

野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信 (ニュージーランドドルコース) 年2回決算型

運用報告書(全体版)

第29期（決算日2024年2月26日）

作成対象期間（2023年8月26日～2024年2月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
なお、当ファンドは、運用開始以来永らくご愛顧いただきましたが、2024年8月26日に信託期間満了となります。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券		
信託期間	2009年9月9日から2024年8月26日までです。		
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるPIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り事業債（「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。）を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。		
主な投資対象	野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）受益証券および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。	
	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）	PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド（M）受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り事業債を実質的な主要投資対象とします。	
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。	
主な投資制限	野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。	
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	株式への投資は行ないません。	
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。		

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 達 配	期 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
25期(2022年 2 月25日)	31,867	10	△ 2.8	0.0	—	93.9	43
26期(2022年 8 月25日)	33,264	10	4.4	0.0	—	94.3	44
27期(2023年 2 月27日)	32,854	10	△ 1.2	0.0	—	94.4	43
28期(2023年 8 月25日)	34,750	10	5.8	0.0	—	95.1	45
29期(2024年 2 月26日)	39,470	10	13.6	0.0	—	95.0	39

* 基準価額の騰落率は分配金込み。
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

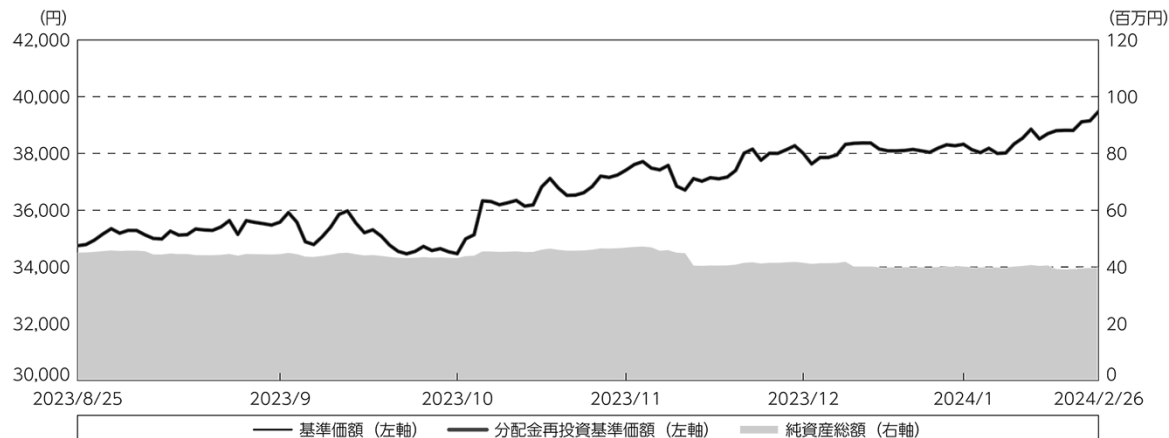
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券	債 券	投 資	信 託	
		騰 落	率					組 入
(期 首)	円		%		%			%
2023年 8 月25日	34,750		—		0.0			95.1
8 月末	35,348		1.7		0.0			95.2
9 月末	35,581		2.4		0.0			95.1
10月末	34,470		△ 0.8		0.0			95.1
11月末	37,414		7.7		0.0			95.6
12月末	38,008		9.4		0.0			95.3
2024年 1 月末	38,324		10.3		0.0			95.4
(期 末)								
2024年 2 月26日	39,480		13.6		0.0			95.0

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- （注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2023年8月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- （注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- （注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

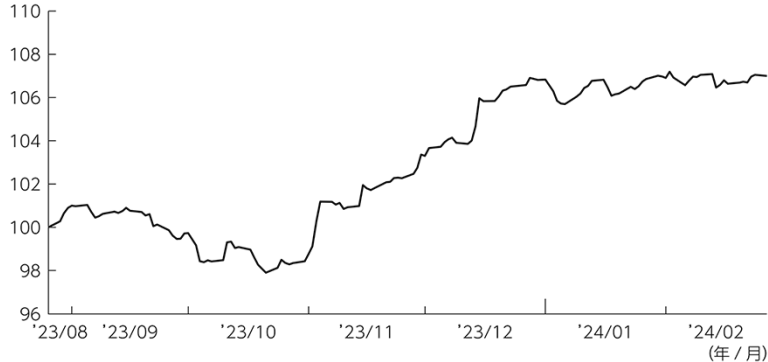
- ・実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利息収入）
- ・実質的に投資しているハイ・イールド債からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）
- ・円／ニュージーランドドルの為替変動

○投資環境

<米国ハイ・イールド債市場>

米国ハイ・イールド債市場の騰落は以下ようになりました。

<米国ハイ・イールド債市場の推移>

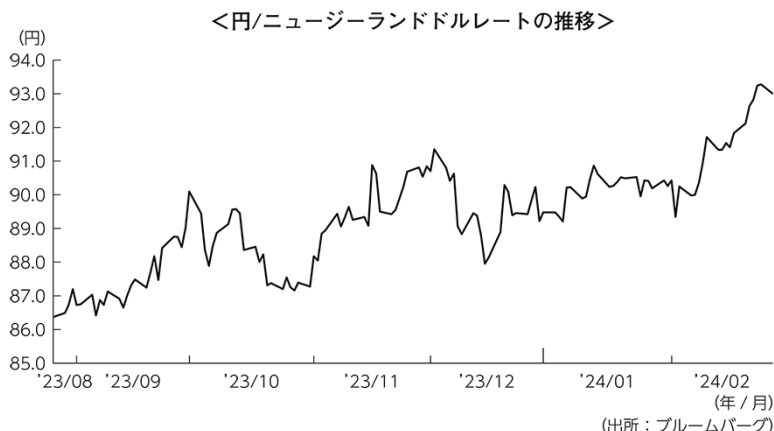


※ハイ・イールド債市場：ICE BofA US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index。当作成期首を 100 として指数化。
 (出所：ブルームバーグ / 出所および許可：ICE Data Indices, LLC)

米国ハイ・イールド債市場は、2023年10月にかけて、FRB（米連邦準備制度理事会）の高金利政策が長期化するとの懸念が高まる中で米金利が上昇したことや、中東情勢の緊迫化などを背景に下落しました。2023年11月に入り、パウエルFRB議長が金融引き締め局面が終了した可能性も認めたことにより、米金利の低下や市場心理の改善がもたらされ上昇に転じました。その後も、2023年12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）における最新の経済見通しで2024年に複数回の利下げが示唆されたことから米金利が低下し、上昇基調が継続しました。2024年1月以降は一進一退の展開となり、当作成期間において値上がりとなりました。

＜為替レートの推移＞

ニュージーランドドルの円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。



○当ファンドのポートフォリオ

〔野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型〕

〔PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）〕および〔野村マネーポートフォリオ マザーファンド〕の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）〕の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

〔PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）〕

主要投資対象である〔PIMCO パミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド（M）〕のハイ・イールド債ポートフォリオでは、ハイ・イールド債券を概ね高位に組入れました。

外部環境の変化に対し耐性を持たせることに配慮したセクター選別を継続しました。具体的には、新型コロナウイルス収束後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空、定期課金により安定的なキャッシュフロー（現金収支）が望めるメディア・ケーブルへの投資比率をオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）としています。一方、景気減速局面において需要の縮小が見込まれる自動車セクター、インターネットを通して商品を購入する消費者の割合が増加するなか、消費者行動の変化への対応が遅れている一部の小売セクターへの投資比率をアンダーウェイト（ベンチマークに比べ低めの投資比率）としました。

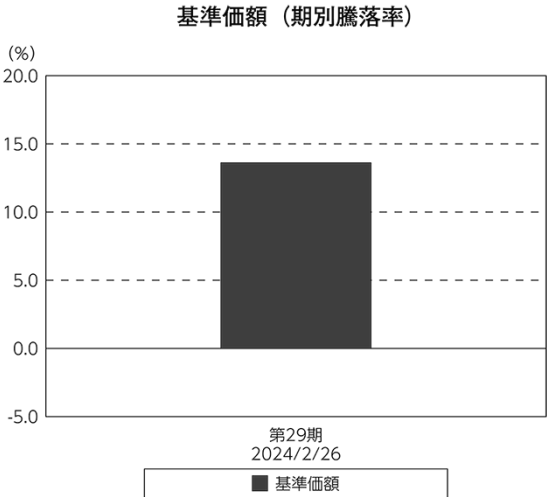
〔野村マネーポートフォリオ マザーファンド〕

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案して決定しました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第29期
	2023年 8 月26日～ 2024年 2 月26日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.025%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	43,458

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。
（注）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

◎今後の運用方針

【野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型】

【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）】受益証券および【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）】受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J（NZD）】

米ドル建ての高利回り事業債（「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。また、外国為替予約取引、為替先渡し取引、直物為替先渡し取引等を活用し、米ドル建て資産について、原則として米ドルを売り、ニュージーランドドルを買う為替取引を行ないます。

米国については、FRBによる積極的な金融引き締め、米地方銀行の経営破綻、地政学的リスクの高まりといったマイナス要因にも関わらず、2023年の景気は底堅いものとなりました。2024年の成長率は2023年に比べて低下するとみているものの、過去の低金利時において長期固定金利での住宅ローンの借入れを行なった世帯の割合が多いことから金利上昇が消費に与えるマイナスの影響が相対的に少ないため、他の主要先進国対比では底堅い成長を予想しています。コロナショックにより停滞がみられたサプライチェーン（供給網）の改善が引き続きインフレ圧力の緩和に繋がる一方、生産性が大幅に改善しない限り、労働市場のひっ迫などによる賃金への上昇圧力を背景にインフレ率はFRBの目標水準を上回って推移する可能性が高いとみています。なお、失業率の上昇などによる景気の悪化を背景に2024年半ばには利下げが開始されるとみています。

米国ハイ・イールド債券については、多くの企業が手元資金の確保に努めてきており、デフォルト（債務不履行）率は低位で推移しております。一方、中小銀行を中心に融資姿勢の厳格化により景気減速の可能性が高まる中、今後のデフォルト率は緩やかに上昇すると考えております。

当戦略は慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行なう方針です。具体的には、新型コロナウイルス収束後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空、定期課金により安定的なキャッシュフローが望めるメディア・ケーブルなどへの投資比率を高めとします。一方、脱炭素社会への転換など構造転換局面にある自動車、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売への投資比率を低く抑える方針です。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

[野村マネーポートフォリオ マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023 年 8 月 26 日～2024 年 2 月 26 日)

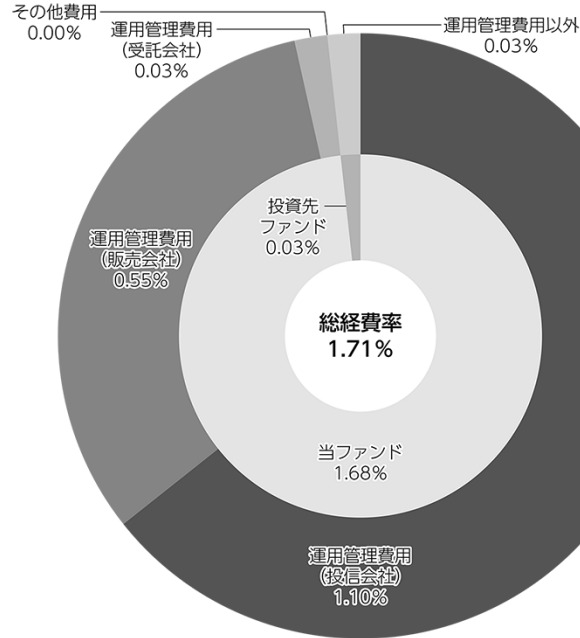
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 311	% 0.851	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(203)	(0.556)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(102)	(0.278)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(6)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	311	0.852	
期中の平均基準価額は、36,524円です。			

- * 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- * 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- * その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- * 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- * 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.71%です。



(単位: %)

総経費率 (①+②+③)	1.71
①当ファンドの費用の比率	1.68
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.03

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年 8 月26日～2024年 2 月26日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J (NZD)	口	千円	口	千円
		117	918	1,325	10,547

*金額は受け渡し代金。
*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年 8 月26日～2024年 2 月26日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2024年 2 月26日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額
PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファン dB-J (NZD)	口	口	千円	%
	5,713	4,505	37,968	95.0
合 計	5,713	4,505	37,968	95.0

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。
*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘柄		期首(前期末)	当期末	
		口数	口数	評価額
野村マネーポートフォリオ マザーファンド		千口	千口	千円
		9	9	10

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年 2 月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 37,968	% 94.1
野村マネーポートフォリオ マザーファンド	10	0.0
コール・ローン等、その他	2,357	5.9
投資信託財産総額	40,335	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年 2 月26日現在）

○損益の状況（2023年 8 月26日～2024年 2 月26日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	40,335,300
コール・ローン等	2,357,145
投資信託受益証券(評価額)	37,968,140
野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額)	10,015
(B) 負債	377,609
未払収益分配金	10,123
未払信託報酬	367,073
その他未払費用	413
(C) 純資産総額(A－B)	39,957,691
元本	10,123,503
次期繰越損益金	29,834,188
(D) 受益権総口数	10,123,503口
1 万口当たり基準価額(C／D)	39,470円

(注) 期首元本額は12,963,195円、期中追加設定元本額は45,619円、期中一部解約元本額は2,885,311円、1 口当たり純資産額は3,9470円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額134,810円。

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	925,099
受取配当金	925,303
支払利息	△ 204
(B) 有価証券売買損益	4,196,143
売買益	4,710,689
売買損	△ 514,546
(C) 信託報酬等	△ 367,486
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	4,753,756
(E) 前期繰越損益金	8,661,340
(F) 追加信託差損益金	16,429,215
(配当等相当額)	(25,107,300)
(売買損益相当額)	(△ 8,678,085)
(G) 計(D＋E＋F)	29,844,311
(H) 収益分配金	△ 10,123
次期繰越損益金(G＋H)	29,834,188
追加信託差損益金	16,429,215
(配当等相当額)	(25,107,300)
(売買損益相当額)	(△ 8,678,085)
分配準備積立金	18,887,666
繰越損益金	△ 5,482,693

*損益の状況の中で(B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

（注）分配金の計算過程（2023年8月26日～2024年2月26日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年8月26日～ 2024年2月26日
a. 配当等収益(経費控除後)	858,745円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	25,107,300円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	18,039,044円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	44,005,089円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	43,468円
g. 分配金	10,123円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金（税込み）	10円
----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)
PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J(AUD)/J(NZD)/
J(BRL)/J(ZAR)/J(MXN)

2023年6月30日決算
(計算期間:2022年7月1日～2023年6月30日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	英領バミューダ諸島籍円建て外国投資信託
運 用 方 針	PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)受益証券への投資を通じて、米ドル建てのハイ・イールド・ボンド(高利回り事業債)に実質的に投資を行ない、トータルリターンを最大化を目指します。
投 資 対 象	米ドル建ての高利回り事業債
管 理 会 社 投 資 顧 問 会 社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 会 社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ(バミューダ)リミテッド
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 受 託 銀 行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名 義 書 換 事 務 受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・エー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA

運用計算書

2023年6月30日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:	
受取利息	\$ 15
雑収入	24
収益合計	39
費用:	
支払利息	2
費用合計	2
純投資損益	37
当期実現損益:	
投資有価証券	(1)
関連投資	213
上場または中央清算金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	(1,796)
外貨通貨	9
当期実現損益	(1,575)
当期末実現評価損益:	
投資有価証券	1
関連投資	856
上場または中央清算金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	456
外貨建資産および負債	0
当期末実現評価損益	1,313
当期実現および未実現評価損益	(262)
運用の結果による純資産の増減額	\$ (225)

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

(単位:千 1口単位を除く)

期末純資産総額	
J (JPY)	\$ 11,758
期末現在発行済受益証券数	
J (JPY)	261
期末1口当たり純資産価格	
J (JPY)	\$ 45.02

※PIMCO パミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)の期末純資産額は63,324千米ドル

組入資産の明細

2023年6月30日

額面金額(単位:千)

評価額(単位:千)

投資有価証券 3.0%			
短期金融商品 3.0%			
定期預金 1.3%			
Bank of Nova Scotia			
4.570% due 07/03/2023	\$	3	\$ 3
Citibank N.A.			
4.570% due 07/03/2023		25	25
DBS Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		20	20
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.570% due 07/03/2023		19	19
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
4.570% due 07/03/2023		38	38
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		45	45
			<u>150</u>
米国財務省短期証券 1.7%			
5.266% due 08/31/2023 (a)		200	<u>199</u>
短期金融商品合計			<u>349</u>
(取得原価\$348)			
投資有価証券合計			<u>349</u>
(取得原価\$348)			
口数(単位:千)			
関連投資 100.9%			
その他の投資会社 100.9%			
PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)			
(取得原価\$11,220)		726	<u>11,870</u>
関連投資合計			<u>11,870</u>
(取得原価\$11,220)			
投資合計 103.9%			\$ 12,219
(取得原価\$11,568)			
金融デリバティブ商品 (3.9%)			(458)
(取得原価またはプレミアム\$0)			
その他の資産および負債 (0.0%)			(3)
純資産 100.0%			\$ 11,758

(a)クーポンは最終利回りである。

◎店頭金融デリバティブ商品
●J (JPY)クラス外国為替先渡し契約

2023年6月30日現在

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益					
				資産	負債				
BOA	07/2023	JPY	577,988	\$	4,003	\$	4	\$	0
BOA	07/2023	\$	4,250	JPY	590,767		0		(163)
BOA	08/2023		3,906		562,116		1		0
BPS	07/2023	JPY	574,809	\$	3,978		1		0
BPS	07/2023	\$	4,250	JPY	590,767		0		(163)
BPS	08/2023		3,906		562,116		2		0
BRC	07/2023		7		937		0		0
JPM	07/2023	JPY	200,261	\$	1,400		15		0
JPM	08/2023	\$	1,400	JPY	199,410		0		(14)
MBC	07/2023	JPY	4,600	\$	32		1		0
MYI	07/2023	\$	148	JPY	21,356		0		0
SCX	07/2023	JPY	339,842	\$	2,351		0		0
SCX	07/2023	\$	3,729	JPY	518,330		0		(143)
SCX	08/2023		2,351		338,407		1		0
外国為替先渡し契約合計						\$	25	\$	(483)

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB

(単位: 千 1口単位を除く)

運用計算書

2023年6月30日に終了した期間

(金額単位: 千米ドル)

収益:

受取利息	\$	227
雑収入		350
収益合計		577

費用:

支払利息		19
費用合計		19

純投資損益	558
-------	-----

当期実現損益:

投資有価証券	(2)
関連投資	1,149
上場または中央清算金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	4,747
外貨通貨	15
当期実現損益	5,909

当期末実現評価損益:

投資有価証券	3
関連投資	3,368
上場または中央清算金融デリバティブ商品	0
店頭金融デリバティブ商品	4,378
外貨建資産および負債	0
当期末実現評価損益	7,749
当期実現および未実現評価損益	13,658

運用の結果による純資産の増減額	\$	14,216
-----------------	----	--------

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

期末純資産総額

J (AUD)	\$	5,070
J (BRL)		26,156
J (MXN)		25,698
J (NZD)		2,470
J (ZAR)		386

期末現在発行済受益証券数

J (AUD)	87
J (BRL)	987
J (MXN)	510
J (NZD)	46
J (ZAR)	15

期末1口当たり純資産価格

J (AUD)	\$	58.59
J (BRL)		26.50
J (MXN)		50.41
J (NZD)		53.36
J (ZAR)		25.95

※PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド (M)の期末純資産額は63,324千米ドル

組入資産の明細

	2023年6月30日	
	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
投資有価証券 13.1%		
短期金融商品 13.1%		
定期預金 1.3%		
Bank of Nova Scotia		
4.570% due 07/03/2023	\$ 18	\$ 18
Citibank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	130	130
DBS Bank Ltd.		
4.570% due 07/03/2023	102	102
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	101	101
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
4.570% due 07/03/2023	198	198
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
4.570% due 07/03/2023	232	232
		<u>781</u>
米国財務省短期証券 (a) 11.8%		
5.057% due 07/20/2023	2,200	2,195
5.082% due 08/03/2023	800	797
5.110% due 08/15/2023	3,200	3,180
5.290% due 08/31/2023	900	892
		<u>7,064</u>
短期金融商品合計		<u>7,845</u>
(取得原価\$7,843)		
投資有価証券合計		<u>7,845</u>
(取得原価\$7,843)		
	口数(単位:千)	
関連投資 86.1%		
その他の投資会社 86.1%		
PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)		
(取得原価\$49,476)	3,145	51,454
関連投資合計		<u>51,454</u>
(取得原価\$49,476)		
投資合計 99.2%		
(取得原価\$57,319)	\$	59,299
金融デリバティブ商品 3.8%		
(取得原価またはプレミアム\$0)		2,282
その他の資産および負債 (3.0%)		<u>(1,801)</u>
純資産 100.0%	\$	<u>59,780</u>

(a)クーポンは最終利回りである。

◎店頭金融デリバティブ商品

2023年6月30日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
BPS	07/2023	\$	176	JPY	24,735	\$ 0	\$ (5)
BPS	08/2023		43		6,192	0	0
GRE	07/2023	JPY	18,503	\$	134	6	0
MYI	07/2023	\$	27	JPY	3,906	0	0
MYI	07/2023		1		100	0	0
						\$ 6	\$ (5)

●J (AUD)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
BOA	07/2023	AUD	46	\$	31	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2023	\$	1,395	AUD	2,146	34	0
BPS	07/2023	AUD	2,296	\$	1,521	0	(7)
BPS	08/2023	\$	1,462	AUD	2,206	7	0
CBK	07/2023	AUD	746	\$	494	0	(2)
CBK	07/2023	\$	344	AUD	527	7	0
CBK	08/2023		472		713	3	0
JPM	07/2023		524		801	10	0
MYI	07/2023		69		104	0	0
RBC	07/2023	AUD	9	\$	6	0	0
SCX	07/2023		747		496	0	(1)
SCX	07/2023	\$	420	AUD	642	8	0
SCX	08/2023		496		747	1	0
SOG	07/2023		830		1,268	14	0
TOR	07/2023	AUD	1,304	\$	861	0	(7)
TOR	07/2023	\$	882	AUD	1,348	16	0
TOR	08/2023		862		1,304	7	0
UAG	07/2023	AUD	2,546	\$	1,691	0	(4)
UAG	07/2023	\$	629	AUD	961	11	0
UAG	08/2023		1,688		2,540	4	0
						\$ 122	\$ (21)

●J (BRL)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
BOA	07/2023	BRL	614	\$	127	\$	0
BOA	07/2023	\$	123	BRL	614		\$
BPS	07/2023	BRL	43,369	\$	9,056		0
BPS	07/2023	\$	8,999	BRL	43,369		0
BPS	08/2023		8,733		41,944		(85)
BRC	07/2023	BRL	170	\$	35		0
BRC	07/2023	\$	35	BRL	170		0
BRC	08/2023	BRL	87	\$	18		0
BSS	07/2023		524		103		(6)
BSS	07/2023	\$	109	BRL	524		0
CBK	07/2023	BRL	42,841	\$	8,958		77
CBK	07/2023	\$	8,556	BRL	42,841		325
CBK	08/2023		8,724		41,934		0
GLM	07/2023	BRL	42,702	\$	8,860		8
GLM	07/2023	\$	8,527	BRL	42,702		325
JPM	07/2023	BRL	42,837	\$	8,889		9
JPM	07/2023	\$	8,556	BRL	42,837		324
MBC	08/2023	BRL	34	\$	7		0
MBC	08/2023	\$	270	BRL	1,296		0
TOR	07/2023	BRL	41,998	\$	8,754		48
TOR	07/2023	\$	8,715	BRL	41,998		0
TOR	08/2023		8,673		41,828		0
UAG	07/2023	BRL	168	\$	35		0
UAG	07/2023	\$	35	BRL	168		0
						\$	1,185
						\$	(237)

●J (MXN)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
BPS	07/2023	MXN	668	\$	39	\$	0
BPS	07/2023		144,372		8,386		0
BPS	07/2023	\$	8,548	MXN	153,778		417
BPS	08/2023		8,340		144,372		28
BRC	07/2023	MXN	146,282	\$	8,514		0
BRC	08/2023	\$	8,467	MXN	146,282		12
BSS	07/2023		278		4,958		11
CBK	07/2023	MXN	149,300	\$	8,682		0
CBK	07/2023	\$	8,109	MXN	145,887		397
CBK	07/2023		39		668		0
CBK	08/2023	MXN	668	\$	39		0
CBK	08/2023	\$	8,464	MXN	146,282		14
DUB	07/2023	MXN	593	\$	34		0
MBC	07/2023		4,744		271		0
MYI	07/2023		996		57		0
MYI	07/2023	\$	209	MXN	3,582		0
MYI	08/2023		230		3,948		0
RBC	07/2023	MXN	4,480	\$	260		0
RBC	08/2023		359		21		0
SCX	07/2023	\$	8,121	MXN	145,887		385
UAG	07/2023		15		257		0
						\$	1,264
						\$	(79)

●J (NZD)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益		
						資産	負債	
BOA	07/2023	\$	737	NZD	1,215	\$	7	\$ 0
BPS	07/2023	NZD	45	\$	27		0	0
BPS	07/2023	\$	16	NZD	27		0	0
BRC	07/2023	NZD	1,339	\$	814		0	(6)
BRC	07/2023	\$	556	NZD	927		11	0
BRC	08/2023		814		1,339		6	0
DUB	07/2023	NZD	4	\$	2		0	0
GRE	07/2023		18		11		0	0
JPM	07/2023		1,316		802		0	(4)
JPM	07/2023	\$	0	NZD	1		0	0
JPM	08/2023	NZD	1	\$	0		0	0
JPM	08/2023	\$	797	NZD	1,309		4	0
MBC	07/2023		5		8		0	0
MBC	08/2023	NZD	8	\$	5		0	0
MYI	07/2023	\$	616	NZD	1,017		7	0
SCX	07/2023		567		933		5	0
TOR	07/2023	NZD	1,370	\$	834		0	(5)
TOR	08/2023	\$	828	NZD	1,360		5	0
						\$	45	\$ (15)

●J (ZAR)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益		
						資産	負債	
BPS	07/2023	ZAR	2,370	\$	125	\$	0	\$ (1)
BPS	08/2023	\$	125	ZAR	2,376		1	0
CBK	07/2023		3		50		0	0
JPM	07/2023		122		2,412		6	0
MYI	07/2023		246		4,863		11	0
MYI	07/2023	ZAR	55	\$	3		0	0
NGF	07/2023	\$	1	ZAR	23		0	0
SOG	07/2023	ZAR	4,880	\$	259		1	0
SOG	08/2023	\$	259	ZAR	4,893		0	(1)
						\$	19	\$ (2)
外国為替先渡し契約合計						\$	2,641	\$ (359)

PIMCO バミューダ US ハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)

組入資産の明細

2023年6月30日

		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)	
投資有価証券 97.0%				
バンクローン 2.2%				
AAdvantage Loyalty IP Ltd.				
10.000% due 04/20/2028	\$	100	\$	102
Carnival Corp.				
8.467% due 10/18/2028		172		171
Diamond Sports Group LLC				
13.064% due 05/25/2026		9		7
Nouryon Finance BV				
3.369% due 04/03/2028		551		547
TransDigm, Inc.				
8.492% due 08/24/2028		504		504
United AirLines, Inc.				
9.292% due 04/21/2028		78		78
バンクローン合計				1,409
(取得原価\$1,416)				
社債・約束手形 81.9%				
銀行・金融 9.7%				
Burford Capital Global Finance LLC				
6.250% due 04/15/2028		200		184
Coinbase Global, Inc.				
3.625% due 10/01/2031		50		30
Credit Acceptance Corp.				
5.125% due 12/31/2024		170		165
Credit Suisse Group AG AT1 Claim (d)		300		12
CTR Partnership LP				
3.875% due 06/30/2028		75		65
Curo Group Holdings Corp.				
7.500% due 08/01/2028		200		76
Freedom Mortgage Corp.				
8.125% due 11/15/2024		750		744
goeasy Ltd.				
4.375% due 05/01/2026		50		46
5.375% due 12/01/2024		150		146
HAT Holdings I LLC				
3.375% due 06/15/2026		325		292
Howard Hughes Corp.				
5.375% due 08/01/2028		200		178
Intesa Sanpaolo SpA				
5.017% due 06/26/2024		550		533
Ladder Capital Finance Holdings LLLP				
4.250% due 02/01/2027		100		87
LPL Holdings, Inc.				
4.000% due 03/15/2029		200		176
Midcap Financial Issuer Trust				
6.500% due 05/01/2028		200		178
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5.500% due 08/15/2028		160		140
6.000% due 01/15/2027		150		140
NMI Holdings, Inc.				
7.375% due 06/01/2025		90		91
OneMain Finance Corp.				
6.125% due 03/15/2024		150		150
6.625% due 01/15/2028		600		566

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Oxford Finance LLC		
6.375% due 02/01/2027	100	93
Park Intermediate Holdings LLC		
4.875% due 05/15/2029	100	86
5.875% due 10/01/2028	50	46
7.500% due 06/01/2025	150	150
PennyMac Financial Services, Inc.		
4.250% due 02/15/2029	125	100
5.375% due 10/15/2025	80	76
PRA Group, Inc.		
7.375% due 09/01/2025	230	219
Provident Funding Associates LP		
6.375% due 06/15/2025	125	110
RHP Hotel Properties LP		
4.750% due 10/15/2027	370	345
RLJ Lodging Trust LP		
3.750% due 07/01/2026	100	92
Rocket Mortgage LLC		
3.875% due 03/01/2031	210	170
4.000% due 10/15/2033	150	117
SBA Communications Corp.		
3.125% due 02/01/2029	200	170
SLM Corp.		
3.125% due 11/02/2026	200	173
UniCredit SpA		
5.459% due 06/30/2035	200	170
		6,116
工業 54.7%		
Acadia Healthcare Co., Inc.		
5.000% due 04/15/2029	50	46
5.500% due 07/01/2028	180	172
AdaptHealth LLC		
6.125% due 08/01/2028	140	121
Adient Global Holdings Ltd.		
7.000% due 04/15/2028	100	101
Advantage Sales & Marketing, Inc.		
6.500% due 11/15/2028	280	237
AECOM		
5.125% due 03/15/2027	125	121
Air Canada		
3.875% due 08/15/2026	250	232
Albertsons Cos., Inc.		
6.500% due 02/15/2028	200	201
Allied Universal Holdco LLC		
6.625% due 07/15/2026	330	314
Allison Transmission, Inc.		
3.750% due 01/30/2031	125	106
Allwyn Entertainment Financing UK PLC		
7.875% due 04/30/2029	100	102
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust		
3.700% due 10/01/2026	179	161
American Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust		
3.575% due 01/15/2028	69	64
American Airlines, Inc.		
5.500% due 04/20/2026	500	496

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
5.750% due 04/20/2029	50	49
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.		
3.875% due 11/15/2029	150	128
Amsted Industries, Inc.		
4.625% due 05/15/2030	50	45
ANGI Group LLC		
3.875% due 08/15/2028	160	131
Antero Midstream Partners LP		
5.375% due 06/15/2029	150	140
7.875% due 05/15/2026	100	102
ATS Corp.		
4.125% due 12/15/2028	100	90
Avantor Funding, Inc.		
4.625% due 07/15/2028	310	288
Axalta Coating Systems LLC		
4.750% due 06/15/2027	150	142
B&G Foods, Inc.		
5.250% due 09/15/2027	340	296
Ball Corp.		
3.125% due 09/15/2031	200	165
Bath & Body Works, Inc.		
6.625% due 10/01/2030	320	309
Bausch Health Cos., Inc.		
4.875% due 06/01/2028	200	119
Beacon Roofing Supply, Inc.		
4.125% due 05/15/2029	75	66
BellRing Brands, Inc.		
7.000% due 03/15/2030	100	101
Berry Global, Inc.		
5.625% due 07/15/2027	80	78
Bloomin' Brands, Inc.		
5.125% due 04/15/2029	125	112
Blue Racer Midstream LLC		
6.625% due 07/15/2026	425	421
Boyd Gaming Corp.		
4.750% due 06/15/2031	150	134
Boyne USA, Inc.		
4.750% due 05/15/2029	75	68
Buckeye Partners LP		
4.500% due 03/01/2028	150	135
BWX Technologies, Inc.		
4.125% due 06/30/2028	170	155
Caesars Resort Collection LLC		
5.750% due 07/01/2025	95	96
Cargo Aircraft Management, Inc.		
4.750% due 02/01/2028	110	96
Carnival Corp.		
4.000% due 08/01/2028	450	399
7.625% due 03/01/2026	225	221
Catalent Pharma Solutions, Inc.		
3.500% due 04/01/2030	150	122
Central Garden & Pet Co.		
4.125% due 10/15/2030	75	63
Central Parent, Inc.		
7.250% due 06/15/2029	100	99
Charles River Laboratories International, Inc.		
4.250% due 05/01/2028	250	229
Cheplapharm Arzneimittel GmbH		
5.500% due 01/15/2028	200	181
Churchill Downs, Inc.		
5.500% due 04/01/2027	250	241

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
6.750% due 05/01/2031	100	99
Cinemark USA, Inc.		
5.875% due 03/15/2026	125	119
Clarios Global LP		
6.750% due 05/15/2028	150	150
Clarivate Science Holdings Corp.		
3.875% due 07/01/2028	200	177
Clean Harbors, Inc.		
6.375% due 02/01/2031	100	101
Clear Channel International BV		
6.625% due 08/01/2025	200	199
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		
5.125% due 08/15/2027	100	91
Cloud Software Group, Inc.		
6.500% due 03/31/2029	225	201
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.		
6.625% due 04/15/2029	100	95
Coherent Corp.		
5.000% due 12/15/2029	100	90
Community Health Systems, Inc.		
5.250% due 05/15/2030	300	237
Coty, Inc.		
5.000% due 04/15/2026	250	240
Crestwood Midstream Partners LP		
6.000% due 02/01/2029	200	187
DaVita, Inc.		
3.750% due 02/15/2031	300	240
4.625% due 06/01/2030	70	60
DT Midstream, Inc.		
4.125% due 06/15/2029	210	184
4.375% due 06/15/2031	210	181
Dun & Bradstreet Corp.		
5.000% due 12/15/2029	200	177
Elanco Animal Health, Inc.		
6.650% due 08/28/2028	100	97
EnLink Midstream LLC		
6.500% due 09/01/2030	100	100
EnLink Midstream Partners LP		
4.150% due 06/01/2025	50	49
5.600% due 04/01/2044	125	105
EQM Midstream Partners LP		
4.500% due 01/15/2029	340	304
4.750% due 01/15/2031	165	145
6.000% due 07/01/2025	48	47
Fertitta Entertainment LLC		
4.625% due 01/15/2029	150	132
First Student Bidco, Inc.		
4.000% due 07/31/2029	225	191
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.		
4.500% due 09/15/2027	170	158
Ford Motor Credit Co. LLC		
3.375% due 11/13/2025	400	372
4.000% due 11/13/2030	600	513
4.134% due 08/04/2025	200	190
Fortrea Holdings, Inc.		
7.500% due 07/01/2030	100	103
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC		
5.500% due 05/01/2028	150	137
6.500% due 10/01/2025	300	296
Garda World Security Corp.		
4.625% due 02/15/2027	120	110

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
7.750% due 02/15/2028	100	99
Genesis Energy LP		
6.500% due 10/01/2025	100	99
8.000% due 01/15/2027	150	146
8.875% due 04/15/2030	100	98
GFL Environmental, Inc.		
3.500% due 09/01/2028	75	67
5.125% due 12/15/2026	160	154
Go Daddy Operating Co. LLC		
3.500% due 03/01/2029	200	172
Graphic Packaging International LLC		
3.500% due 03/01/2029	210	184
Grifols Escrow Issuer S.A.		
4.750% due 10/15/2028	100	87
QYP Holdings III Corp.		
4.625% due 05/01/2029	75	66
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.		
5.750% due 01/20/2026	100	95
HealthEquity, Inc.		
4.500% due 10/01/2029	100	88
Hilton Domestic Operating Co., Inc.		
3.625% due 02/15/2032	400	334
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC		
4.875% due 07/01/2031	150	126
5.000% due 06/01/2029	50	44
Howard Midstream Energy Partners LLC		
6.750% due 01/15/2027	100	95
8.875% due 07/15/2028 (b)	50	50
IHO Verwaltungs GmbH		
6.000% due 05/15/2027 (c)	400	377
Imola Merger Corp.		
4.750% due 05/15/2029	150	131
Ingevity Corp.		
3.875% due 11/01/2028	125	107
Installed Building Products, Inc.		
5.750% due 02/01/2028	80	75
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.		
6.000% due 09/15/2028	230	196
IQVIA, Inc.		
5.000% due 05/15/2027	225	217
Jaguar Land Rover Automotive PLC		
5.875% due 01/15/2028	200	185
7.750% due 10/15/2025	200	201
JELD-WEN, Inc.		
4.875% due 12/15/2027	250	222
Kaiser Aluminum Corp.		
4.625% due 03/01/2028	130	114
LABL, Inc.		
6.750% due 07/15/2026	125	123
Lamar Media Corp.		
4.000% due 02/15/2030	100	88
Lamb Weston Holdings, Inc.		
4.375% due 01/31/2032	225	201
Legends Hospitality Holding Co. LLC		
5.000% due 02/01/2026	225	203
Lindblad Expeditions LLC		
6.750% due 02/15/2027	100	95
Live Nation Entertainment, Inc.		
3.750% due 01/15/2028	200	179
4.750% due 10/15/2027	90	84
6.500% due 05/15/2027	100	101

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
LSF9 Atlantis Holdings LLC		
7.750% due 02/15/2026	75	70
Marriott Ownership Resorts, Inc.		
4.500% due 06/15/2029	75	65
4.750% due 01/15/2028	150	135
Mauser Packaging Solutions Holding Co.		
7.875% due 08/15/2026	100	99
Medline Borrower LP		
3.875% due 04/01/2029	450	391
5.250% due 10/01/2029	100	87
Melco Resorts Finance Ltd.		
5.625% due 07/17/2027	375	340
MGM China Holdings Ltd.		
5.875% due 05/15/2026	175	167
MPH Acquisition Holdings LLC		
5.000% due 09/01/2028	300	256
NCL Corp. Ltd.		
5.875% due 03/15/2026	150	140
8.375% due 02/01/2028	100	105
NCR Corp.		
5.000% due 10/01/2028	200	179
Neptune Bidco U.S., Inc.		
9.290% due 04/15/2029	100	92
New Red Finance, Inc.		
3.875% due 01/15/2028	100	91
4.000% due 10/15/2030	350	300
5.750% due 04/15/2025	200	200
Newell Brands, Inc.		
6.000% due 04/01/2046	200	158
Northriver Midstream Finance LP		
5.625% due 02/15/2026	125	117
Novelis Corp.		
4.750% due 01/30/2030	300	267
NuStar Logistics LP		
6.000% due 06/01/2026	250	244
Olympus Water U.S. Holding Corp.		
4.250% due 10/01/2028	250	198
Open Text Corp.		
3.875% due 12/01/2029	300	251
Organon & Co.		
4.125% due 04/30/2028	400	355
5.125% due 04/30/2031	200	165
Outfront Media Capital LLC		
5.000% due 08/15/2027	475	432
Owens & Minor, Inc.		
4.500% due 03/31/2029	100	83
6.625% due 04/01/2030	100	91
Pediatrix Medical Group, Inc.		
5.375% due 02/15/2030	100	92
Performance Food Group, Inc.		
5.500% due 10/15/2027	140	135
Perrigo Finance Unlimited Co.		
4.650% due 06/15/2030	100	89
PetSmart, Inc.		
4.750% due 02/15/2028	250	231
Post Holdings, Inc.		
4.625% due 04/15/2030	450	395
Presidio Holdings, Inc.		
4.875% due 02/01/2027	90	85
Prime Security Services Borrower LLC		
3.375% due 08/31/2027	130	115

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
5.750% due 04/15/2026	275	270
Rand Parent LLC		
8.500% due 02/15/2030	100	91
Ritchie Bros Holdings, Inc.		
7.750% due 03/15/2031	100	104
Rolls-Royce PLC		
5.750% due 10/15/2027	200	196
Royal Caribbean Cruises Ltd.		
4.250% due 07/01/2026	100	92
5.500% due 08/31/2026	200	190
5.500% due 04/01/2028	350	327
Sabre GLBL, Inc.		
7.375% due 09/01/2025	230	204
Scientific Games Holdings LP		
6.625% due 03/01/2030	100	88
Seagate HDD Cayman		
9.625% due 12/01/2032	230	253
Sealed Air Corp.		
4.000% due 12/01/2027	50	46
6.125% due 02/01/2028	100	99
Sensata Technologies BV		
4.000% due 04/15/2029	300	267
Simmons Foods, Inc.		
4.625% due 03/01/2029	75	60
Spectrum Brands, Inc.		
5.500% due 07/15/2030	100	91
Spirit AeroSystems, Inc.		
7.500% due 04/15/2025	200	198
9.375% due 11/30/2029	100	107
SRS Distribution, Inc.		
4.625% due 07/01/2028	75	67
Stagwell Global LLC		
5.625% due 08/15/2029	200	171
Standard Industries, Inc.		
3.375% due 01/15/2031	440	355
4.375% due 07/15/2030	160	139
Suburban Propane Partners LP		
5.000% due 06/01/2031	100	84
Tallgrass Energy Partners LP		
6.000% due 12/31/2030	400	353
Tenet Healthcare Corp.		
4.250% due 06/01/2029	175	158
6.125% due 10/01/2028	450	434
TK Elevator U.S. Newco, Inc.		
5.250% due 07/15/2027	200	185
TransDigm, Inc.		
4.625% due 01/15/2029	200	178
6.750% due 08/15/2028	100	100
Travel + Leisure Co.		
6.000% due 04/01/2027	275	267
6.600% due 10/01/2025	325	326
TreeHouse Foods, Inc.		
4.000% due 09/01/2028	170	147
TripAdvisor, Inc.		
7.000% due 07/15/2025	100	100
Triumph Group, Inc.		
7.750% due 08/15/2025	300	292
Twilio, Inc.		
3.625% due 03/15/2029	100	85
U.S. Foods, Inc.		
4.750% due 02/15/2029	325	298

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Uber Technologies, Inc.		
4.500% due 08/15/2029	200	184
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 05/01/2028	43	37
United Airlines, Inc.		
4.625% due 04/15/2029	350	319
Valvoline, Inc.		
3.625% due 06/15/2031	125	102
Venture Global Calcasieu Pass LLC		
3.875% due 08/15/2029	225	197
3.875% due 11/01/2033	400	328
Venture Global LNG, Inc.		
8.125% due 06/01/2028	125	127
Veritas U.S., Inc.		
7.500% due 09/01/2025	110	89
Viking Cruises Ltd.		
13.000% due 05/15/2025	240	252
WESCO Distribution, Inc.		
7.125% due 06/15/2025	100	101
Western Digital Corp.		
3.100% due 02/01/2032	100	74
Western Midstream Operating LP		
4.650% due 07/01/2026	300	289
5.450% due 04/01/2044	100	85
5.500% due 02/01/2050	100	82
WMG Acquisition Corp.		
3.000% due 02/15/2031	250	202
WR Grace Holdings LLC		
4.875% due 06/15/2027	130	121
5.625% due 08/15/2029	100	82
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.		
4.375% due 08/15/2028	100	91
Wynn Las Vegas LLC		
5.500% due 03/01/2025	300	295
Wynn Macau Ltd.		
5.500% due 10/01/2027	150	134
Wynn Resorts Finance LLC		
7.125% due 02/15/2031	100	99
XPO, Inc.		
7.125% due 06/01/2031	100	101
Yum! Brands, Inc.		
6.875% due 11/15/2037	100	108
ZF North America Capital, Inc.		
7.125% due 04/14/2030	150	153
ZipRecruiter, Inc.		
5.000% due 01/15/2030	100	85
		34,654

公益事業 17.5%

Altice Financing S.A.		
5.750% due 08/15/2029	200	155
Altice France S.A.		
5.125% due 01/15/2029	200	143
5.500% due 10/15/2029	600	430
AMC Networks, Inc.		
4.250% due 02/15/2029	100	54
Apache Corp.		
4.875% due 11/15/2027	160	149
Arches Buyer, Inc.		
4.250% due 06/01/2028	250	218

額面金額(單位:千) 評價額(單位:千)			額面金額(單位:千) 評價額(單位:千)		
Archrock Partners LP			Lumen Technologies, Inc.		
6.250% due 04/01/2028	100	94	4.000% due 02/15/2027	50	37
Ascent Resources Utica Holdings LLC			MEG Energy Corp.		
8.250% due 12/31/2028	150	148	7.125% due 02/01/2027	240	244
Block Communications, Inc.			Nexstar Media, Inc.		
4.875% due 03/01/2028	100	83	4.750% due 11/01/2028	200	174
Cable One, Inc.			Noble Finance II LLC		
4.000% due 11/15/2030	220	172	8.000% due 04/15/2030	200	204
Cablevision Lightpath LLC			NRG Energy, Inc.		
3.875% due 09/15/2027	225	189	3.875% due 02/15/2032	100	77
CGO Holdings LLC			Parkland Corp.		
4.250% due 01/15/2034	400	303	5.875% due 07/15/2027	225	217
4.500% due 08/15/2030	130	108	Pattern Energy Operations LP		
4.750% due 03/01/2030	290	248	4.500% due 08/15/2028	70	64
5.375% due 06/01/2029	800	724	Range Resources Corp.		
Chesapeake Energy Corp.			4.750% due 02/15/2030	200	179
5.875% due 02/01/2029	75	71	Rockcliff Energy II LLC		
6.750% due 04/15/2029	200	199	5.500% due 10/15/2029	100	92
Clearway Energy Operating LLC			Scripps Escrow II, Inc.		
3.750% due 02/15/2031	100	83	3.875% due 01/15/2029	300	243
4.750% due 03/15/2028	60	55	Sirius XM Radio, Inc.		
CNX Resources Corp.			4.125% due 07/01/2030	400	327
6.000% due 01/15/2029	125	116	SM Energy Co.		
CommScope Technologies LLC			6.500% due 07/15/2028	100	96
5.000% due 03/15/2027	200	139	Southwestern Energy Co.		
Comstock Resources, Inc.			5.375% due 02/01/2029	125	118
5.875% due 01/15/2030	200	174	Telecom Italia Capital S.A.		
Connect Finco SARL			6.375% due 11/15/2033	150	127
6.750% due 10/01/2026	250	243	TerraForm Power Operating LLC		
Consolidated Communications, Inc.			4.750% due 01/15/2030	230	203
5.000% due 10/01/2028	150	113	Transocean, Inc.		
CrownRock LP			8.750% due 02/15/2030	100	102
5.625% due 10/15/2025	100	99	Univision Communications, Inc.		
CSC Holdings LLC			6.625% due 06/01/2027	140	136
5.250% due 06/01/2024	291	271	UPC Holding BV		
5.750% due 01/15/2030	100	47	5.500% due 01/15/2028	200	175
Diamond Sports Group LLC (d)			Valaris Ltd.		
5.375% due 08/15/2026	50	2	8.375% due 04/30/2030	100	100
6.625% due 08/15/2027	750	19	Viavi Solutions, Inc.		
Directv Financing LLC			3.750% due 10/01/2029	150	128
5.875% due 08/15/2027	250	227	Viper Energy Partners LP		
DISH DBS Corp.			5.375% due 11/01/2027	90	86
5.125% due 06/01/2029	100	47	Virgin Media Secured Finance PLC		
5.750% due 12/01/2028	400	298	5.500% due 05/15/2029	750	679
7.750% due 07/01/2026	125	77	Vistra Operations Co. LLC		
DISH Network Corp.			5.000% due 07/31/2027	325	305
11.750% due 11/15/2027	200	195	Vodafone Group PLC		
Endeavor Energy Resources LP			5.125% due 06/04/2081	100	73
5.750% due 01/30/2028	90	88	Zayo Group Holdings, Inc.		
Frontier Communications Holdings LLC			4.000% due 03/01/2027	100	71
5.000% due 05/01/2028	175	151	Ziff Davis, Inc.		
5.875% due 10/15/2027	125	115	4.625% due 10/15/2030	87	75
6.750% due 05/01/2029	125	97	Ziggo BV		
GoTo Group, Inc.			4.875% due 01/15/2030	200	166
5.500% due 09/01/2027	160	88			
iHeartCommunications, Inc.					
4.750% due 01/15/2028	200	151			
Level 3 Financing, Inc.					
3.625% due 01/15/2029	100	60			
3.750% due 07/15/2029	250	151			

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
米国財務省債務証券 0.5%		
U.S. Treasury Bonds		
2.875% due 05/15/2043	100	84
U.S. Treasury Notes		
4.125% due 11/15/2032	200	204
		288
米国財務省債務証券合計		
(取得原価\$318)		
	株数	
普通株式 0.1%		
Groupe Novasep SAS	139,800	78
		78
普通株式合計		
(取得原価\$0)		
	額面金額(単位:千)	
短期金融商品 12.3%		
レボ取引 11.4%		7,200
定期預金 0.9%		
Bank of Nova Scotia		
4.570% due 07/03/2023	14	14
Citibank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	100	100
DBS Bank Ltd.		
4.570% due 07/03/2023	78	78
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.570% due 07/03/2023	77	77

●制限付証券

2023年6月30日現在

発行体	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	純資産に占める 市場価格の割合
Groupe Novasep SAS	N/A	N/A	03/15/2012	\$ 0	78	0.12%

◎借入およびその他の金融取引

2023年6月30日現在

●レボ取引

取引相手	貸出金利	借入日	満期日	額面金額	担保債券	受取担保 (時価)	レボ契約 (時価)	単位:千 レボ契約に 係る受取金 ⁽¹⁾
BPS	5.160%	06/30/2023	07/03/2023	\$ 7,200	U.S. Treasury Notes 2.000% due 08/15/2025	\$ (7,353)	\$ 7,200	\$ 7,203
レボ取引合計						\$ (7,353)	\$ 7,200	\$ 7,203

⁽¹⁾ 未収利息を含む。

◎上場または中央清算金融デリバティブ商品

2023年6月30日現在

●先物契約

銘柄	種類	決算月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金			
					資産	負債		
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2023	12	\$ (36)	\$ 0	\$ 0		
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2023	26	(56)	1	0		
先物契約合計				\$ (92)	\$ 1	\$ 0		

●スワップ契約

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

単位:千

参照組織	受取 固定金利	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2023年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本(3)	市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
Bombardier, Inc.	5.000%	12/20/2027	3.681%	\$ 300	\$ 16	\$ 2	\$ 0	\$ 0
Calpine Corp.	5.000%	06/20/2028	4.408%	200	4	(2)	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2027	2.438%	200	20	1	0	0
						\$ 40	\$ 1	\$ 0

クレジット・デフォルト・スワップ (クレジット・インデックス) — プロテクションの売り⁽¹⁾

単位:千

インデックス/トランシェ	受取 固定金利	満期日	想定元本(3)	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現 評価損益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-40 Index	5.000%	06/20/2028	\$ 7,900	\$ 233	\$ 200	\$ 56	\$ 0

金利スワップ

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
受取	3-Month USD-LIBOR	0.000%	08/22/2023	\$ 5,000	\$ 69	\$ 69	\$ 0	\$ 0
支払	Secured Overnight Financing Rate	0.000%	08/22/2023	5,000	(69)	(69)	1	0
支払 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	0.250%	08/22/2024	10,000	(508)	(494)	3	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	0.360%	08/22/2024	5,000	309	312	0	(1)
支払 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	12/18/2025	2,700	(18)	(15)	0	(1)
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	12/18/2025	1,300	32	17	0	0
						\$ (185)	\$ (180)	\$ 4
						\$ 88	\$ 21	\$ 60
								\$ (2)

スワップ契約合計

⁽¹⁾ ファンドがプロテクションの売り手となり、その特定のスワップ契約の条項で定義されている信用事象が発生した場合、ファンドは(i)プロテクションの買い手にスワップの想定元本に相当する金額を支払参照債務の引き渡しもしくは参照インデックスを構成する原証券の引き渡しを受けるか、または(ii)スワップの想定元本に相当する金額から参照債務の回収価値もしくは参照インデックスを構成する原証券の回収価値を減じた金額を現金もしくは有価証券の形で清算金額純額を支払う。

⁽²⁾ 社債、米国地方債またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末現在の時価を決定する際に使用されるインプライド・クレジット・スプレッド (絶対額で表示) は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブに係る債務不履行の可能性またはリスクを表す。特定の参照組織のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買い/売りに伴う費用を反映しており、契約を締結するため支払う必要のある前払手数料も含む場合がある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照組織の信用の健全性の悪化、および債務不履行または契約の条項で定義されたその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

⁽³⁾ ファンドが、その特定のスワップ契約の条項で定義されている信用事象が発生した場合、クレジット・プロテクションの売り手として支払う必要があり得る潜在的な最大金額またはクレジット・プロテクションの買い手として受ける潜在的な最大金額。

⁽⁴⁾ クレジット・デフォルト・スワップの価格およびその結果としての価値は、支払/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務 (利益) の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した市場価格の絶対額の増加は、参照債務の信用の健全性の悪化および債務不履行のリスクの可能性の増大または契約の条項で定義されたその他の信用事象の発生の可能性の増大を表す。

⁽⁵⁾ この金融商品は将来の指定された日に効力が発生する。

運用計算書

2023年6月30日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:		
受取利息(外国税額控除後)*	\$	3,655
雑収入		0
収益合計		3,655
費用:		
支払利息		0
費用合計		0
純投資損益		3,655
当期実現損益:		
投資有価証券(外国税額控除後)*		(1,942)
上場または中央清算金融デリバティブ商品		(315)
店頭金融デリバティブ商品		2
外貨通貨		(5)
当期実現損益		(2,260)
当期末実現評価損益:		
投資有価証券(外国税額控除後)*		3,530
上場または中央清算金融デリバティブ商品		673
店頭金融デリバティブ商品		1
外貨建資産および負債		(13)
当期末実現評価損益		4,191
当期実現および未実現評価損益		1,931
運用の結果による純資産の増減額	\$	5,586
*外国税	\$	0

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

野村マネーポートフォリオ マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2023年7月11日）

作成対象期間（2022年7月12日～2023年7月11日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
11期(2019年 7 月11日)	10, 058	△0. 0		57. 9	—	124
12期(2020年 7 月13日)	10, 055	△0. 0		62. 0	—	37
13期(2021年 7 月12日)	10, 048	△0. 1		55. 0	—	1, 836
14期(2022年 7 月11日)	10, 045	△0. 0		52. 2	—	38
15期(2023年 7 月11日)	10, 042	△0. 0		58. 8	—	40

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

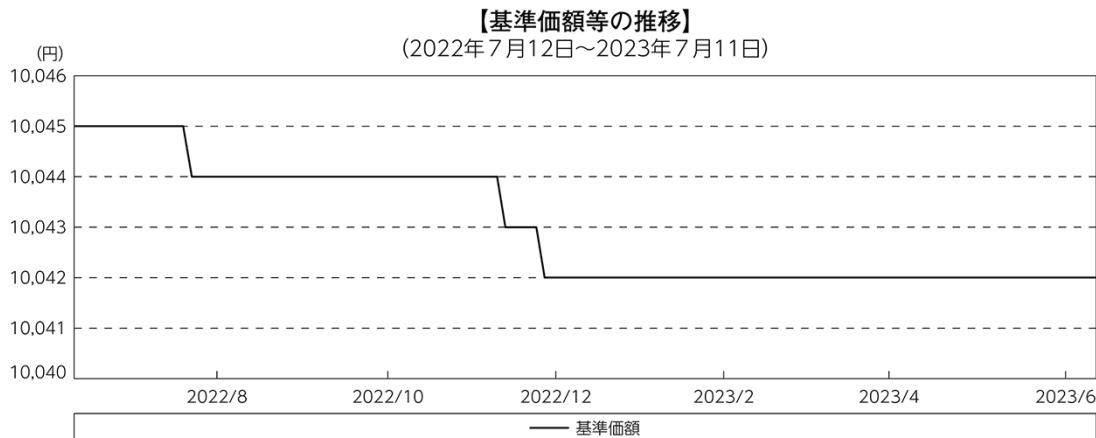
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落	率		
(期 首) 2022年 7 月11日	円		%	%	%
	10, 045		—	52. 2	—
7 月末	10, 045		0. 0	52. 3	—
8 月末	10, 044		△0. 0	58. 3	—
9 月末	10, 044		△0. 0	57. 0	—
10月末	10, 044		△0. 0	55. 8	—
11月末	10, 044		△0. 0	61. 2	—
12月末	10, 042		△0. 0	61. 0	—
2023年 1 月末	10, 042		△0. 0	61. 1	—
2 月末	10, 042		△0. 0	61. 1	—
3 月末	10, 042		△0. 0	60. 9	—
4 月末	10, 042		△0. 0	56. 7	—
5 月末	10, 042		△0. 0	57. 2	—
6 月末	10, 042		△0. 0	58. 8	—
(期 末) 2023年 7 月11日	10, 042		△0. 0	58. 8	—

* 騰落率は期首比です。
* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、消費や雇用環境など景気全般に持ち直しの動きが見られました。このような中、日銀は2022年12月の金融政策決定会合で、長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を一部見直し、長期金利の許容変動幅を±0.5%と、従来の±0.25%から拡大することを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね－0.1%～－0.2%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は－0.01%～－0.08%程度で推移しました。

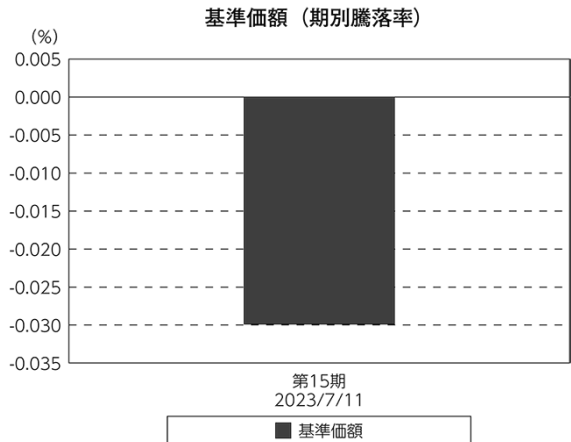
○当ファンドのポートフォリオ

残存１年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

残存１年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日銀によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 7 月12日～2023年 7 月11日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年 7 月12日～2023年 7 月11日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国	特殊債券	千円 28,136	千円 — (24,000)
内			

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年 7 月12日～2023年 7 月11日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第 1 項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年 7 月11日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
特殊債券	千円	千円	%	%	%	%	%
(除く金融債)	24,000	24,008	58.8	—	—	—	58.8
	(24,000)	(24,008)	(58.8)	(—)	(—)	(—)	(58.8)
合 計	24,000	24,008	58.8	—	—	—	58.8
	(24,000)	(24,008)	(58.8)	(—)	(—)	(—)	(58.8)

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が 1 年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
日本政策金融公庫債券 政府保証第26回		0.911	22,000	22,006	2023/7/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回		0.835	2,000	2,002	2023/8/31
合 計			24,000	24,008	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年7月11日現在)

項 目	当期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 24,008	% 58.8
コール・ローン等、その他	16,821	41.2
投資信託財産総額	40,829	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	40,829,856
コール・ローン等	16,755,726
公社債(評価額)	24,008,745
未収利息	65,385
(B) 負債	13
未払利息	13
(C) 純資産総額(A－B)	40,829,843
元本	40,660,592
次期繰越損益金	169,251
(D) 受益権総口数	40,660,592口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,042円

(注) 期首元本額は38,270,791円、期中追加設定元本額は4,879,161円、期中一部解約元本額は2,489,360円、1口当たり純資産額は1.0042円です。

○損益の状況

(2022年7月12日～2023年7月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	182,439
受取利息	188,437
支払利息	△ 5,998
(B) 有価証券売買損益	△194,449
売買損	△194,449
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 12,010
(D) 前期繰越損益金	171,062
(E) 追加信託差損益金	20,839
(F) 解約差損益金	△ 10,640
(G) 計(C＋D＋E＋F)	169,251
次期繰越損益金(G)	169,251

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
財形給付金ファンド	34,251,580
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	1,003,293
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	998,495
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	997,887
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	997,001
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	997,000
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）毎月分配型	996,337
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	100,755
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	99,927
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	99,898
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	9,985
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（ニュージーランドドルコース）年2回決算型	9,978
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,978

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ブラックロック世界REITファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	9,955
野村ブラックロック世界REITファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	9,955
NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50連動型上場投信	9,938
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Eコース	9,937
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Fコース	9,937
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド（為替ヘッジあり）	9,936
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	9,935
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	9,935
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド（為替ヘッジなし）	4,974
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Cコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Dコース	994

○お知らせ

該当事項はございません。