末日	74.40	581

<参考情報>

米ドル・ポートフォリオ	
(単位:米ドル)	
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	6.60
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	5.96
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	4.68
第13計算期間(2021年8月1日~2022年7月31日)	4.68
第14計算期間(2022年8月1日~2023年7月31日)	4.68
2023年10月	0.39
2023年11月	0.39
2023年12月	0.39
2024年 1 月	0.39
2024年 2 月	0.39
直近1年間累計	4.68
設定来累計	88.73

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

豪ドル・ポートフォリオ	
(単位:豪ドル)	
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	11.88
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	9.92
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	3.50
第13計算期間(2021年8月1日~2022年7月31日)	2.37
第14計算期間(2022年8月1日~2023年7月31日)	2.16
2023年10月	0.18
2023年11月	0.18
2023年12月	0.18
2024年 1 月	0.18
2024年 2 月	0.18
直近1年間累計	2.16
設定来累計	133.85

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

ユーロ・ポートフォリオ	
(単位:ユーロ)	
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	7.80
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	6.52
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	2.36
第13計算期間(2021年8月1日~2022年7月31日)	2.04
第14計算期間(2022年8月1日~2023年7月31日)	2.04
2023年10月	0.17
2023年11月	0.17
2023年12月	0.17
2024年 1 月	0.17
2024年 2 月	0.17
直近1年間累計	2.04
設定来累計	90.47

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

南アフリカランド・ポートフォリオ	
(単位:南アフリカランド)	
第10計算期間(2018年8月1日~2019年7月31日)	128.40
第11計算期間(2019年8月1日~2020年7月31日)	110.40
第12計算期間(2020年8月1日~2021年7月31日)	74.40
第13計算期間(2021年8月1日~2022年7月31日)	74.40
第14計算期間(2022年8月1日~2023年7月31日)	74.40
2023年10月	6.20
2023年11月	6.20
2023年12月	6.20
2024年 1 月	6.20
2024年 2 月	6.20
直近1年間累計	74.40
設定来累計	1,661.00

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

③ 収益率の推移

<米ドル・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2023年3月1日～2024年2月末日	9.63%

（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝上記期間末の1口当たり純資産価格（当該期間中の分配金の合計額を加えた額）

b＝上記期間の直前の日の一口当たり純資産価格（分配額の額）

以下同じ。

<ユーロ・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2023年3月1日～2024年2月末日	7.29%

<豪ドル・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2023年3月1日～2024年2月末日	8.11%

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

計算期間	収益率（注）
2023年3月1日～2024年2月末日	12.56%

<参考情報>



- 収益率(%)=100×(a-b)÷b
a=各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格
b=当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格
- 2024年は2月29日までの収益率を表示しています。
- サブ・ファンドにベンチマークはありません。
- グラフの計算の基礎となる1口当たり純資産価格は、2021年10月12日以降、小数点以下第8位までの数値を使用しています。

2 販売及び買戻しの実績

2024年2月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2024年2月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

<米ドル・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	35,438 (35,438)	237,505 (237,505)

(注) () 内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。以下同じ。

<ユーロ・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
0 (0)	6,088 (6,088)	48,902 (48,902)

<豪ドル・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
14,000 (14,000)	42,532 (42,532)	239,290 (239,290)

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
50,352 (50,352)	85,610 (85,610)	291,083 (291,083)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c. サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドル、ユーロ、豪ドルおよび南アフリカランドで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱UFJ銀行の2024年2月29日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=150.67円、1ユーロ=163.25円、1豪ドル=97.88円および1南アフリカランド=7.81円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

[次へ](#)

（１）資産及び負債の状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー米ドル・ポートフォリオ

純資産計算書

2024年1月31日現在

（米ドルで表示）

	米ドル	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	16,010,356.06	2,412,280
現金（ロング）		
現金および現金等価物	90,207.37	13,592
前払政府手数料		
前払政府手数料	575.94	87
資産合計	16,101,139.37	2,425,959
負債		
未払AIFMD報酬		
未払AIFMD報酬	(277.73)	(42)
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(689.91)	(104)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(27,773.31)	(4,185)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(6,826.74)	(1,029)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(6,899.26)	(1,040)
未払FATCA関連費用		
未払FATCA関連費用	(279.48)	(42)
未払財務書類作成費用		
未払財務書類作成費用	(2,372.06)	(357)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(8,141.27)	(1,227)
未払MLRO報酬		
未払MLRO報酬	(558.96)	(84)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(4,691.55)	(707)
未払金		
未払金	(15.61)	(2)
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(1,341.36)	(202)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(3,422.47)	(516)
負債合計	(63,289.71)	(9,536)
純資産総額	16,037,849.66	2,416,423
発行済口数	241,105	口
1口当たり純資産価格	66.52	米ドル

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションーユーロ・ポートフォリオ

純資産計算書

2024年1月31日現在

(ユーロで表示)

	ユーロ	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	2,132,429.54	348,119
現金（ロング）		
現金および現金等価物	11,994.76	1,958
前払政府手数料		
前払政府手数料	534.09	87
未収金		
未収金	(3.89)	(1)
資産合計	2,144,954.50	350,164
負債		
未払AIFMD報酬		
未払AIFMD報酬	(255.12)	(42)
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(91.79)	(15)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(3,556.70)	(581)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(919.08)	(150)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(918.13)	(150)
未払FATCA関連費用		
未払FATCA関連費用	(256.29)	(42)
未払財務書類作成費用		
未払財務書類作成費用	(230.00)	(38)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(1,083.32)	(177)
未払MLRO報酬		
未払MLRO報酬	(512.57)	(84)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(624.32)	(102)
未払金		
未払金	37.90	6
未払報告書作成費用		
未払報告書作成費用	0.00	0
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(180.91)	(30)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(3,169.93)	(517)
負債合計	(11,760.26)	(1,920)
純資産総額	2,133,194.24	348,244
発行済口数	48,977	口
1口当たり純資産価格	43.56	ユーロ

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー豪ドル・ポートフォリオ

純資産計算書

2024年1月31日現在

(豪ドルで表示)

	豪ドル	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	7,488,400.62	732,965
現金（ロング）		
現金および現金等価物	47,741.49	4,673
前払政府手数料		
前払政府手数料	873.83	86
未収金		
未収金	31,997.44	3,132
資産合計	7,569,013.38	740,855
負債		
未払AIFMD報酬		
未払AIFMD報酬	(419.24)	(41)
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(319.19)	(31)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(14,030.62)	(1,373)
資本準備金		
資本準備金	(30,904.80)	(3,025)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(3,216.48)	(315)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(3,191.54)	(312)
未払FATCA関連費用		
未払FATCA関連費用	(419.96)	(41)
未払財務書類作成費用		
未払財務書類作成費用	(1,331.90)	(130)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(3,766.05)	(369)
未払MLRO報酬		
未払MLRO報酬	(839.94)	(82)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(2,170.27)	(212)
未払金		
未払金	265.36	26
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(630.95)	(62)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(5,230.93)	(512)
負債合計	(66,206.51)	(6,480)
純資産総額	7,502,806.87	734,375
発行済口数	250,095	口
1口当たり純資産価格	30.00	豪ドル

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー南アフリカランド・ポートフォリオ

純資産計算書

2024年1月31日現在

（南アフリカランドで表示）

	南アフリカランド	千円
資産		
投資有価証券（ロング）		
ファンド	138,330,569.55	1,080,362
現金（ロング）		
現金および現金等価物	808,514.18	6,314
前払政府手数料		
前払政府手数料	10,840.67	85
未収金		
未収金	(128.91)	(1)
資産合計	139,149,795.49	1,086,760
負債		
未払AIFMD報酬		
未払AIFMD報酬	(5,237.59)	(41)
未払代行協会員報酬		
未払代行協会員報酬	(6,112.73)	(48)
未払監査報酬		
未払監査報酬	(272,392.01)	(2,127)
未払保管報酬		
未払保管報酬	(59,491.15)	(465)
未払販売報酬		
未払販売報酬	(61,127.42)	(477)
未払FATCA関連費用		
未払FATCA関連費用	(5,241.51)	(41)
未払財務書類作成費用		
未払財務書類作成費用	(28,247.01)	(221)
未払投資顧問報酬		
未払投資顧問報酬	(72,130.38)	(563)
未払MLRO報酬		
未払MLRO報酬	(10,482.97)	(82)
未払管理報酬		
未払管理報酬	(41,566.65)	(325)
未払金		
未払金	3,876.06	30
未払副投資運用報酬		
未払副投資運用報酬	(11,673.18)	(91)
未払受託報酬		
未払受託報酬	(64,211.78)	(501)
負債合計	(634,038.32)	(4,952)
純資産総額	138,515,757.17	1,081,808
発行済口数	292,332	口
1口当たり純資産価格	473.83	南アフリカランド

[次へ](#)

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー米ドル・ポートフォリオ

運用計算書

2023年8月1日から2024年1月31日までの期間

(米ドルで表示)

		米ドル	千円
収益		690,567.90	104,048
受取配当金		687,143.24	103,532
	ファンド	687,143.24	103,532
受取利息		3,424.66	516
	現金および現金等価物	3,424.66	516
費用		(767,735.30)	(115,675)
A I F M D 報酬		(1,633.20)	(246)
	現金および現金等価物	(1,633.20)	(246)
代行協会員報酬		(4,031.84)	(607)
	現金および現金等価物	(4,031.84)	(607)
監査報酬		(28,422.58)	(4,282)
	現金および現金等価物	(28,422.58)	(4,282)
銀行手数料		(158.46)	(24)
	現金および現金等価物	(158.46)	(24)
保管報酬		(10,079.72)	(1,519)
	現金および現金等価物	(10,079.72)	(1,519)
販売報酬		(40,318.77)	(6,075)
	現金および現金等価物	(40,318.77)	(6,075)
配当金		(581,197.11)	(87,569)
	現金および現金等価物	(581,197.11)	(87,569)
F A T C A 関連費用		(1,404.48)	(212)
	現金および現金等価物	(1,404.48)	(212)
財務書類作成費用		(2,652.56)	(400)
	現金および現金等価物	(2,652.56)	(400)
政府手数料		(58.82)	(9)
	現金および現金等価物	(58.82)	(9)
投資顧問報酬		(47,576.21)	(7,168)
	現金および現金等価物	(47,576.21)	(7,168)
弁護士および専門家報酬		(12,205.15)	(1,839)
	現金および現金等価物	(12,205.15)	(1,839)
M L R O 報酬		(2,808.96)	(423)
	現金および現金等価物	(2,808.96)	(423)
管理報酬		(27,416.77)	(4,131)
	現金および現金等価物	(27,416.77)	(4,131)
立替費用		(625.00)	(94)
	現金および現金等価物	(625.00)	(94)
規制報告費用		(91.00)	(14)
	現金および現金等価物	(91.00)	(14)
副投資運用報酬		(2,015.98)	(304)
	現金および現金等価物	(2,015.98)	(304)
受託報酬		(5,038.69)	(759)
	現金および現金等価物	(5,038.69)	(759)
投資に係る実現および未実現損益		217,984.47	32,844
為替に係る未実現損益の変動		43.63	7
	現金および現金等価物	43.63	7
価格に係る未実現損益の変動		611,670.44	92,160
	ファンド	611,670.44	92,160
長期価格に係る損益		(393,642.70)	(59,310)
	ファンド	(393,642.70)	(59,310)
為替取引の時価評価に係る損失		(141.22)	(21)
	現金および現金等価物	(141.22)	(21)
為替取引の時価評価に係る利益		54.32	8
	現金および現金等価物	54.32	8
純損益		140,817.07	21,217

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションーユーロ・ポートフォリオ

運用計算書

2023年8月1日から2024年1月31日までの期間

(ユーロで表示)

		ユーロ	千円
収益		77,271.17	12,615
受取配当金		76,950.24	12,562
	ファンド	76,950.24	12,562
受取利息		320.93	52
	現金および現金等価物	320.93	52
費用		(86,596.72)	(14,137)
A I F M D 報酬		(1,512.48)	(247)
	現金および現金等価物	(1,512.48)	(247)
代行協会員報酬		(548.29)	(90)
	現金および現金等価物	(548.29)	(90)
監査報酬		(3,634.53)	(593)
	現金および現金等価物	(3,634.53)	(593)
銀行手数料		(148.69)	(24)
	現金および現金等価物	(148.69)	(24)
保管報酬		(1,370.87)	(224)
	現金および現金等価物	(1,370.87)	(224)
販売報酬		(5,483.42)	(895)
	現金および現金等価物	(5,483.42)	(895)
配当金		(52,452.99)	(8,563)
	現金および現金等価物	(52,452.99)	(8,563)
F A T C A 関連費用		(1,292.38)	(211)
	現金および現金等価物	(1,292.38)	(211)
財務書類作成費用		(305.44)	(50)
	現金および現金等価物	(305.44)	(50)
政府手数料		(54.00)	(9)
	現金および現金等価物	(54.00)	(9)
投資顧問報酬		(6,470.36)	(1,056)
	現金および現金等価物	(6,470.36)	(1,056)
弁護士および専門家報酬		(1,712.36)	(280)
	現金および現金等価物	(1,712.36)	(280)
M L R O 報酬		(2,580.40)	(421)
	現金および現金等価物	(2,580.40)	(421)
管理報酬		(3,728.71)	(609)
	現金および現金等価物	(3,728.71)	(609)
立替費用		(273.84)	(45)
	現金および現金等価物	(273.84)	(45)
規制報告費用		(86.53)	(14)
	現金および現金等価物	(86.53)	(14)
副投資運用報酬		(274.17)	(45)
	現金および現金等価物	(274.17)	(45)
受託報酬		(4,667.26)	(762)
	現金および現金等価物	(4,667.26)	(762)
投資に係る実現および未実現損益		20,831.34	3,401
為替に係る未実現損益の変動		(582.70)	(95)
	現金および現金等価物	(582.70)	(95)
価格に係る未実現損益の変動		120,585.69	19,686
	ファンド	120,585.69	19,686
長期価格に係る損益		(99,457.39)	(16,236)
	ファンド	(99,457.39)	(16,236)
為替取引の時価評価に係る損失		(117.68)	(19)
	現金および現金等価物	(117.68)	(19)
為替取引の時価評価に係る利益		403.42	66
	現金および現金等価物	403.42	66
純損益		11,505.79	1,878

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー豪ドル・ポートフォリオ

運用計算書

2023年8月1日から2024年1月31日までの期間

(豪ドルで表示)

		豪ドル	千円
収益		274,067.67	26,826
受取配当金		272,878.26	26,709
	ファンド	272,878.26	26,709
受取利息		1,189.41	116
	現金および現金等価物	1,189.41	116
費用		(382,602.57)	(37,449)
A I F M D 報酬		(2,507.23)	(245)
	現金および現金等価物	(2,507.23)	(245)
代行協会員報酬		(1,918.21)	(188)
	現金および現金等価物	(1,918.21)	(188)
監査報酬		(14,356.31)	(1,405)
	現金および現金等価物	(14,356.31)	(1,405)
銀行手数料		(245.69)	(24)
	現金および現金等価物	(245.69)	(24)
保管報酬		(4,795.51)	(469)
	現金および現金等価物	(4,795.51)	(469)
販売報酬		(19,182.12)	(1,878)
	現金および現金等価物	(19,182.12)	(1,878)
配当金		(280,323.72)	(27,438)
	現金および現金等価物	(280,323.72)	(27,438)
F A T C A 関連費用		(2,132.43)	(209)
	現金および現金等価物	(2,132.43)	(209)
財務書類作成費用		(1,265.84)	(124)
	現金および現金等価物	(1,265.84)	(124)
政府手数料		(88.71)	(9)
	現金および現金等価物	(88.71)	(9)
投資顧問報酬		(22,634.98)	(2,216)
	現金および現金等価物	(22,634.98)	(2,216)
弁護士および専門家報酬		(6,122.43)	(599)
	現金および現金等価物	(6,122.43)	(599)
M L R O 報酬		(4,264.87)	(417)
	現金および現金等価物	(4,264.87)	(417)
管理報酬		(13,043.89)	(1,277)
	現金および現金等価物	(13,043.89)	(1,277)
立替費用		(881.48)	(86)
	現金および現金等価物	(881.48)	(86)
規制報告費用		(142.83)	(14)
	現金および現金等価物	(142.83)	(14)
副投資運用報酬		(959.09)	(94)
	現金および現金等価物	(959.09)	(94)
受託報酬		(7,737.23)	(757)
	現金および現金等価物	(7,737.23)	(757)
投資に係る実現および未実現損益		60,204.27	5,893
為替に係る未実現損益の変動		344.49	34
	現金および現金等価物	344.49	34
価格に係る未実現損益の変動		301,767.16	29,537
	ファンド	301,767.16	29,537
長期価格に係る損益		(240,753.38)	(23,565)
	ファンド	(240,753.38)	(23,565)
為替取引の時価評価に係る損失		(1,379.62)	(135)
	現金および現金等価物	(1,379.62)	(135)
為替取引の時価評価に係る利益		225.62	22
	現金および現金等価物	225.62	22
純損益		(48,330.63)	(4,731)

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー南アフリカランド・ポートフォリオ

運用計算書

2023年8月1日から2024年1月31日までの期間

(南アフリカランドで表示)

		南アフリカランド	千円
収益		8,035,111.30	62,754
受取配当金		8,035,111.30	62,754
	ファンド	8,035,111.30	62,754
費用		(12,850,263.37)	(100,361)
A I F M D 報酬		(30,703.88)	(240)
	現金および現金等価物	(30,703.88)	(240)
代行協会員報酬		(35,054.99)	(274)
	現金および現金等価物	(35,054.99)	(274)
監査報酬		(278,736.64)	(2,177)
	現金および現金等価物	(278,736.64)	(2,177)
銀行手数料		(3,027.89)	(24)
	現金および現金等価物	(3,027.89)	(24)
保管報酬		(87,637.61)	(684)
	現金および現金等価物	(87,637.61)	(684)
販売報酬		(350,550.34)	(2,738)
	現金および現金等価物	(350,550.34)	(2,738)
配当金		(11,068,500.40)	(86,445)
	現金および現金等価物	(11,068,500.40)	(86,445)
F A T C A 関連費用		(26,705.58)	(209)
	現金および現金等価物	(26,705.58)	(209)
財務書類作成費用		(24,914.22)	(195)
	現金および現金等価物	(24,914.22)	(195)
政府手数料		(1,108.56)	(9)
	現金および現金等価物	(1,108.56)	(9)
投資顧問報酬		(413,649.42)	(3,231)
	現金および現金等価物	(413,649.42)	(3,231)
弁護士および専門家報酬		(112,040.42)	(875)
	現金および現金等価物	(112,040.42)	(875)
M L R O 報酬		(53,411.09)	(417)
	現金および現金等価物	(53,411.09)	(417)
管理報酬		(238,374.24)	(1,862)
	現金および現金等価物	(238,374.24)	(1,862)
立替費用		(11,740.45)	(92)
	現金および現金等価物	(11,740.45)	(92)
規制報告費用		(1,843.50)	(14)
	現金および現金等価物	(1,843.50)	(14)
副投資運用報酬		(17,527.50)	(137)
	現金および現金等価物	(17,527.50)	(137)
受託報酬		(94,736.64)	(740)
	現金および現金等価物	(94,736.64)	(740)
投資に係る実現および未実現損益		1,545,678.74	12,072
為替に係る未実現損益の変動		(5,605.44)	(44)
	現金および現金等価物	(5,605.44)	(44)
価格に係る未実現損益の変動		5,143,055.13	40,167
	ファンド	5,143,055.13	40,167
長期価格に係る損益		(3,549,457.86)	(27,721)
	ファンド	(3,549,457.86)	(27,721)
為替取引の時価評価に係る損失		(44,911.06)	(351)
	現金および現金等価物	(44,911.06)	(351)
為替取引の時価評価に係る利益		2,598.00	20
	現金および現金等価物	2,598.00	20
短期価格に係る損益		(0.03)	(0)
	ファンド	(0.03)	(0)
純損益		(3,269,473.33)	(25,535)

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー米ドル・ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表
2024年1月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					19,214,079.56	-3,113,516.13	0.00	16,100,563.43	100.00%
現金（ロング）					90,207.37	0.00	0.00	90,207.37	0.56%
現金および現金等価物					90,207.37	0.00	0.00	90,207.37	0.56%
米ドル					90,207.37	0.00	0.00	90,207.37	0.56%
米ドル	USD	90,207.37000	1.0000	90,207.37	90,207.37	0.00	0.00	90,207.37	0.56%
投資有価証券（ロング）					19,123,872.19	-3,113,516.13	0.00	16,010,356.06	99.44%
ファンド					19,123,872.19	-3,113,516.13	0.00	16,010,356.06	99.44%
米ドル					19,123,872.19	-3,113,516.13	0.00	16,010,356.06	99.44%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A クラスF（米ドル）	618337	1,708,682.61000	9.3700	19,123,872.19	19,123,872.19	-3,113,516.13	0.00	16,010,356.06	99.44%
未収金					575.94	0.00	0.00	575.94	100.00%
前払政府手数料					575.94	0.00	0.00	575.94	100.00%
現金および現金等価物					575.94	0.00	0.00	575.94	100.00%
米ドル					575.94	0.00	0.00	575.94	100.00%
米ドル	USD	575.94000	1.0000	575.94	575.94	0.00	0.00	575.94	100.00%
未払金					-63,274.10	-15.61	0.00	-63,289.71	100.00%
未払A I F M D報酬					-277.73	0.00	0.00	-277.73	0.44%
現金および現金等価物					-277.73	0.00	0.00	-277.73	0.44%
ユーロ					-277.73	0.00	0.00	-277.73	0.44%
ユーロ	EUR	-255.12000	1.0000	-255.12	-277.73	0.00	0.00	-277.73	0.44%
未払代行協会員報酬					-689.91	0.00	0.00	-689.91	1.09%
現金および現金等価物					-689.91	0.00	0.00	-689.91	1.09%
米ドル					-689.91	0.00	0.00	-689.91	1.09%
米ドル	USD	-689.91000	1.0000	-689.91	-689.91	0.00	0.00	-689.91	1.09%
未払監査報酬					-27,773.31	0.00	0.00	-27,773.31	43.88%
現金および現金等価物					-27,773.31	0.00	0.00	-27,773.31	43.88%
米ドル					-27,773.31	0.00	0.00	-27,773.31	43.88%
米ドル	USD	-27,773.31000	1.0000	-27,773.31	-27,773.31	0.00	0.00	-27,773.31	43.88%
未払保管報酬					-6,826.74	0.00	0.00	-6,826.74	10.79%
現金および現金等価物					-6,826.74	0.00	0.00	-6,826.74	10.79%
米ドル					-6,826.74	0.00	0.00	-6,826.74	10.79%
米ドル	USD	-6,826.74000	1.0000	-6,826.74	-6,826.74	0.00	0.00	-6,826.74	10.79%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払販売報酬					-6,899.26	0.00	0.00	-6,899.26	10.90%
現金および現金等価物					-6,899.26	0.00	0.00	-6,899.26	10.90%
米ドル					-6,899.26	0.00	0.00	-6,899.26	10.90%
米ドル	USD	-6,899.26000	1.0000	-6,899.26	-6,899.26	0.00	0.00	-6,899.26	10.90%
未払ＦＡＴＣＡ関連費用					-279.48	0.00	0.00	-279.48	0.44%
現金および現金等価物					-279.48	0.00	0.00	-279.48	0.44%
米ドル					-279.48	0.00	0.00	-279.48	0.44%
米ドル	USD	-279.48000	1.0000	-279.48	-279.48	0.00	0.00	-279.48	0.44%
未払財務書類作成費用					-2,372.06	0.00	0.00	-2,372.06	3.75%
現金および現金等価物					-2,372.06	0.00	0.00	-2,372.06	3.75%
ユーロ					-2,372.06	0.00	0.00	-2,372.06	3.75%
ユーロ	EUR	-2,198.67000	1.0000	-2,198.67	-2,372.06	0.00	0.00	-2,372.06	3.75%
未払投資顧問報酬					-8,141.27	0.00	0.00	-8,141.27	12.86%
現金および現金等価物					-8,141.27	0.00	0.00	-8,141.27	12.86%
米ドル					-8,141.27	0.00	0.00	-8,141.27	12.86%
米ドル	USD	-8,141.27000	1.0000	-8,141.27	-8,141.27	0.00	0.00	-8,141.27	12.86%
未払ＭＬＲＯ報酬					-558.96	0.00	0.00	-558.96	0.88%
現金および現金等価物					-558.96	0.00	0.00	-558.96	0.88%
米ドル					-558.96	0.00	0.00	-558.96	0.88%
米ドル	USD	-558.96000	1.0000	-558.96	-558.96	0.00	0.00	-558.96	0.88%
未払管理報酬					-4,691.55	0.00	0.00	-4,691.55	7.41%
現金および現金等価物					-4,691.55	0.00	0.00	-4,691.55	7.41%
米ドル					-4,691.55	0.00	0.00	-4,691.55	7.41%
米ドル	USD	-4,691.55000	1.0000	-4,691.55	-4,691.55	0.00	0.00	-4,691.55	7.41%
未払金					0.00	-15.61	0.00	-15.61	0.02%
現金および現金等価物					0.00	-15.61	0.00	-15.61	0.02%
ユーロ					0.00	-15.61	0.00	-15.61	0.02%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	-15.61	0.00	-15.61	0.02%
未払副投資運用報酬					-1,341.36	0.00	0.00	-1,341.36	2.12%
現金および現金等価物					-1,341.36	0.00	0.00	-1,341.36	2.12%
米ドル					-1,341.36	0.00	0.00	-1,341.36	2.12%
米ドル	USD	-1,341.36000	1.0000	-1,341.36	-1,341.36	0.00	0.00	-1,341.36	2.12%
未払受託報酬					-3,422.47	0.00	0.00	-3,422.47	5.41%
現金および現金等価物					-3,422.47	0.00	0.00	-3,422.47	5.41%
米ドル					-3,422.47	0.00	0.00	-3,422.47	5.41%
米ドル	USD	-3,422.47000	1.0000	-3,422.47	-3,422.47	0.00	0.00	-3,422.47	5.41%
報告額合計：					19,151,381.40	-3,113,531.74	0.00	16,037,849.66	100.00%

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションーユーロ・ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表
2024年1月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					2,719,552.56	-575,128.26	0.00	2,144,424.30	100.00%
現金（ロング）					11,994.76	0.00	0.00	11,994.76	0.56%
現金および現金等価物					11,994.76	0.00	0.00	11,994.76	0.56%
ユーロ					11,994.76	0.00	0.00	11,994.76	0.56%
ユーロ	EUR	11,994.76000	1.0000	11,994.76	11,994.76	0.00	0.00	11,994.76	0.56%
投資有価証券（ロング）					2,707,557.80	-575,128.26	0.00	2,132,429.54	99.44%
ファンド					2,707,557.80	-575,128.26	0.00	2,132,429.54	99.44%
ユーロ					2,707,557.80	-575,128.26	0.00	2,132,429.54	99.44%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド A クラスF（ユーロ）	618338	243,428.03000	8.7600	2,707,557.80	2,707,557.80	-575,128.26	0.00	2,132,429.54	99.44%
未収金					534.09	-3.89	0.00	530.20	100.00%
前払政府手数料					534.09	0.00	0.00	534.09	100.73%
現金および現金等価物					534.09	0.00	0.00	534.09	100.73%
米ドル					534.09	0.00	0.00	534.09	100.73%
米ドル	USD	575.93000	1.0000	575.93	534.09	0.00	0.00	534.09	100.73%
未収金					0.00	-3.89	0.00	-3.89	-0.73%
現金および現金等価物					0.00	-3.89	0.00	-3.89	-0.73%
米ドル					0.00	-3.89	0.00	-3.89	-0.73%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-3.89	0.00	-3.89	-0.73%
未払金					-11,798.16	37.90	0.00	-11,760.26	100.00%
未払AIFMD報酬					-255.12	0.00	0.00	-255.12	2.17%
現金および現金等価物					-255.12	0.00	0.00	-255.12	2.17%
ユーロ					-255.12	0.00	0.00	-255.12	2.17%
ユーロ	EUR	-255.12000	1.0000	-255.12	-255.12	0.00	0.00	-255.12	2.17%
未払代行協会員報酬					-91.79	0.00	0.00	-91.79	0.78%
現金および現金等価物					-91.79	0.00	0.00	-91.79	0.78%
ユーロ					-91.79	0.00	0.00	-91.79	0.78%
ユーロ	EUR	-91.79000	1.0000	-91.79	-91.79	0.00	0.00	-91.79	0.78%
未払監査報酬					-3,556.70	0.00	0.00	-3,556.70	30.24%
現金および現金等価物					-3,556.70	0.00	0.00	-3,556.70	30.24%
米ドル					-3,556.70	0.00	0.00	-3,556.70	30.24%
米ドル	USD	-3,840.17000	1.0000	-3,840.17	-3,556.70	0.00	0.00	-3,556.70	30.24%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払保管報酬					-919.08	0.00	0.00	-919.08	7.82%
現金および現金等価物					-919.08	0.00	0.00	-919.08	7.82%
ユーロ					-919.08	0.00	0.00	-919.08	7.82%
ユーロ	EUR	-919.08000	1.0000	-919.08	-919.08	0.00	0.00	-919.08	7.82%
未払販売報酬					-918.13	0.00	0.00	-918.13	7.81%
現金および現金等価物					-918.13	0.00	0.00	-918.13	7.81%
ユーロ					-918.13	0.00	0.00	-918.13	7.81%
ユーロ	EUR	-918.13000	1.0000	-918.13	-918.13	0.00	0.00	-918.13	7.81%
未払ＦＡＴＣＡ関連費用					-256.29	0.00	0.00	-256.29	2.18%
現金および現金等価物					-256.29	0.00	0.00	-256.29	2.18%
米ドル					-256.29	0.00	0.00	-256.29	2.18%
米ドル	USD	-279.48000	1.0000	-279.48	-256.29	0.00	0.00	-256.29	2.18%
未払財務書類作成費用					-230.00	0.00	0.00	-230.00	1.96%
現金および現金等価物					-230.00	0.00	0.00	-230.00	1.96%
ユーロ					-230.00	0.00	0.00	-230.00	1.96%
ユーロ	EUR	-230.00000	1.0000	-230.00	-230.00	0.00	0.00	-230.00	1.96%
未払投資顧問報酬					-1,083.32	0.00	0.00	-1,083.32	9.21%
現金および現金等価物					-1,083.32	0.00	0.00	-1,083.32	9.21%
ユーロ					-1,083.32	0.00	0.00	-1,083.32	9.21%
ユーロ	EUR	-1,083.32000	1.0000	-1,083.32	-1,083.32	0.00	0.00	-1,083.32	9.21%
未払ＭＬＲＯ報酬					-512.57	0.00	0.00	-512.57	4.36%
現金および現金等価物					-512.57	0.00	0.00	-512.57	4.36%
米ドル					-512.57	0.00	0.00	-512.57	4.36%
米ドル	USD	-558.96000	1.0000	-558.96	-512.57	0.00	0.00	-512.57	4.36%
未払管理報酬					-624.32	0.00	0.00	-624.32	5.31%
現金および現金等価物					-624.32	0.00	0.00	-624.32	5.31%
ユーロ					-624.32	0.00	0.00	-624.32	5.31%
ユーロ	EUR	-624.32000	1.0000	-624.32	-624.32	0.00	0.00	-624.32	5.31%
未払金					0.00	37.90	0.00	37.90	-0.32%
現金および現金等価物					0.00	37.90	0.00	37.90	-0.32%
米ドル					0.00	37.90	0.00	37.90	-0.32%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	37.90	0.00	37.90	-0.32%
未払副投資運用報酬					-180.91	0.00	0.00	-180.91	1.54%
現金および現金等価物					-180.91	0.00	0.00	-180.91	1.54%
ユーロ					-180.91	0.00	0.00	-180.91	1.54%
ユーロ	EUR	-180.91000	1.0000	-180.91	-180.91	0.00	0.00	-180.91	1.54%
未払受託報酬					-3,169.93	0.00	0.00	-3,169.93	26.95%
現金および現金等価物					-3,169.93	0.00	0.00	-3,169.93	26.95%
米ドル					-3,169.93	0.00	0.00	-3,169.93	26.95%
米ドル	USD	-3,422.47000	1.0000	-3,422.47	-3,169.93	0.00	0.00	-3,169.93	26.95%
報告額合計：					2,708,288.49	-575,094.25	0.00	2,133,194.24	100.00%

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー豪ドル・ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表
2024年1月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					9,141,500.92	-1,605,358.81	0.00	7,536,142.11	100.00%
現金（ロング）					47,741.49	0.00	0.00	47,741.49	0.63%
現金および現金等価物					47,741.49	0.00	0.00	47,741.49	0.63%
豪ドル					47,741.49	0.00	0.00	47,741.49	0.63%
豪ドル	AUD	47,741.49000	1.0000	47,741.49	47,741.49	0.00	0.00	47,741.49	0.63%
投資有価証券（ロング）					9,093,759.43	-1,605,358.81	0.00	7,488,400.62	99.37%
ファンド					9,093,759.43	-1,605,358.81	0.00	7,488,400.62	99.37%
豪ドル					9,093,759.43	-1,605,358.81	0.00	7,488,400.62	99.37%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスF（豪ドル）	618341	868,723.97000	8.6200	9,093,759.43	9,093,759.43	-1,605,358.81	0.00	7,488,400.62	99.37%
未収金					32,873.85	-2.58	0.00	32,871.27	100.00%
前払政府手数料					873.83	0.00	0.00	873.83	2.66%
現金および現金等価物					873.83	0.00	0.00	873.83	2.66%
米ドル					873.83	0.00	0.00	873.83	2.66%
米ドル	USD	575.94000	1.0000	575.94	873.83	0.00	0.00	873.83	2.66%
未収金					32,000.02	-2.58	0.00	31,997.44	97.34%
現金および現金等価物					32,000.02	-2.58	0.00	31,997.44	97.34%
豪ドル					32,000.02	0.00	0.00	32,000.02	97.35%
豪ドル	AUD	32,000.02000	1.0000	32,000.02	32,000.02	0.00	0.00	32,000.02	97.35%
米ドル					0.00	-2.58	0.00	-2.58	-0.01%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-2.58	0.00	-2.58	-0.01%
未払金					-66,471.87	265.36	0.00	-66,206.51	100.00%
未払AIFMD報酬					-419.24	0.00	0.00	-419.24	0.63%
現金および現金等価物					-419.24	0.00	0.00	-419.24	0.63%
ユーロ					-419.24	0.00	0.00	-419.24	0.63%
ユーロ	EUR	-255.12000	1.0000	-255.12	-419.24	0.00	0.00	-419.24	0.63%
未払代行協会員報酬					-319.19	0.00	0.00	-319.19	0.48%
現金および現金等価物					-319.19	0.00	0.00	-319.19	0.48%
豪ドル					-319.19	0.00	0.00	-319.19	0.48%
豪ドル	AUD	-319.19000	1.0000	-319.19	-319.19	0.00	0.00	-319.19	0.48%
未払監査報酬					-14,030.62	0.00	0.00	-14,030.62	21.19%
現金および現金等価物					-14,030.62	0.00	0.00	-14,030.62	21.19%
米ドル					-14,030.62	0.00	0.00	-14,030.62	21.19%
米ドル	USD	-9,135.38000	1.0000	-9,135.38	-14,030.62	0.00	0.00	-14,030.62	21.19%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
資本準備金					-30,904.80	0.00	0.00	-30,904.80	46.68%
現金および現金等価物					-30,904.80	0.00	0.00	-30,904.80	46.68%
豪ドル					-30,904.80	0.00	0.00	-30,904.80	46.68%
豪ドル	AUD	-30,904.80000	1.0000	-30,904.80	-30,904.80	0.00	0.00	-30,904.80	46.68%
未払保管報酬					-3,216.48	0.00	0.00	-3,216.48	4.86%
現金および現金等価物					-3,216.48	0.00	0.00	-3,216.48	4.86%
豪ドル					-3,216.48	0.00	0.00	-3,216.48	4.86%
豪ドル	AUD	-3,216.48000	1.0000	-3,216.48	-3,216.48	0.00	0.00	-3,216.48	4.86%
未払販売報酬					-3,191.54	0.00	0.00	-3,191.54	4.82%
現金および現金等価物					-3,191.54	0.00	0.00	-3,191.54	4.82%
豪ドル					-3,191.54	0.00	0.00	-3,191.54	4.82%
豪ドル	AUD	-3,191.54000	1.0000	-3,191.54	-3,191.54	0.00	0.00	-3,191.54	4.82%
未払FATCA関連費用					-419.96	0.00	0.00	-419.96	0.63%
現金および現金等価物					-419.96	0.00	0.00	-419.96	0.63%
米ドル					-419.96	0.00	0.00	-419.96	0.63%
米ドル	USD	-279.48000	1.0000	-279.48	-419.96	0.00	0.00	-419.96	0.63%
未払財務書類作成費用					-1,331.90	0.00	0.00	-1,331.90	2.01%
現金および現金等価物					-1,331.90	0.00	0.00	-1,331.90	2.01%
ユーロ					-1,331.90	0.00	0.00	-1,331.90	2.01%
ユーロ	EUR	-804.96000	1.0000	-804.96	-1,331.90	0.00	0.00	-1,331.90	2.01%
未払投資顧問報酬					-3,766.05	0.00	0.00	-3,766.05	5.69%
現金および現金等価物					-3,766.05	0.00	0.00	-3,766.05	5.69%
豪ドル					-3,766.05	0.00	0.00	-3,766.05	5.69%
豪ドル	AUD	-3,766.05000	1.0000	-3,766.05	-3,766.05	0.00	0.00	-3,766.05	5.69%
未払MLRO報酬					-839.94	0.00	0.00	-839.94	1.27%
現金および現金等価物					-839.94	0.00	0.00	-839.94	1.27%
米ドル					-839.94	0.00	0.00	-839.94	1.27%
米ドル	USD	-558.96000	1.0000	-558.96	-839.94	0.00	0.00	-839.94	1.27%
未払管理報酬					-2,170.27	0.00	0.00	-2,170.27	3.28%
現金および現金等価物					-2,170.27	0.00	0.00	-2,170.27	3.28%
豪ドル					-2,170.27	0.00	0.00	-2,170.27	3.28%
豪ドル	AUD	-2,170.27000	1.0000	-2,170.27	-2,170.27	0.00	0.00	-2,170.27	3.28%
未払金					0.00	265.36	0.00	265.36	-0.40%
現金および現金等価物					0.00	265.36	0.00	265.36	-0.40%
ユーロ					0.00	9.05	0.00	9.05	-0.01%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	9.05	0.00	9.05	-0.01%
米ドル					0.00	256.31	0.00	256.31	-0.39%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	256.31	0.00	256.31	-0.39%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払副投資運用報酬					-630.95	0.00	0.00	-630.95	0.95%
現金および現金等価物					-630.95	0.00	0.00	-630.95	0.95%
豪ドル					-630.95	0.00	0.00	-630.95	0.95%
豪ドル	AUD	-630.95000	1.0000	-630.95	-630.95	0.00	0.00	-630.95	0.95%
未払受託報酬					-5,230.93	0.00	0.00	-5,230.93	7.90%
現金および現金等価物					-5,230.93	0.00	0.00	-5,230.93	7.90%
米ドル					-5,230.93	0.00	0.00	-5,230.93	7.90%
米ドル	USD	-3,422.47000	1.0000	-3,422.47	-5,230.93	0.00	0.00	-5,230.93	7.90%
報告額合計：					9,107,902.90	-1,605,096.03	0.00	7,502,806.87	100.00%

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションー南アフリカランド・ポートフォリオ

投資ポジション評価明細表
2024年1月31日現在

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
投資					158,729,004.17	-19,589,920.44	0.00	139,139,083.73	100.00%
現金（ロング）					808,514.18	0.00	0.00	808,514.18	0.58%
現金および現金等価物					808,514.18	0.00	0.00	808,514.18	0.58%
南アフリカランド					808,514.18	0.00	0.00	808,514.18	0.58%
南アフリカランド	ZAR	808,514.18000	1.0000	808,514.18	808,514.18	0.00	0.00	808,514.18	0.58%
投資有価証券（ロング）					157,920,489.99	-19,589,920.44	0.00	138,330,569.55	99.42%
ファンド					157,920,489.99	-19,589,920.44	0.00	138,330,569.55	99.42%
南アフリカランド					157,920,489.99	-19,589,920.44	0.00	138,330,569.55	99.42%
ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスF （南アフリカランド）	618342	1,518,114.24000	91.1200	157,920,489.99	157,920,489.99	-19,589,920.44	0.00	138,330,569.55	99.42%
未収金					10,840.67	-128.91	0.00	10,711.76	100.00%
前払政府手数料					10,840.67	0.00	0.00	10,840.67	101.20%
現金および現金等価物					10,840.67	0.00	0.00	10,840.67	101.20%
米ドル					10,840.67	0.00	0.00	10,840.67	101.20%
米ドル	USD	575.94000	1.0000	575.94	10,840.67	0.00	0.00	10,840.67	101.20%
未収金					0.00	-128.91	0.00	-128.91	-1.20%
現金および現金等価物					0.00	-128.91	0.00	-128.91	-1.20%
米ドル					0.00	-128.91	0.00	-128.91	-1.20%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	-128.91	0.00	-128.91	-1.20%
未払金					-637,914.38	3,876.06	0.00	-634,038.32	100.00%
未払AIFMD報酬					-5,237.59	0.00	0.00	-5,237.59	0.83%
現金および現金等価物					-5,237.59	0.00	0.00	-5,237.59	0.83%
ユーロ					-5,237.59	0.00	0.00	-5,237.59	0.83%
ユーロ	EUR	-255.12000	1.0000	-255.12	-5,237.59	0.00	0.00	-5,237.59	0.83%
未払代行協会員報酬					-6,112.73	0.00	0.00	-6,112.73	0.96%
現金および現金等価物					-6,112.73	0.00	0.00	-6,112.73	0.96%
南アフリカランド					-6,112.73	0.00	0.00	-6,112.73	0.96%
南アフリカランド	ZAR	-6,112.73000	1.0000	-6,112.73	-6,112.73	0.00	0.00	-6,112.73	0.96%
未払監査報酬					-272,392.01	0.00	0.00	-272,392.01	42.96%
現金および現金等価物					-272,392.01	0.00	0.00	-272,392.01	42.96%
米ドル					-272,392.01	0.00	0.00	-272,392.01	42.96%
米ドル	USD	-14,481.21000	1.0000	-14,481.21	-272,392.01	0.00	0.00	-272,392.01	42.96%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払保管報酬					-59,491.15	0.00	0.00	-59,491.15	9.38%
現金および現金等価物					-59,491.15	0.00	0.00	-59,491.15	9.38%
南アフリカランド					-59,491.15	0.00	0.00	-59,491.15	9.38%
南アフリカランド	ZAR	-59,491.15000	1.0000	-59,491.15	-59,491.15	0.00	0.00	-59,491.15	9.38%
未払販売報酬					-61,127.42	0.00	0.00	-61,127.42	9.64%
現金および現金等価物					-61,127.42	0.00	0.00	-61,127.42	9.64%
南アフリカランド					-61,127.42	0.00	0.00	-61,127.42	9.64%
南アフリカランド	ZAR	-61,127.42000	1.0000	-61,127.42	-61,127.42	0.00	0.00	-61,127.42	9.64%
未払FATCA関連費用					-5,241.51	0.00	0.00	-5,241.51	0.83%
現金および現金等価物					-5,241.51	0.00	0.00	-5,241.51	0.83%
米ドル					-5,241.51	0.00	0.00	-5,241.51	0.83%
米ドル	USD	-279.48000	1.0000	-279.48	-5,241.51	0.00	0.00	-5,241.51	0.83%
未払財務書類作成費用					-28,247.01	0.00	0.00	-28,247.01	4.46%
現金および現金等価物					-28,247.01	0.00	0.00	-28,247.01	4.46%
ユーロ					-28,247.01	0.00	0.00	-28,247.01	4.46%
ユーロ	EUR	-1,395.98000	1.0000	-1,395.98	-28,247.01	0.00	0.00	-28,247.01	4.46%
未払投資顧問報酬					-72,130.38	0.00	0.00	-72,130.38	11.38%
現金および現金等価物					-72,130.38	0.00	0.00	-72,130.38	11.38%
南アフリカランド					-72,130.38	0.00	0.00	-72,130.38	11.38%
南アフリカランド	ZAR	-72,130.38000	1.0000	-72,130.38	-72,130.38	0.00	0.00	-72,130.38	11.38%
未払MLRO報酬					-10,482.97	0.00	0.00	-10,482.97	1.65%
現金および現金等価物					-10,482.97	0.00	0.00	-10,482.97	1.65%
米ドル					-10,482.97	0.00	0.00	-10,482.97	1.65%
米ドル	USD	-558.96000	1.0000	-558.96	-10,482.97	0.00	0.00	-10,482.97	1.65%
未払管理報酬					-41,566.65	0.00	0.00	-41,566.65	6.56%
現金および現金等価物					-41,566.65	0.00	0.00	-41,566.65	6.56%
南アフリカランド					-41,566.65	0.00	0.00	-41,566.65	6.56%
南アフリカランド	ZAR	-41,566.65000	1.0000	-41,566.65	-41,566.65	0.00	0.00	-41,566.65	6.56%
未払金					0.00	3,876.06	0.00	3,876.06	-0.61%
現金および現金等価物					0.00	3,876.06	0.00	3,876.06	-0.61%
ユーロ					0.00	127.78	0.00	127.78	-0.02%
ユーロ	EUR	0.00000	NA	0.00	0.00	127.78	0.00	127.78	-0.02%
米ドル					0.00	3,748.28	0.00	3,748.28	-0.59%
米ドル	USD	0.00000	NA	0.00	0.00	3,748.28	0.00	3,748.28	-0.59%
未払副投資運用報酬					-11,673.18	0.00	0.00	-11,673.18	1.84%
現金および現金等価物					-11,673.18	0.00	0.00	-11,673.18	1.84%
南アフリカランド					-11,673.18	0.00	0.00	-11,673.18	1.84%
南アフリカランド	ZAR	-11,673.18000	1.0000	-11,673.18	-11,673.18	0.00	0.00	-11,673.18	1.84%

銘柄	投資ID	数量	現地価格	現地 取得原価	取得原価	未実現 利益/損失	経過利息	時価	投資 比率%
未払受託報酬					-64,211.78	0.00	0.00	-64,211.78	10.13%
現金および現金等価物					-64,211.78	0.00	0.00	-64,211.78	10.13%
米ドル					-64,211.78	0.00	0.00	-64,211.78	10.13%
米ドル	USD	-3,422.47000	1.0000	-3,422.47	-64,211.78	0.00	0.00	-64,211.78	10.13%
報告額合計：					158,101,930.46	-19,586,173.29	0.00	138,515,757.17	100.00%

[次へ](#)

＜参考＞

当ファンドは、ピムコ・ケイマン・トラストのサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドAまたはピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドBを通じてピムコ・ケイマン・トラストの別のサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（M）に投資します。資産負債計算書の資産の部に計上された投資有価証券は、ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドAまたはピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドBの受益証券です。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（M）の状況は次の通りです。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（M）の状況

同投資信託は、ケイマンの法律に基づき設立された外国投資信託です。同投資信託の資産負債計算書および投資有価証券明細表は、ピムコジャパンリミテッドより入手した中間財務書類の原文を管理会社が抜粋したものが翻訳されております。

資産負債計算書（未監査）

2023年8月31日現在

	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド (M)	
	千米ドル (受益証券1口当 りの金額を除く)	百万円 (受益証券1口当 りの金額を除く)
資産：		
投資、時価評価額		
投資有価証券*	270,598	40,771
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	83	13
店頭取引	830	125
現金	19	3
取引相手への預け金	945	142
外貨、時価評価額	1,259	190
投資売却未収金	174	26
未収利息および／または未収配当金	3,652	550
	<u>277,560</u>	<u>41,820</u>
負債：		
借入金およびその他の金融取引		
逆現先取引契約に係る未払金	2,563	386
空売りに係る未払金	1,251	188
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	16	2
店頭取引	201	30
投資購入未払金	1,373	207
未払利息	2	0
取引相手からの預り金	720	108
ファンド受益証券買戻未払金	998	150
	<u>7,124</u>	<u>1,073</u>
純資産	<u>270,436</u>	<u>40,747</u>
投資有価証券原価	345,025	51,985
保有外貨原価	1,279	193
空売りに係る受領額	1,276	192
金融デリバティブ商品の原価純額またはプレミアム純額	187	28
*次の現先取引契約を含む：	<u>13,048</u>	<u>1,966</u>

ピムコ ケイマン
エマージング ボンド ファンド (M)

千米ドル (受益証券1口当 たりの金額を除く)	百万円 (受益証券1口当 たりの金額を除く)
100	100
200	200
300	300
400	400
500	500
600	600
700	700
800	800
900	900
1000	1000
1100	1100
1200	1200
1300	1300
1400	1400
1500	1500
1600	1600
1700	1700
1800	1800
1900	1900
2000	2000
2100	2100
2200	2200
2300	2300
2400	2400
2500	2500
2600	2600
2700	2700
2800	2800
2900	2900
3000	3000
3100	3100
3200	3200
3300	3300
3400	3400
3500	3500
3600	3600
3700	3700
3800	3800
3900	3900
4000	4000
4100	4100
4200	4200
4300	4300
4400	4400
4500	4500
4600	4600
4700	4700
4800	4800
4900	4900
5000	5000
5100	5100
5200	5200
5300	5300
5400	5400
5500	5500
5600	5600
5700	5700
5800	5800
5900	5900
6000	6000
6100	6100
6200	6200
6300	6300
6400	6400
6500	6500
6600	6600
6700	6700
6800	6800
6900	6900
7000	7000
7100	7100
7200	7200
7300	7300
7400	7400
7500	7500
7600	7600
7700	7700
7800	7800
7900	7900
8000	8000
8100	8100
8200	8200
8300	8300
8400	8400
8500	8500
8600	8600
8700	8700
8800	8800
8900	8900
9000	9000
9100	9100
9200	9200
9300	9300
9400	9400
9500	9500
9600	9600
9700	9700
9800	9800
9900	9900
10000	10000

純資産:	270,436	40,747
発行済受益証券口数:	17,373千口	
発行済受益証券1口当たり純資産価格および買戻価格: (機能通貨による表示)	15.57米ドル	2,346円

千未満の数値は四捨五入により残高が0と表示されることがある。

次へ

投資有価証券明細表（未監査）

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（M）

（2023年8月31日現在）

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

		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 100.1%				BAHAMAS 0.4%		
ALBANIA 0.1%				SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%				Bahamas Government International Bond		
Republic of Albania				6.000% due 11/21/2028	\$ 1,200	\$ 996
3.500% due 11/23/2031	EUR	300	\$ 272	Total Bahamas (Cost \$1,200)		996
Total Albania (Cost \$334)			272			
ANGOLA 1.0%				BAHRAIN 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%				SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Angolan Government International Bond				Bahrain Government International Bond		
8.000% due 11/26/2029	\$	200	166	4.250% due 01/25/2028	1,400	1,300
8.250% due 05/09/2028		1,100	965	5.625% due 09/30/2031	1,000	923
8.750% due 04/14/2032		1,200	989	Total Bahrain (Cost \$2,423)		2,223
9.375% due 05/08/2048		600	460			
9.500% due 11/12/2025		200	197	BRAZIL 2.1%		
Total Angola (Cost \$3,080)			2,777	CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
ARGENTINA 1.5%				Banco do Brasil S.A.		
SOVEREIGN ISSUES 1.5%				8.500% due 07/29/2026	MXN 22,000	1,175
Argentina Government International Bond				SOVEREIGN ISSUES 1.7%		
0.750% due 07/09/2030		1,030	349	Brazil Government International Bond		
1.000% due 07/09/2029		629	205	4.750% due 01/14/2050	\$ 5,700	4,204
3.500% due 07/09/2041		1,881	581	8.250% due 01/20/2034	60	68
3.625% due 07/09/2035		3,999	1,188	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais		
3.625% due 07/09/2046		2,415	726	5.333% due 02/15/2028	200	196
4.250% due 01/09/2038		1,468	516			4,468
Argentine Bonos del Tesoro				Total Brazil (Cost \$7,059)		5,643
15.500% due 10/17/2026	ARS	1,650	1	CAMEROON 0.3%		
Provincia de Buenos Aires				SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
5.250% due 09/01/2037	\$	400	152	Republic of Cameroon International Bond		
Provincia de la Rioja				5.950% due 07/07/2032	EUR 700	523
6.500% due 02/24/2028		500	290	9.500% due 11/19/2025	\$ 300	292
Total Argentina (Cost \$6,194)			4,008	Total Cameroon (Cost \$1,124)		815
ARMENIA 0.4%				CAYMAN ISLANDS 2.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%				CORPORATE BONDS & NOTES 2.4%		
Armenia Government International Bond				Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.		
3.600% due 02/02/2031		500	397	0.000% due 06/05/2034	1,158	822
3.950% due 09/26/2029		800	671	Gaci First Investment Co.		
Total Armenia (Cost \$1,281)			1,068	5.000% due 10/13/2027	2,000	1,978
AZERBAIJAN 1.1%				5.125% due 02/14/2053	1,400	1,217
CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%				Interoceanica IV Finance Ltd.		
SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding I DAC				0.000% due 11/30/2025	183	168
7.230% due 03/17/2026		100	98	Interoceanica V Finance Ltd.		
Southern Gas Corridor CJSC				0.000% due 05/15/2030	1,844	1,419
6.875% due 03/24/2026		2,200	2,225	7.860% due 05/15/2030	161	162
			2,323	Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%				0.000% due 06/02/2025	857	803
Republic of Azerbaijan International Bond						6,569
3.500% due 09/01/2032		300	253	SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
4.750% due 03/18/2024		333	330	KSA Sukuk Ltd.		
			583	5.268% due 10/25/2028	1,300	1,322
Total Azerbaijan (Cost \$3,013)			2,906	Total Cayman Islands (Cost \$7,991)		7,891

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
CHILE 2.7%			Dominican Republic International Bond		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.8%			4.875% due 09/23/2032	\$ 500	\$ 426
Banco del Estado de Chile			5.300% due 01/21/2041	500	392
2.704% due 01/09/2025	\$ 500	\$ 480	5.500% due 01/27/2025	300	297
			5.500% due 02/22/2029	700	656
Corp. Nacional del Cobre de Chile			5.875% due 01/30/2060	1,000	771
3.700% due 01/30/2050	200	141	5.950% due 01/25/2027	3,500	3,433
4.250% due 07/17/2042	600	482	6.000% due 07/19/2028	1,300	1,261
4.500% due 08/01/2047	500	403	6.000% due 02/22/2033	300	277
4.875% due 11/04/2044	1,600	1,367	6.400% due 06/05/2049	600	506
			6.875% due 01/29/2026	1,700	1,716
Empresa de los Ferrocarriles del Estado			7.050% due 02/03/2031	1,300	1,295
3.068% due 08/18/2050	200	120	13.625% due 02/10/2034	DOP 41,200	915
3.830% due 09/14/2061	400	260	Total Dominican Republic (Cost \$13,884)		13,238
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			ECUADOR 1.3%		
4.700% due 05/07/2050	600	490	SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
			Ecuador Government International Bond		
Empresa Nacional del Petroleo			0.000% due 07/31/2030	\$ 610	171
3.450% due 09/16/2031	200	165	2.500% due 07/31/2040	3,857	1,279
4.500% due 09/14/2047	600	449	3.500% due 07/31/2035	3,776	1,399
6.150% due 05/10/2033	400	396	6.000% due 07/31/2030	1,340	659
		4,753	Total Ecuador (Cost \$4,788)		3,508
SOVEREIGN ISSUES 0.9%			EGYPT 2.4%		
Chile Government International Bond			SOVEREIGN ISSUES 2.4%		
3.250% due 09/21/2071	500	314	Egypt Government International Bond		
4.950% due 01/05/2036	2,300	2,223	4.750% due 04/11/2025	EUR 100	87
		2,537	5.625% due 04/16/2030	800	480
Total Chile (Cost \$8,287)		7,290	5.875% due 06/11/2025 (g)	\$ 800	653
			5.875% due 02/16/2031	600	328
COLOMBIA 2.2%			6.375% due 04/11/2031	EUR 1,100	659
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%			7.300% due 09/30/2033	\$ 700	389
Ecopetrol S.A.			7.500% due 02/16/2061	1,100	558
5.875% due 05/28/2045	2,000	1,411	7.625% due 05/29/2032	2,200	1,271
7.375% due 09/18/2043	100	86	7.903% due 02/21/2048	1,500	767
		1,497	8.500% due 01/31/2047	1,500	799
			8.875% due 05/29/2050	1,100	592
SOVEREIGN ISSUES 1.7%			Total Egypt (Cost \$9,912)		6,583
Colombia Government International Bond					
3.875% due 02/15/2061	200	113	EL SALVADOR 0.7%		
4.500% due 03/15/2029	300	268	SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
5.200% due 05/15/2049	800	564	El Salvador Government International Bond		
5.625% due 02/26/2044	3,300	2,510	7.125% due 01/20/2050	1,300	878
7.375% due 09/18/2037	200	194	7.625% due 09/21/2034	100	70
7.500% due 02/02/2034	900	896	7.625% due 02/01/2041	800	555
		4,545	9.500% due 07/15/2052	400	312
Total Colombia (Cost \$7,800)		6,042	Total El Salvador (Cost \$2,631)		1,815
COSTA RICA 0.4%			GABON 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%			SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Costa Rica Government International Bond			Gabon Government International Bond		
5.625% due 04/30/2043	1,100	958	6.625% due 02/06/2031	200	146
6.550% due 04/03/2034	200	202	Total Gabon (Cost \$147)		146
Total Costa Rica (Cost \$1,066)		1,160			
DOMINICAN REPUBLIC 4.9%			GEORGIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 4.9%			SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Dominican Republic Central Bank Notes			Georgia Government International Bond		
13.000% due 01/30/2026	DOP 69,500	1,293	2.750% due 04/22/2026	200	180
			Total Georgia (Cost \$182)		180

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
GHANA 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Republic of Ghana International Bond (a)		
0.000% due 04/07/2025	\$ 300	\$ 119
7.625% due 05/16/2029	300	130
7.750% due 04/07/2029	700	304
8.125% due 03/26/2032	400	176
8.625% due 04/07/2034	1,200	533
8.750% due 03/11/2061	1,900	793
8.875% due 05/07/2042	1,200	503
8.950% due 03/26/2051	1,600	672
Total Ghana (Cost \$6,769)		<u>3,230</u>
GUATEMALA 1.0%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Guatemala Government Bond		
4.650% due 10/07/2041	200	158
4.875% due 02/13/2028	800	763
4.900% due 06/01/2030	600	564
6.125% due 06/01/2050	700	641
6.600% due 06/13/2036	600	601
Total Guatemala (Cost \$3,051)		<u>2,727</u>
HONG KONG 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.		
3.875% due 11/13/2029	200	<u>144</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Airport Authority		
2.100% due 03/08/2026 (b)	700	638
2.400% due 03/08/2028 (b)	1,000	869
4.875% due 01/12/2030	700	701
		<u>2,208</u>
Total Hong Kong (Cost \$2,588)		<u>2,352</u>
HUNGARY 2.8%		
SOVEREIGN ISSUES 2.8%		
Hungary Government International Bond		
1.625% due 04/28/2032	EUR 100	83
2.125% due 09/22/2031	\$ 800	617
3.125% due 09/21/2051	800	485
5.250% due 06/16/2029	1,600	1,568
5.500% due 06/16/2034	1,200	1,142
6.250% due 09/22/2032	700	707
6.750% due 09/25/2052	1,200	1,221
Magyar Export-Import Bank Zrt		
6.125% due 12/04/2027	500	498
MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt		
6.500% due 06/29/2028	1,300	<u>1,310</u>
Total Hungary (Cost \$7,939)		<u>7,631</u>
INDIA 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Indian Railway Finance Corp. Ltd.		
3.249% due 02/13/2030	500	433
3.950% due 02/13/2050	300	226
		<u>659</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Export-Import Bank of India		
3.250% due 01/15/2030	\$ 1,800	\$ 1,566
Total India (Cost \$2,582)		<u>2,225</u>
INDONESIA 4.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.5%		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		
3.950% due 03/28/2024	2,200	2,176
Indonesia Asahan Aluminium PT		
5.450% due 05/15/2030	800	768
Pelabuhan Indonesia Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,100	3,059
Pertamina Persero PT		
6.450% due 05/30/2044	1,400	1,418
6.500% due 11/07/2048	1,700	1,748
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara		
5.250% due 10/24/2042	2,800	2,449
5.250% due 05/15/2047	200	171
6.150% due 05/21/2048	400	377
		<u>12,166</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Indonesia Government International Bond		
5.650% due 01/11/2053	200	205
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
4.700% due 06/06/2032	800	781
		<u>986</u>
Total Indonesia (Cost \$13,614)		<u>13,152</u>
IRELAND 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC		
6.927% due 02/19/2027	1,450	1,367
Total Ireland (Cost \$1,363)		<u>1,367</u>
ISRAEL 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Israel Electric Corp. Ltd.		
3.750% due 02/22/2032	800	679
5.000% due 11/12/2024	300	297
Total Israel (Cost \$1,106)		<u>976</u>
IVORY COAST 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Ivory Coast Government International Bond		
5.250% due 03/22/2030	EUR 1,400	1,288
5.750% due 12/31/2032	\$ 567	516
6.625% due 03/22/2048	EUR 300	228
Total Ivory Coast (Cost \$2,459)		<u>2,032</u>
JAMAICA 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
TransJamaican Highway Ltd.		
5.750% due 10/10/2036	\$ 371	308

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Jamaica Government International Bond		
7.875% due 07/28/2045	\$ 1,000	\$ 1,140
Total Jamaica (Cost \$1,371)		<u>1,448</u>
JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Corsair International Ltd.		
8.802% due 01/28/2027	EUR 900	974
9.152% due 01/28/2029	400	432
Total Jersey, Channel Islands (Cost \$1,456)		<u>1,406</u>
JORDAN 1.0%		
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Jordan Government International Bond		
5.750% due 01/31/2027	\$ 400	391
5.850% due 07/07/2030	200	186
7.375% due 10/10/2047	600	526
7.500% due 01/13/2029	700	712
7.750% due 01/15/2028	900	925
Total Jordan (Cost \$2,844)		<u>2,740</u>
KAZAKHSTAN 1.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
KazMunayGas National Co. JSC		
5.375% due 04/24/2030	1,300	1,185
5.750% due 04/19/2047	500	404
6.375% due 10/24/2048	1,000	839
QazaqGaz NC JSC		
4.375% due 09/26/2027	200	184
		<u>2,612</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Kazakhstan Government International Bond		
6.500% due 07/21/2045	300	316
Total Kazakhstan (Cost \$2,984)		<u>2,928</u>
KENYA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Republic of Kenya Government International Bond		
6.300% due 01/23/2034	300	218
8.000% due 05/22/2032 (g)	1,800	1,495
Total Kenya (Cost \$2,143)		<u>1,713</u>
MALAYSIA 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.1%		
Khazanah Capital Ltd.		
4.876% due 06/01/2033	500	487
Khazanah Global Sukuk Bhd		
4.687% due 06/01/2028	700	689
Petronas Capital Ltd.		
3.404% due 04/28/2061	600	405
4.550% due 04/21/2050	200	174
4.800% due 04/21/2060	700	626
Petronas Energy Canada Ltd.		
2.112% due 03/23/2028	600	531
		<u>2,912</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Malaysia Sukuk Global Bhd		
4.080% due 04/27/2046	\$ 700	\$ 620
Total Malaysia (Cost \$4,334)		<u>3,532</u>
MARSHALL ISLANDS 0.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%		
Nakilat, Inc.		
6.267% due 12/31/2033	62	65
Total Marshall Islands (Cost \$72)		<u>65</u>
MEXICO 4.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.4%		
Petroleos Mexicanos		
6.625% due 06/15/2038	3,600	2,364
6.700% due 02/16/2032	1,842	1,394
6.950% due 01/28/2060	2,460	1,524
7.690% due 01/23/2050	700	469
10.000% due 02/07/2033	800	730
		<u>6,481</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.9%		
Mexico Government International Bond		
5.400% due 02/09/2028	800	809
5.750% due 10/12/2110	3,400	2,985
6.350% due 02/09/2035	1,400	1,455
		<u>5,249</u>
Total Mexico (Cost \$14,425)		<u>11,730</u>
MONGOLIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Mongolia Government International Bond		
3.500% due 07/07/2027	600	504
Total Mongolia (Cost \$595)		<u>504</u>
MOROCCO 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
OCP S.A.		
3.750% due 06/23/2031	800	662
5.125% due 06/23/2051	1,000	710
		<u>1,372</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Morocco Government International Bond		
4.000% due 12/15/2050	500	328
Total Morocco (Cost \$2,279)		<u>1,700</u>
NAMIBIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Namibia Government International Bond		
5.250% due 10/29/2025	500	477
Total Namibia (Cost \$499)		<u>477</u>
NETHERLANDS 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Republic of Angola Via Avenir II BV		
10.163% due 12/07/2023	170	168
Total Netherlands (Cost \$169)		<u>168</u>
NIGERIA 2.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
BOI Finance BV		
7.500% due 02/16/2027	EUR 1,100	1,029

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 2.2%		
Nigeria Government International Bond		
6.125% due 09/28/2028	\$ 400	\$ 331
6.500% due 11/28/2027	600	516
7.143% due 02/23/2030	2,100	1,717
7.375% due 09/28/2033	500	384
7.625% due 11/21/2025	200	191
7.875% due 02/16/2032	200	164
8.250% due 09/28/2051	900	645
8.375% due 03/24/2029	500	442
8.747% due 01/21/2031	1,800	1,575
		<u>5,965</u>
Total Nigeria (Cost \$8,248)		<u>6,994</u>
NORTH MACEDONIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
North Macedonia Government International Bond		
6.960% due 03/13/2027	EUR 700	784
Total North Macedonia (Cost \$741)		<u>784</u>
OMAN 1.8%		
SOVEREIGN ISSUES 1.8%		
Oman Government International Bond		
6.000% due 08/01/2029	\$ 2,800	2,822
6.500% due 03/08/2047	400	378
6.750% due 01/17/2048	1,100	1,070
7.000% due 01/25/2051	400	397
Oman Sovereign Sukuk Co.		
4.397% due 06/01/2024	200	197
Total Oman (Cost \$4,715)		<u>4,864</u>
PAKISTAN 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Pakistan Government International Bond		
6.875% due 12/05/2027	1,200	616
7.375% due 04/08/2031	700	326
8.875% due 04/08/2051	2,000	889
Total Pakistan (Cost \$3,524)		<u>1,831</u>
PANAMA 3.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.		
5.125% due 08/11/2061	600	452
Banco Nacional de Panama		
2.500% due 08/11/2030	600	481
		<u>933</u>
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Panama Government International Bond		
4.500% due 04/01/2056	500	364
4.500% due 01/19/2063	200	143
6.400% due 02/14/2035	1,200	1,234
6.853% due 03/28/2054	300	308
8.125% due 04/28/2034	4,400	5,013
		<u>7,062</u>
Total Panama (Cost \$8,224)		<u>7,995</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
PARAGUAY 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Paraguay Government International Bond		
3.849% due 06/28/2033	\$ 300	\$ 257
4.700% due 03/27/2027	400	387
5.400% due 03/30/2050	400	335
5.850% due 08/21/2033	300	296
6.100% due 08/11/2044	400	372
Total Paraguay (Cost \$1,836)		<u>1,647</u>
PERU 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Petroleos del Peru S.A.		
5.625% due 06/19/2047	1,000	641
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Peru Government International Bond		
3.000% due 01/15/2034	800	653
3.230% due 07/28/2121	400	232
3.600% due 01/15/2072	500	329
6.550% due 03/14/2037	205	224
		<u>1,438</u>
Total Peru (Cost \$2,883)		<u>2,079</u>
PHILIPPINES 1.5%		
SOVEREIGN ISSUES 1.5%		
Philippines Government International Bond		
2.650% due 12/10/2045	400	260
2.950% due 05/05/2045	1,800	1,238
3.700% due 03/01/2041	2,500	2,010
5.000% due 07/17/2033	600	599
Total Philippines (Cost \$5,499)		<u>4,107</u>
POLAND 1.7%		
SOVEREIGN ISSUES 1.7%		
Poland Government International Bond		
4.875% due 10/04/2033	2,200	2,139
5.500% due 11/16/2027	1,200	1,223
5.500% due 04/04/2053	1,300	1,266
Total Poland (Cost \$4,668)		<u>4,628</u>
QATAR 2.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.2%		
Qatar Energy		
2.250% due 07/12/2031	2,000	1,649
3.125% due 07/12/2041	1,200	884
3.300% due 07/12/2051	1,300	914
		<u>3,447</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Qatar Government International Bond		
4.400% due 04/16/2050	1,200	1,058
4.817% due 03/14/2049	1,200	1,121
5.103% due 04/23/2048	200	192
5.750% due 01/20/2042	500	535
		<u>2,906</u>
Total Qatar (Cost \$7,454)		<u>6,353</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
ROMANIA 2.5%		
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
Romania Government International Bond		
1.750% due 07/13/2030	EUR 600	\$ 504
2.375% due 04/19/2027	1,000	1,002
2.875% due 04/13/2042	200	134
3.000% due 02/14/2031	\$ 400	332
3.500% due 04/03/2034	EUR 100	87
3.750% due 02/07/2034	500	443
4.000% due 02/14/2051	\$ 1,400	963
4.625% due 04/03/2049	EUR 200	172
5.000% due 09/27/2026	700	767
6.000% due 05/25/2034	\$ 800	784
6.125% due 01/22/2044	400	379
7.625% due 01/17/2053	1,100	1,186
Total Romania (Cost \$7,795)		6,753
RUSSIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Russia Government International Bond		
5.100% due 03/28/2035	1,400	592
Total Russia (Cost \$1,501)		592
RWANDA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Rwanda International Government Bond		
5.500% due 08/09/2031	400	312
Total Rwanda (Cost \$400)		312
SAUDI ARABIA 3.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%		
Saudi Arabian Oil Co.		
1.625% due 11/24/2025	600	552
2.250% due 11/24/2030	500	412
3.500% due 11/24/2070	1,000	634
4.250% due 04/16/2039	400	342
		1,940
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Saudi Government International Bond		
0.000% due 03/03/2024	EUR 100	106
2.250% due 02/02/2033	\$ 200	159
3.250% due 10/22/2030	500	450
3.450% due 02/02/2061	600	399
3.750% due 01/21/2055	300	216
4.375% due 04/16/2029	1,100	1,071
4.500% due 10/26/2046	2,300	1,946
4.750% due 01/18/2028	1,300	1,288
4.875% due 07/18/2033	1,400	1,381
		7,016
Total Saudi Arabia (Cost \$10,411)		8,956
SENEGAL 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Senegal Government International Bond		
4.750% due 03/13/2028	EUR 1,100	1,033
5.375% due 06/08/2037	100	73
6.250% due 05/23/2033	\$ 200	164
6.750% due 03/13/2048	400	279
Total Senegal (Cost \$2,087)		1,549

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SERBIA 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Serbia Government International Bond		
1.000% due 09/23/2028	EUR 1,100	\$ 944
2.050% due 09/23/2036	400	272
3.125% due 05/15/2027	400	398
6.250% due 05/26/2028	\$ 600	598
6.500% due 09/26/2033	1,000	989
Total Serbia (Cost \$3,157)		3,201
SINGAPORE 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Singapore Airlines Ltd.		
3.375% due 01/19/2029	600	553
Total Singapore (Cost \$597)		553
SOUTH AFRICA 4.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.2%		
Development Bank of Southern Africa Ltd.		
8.600% due 10/21/2024 (e)	ZAR 41,000	2,150
Eskom Holdings SOC Ltd.		
4.314% due 07/23/2027	\$ 1,300	1,157
6.350% due 08/10/2028	1,700	1,596
8.450% due 08/10/2028	1,100	1,069
		5,972
SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
South Africa Government International Bond		
4.300% due 10/12/2028	200	177
5.375% due 07/24/2044	1,000	715
5.750% due 09/30/2049	700	498
5.875% due 04/20/2032	400	355
6.300% due 06/22/2048 (g)	2,000	1,534
7.300% due 04/20/2052	300	254
10.500% due 12/21/2026	ZAR 58,500	3,229
		6,762
Total South Africa (Cost \$15,115)		12,734
SOUTH KOREA 0.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
Kodit Global 2023-1 Co. Ltd.		
4.954% due 05/25/2026	200	197
Total South Korea (Cost \$200)		197
SRI LANKA 1.1%		
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Sri Lanka Government International Bond (a)		
5.750% due 04/18/2049	1,000	472
5.875% due 07/25/2049	200	99
6.125% due 06/03/2025	900	429
6.200% due 05/11/2027	1,700	784
6.850% due 11/03/2025	1,100	522
7.550% due 03/28/2030	1,700	784
Total Sri Lanka (Cost \$5,761)		3,090
SUPRANATIONAL 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Eastern & Southern African Trade & Development Bank		
4.125% due 06/30/2028	700	566

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
African Export-Import Bank		
2.634% due 05/17/2026	\$ 1,000	\$ 903
Total Supranational (Cost \$1,701)		<u>1,469</u>
TUNISIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Tunisian Republic		
3.280% due 08/09/2027	\ 200,000	663
5.625% due 02/17/2024	EUR 400	373
Total Tunisia (Cost \$2,311)		<u>1,036</u>
TURKEY 3.4%		
SOVEREIGN ISSUES 3.4%		
Turkey Government International Bond		
5.125% due 02/17/2028	\$ 500	451
5.750% due 05/11/2047	6,100	4,358
5.875% due 06/26/2031	300	258
6.125% due 10/24/2028	1,900	1,756
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S		
9.375% due 01/31/2026	2,200	2,253
Total Turkey (Cost \$10,523)		<u>9,076</u>
UKRAINE 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%		
NPC Ukrenergo		
6.875% due 11/09/2028	1,200	<u>336</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Ukraine Government International Bond		
6.876% due 05/21/2031	600	160
7.253% due 03/15/2035	900	243
7.375% due 09/25/2034	1,500	399
7.750% due 09/01/2025	1,900	617
7.750% due 09/01/2026	700	204
7.750% due 09/01/2027	1,000	289
7.750% due 09/01/2029	1,400	405
		<u>2,317</u>
Total Ukraine (Cost \$8,509)		<u>2,653</u>
UNITED ARAB EMIRATES 1.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.6%		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC		
3.650% due 11/02/2029	1,600	1,491
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC		
4.375% due 01/24/2029	500	486
4.696% due 04/24/2033	500	490
Abu Dhabi Ports Co. PJSC		
2.500% due 05/06/2031	900	752
DP World Ltd.		
5.625% due 09/25/2048	700	649
MDGH GMTN RSC Ltd.		
3.950% due 05/21/2050	200	157
5.084% due 05/22/2053	300	284
Total United Arab Emirates (Cost \$4,763)		<u>4,309</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UNITED KINGDOM 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC		
8.250% due 07/09/2026	\$ 1,500	\$ 654
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.7%		
Polaris PLC		
6.486% due 05/23/2059	GBP 873	1,110
Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC		
6.987% due 02/20/2054	532	675
		<u>1,785</u>
SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC		
9.750% due 01/22/2025	\$ 150	135
Total United Kingdom (Cost \$3,371)		<u>2,574</u>
UNITED STATES 5.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
DAE Funding LLC		
2.625% due 03/20/2025	400	377
3.375% due 03/20/2028	200	179
Rutas 2 & 7 Finance Ltd.		
0.000% due 09/30/2036	1,260	810
		<u>1,366</u>
U.S. TREASURY OBLIGATIONS 4.8%		
U.S. Treasury Bonds		
1.750% due 08/15/2041	100	67
2.250% due 05/15/2041	200	148
2.375% due 02/15/2042	1,100	819
2.875% due 05/15/2043	500	398
3.250% due 05/15/2042	5,300	4,527
3.375% due 08/15/2042	2,700	2,343
4.000% due 11/15/2042	400	380
U.S. Treasury Notes		
3.125% due 08/31/2029	4,700	4,425
		<u>13,107</u>
Total United States (Cost \$15,861)		<u>14,473</u>
URUGUAY 1.3%		
SOVEREIGN ISSUES 1.3%		
Uruguay Government International Bond		
4.975% due 04/20/2055	100	94
7.625% due 03/21/2036	1,490	1,806
7.875% due 01/15/2033 (c)	1,340	1,621
Total Uruguay (Cost \$3,516)		<u>3,521</u>
UZBEKISTAN 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Republic of Uzbekistan International Bond		
3.700% due 11/25/2030	300	243
Total Uzbekistan (Cost \$263)		<u>243</u>
VENEZUELA 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.500% due 04/12/2037 (a)	20,990	1,337

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SOVEREIGN ISSUES 0.8%					
Venezuela Government International Bond (a)			JPMorgan Chase Bank N.A.		
7.000% due 03/31/2038	\$ 10,900	\$ 1,138	4.830% due 09/01/2023	\$ 160	\$ 160
7.650% due 04/21/2025	4,215	423	MUFG Bank Ltd.		
9.250% due 09/15/2027	4,520	463	(0.530%) due 09/01/2023	\ 2,295	16
11.950% due 08/05/2031	340	37			
		2,061	Royal Bank of Canada		
Total Venezuela (Cost \$25,720)		3,398	4.830% due 09/01/2023	\$ 1	1
ZAMBIA 0.2%					
SOVEREIGN ISSUES 0.2%			Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
Zambia Government International Bond			(0.530%) due 09/01/2023	\ 55	0
5.375% due 12/20/2049 (a)	1,200	592	4.420% due 09/01/2023	GBP 40	50
Total Zambia (Cost \$1,259)		592	4.830% due 09/01/2023	\$ 40	40
SHORT-TERM INSTRUMENTS 5.7%					
REPURCHASE AGREEMENTS (f) 4.8%			Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
		13,048	(0.530%) due 09/01/2023	\ 615	4
			4.420% due 09/01/2023	GBP 123	156
			4.830% due 09/01/2023	\$ 425	425
					1,226
TIME DEPOSITS 0.5%					
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			ARGENTINA TREASURY BILLS (d) 0.0%		
4.830% due 09/01/2023	26	26	(32.423%) due 10/18/2023	ARS 4,444	7
Bank of Nova Scotia			(17.346%) due 11/23/2023	4,444	7
4.080% due 09/01/2023	CAD 7	5			14
4.830% due 09/01/2023	\$ 29	29	JAPAN TREASURY BILLS (d) 0.3%		
BNP Paribas Bank			(0.190%) due 01/10/2024	\ 40,000	275
(0.530%) due 09/01/2023	\ 215	2	(0.170%) due 02/13/2024	80,000	550
4.420% due 09/01/2023	GBP 10	13			825
6.410% due 09/01/2023	ZAR 32	2	MALAYSIA TREASURY BILLS (d) 0.1%		
Brown Brothers Harriman & Co.			3.199% due 10/24/2023	MYR 280	60
(0.530%) due 09/01/2023	\ 8	0	3.228% due 02/06/2024	930	198
4.420% due 09/01/2023	GBP 2	3			258
4.830% due 09/01/2023	\$ 2	2	Total Short-Term Instruments		15,371
Citibank N.A.			(Cost \$15,374)		
4.830% due 09/01/2023	95	95	Total Investments in Securities 100.1%	\$	270,598
DBS Bank Ltd.			(Cost \$345,025)		
4.830% due 09/01/2023	154	154	Financial Derivative Instruments (h)(i) 0.3%		696
HSBC Bank PLC			(Cost or Premiums, net \$187)		
4.420% due 09/01/2023	GBP 34	43	Other Assets and Liabilities, net (0.4%)		(858)
			Net Assets 100.0%	\$	270,436

[次へ](#)

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

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

(a) Security is in default.

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

(c) Payment in-kind security.

(d) Coupon represents a yield to maturity.

(e) RESTRICTED SECURITIES:

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	時価	時価 純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	\$ 2,753	\$ 2,150	0.80%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(f) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受入担保 (時価評価額)	現先取引 (時価評価額)	現先取引に係る未収金 ⁽¹⁾
BOS	5.260%	08/31/2023	09/07/2023	\$ 593	U.S. Treasury Notes 3.875% due 12/31/2027	\$ (593)	\$ 593	\$ 594
DEU	5.300%	08/30/2023	09/06/2023	655	U.S. Treasury Notes 4.125% due 11/15/2032	(658)	655	655
SAL	5.320%	08/31/2023	09/01/2023	11,800	U.S. Treasury Notes 0.375% due 12/31/2025	(12,045)	11,800	11,802
Total Repurchase Agreements						\$ (13,296)	\$ 13,048	\$ 13,051

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日 ⁽³⁾	借入額 ⁽²⁾	逆現先取引に係る未払金
BPS	4.750%	07/27/2023	TBD	\$ (406)	\$ (408)
BRC	4.750%	06/05/2023	TBD	(638)	(644)
BRC	5.000%	07/13/2023	TBD	(1,501)	(1,511)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (2,563)

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	逆現先取引の契約満期までの残存期間				合計
	翌日物および 継続	30日まで	31日から90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Government Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,563)	(2,563)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,563)	(2,563)
Total Borrowings	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(2,563)	(2,563)
Payable for Reverse Repurchase Agreements				\$	(2,563)

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本金額	受領額	空売りに係る 未払金 ⁽⁴⁾
BPS	U.S. Treasury Bonds	4.125%	11/15/2032	\$ 650	\$ (673)	(658)
BPS	U.S. Treasury Notes	3.875%	12/31/2027	600	(603)	(593)
Total Short Sales (0.5%)					\$ (1,276)	(1,251)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of August 31, 2023:

(g) Securities with an aggregate market value of \$2,532 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of August 31, 2023.

取引相手	現先取引 に係る未収金	逆現先取引 に係る未払金	買戻し条件付 売買取引に係る 未払金	空売り に係る未払金	借入金および その他の 金融取引合計	差入／ (受入) 担保	エクスポ ージャー 純額 (5)
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 594	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 594	\$ (593)	\$ 1
BPS	0	(408)	0	0	(408)	384	(24)
BRC	0	(2,155)	0	0	(2,155)	2,148	(7)
DEU	655	0	0	0	655	(658)	(3)
SAL	11,802	0	0	0	11,802	(12,045)	(243)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
BPS	0	0	0	(1,251)	(1,251)	0	(1,251)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 13,051	\$ (2,563)	\$ 0	\$ (1,251)			

(1) Includes accrued interest.

(2) The average amount of borrowings outstanding during the period ended August 31, 2023 was \$1,641 at a weighted average interest rate of 4.365%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

(3) Open maturity reverse repurchase agreement.

(4) Includes \$12 of interest payable on short sales.

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

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

WRITTEN OPTIONS:

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

銘柄	行使価格	期限日	契約数	プレミアム (受領)	時価
Call - U.S. Treasury 10-Year Note October 2023 Futures	\$ 113.500	09/22/2023	3	\$ (2)	\$ 0
Put - U.S. Treasury 10-Year Note October 2023 Futures	109.500	09/22/2023	3	(1)	(1)
Total Written Options				\$ (3)	\$ (1)

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価益／(損)	変動証拠金	
					資産	負債
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2023	27	\$ 14	\$ 3	\$ 0
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2023	246	179	40	0
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2023	85	94	16	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures	Short	12/2023	29	(57)	0	(15)
Total Futures Contracts				\$ 230	\$ 59	\$ (15)

SWAP AGREEMENTS:

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	時価	未実現 評価益／（損）	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2024	\$ 8,500	\$ (302)	\$ (16)	22	\$ 0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.730%	08/03/2033	300	(3)	(3)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.735%	08/07/2033	300	(2)	(2)	1	0
Total Swap Agreements					\$ (307)	\$ (21)	24	\$ 0

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of August 31, 2023:

Cash of \$942 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of August 31, 2023. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	金融デリバティブ資産					金融デリバティブ負債				
	時価	未収変動証拠金			合計	時価	未払変動証拠金			合計
	買建	先物	スワップ 契約	売建		先物	スワップ 契約			
	オプション							オプション		
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 59	\$ 24	\$ 83	\$ (1)	\$ (15)	0	\$ (16)		

(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨	未実現評価益／（損）		
					資産	負債	
BOA	09/2023	EUR	115	\$	124	\$ 0	\$ (1)
BOA	10/2023	DOP	5,120		90	0	0
BOA	10/2023	MYR	278		60	0	0
BOA	02/2024	DOP	27,117		469	0	0
BPS	09/2023	EUR	323		355	5	0
BPS	09/2023	\$	5	ILS	19	0	0
BPS	10/2023	ZAR	25,782	\$	1,336	0	(20)
CBK	09/2023	EUR	213		232	1	0
CBK	09/2023	MXN	901	\$	52	0	(1)
DUB	10/2023	ZAR	19,979		1,097	46	0
GLM	10/2023	DOP	9,912		177	3	0
GLM	10/2023		6,000		107	2	0
GLM	10/2023	ZAR	6,415		344	7	0
GLM	11/2023	DOP	17,957		323	9	0
GLM	11/2023		6,553		118	3	0
GLM	12/2023		18,207		327	10	0
JPM	09/2023	PEN	822		223	1	0
JPM	11/2023	GBP	1,506		1,921	12	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価益／（損）	
						資産	負債
MBC	09/2023	EUR	119	\$	131	\$ 2	\$ 0
MBC	09/2023	JPY	141,200		994	24	0
MBC	09/2023	\$	13,653	EUR	12,645	71	0
MBC	09/2023		136	JPY	19,913	1	0
MBC	10/2023	EUR	12,645	\$	13,672	0	(71)
MBC	10/2023	JPY	19,824		136	0	(1)
MBC	01/2024		40,000		280	0	0
MBC	02/2024		80,000		564	0	(1)
MYI	09/2023	EUR	11,875		13,149	261	0
SCX	09/2023	MXN	18,907		1,126	6	0
SCX	02/2024	MYR	916		200	1	0
TOR	09/2023	\$	729	JPY	106,906	5	0
TOR	10/2023	JPY	106,427	\$	729	0	(5)
UAG	09/2023	ZAR	3,921		224	17	0
UAG	09/2023		46,631		2,468	9	0
UAG	10/2023	JPY	14,313		99	0	0
Total Forward Foreign Currency Contracts						\$ 496	\$ (100)

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	支払／受取 変動金利	行使率	期限日	想定元本(1)	プレミアム (受領)	時価
BPS	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.750%	09/05/2023	400	\$ (1)	\$ 0
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.800%	09/22/2023	600	(3)	(5)
BPS	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.250%	09/05/2023	400	(1)	0
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.300%	09/22/2023	600	(3)	0
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.750%	09/01/2023	400	(1)	0
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.800%	09/05/2023	400	(1)	0
BRC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.400%	09/11/2023	500	(4)	(1)
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.250%	09/01/2023	400	(1)	0
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.300%	09/05/2023	400	(1)	0
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.800%	09/11/2023	500	(4)	0
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.705%	09/28/2023	100	0	(1)
FAR	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.580%	10/02/2023	100	0	0
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.155%	09/28/2023	100	0	0
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.030%	10/02/2023	100	0	(1)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.800%	09/05/2023	300	(1)	0
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.550%	09/05/2023	400	(2)	0
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.665%	09/25/2023	200	(1)	(1)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.300%	09/05/2023	300	(1)	0

INTEREST RATE SWAPPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	支払／受取 変動金利	行使率	期限日	想定元本(1)	プレミアム (受領)	時価
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.000%	09/05/2023	400 \$	(2) \$	0
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.165%	09/25/2023	200	(1)	0
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.665%	09/25/2023	300	(1)	(1)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.720%	09/29/2023	1,000	(4)	(7)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.170%	09/29/2023	1,000	(4)	(2)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.775%	09/25/2023	100	(1)	(1)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.300%	09/08/2023	500	(4)	0
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.225%	09/25/2023	100	(1)	0
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.700%	09/08/2023	500	(4)	(1)
Total Written Options							\$ (48) \$	(22)

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - BUY PROTECTION(2)

取引相手	参照債券	固定金利 の（支払）	満期日	2023年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド(4)	想定元本(5)	プレミアム 支払額／ (受領額)	未実現評価益／ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
BOA	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	2.894%	\$ 700	\$ 60	\$ (33)	\$ 27	\$ 0
BPS	Oman Government International Bond	(1.000%)	12/20/2027	1.050%	100	3	(3)	0	0
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	2.220%	1,300	161	(143)	18	0
HUS	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.247%	200	(1)	(2)	0	(3)
JPM	Dubai Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	0.247%	700	(1)	(7)	0	(8)
JPM	Turkey Government International Bond	(1.000%)	12/20/2025	2.894%	300	29	(18)	11	0
							\$ 251 \$ (206)	\$ 56	\$ (11)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION(3)

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2023年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド(4)	想定元本(5)	プレミアム 支払額／ (受取額)	未実現評価益／ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2031	2.484%	\$ 300	\$ (43)	\$ 17	\$ 0	\$ (26)
BOA	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.056%	100	0	1	1	0
BOA	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.181%	1,100	1	9	10	0
BOA	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.373%	200	2	2	4	0
BPS	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.085%	100	0	1	1	0
BPS	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	0.333%	700	4	12	16	0

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽³⁾ (Cont.)

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2023年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド(4)	想定元本(5)	プレミアム 支払額／ (受取額)	未実現評価益／ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
BPS	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.262%	\$ 600	\$ (2)	\$ 9	\$ 7	\$ 0
BPS	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.373%	1,000	9	9	18	0
BPS	Poland Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.085%	100	0	0	0	0
BPS	Romania Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.253%	200	(1)	2	1	0
BPS	Serbia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	2.055%	200	(18)	10	0	(8)
BRC	Argentina Government International Bond	5.000%	12/20/2023	24.842%	600	(83)	55	0	(28)
BRC	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.056%	400	1	3	4	0
BRC	Romania Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.253%	100	(1)	1	0	0
BRC	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.226%	188	2	0	2	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2026	1.103%	300	(19)	18	0	(1)
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.331%	200	0	1	1	0
CBK	Panama Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.424%	200	0	2	2	0
CBK	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.373%	3,600	25	42	67	0
GST	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.056%	700	2	4	6	0
GST	Chile Government International Bond	1.000%	06/20/2028	0.572%	300	1	6	7	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2028	0.816%	500	2	3	5	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	12/20/2025	0.313%	5,000	105	(20)	85	0
GST	Peru Government International Bond	1.000%	06/20/2026	0.373%	1,300	13	12	25	0
GST	Poland Government International Bond	1.000%	12/20/2023	0.085%	100	0	0	0	0
GST	Poland Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.171%	400	2	2	4	0
GST	Saudi Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.226%	112	1	0	1	0
JPM	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.616%	800	(18)	13	0	(5)
JPM	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2026	0.333%	200	1	3	4	0
JPM	Poland Government International Bond	1.000%	06/20/2028	0.623%	100	0	2	2	0
MYC	Chile Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.085%	300	1	3	4	0
MYC	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2024	0.181%	100	0	1	1	0
Total Swap Agreements						\$ (13)	\$ 223	\$ 278	\$ (68)
						\$ 238	\$ 17	\$ 334	\$ (79)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of OTC financial derivative instruments and collateral pledged/(received) as of August 31, 2023:

Cash of \$3 has been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as of August 31, 2023.

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバ ティブの 時価純額	差入／ (受入)担保	エクスポ ージャー純額(6)
	先渡為替 契約	買建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計	先渡為替 契約	売建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計			
BOA	\$ 0	\$ 0	\$ 42	\$ 42	\$ (1)	\$ 0	\$ (26)	\$ (27)	\$ 15	\$ 0	\$ 15
BPS	5	0	43	48	(20)	(5)	(8)	(33)	15	0	15
BRC	0	0	6	6	0	(1)	(28)	(29)	(23)	0	(23)
CBK	1	0	70	71	(1)	0	(1)	(2)	69	(230)	(161)
DUB	46	0	0	46	0	0	0	0	46	0	46
FAR	0	0	0	0	0	(2)	0	(2)	(2)	0	(2)
GLM	34	0	0	34	0	(1)	0	(1)	33	0	33
GST	0	0	151	151	0	0	0	0	151	(230)	(79)
HUS	0	0	0	0	0	0	(3)	(3)	(3)	0	(3)
JPM	13	0	17	30	0	(11)	(13)	(24)	6	0	6
MBC	98	0	0	98	(73)	0	0	(73)	25	0	25
MYC	0	0	5	5	0	(2)	0	(2)	3	3	6
MYI	261	0	0	261	0	0	0	0	261	(260)	1
SCX	7	0	0	7	0	0	0	0	7	0	7
TOR	5	0	0	5	(5)	0	0	(5)	0	0	0
UAG	26	0	0	26	0	0	0	0	26	0	26
Total Over the Counter	\$ 496	\$ 0	\$ 334	\$ 830	\$ (100)	\$ (22)	\$ (79)	\$ (201)			

- (1) Notional amount represents the number of contracts.
- (2) If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (3) If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (4) Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- (5) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- (6) Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from OTC financial derivative instruments can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

FAIR VALUE OF FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS

The following is a summary of the fair valuation of the Fund's derivative instruments categorized by risk exposure. See Note 7, Principal and Other Risks, in the Notes to Financial Statements on risks of the Fund.

Fair Values of Financial Derivative Instruments on the Statement of Assets and Liabilities as of August 31, 2023:

	Derivatives not accounted for as hedging instruments						
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total	
Financial Derivative Instruments - Assets							
Exchange-traded or centrally cleared							
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 59	\$ 59	
Swap Agreements	0	0	0	0	24	24	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 83</u>	<u>\$ 83</u>	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 496	\$ 0	\$ 496	
Swap Agreements	0	334	0	0	0	334	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 334</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 496</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 830</u>	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 334</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 496</u>	<u>\$ 83</u>	<u>\$ 913</u>	
Financial Derivative Instruments - Liabilities							
Exchange-traded or centrally cleared							
Written Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	
Futures	0	0	0	0	(15)	(15)	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (16)</u>	<u>\$ (16)</u>	
Over the counter							
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (100)	\$ 0	\$ (100)	
Written Options	0	0	0	0	(22)	(22)	
Swap Agreements	0	(79)	0	0	0	(79)	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (79)</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (100)</u>	<u>\$ (22)</u>	<u>\$ (201)</u>	
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (79)</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (100)</u>	<u>\$ (38)</u>	<u>\$ (217)</u>	

The Effect of Financial Derivative Instruments on the Statement of Operations for the period ended August 31, 2023:

	Derivatives not accounted for as hedging instruments					
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Written Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 3	3
Futures	0	0	0	0	(487)	(487)
Swap Agreements	0	0	0	0	(195)	(195)
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (679)</u>	<u>\$ (679)</u>
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 436	\$ 0	436
Written Options	0	0	0	0	51	51
Swap Agreements	0	17	0	0	0	17
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 17</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 436</u>	<u>\$ 51</u>	<u>\$ 504</u>
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 17</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 436</u>	<u>\$ (628)</u>	<u>\$ (175)</u>
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Written Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2	2
Futures	0	0	0	0	231	231
Swap Agreements	0	0	0	0	128	128
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 361</u>	<u>\$ 361</u>
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (466)	\$ 0	(466)
Written Options	0	0	0	0	26	26
Swap Agreements	0	70	0	0	0	70
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 70</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (466)</u>	<u>\$ 26</u>	<u>\$ (370)</u>
	<u>\$ 0</u>	<u>\$ 70</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ (466)</u>	<u>\$ 387</u>	<u>\$ (9)</u>

FAIR VALUE MEASUREMENTS

The following is a summary of the fair valuations according to the inputs used as of August 31, 2023 in valuing the Fund's assets and liabilities:

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2023	Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2023
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Albania					El Salvador				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 272	\$ 0	\$ 272	Sovereign Issues	\$ 0	\$ 1,815	\$ 0	\$ 1,815
Angola					Gabon				
Sovereign Issues	0	2,777	0	2,777	Sovereign Issues	0	146	0	146
Argentina					Georgia				
Sovereign Issues	0	4,008	0	4,008	Sovereign Issues	0	180	0	180
Armenia					Ghana				
Sovereign Issues	0	1,068	0	1,068	Sovereign Issues	0	3,230	0	3,230
Azerbaijan					Guatemala				
Corporate Bonds & Notes	0	2,323	0	2,323	Sovereign Issues	0	2,727	0	2,727
Sovereign Issues	0	583	0	583	Hong Kong				
Bahamas					Corporate Bonds & Notes	0	144	0	144
Sovereign Issues	0	996	0	996	Sovereign Issues	0	2,208	0	2,208
Bahrain					Hungary				
Sovereign Issues	0	2,223	0	2,223	Sovereign Issues	0	7,631	0	7,631
Brazil					India				
Corporate Bonds & Notes	0	1,175	0	1,175	Corporate Bonds & Notes	0	659	0	659
Sovereign Issues	0	4,468	0	4,468	Sovereign Issues	0	1,566	0	1,566
Cameroon					Indonesia				
Sovereign Issues	0	815	0	815	Corporate Bonds & Notes	0	12,166	0	12,166
Cayman Islands					Sovereign Issues	0	986	0	986
Corporate Bonds & Notes	0	6,569	0	6,569	Ireland				
Sovereign Issues	0	1,322	0	1,322	Sovereign Issues	0	1,367	0	1,367
Chile					Israel				
Corporate Bonds & Notes	0	4,753	0	4,753	Corporate Bonds & Notes	0	976	0	976
Sovereign Issues	0	2,537	0	2,537	Ivory Coast				
Colombia					Sovereign Issues	0	2,032	0	2,032
Corporate Bonds & Notes	0	1,497	0	1,497	Jamaica				
Sovereign Issues	0	4,545	0	4,545	Corporate Bonds & Notes	0	308	0	308
Costa Rica					Sovereign Issues	0	1,140	0	1,140
Sovereign Issues	0	1,160	0	1,160	Jersey, Channel Islands				
Dominican Republic					Corporate Bonds & Notes	0	1,406	0	1,406
Sovereign Issues	0	13,238	0	13,238	Jordan				
Ecuador					Sovereign Issues	0	2,740	0	2,740
Sovereign Issues	0	3,508	0	3,508	Kazakhstan				
Egypt					Corporate Bonds & Notes	0	2,612	0	2,612
Sovereign Issues	0	6,583	0	6,583	Sovereign Issues	0	316	0	316

Category and Sub-category	Level 1		Level 2		Level 3		Fair Value at 08/31/2023
Investments in Securities, at Value							
Kenya							
Sovereign Issues	\$	0	\$	1,713	\$	0	\$ 1,713
Malaysia							
Corporate Bonds & Notes		0		2,912		0	2,912
Sovereign Issues		0		620		0	620
Marshall Islands							
Corporate Bonds & Notes		0		65		0	65
Mexico							
Corporate Bonds & Notes		0		6,481		0	6,481
Sovereign Issues		0		5,249		0	5,249
Mongolia							
Sovereign Issues		0		504		0	504
Morocco							
Corporate Bonds & Notes		0		1,372		0	1,372
Sovereign Issues		0		328		0	328
Namibia							
Sovereign Issues		0		477		0	477
Netherlands							
Sovereign Issues		0		168		0	168
Nigeria							
Corporate Bonds & Notes		0		1,029		0	1,029
Sovereign Issues		0		5,965		0	5,965
North Macedonia							
Sovereign Issues		0		784		0	784
Oman							
Sovereign Issues		0		4,864		0	4,864
Pakistan							
Sovereign Issues		0		1,831		0	1,831
Panama							
Corporate Bonds & Notes		0		933		0	933
Sovereign Issues		0		7,062		0	7,062
Paraguay							
Sovereign Issues		0		1,647		0	1,647
Peru							
Corporate Bonds & Notes		0		641		0	641
Sovereign Issues		0		1,438		0	1,438
Philippines							
Sovereign Issues		0		4,107		0	4,107

Category and Sub-category	Level 1		Level 2		Level 3		Fair Value at 08/31/2023
Investments in Securities, at Value							
Poland							
Sovereign Issues	\$	0	\$	4,628	\$	0	\$ 4,628
Qatar							
Corporate Bonds & Notes		0		3,447		0	3,447
Sovereign Issues		0		2,906		0	2,906
Romania							
Sovereign Issues		0		6,753		0	6,753
Russia							
Sovereign Issues		0		592		0	592
Rwanda							
Sovereign Issues		0		312		0	312
Saudi Arabia							
Corporate Bonds & Notes		0		1,940		0	1,940
Sovereign Issues		0		7,016		0	7,016
Senegal							
Sovereign Issues		0		1,549		0	1,549
Serbia							
Sovereign Issues		0		3,201		0	3,201
Singapore							
Corporate Bonds & Notes		0		553		0	553
South Africa							
Corporate Bonds & Notes		0		5,972		0	5,972
Sovereign Issues		0		6,762		0	6,762
South Korea							
Corporate Bonds & Notes		0		197		0	197
Sri Lanka							
Sovereign Issues		0		3,090		0	3,090
Supranational							
Corporate Bonds & Notes		0		566		0	566
Sovereign Issues		0		903		0	903
Tunisia							
Sovereign Issues		0		1,036		0	1,036
Turkey							
Sovereign Issues		0		9,076		0	9,076
Ukraine							
Corporate Bonds & Notes		0		336		0	336
Sovereign Issues		0		2,317		0	2,317
United Arab Emirates							
Corporate Bonds & Notes		0		4,309		0	4,309

Category and Sub-category	Level 1		Level 2		Level 3		Fair Value at 08/31/2023
Investments in Securities, at Value							
United Kingdom							
Corporate Bonds & Notes	\$	0	\$	654	\$	0	\$ 654
Mortgage-Backed Securities		0		1,785		0	1,785
Sovereign Issues		0		135		0	135
United States							
Corporate Bonds & Notes		0		1,366		0	1,366
U.S. Treasury Obligations		0		13,107		0	13,107
Uruguay							
Sovereign Issues		0		3,521		0	3,521
Uzbekistan							
Sovereign Issues		0		243		0	243
Venezuela							
Corporate Bonds & Notes		0		1,337		0	1,337
Sovereign Issues		0		2,061		0	2,061
Zambia							
Sovereign Issues		0		592		0	592
Short-Term Instruments		0		15,371		0	15,371
Total Investments	\$	0	\$	270,598	\$	0	\$ 270,598
Short Sales, at value	\$	0	\$	(1,251)	\$	0	\$ (1,251)
Financial Derivative Instruments - Assets							
Exchange-traded or centrally cleared		0		83		0	83
Over the counter		0		830		0	830
	\$	0	\$	913	\$	0	\$ 913
Financial Derivative Instruments - Liabilities							
Exchange-traded or centrally cleared		0		(16)		0	(16)
Over the counter		0		(201)		0	(201)
	\$	0	\$	(217)	\$	0	\$ (217)
Totals	\$	0	\$	270,043	\$	0	\$ 270,043

There were no significant transfers into or out of Level 3 during the period ended August 31, 2023.

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額（2024年２月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約282億円）

発行済株式総数 5,051,655株

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命をただちに解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の4分の3以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の4分の3を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不適切な行為、詐欺または重過失の場合を除き、信託証書に基づく職務の遂行について、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、(i) ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは(ii) 管理会社の行為に関係し、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が実際に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、信託証書に基づく職務の遂行について、かかる行為が故意の不適切な行為、詐欺または重過失を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は2024年１月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産価格の合計（通貨別）
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	26	3,153,325,664.18米ドル

（３）その他

半期報告書提出前６か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

③ 管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

(iii) 資本金の額（2023年11月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約275億円）

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

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

（注）米ドルの円貨換算は、2023年11月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、

1米ドル=147.07円による。

(後略)

<訂正後>

(前略)

(iii) 資本金の額（2024年2月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約282億円）

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

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

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

（注）米ドルの円貨換算は、2024年2月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、

1米ドル=150.67円による。

(後略)

2 投資方針

（3）運用体制

<訂正前>

（イ）サブ・ファンドの運用体制

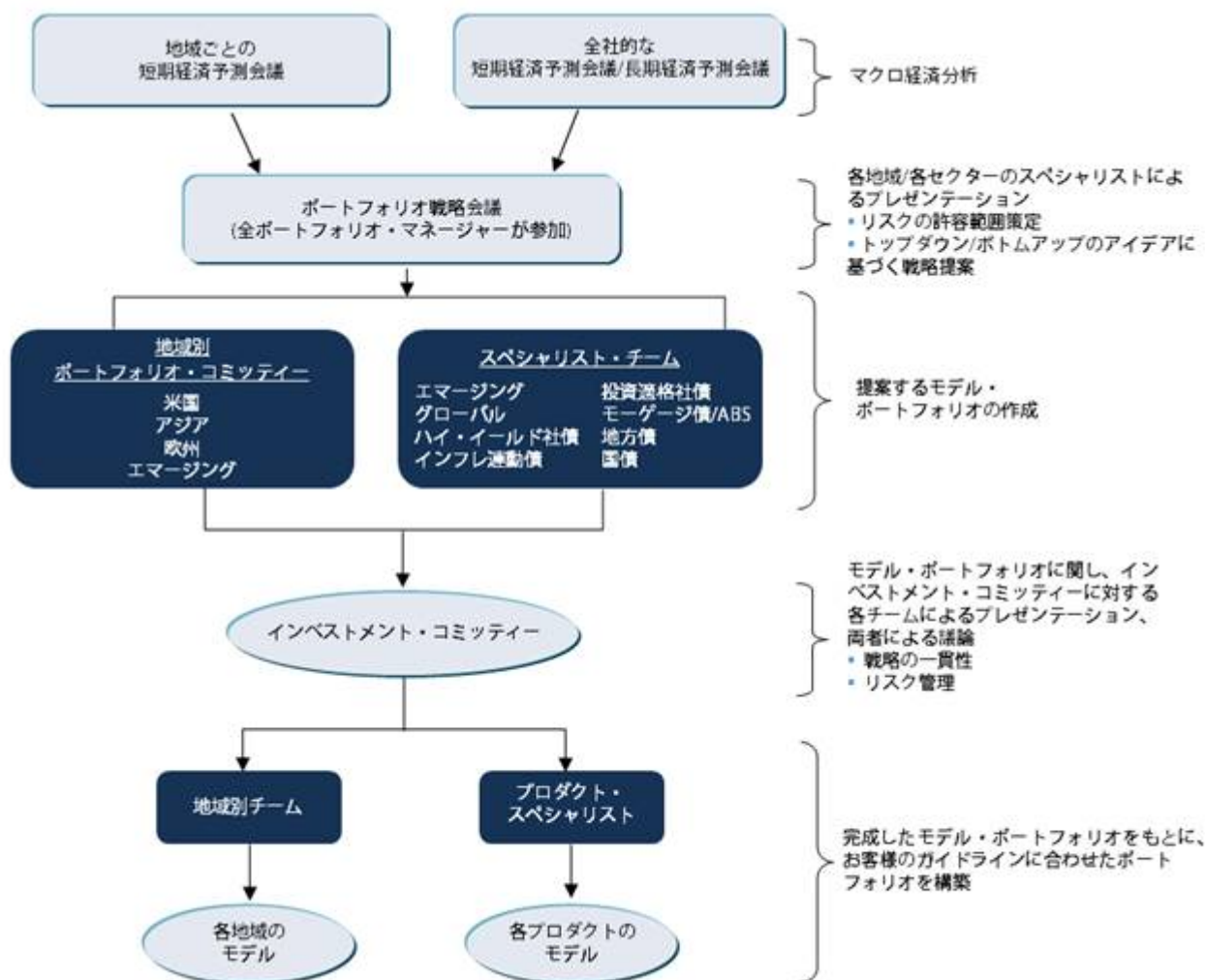
② 副投資運用会社の運用体制

（中略）

上記運用体制は、2023年12月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

（ロ）投資先ファンドの運用体制

運用プロセス

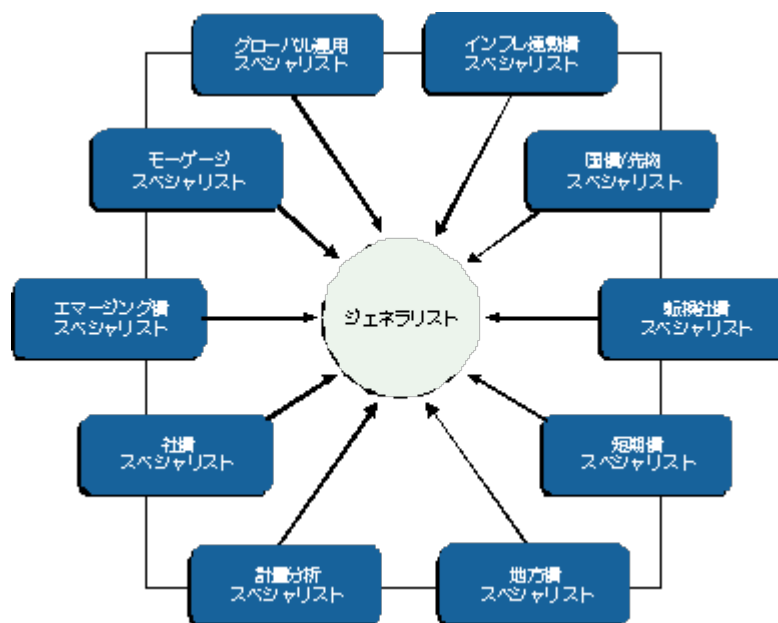


（2023年12月末日現在）

（中略）

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



(2023年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

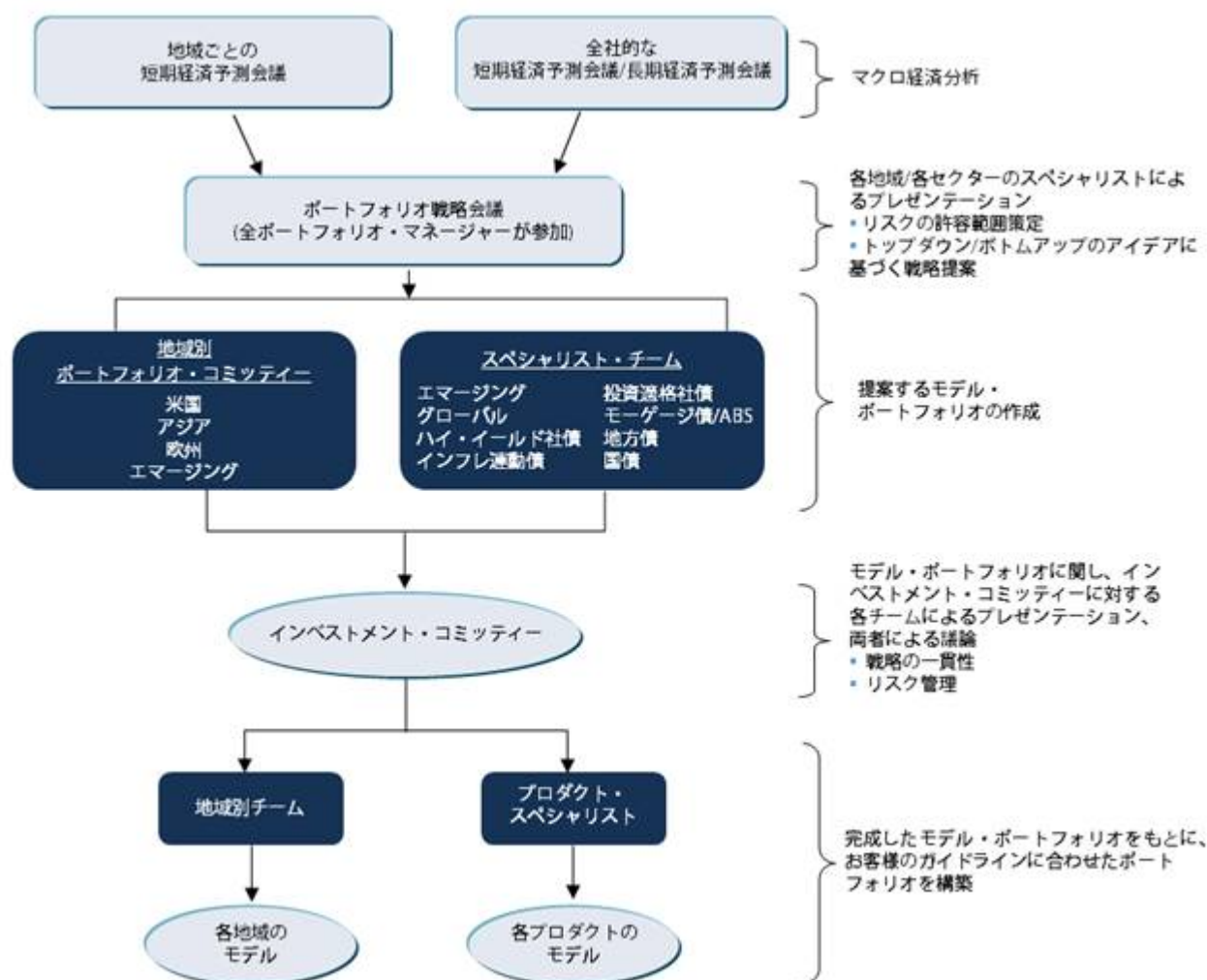
(イ) サブ・ファンドの運用体制

② 副投資運用会社の運用体制

(中略)

上記運用体制は、2024年2月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

(ロ) 投資先ファンドの運用体制

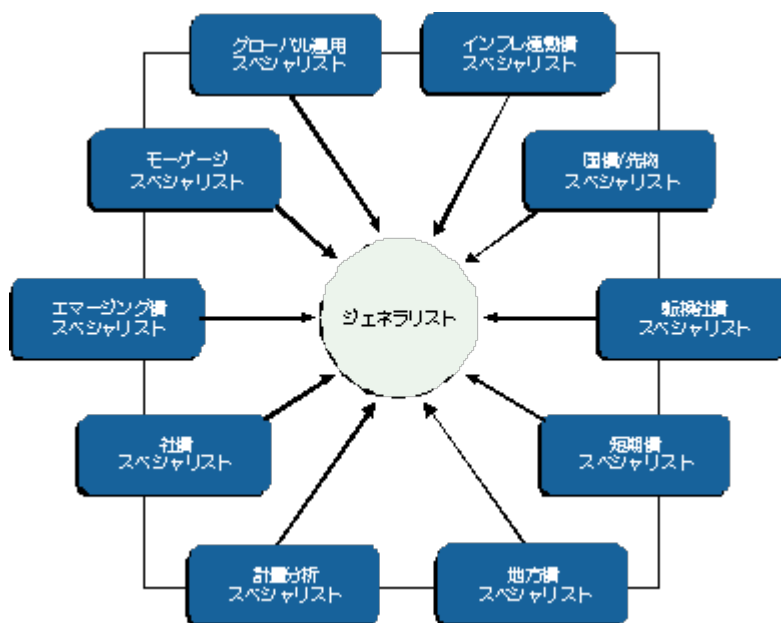
運用プロセス

(2024年2月末日現在)

(中略)

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



(2024年2月末日現在)

(後略)

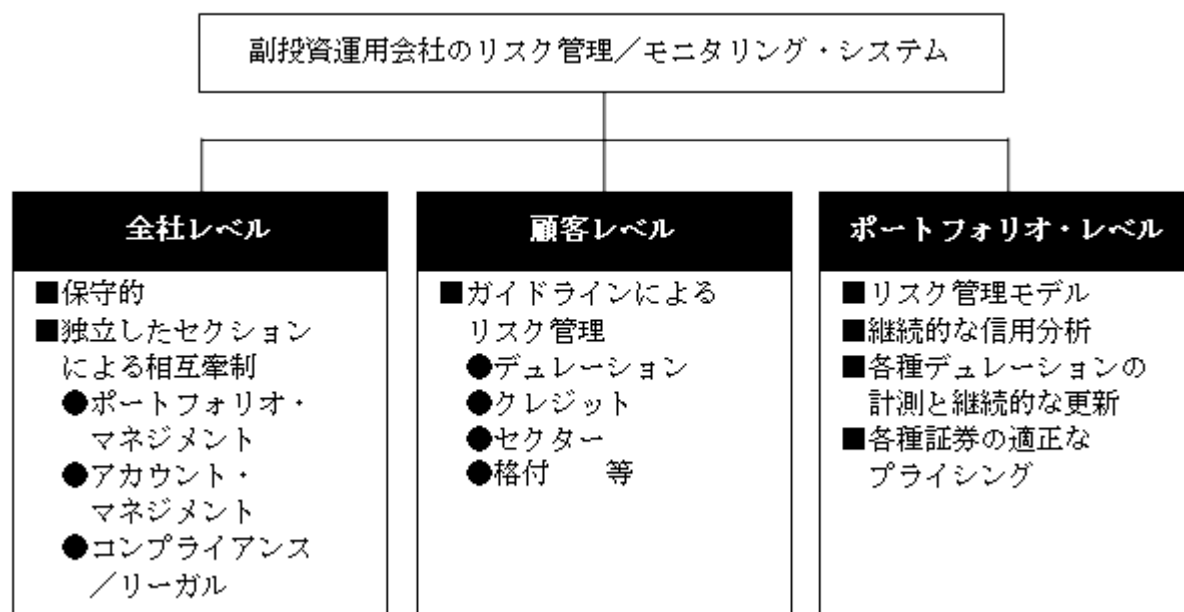
3 投資リスク

(2) リスクに対する管理体制

<訂正前>

(イ) サブ・ファンドのリスク管理体制

(中略)



(2023年12月末日現在)

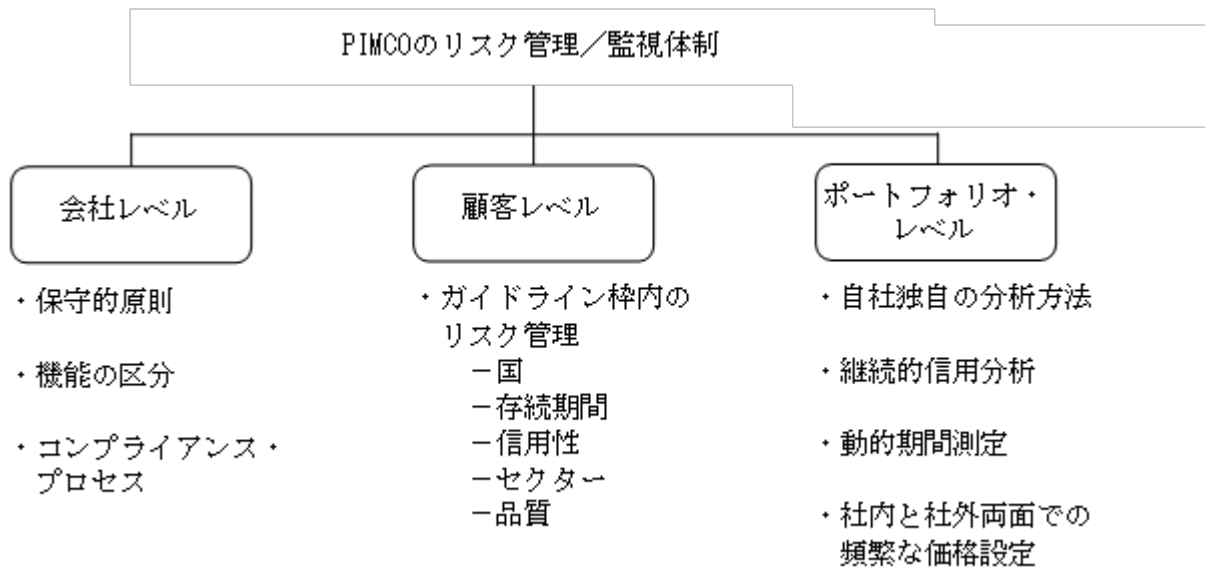
(中略)

(ロ) 投資先ファンドのリスク管理体制

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

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

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



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

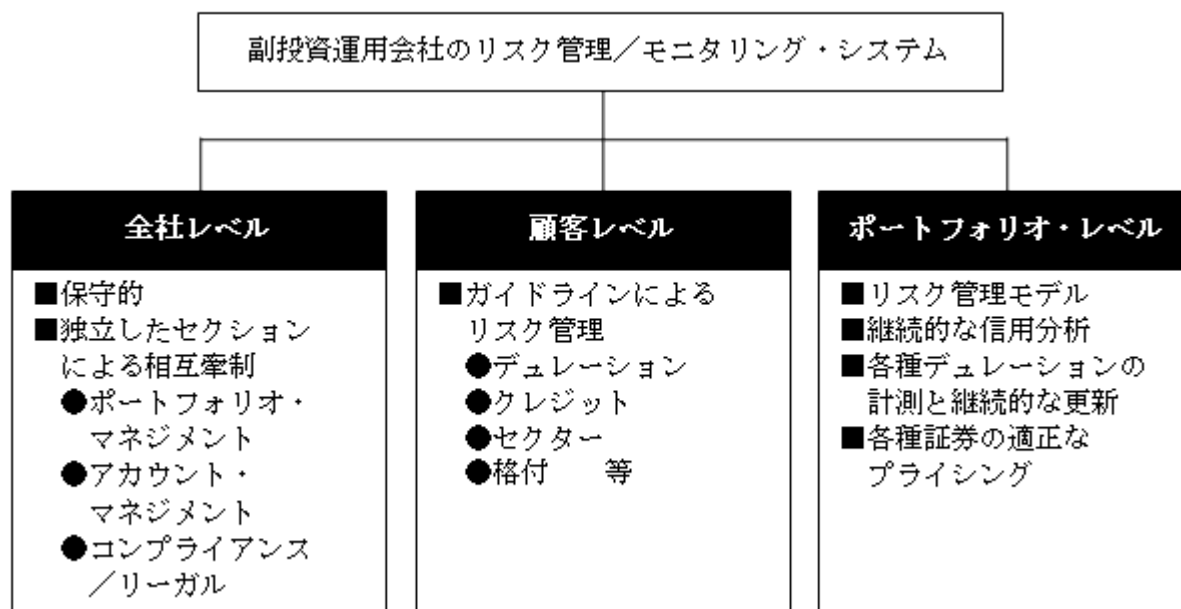
(2023年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

(イ) サブ・ファンドのリスク管理体制

(中略)



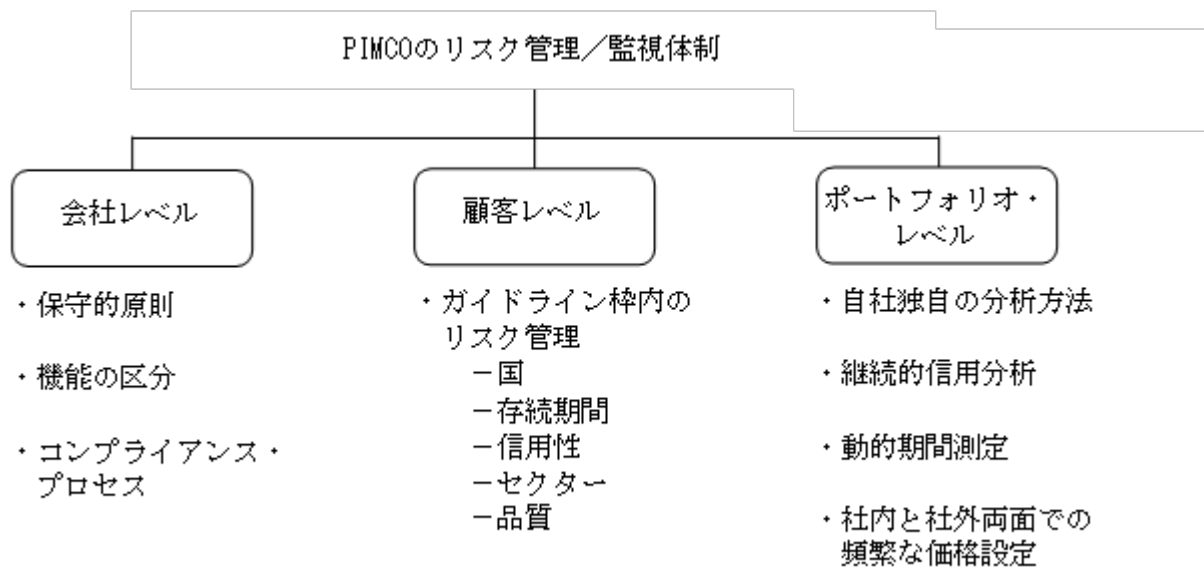
(2024年2月末日現在)

(中略)

(ロ) 投資先ファンドのリスク管理体制

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

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



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

(2024年2月末日現在)

(後略)

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

（A）日本

2023年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

<訂正後>

（前略）

（A）日本

2024年3月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

5 運用状況

（２）投資資産

<訂正前>

① 投資有価証券の主要銘柄（2023年11月末日現在）

<米ドル・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドA クラスF（米ドル）	ケイマン諸島	投資信託	1,752,541.97	11.22	19,662,973.83	9.11	15,965,657.35	99.94

<ユーロ・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（ユーロ）		時価（ユーロ）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドA クラスF（ユーロ）	ケイマン諸島	投資信託	250,191.65	11.15	2,789,573.49	8.52	2,131,632.86	100.40

<豪ドル・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（豪ドル）		時価（豪ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドB クラスF（豪ドル）	ケイマン諸島	投資信託	895,699.68	10.49	9,395,465.15	8.40	7,523,877.31	100.09

<南アフリカランド・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格 （南アフリカランド）		時価 （南アフリカランド）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドB クラスF（南アフリカランド）	ケイマン諸島	投資信託	1,549,932.41	104.29	161,635,315.40	88.88	137,757,992.60	100.12

<参考情報>

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

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	PANAMA (REP OF)	8.1250%	2034/04/28	1.5%
2	U S TREASURY BOND	3.2500%	2042/05/15	1.4%
3	REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC	5.7500%	2047/05/11	1.4%
4	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.9500%	2027/01/25	1.1%
5	SOUTH AFRICA (REP) BD SER R186	10.5000%	2026/12/21	1.1%
6	ISRAEL GOVT	5.0000%	2026/10/30	1.1%
7	U S TREASURY NOTE	3.1250%	2029/08/31	1.0%
8	PELABUHAN INDONESIA III SR UNSEC REGS	4.8750%	2024/10/01	1.0%
9	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.7500%	2050/01/14	1.0%
10	MEXICO GOVT (UMS) GLBL SR NT	5.7500%	2110/10/12	0.9%

● 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。

● 現金同等資産(米国短期国債等)を除いて表示しています。

② 投資不動産物件（2023年11月末日現在）

該当事項なし。

③ その他投資資産の主要なもの（2023年11月末日現在）

該当事項なし。

<訂正後>

① 投資有価証券の主要銘柄（2024年2月末日現在）

<米ドル・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドA クラスF（米ドル）	ケイマン諸島	投資信託	1,672,476.21	11.18	18,698,099.56	9.40	15,721,276.37	99.44

<ユーロ・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（ユーロ）		時価（ユーロ）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドA クラスF（ユーロ）	ケイマン諸島	投資信託	241,948.58	11.11	2,687,699.87	8.78	2,124,308.53	99.68

<豪ドル・ポートフォリオ>

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（豪ドル）		時価（豪ドル）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドB クラスF（豪ドル）	ケイマン諸島	投資信託	825,868.42	10.46	8,635,881.71	8.64	7,135,503.15	99.52

＜南アフリカランド・ポートフォリオ＞

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格 （南アフリカランド）		時価 （南アフリカランド）		投資 比率 （%）
					単価	金額	単価	金額	
1	ビムコ ケイマン エマージン グ ボンド ファンドB クラ スF（南アフリカランド）	ケイマン 諸島	投資信託	1,495,839.28	103.90	155,421,263.62	91.37	136,674,835.02	99.58

＜参考情報＞

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

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	PANAMA (REP OF)	8.1250%	2034/04/28	1.5%
2	U S TREASURY BOND	3.2500%	2042/05/15	1.5%
3	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.9500%	2027/01/25	1.2%
4	REPUBLIC OF TURKEY SR UNSEC	5.7500%	2047/05/11	1.1%
5	U S TREASURY NOTE	3.1250%	2029/08/31	1.0%
6	PELABUHAN INDONESIA III SR UNSEC REGS	4.8750%	2024/10/01	1.0%
7	MEXICO GOVT (UMS) GLBL SR NT	5.7500%	2110/10/12	1.0%
8	OMAN GOV INTERNTL BOND SR UNSEC REGS	6.0000%	2029/08/01	0.9%
9	ISRAEL GOVT	5.0000%	2026/10/30	0.9%
10	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.7500%	2050/01/14	0.9%

- 組入比率は、債券評価額の比率を小数第2位を四捨五入して表示しています。
- 現金同等資産（米国短期国債等）を除いて表示しています。

- ② 投資不動産物件（2024年2月末日現在）
該当事項なし。
- ③ その他投資資産の主要なもの（2024年2月末日現在）
該当事項なし。