

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

運用報告書(全体版)

第24期（決算日2021年8月25日）

作成対象期間（2021年2月26日～2021年8月25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。

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 (MXN) 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 (MXN) 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（メキシコペソコース）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 (MXN) 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 (MXN)	PIMCO パミューダ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（メキシコペソコース）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。外貨建て資産への直接投資は行いません。
	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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	期 騰 落 中 率				
	円	円		%	%	%	%	百万円
20期(2019年 8 月26日)	19,286	10		△ 1.1	0.0	—	93.8	421
21期(2020年 2 月25日)	21,964	10		13.9	0.0	—	94.2	439
22期(2020年 8 月25日)	18,651	10		△15.0	0.0	—	94.2	492
23期(2021年 2 月25日)	21,213	10		13.8	0.0	—	93.2	354
24期(2021年 8 月25日)	23,303	10		9.9	0.0	—	93.5	358

* 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。

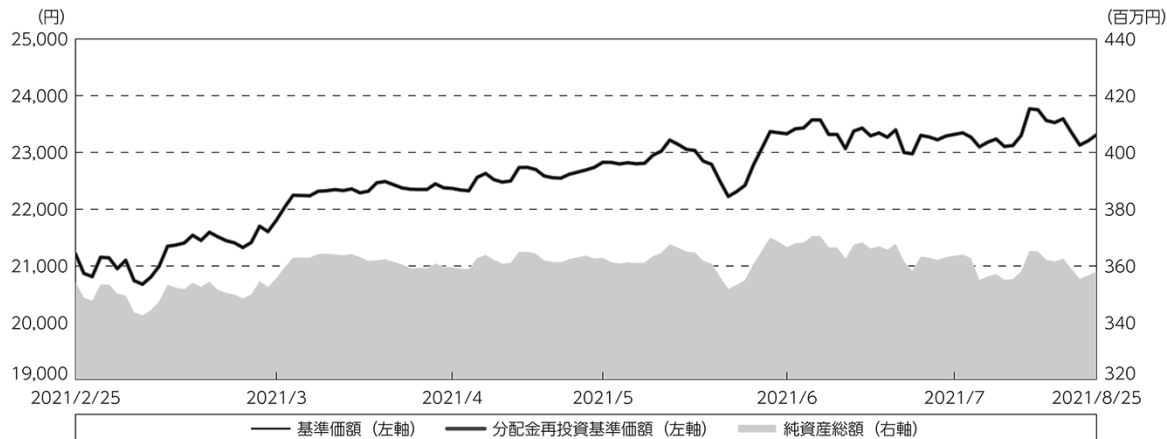
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首) 2021年 2 月25日	円 21,213		% —	% 0.0	% —	% 93.2
2 月末	20,869	△ 1.6		0.0	—	93.0
3 月末	21,805	2.8		0.0	—	93.4
4 月末	22,367	5.4		0.0	—	93.6
5 月末	22,826	7.6		0.0	—	93.4
6 月末	23,330	10.0		0.0	—	94.1
7 月末	23,318	9.9		0.0	—	94.2
(期 末) 2021年 8 月25日	23,313	9.9		0.0	—	93.5

* 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（2021年2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

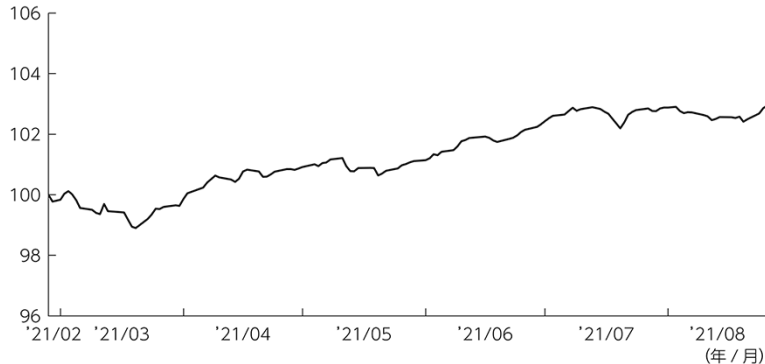
- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利息収入）
- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）
- ・ 円／メキシコペソの為替変動

○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)

米長期金利が上昇したことなどを背景に、3月中旬にかけて下落しました。その後は、良好な経済指標の発表が相次ぎ米景気回復に期待が高まるなか、新型コロナウイルスワクチンの普及を受けた米経済正常化への期待や、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和の長期化観測などを材料に概ね堅調に推移しました。7月中旬、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などから大きく下落しましたが、米株式市場の大幅上昇を好感したことなどから反発しました。8月に入り、金融緩和縮小が意識されたことなどから軟調な展開となりましたが、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＞

メキシコペソ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（メキシコペソコース）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（MXN）〕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（MXN）〕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（MXN）〕

主要投資対象である〔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、継続的な家財修繕やリフォーム需要の高まりを享受できる建設資材セクターや新型コロナウイルスの影響から自宅での時間が増えることを背景にゲーム業界への投資比率を引き続きオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）としています。一方、景気後退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等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。

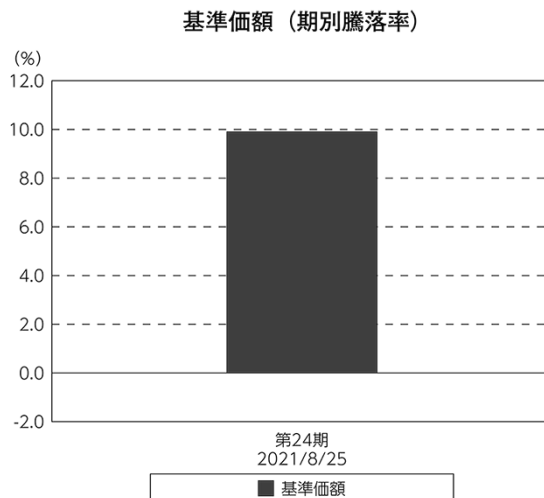
〔野村マネーポートフォリオ マザーファンド〕

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24期
	2021年2月26日～ 2021年8月25日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.043%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	27,199

(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（メキシコペソコース）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（MXN）】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（MXN）】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（MXN）】

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、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル建て資産について、原則として米ドルを売り、メキシコペソを買う為替取引を行います。

米国については、3月に可決された追加経済対策により2021年は力強い成長となる見通しです。一方、家計支援のための現金給付が終了予定であることや、失業手当の加算措置も今年9月に失効する見通しであることから、2022年の成長は鈍化するものと予想しています。また、足元では様々な供給制約によりインフレ圧力が高まっていますが、こうした制約は2022年には解消していく見通しであり、消費財に対する需要もピークを迎えることから、インフレ率は今年後半には落ち着く見込みです。なお、金融政策について、FRBは今年後半にテーパリング（量的金融緩和の縮小）を開始し、2023年後半に利上げを行なうと予想しています。

米国ハイ・イールド債券については、2021年は経済活動の再開に伴う企業のファンダメンタルズ（基礎的条件）の回復やデフォルト（債務不履行）率の改善が見込まれる点などもプラス材料です。一方で、スプレッド（利回り格差）水準はコロナショック前の水準に達しており、FRBによる資産購入規模の縮小観測や金利上昇などを背景に、リスク性資産の価格変動が大きくなるリスクには注視する必要があると考えています。

運用に関しては、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、堅調な米住宅市況の恩恵を享受しやすい建設資材、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高めとします。一方、実体経済の回復には相応の期間を要すると見込まれる中で需要の低迷が見込まれる自動車、Eコマース（電子商取引）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

(2021 年 2 月 26 日～2021 年 8 月 25 日)

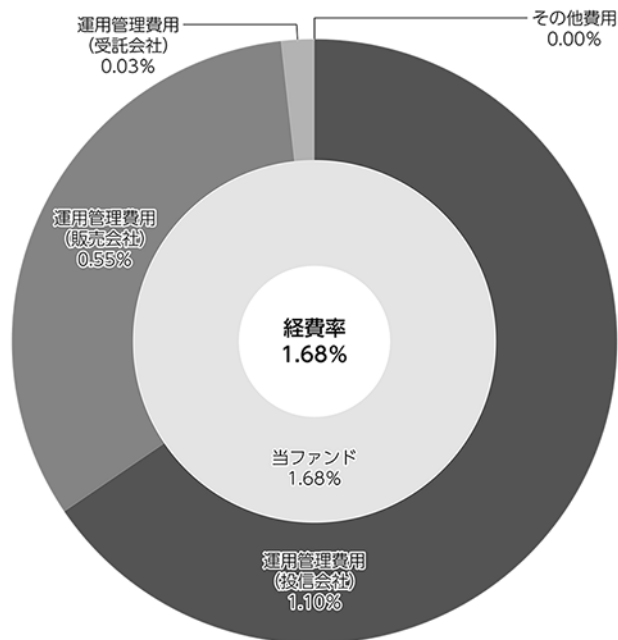
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 187	% 0.835	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(122)	(0.545)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(61)	(0.273)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(4)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷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	187	0.836	
期中の平均基準価額は、22,419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)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.68%です。



(単位: %)

経費率 (①+②)	1.68
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	—

(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) 各費用は、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含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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

(2021年 2 月26日～2021年 8 月25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 (MXN)	口	千円	口	千円
		2,965	14,362	6,160	30,067

*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

(2021年 2 月26日～2021年 8 月25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

(2021年 8 月25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	比率
PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J (MXN)		口	口	千円	%
		70,612	67,417	334,860	93.5
合 計		70,612	67,417	334,860	93.5

*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 9	千口 9	千円 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

(2021年8月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 334,860	% 92.7
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	26,462	7.3
投資信託財産総額	361,332	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 (2021年8月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	361,332,015
コール・ローン等	26,461,750
投資信託受益証券(評価額)	334,860,239
野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額)	10,026
(B) 負債	3,161,350
未払収益分配金	153,699
未払信託報酬	3,003,767
未払利息	25
その他未払費用	3,859
(C) 純資産総額(A－B)	358,170,665
元本	153,699,401
次期繰越損益金	204,471,264
(D) 受益権総口数	153,699,401口
1万口当たり基準価額(C／D)	23,303円

(注) 期首元本額は167,047,687円、期中追加設定元本額は373,423円、期中一部解約元本額は13,721,709円、1口当たり純資産額は2,3303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1,087,058円。

○損益の状況 (2021年2月26日～2021年8月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	15,966,879
受取配当金	15,969,767
支払利息	△ 2,888
(B) 有価証券売買損益	19,212,628
売買益	20,442,502
売買損	△ 1,229,874
(C) 信託報酬等	△ 3,007,626
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	32,171,881
(E) 前期繰越損益金	54,621,030
(F) 追加信託差損益金	117,832,052
(配当等相当額)	(259,307,400)
(売買損益相当額)	(△141,475,348)
(G) 計(D＋E＋F)	204,624,963
(H) 収益分配金	△ 153,699
次期繰越損益金(G＋H)	204,471,264
追加信託差損益金	117,832,052
(配当等相当額)	(259,307,400)
(売買損益相当額)	(△141,475,348)
分配準備積立金	158,750,821
繰越損益金	△ 72,111,609

*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（2021年2月26日～2021年8月25日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年2月26日～ 2021年8月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	14,601,718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	259,307,400円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	144,302,802円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	418,211,920円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	27,209円
g. 分配金	153,699円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（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)

2020年6月30日決算
(計算期間:2019年7月1日～2020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・ボンドに実質的に投資を行い、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

2020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	\$	20
収益合計		20
費用:		
支払利息		1
費用合計		1
純投資損益		19
当期実現損益:		
投資有価証券		2
関連投資		1,454
店頭金融デリバティブ商品		(269)
外貨通貨		4
当期実現損益		1,191
当期末実現評価損益:		
投資有価証券		0
関連投資		(1,657)
店頭金融デリバティブ商品		(526)
外貨建資産および負債		1
当期末実現評価損益		(2,182)
当期実現および未実現評価損益		(991)
運用の結果による純資産の増減額	\$	(972)

(単位: 千 1口単位を除く)

期末純資産総額		
J (JPY)	\$	33,928

期末現在発行済受益証券数		
J (JPY)		520

期末1口当たり純資産価格		
J (JPY)	\$	65.27

※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114,823千米ドル

組入資産の明細

2020年6月30日

額面金額(単位:千)

評価額(単位:千)

投資有価証券 4.1%		
短期金融商品 4.1%		
定期預金 0.3%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.010% due 07/01/2020	\$ 24	\$ 24
Bank of Nova Scotia		
0.010% due 07/01/2020	23	23
BNP Paribas Bank		
0.010% due 07/01/2020	2	2
Citibank N.A.		
0.010% due 07/01/2020	12	12
DBS Bank Ltd.		
0.010% due 07/01/2020	1	1
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.010% due 07/01/2020	24	24
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.010% due 07/01/2020	2	2
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.010% due 07/01/2020	11	11
		99
米国財務省短期証券 3.8%		
0.102% due 07/14/2020 (a)	1,300	1,300
短期金融商品合計		1,399
(取得原価\$1,399)		
投資有価証券合計		1,399
(取得原価\$1,399)		
	口数(単位:千)	
関連投資 96.1%		
投資信託 96.1%		
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\$30,154)	2,242	32,592
関連投資合計		32,592
(取得原価\$30,154)		
投資合計 100.2%		
(取得原価\$31,553)	\$	33,991
金融デリバティブ商品 (0.2%)		(64)
(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%		1
純資産 100.0%	\$	33,928

(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

2020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
JPM	07/2020	JPY	2,872	\$	0
MYI	07/2020		1,031		0
				\$	0

●J (JPY)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	\$	11,092	JPY	1,195,547
BPS	07/2020	JPY	1,002	\$	9
BPS	07/2020	\$	112	JPY	11,959
BRC	07/2020	JPY	1,464,585	\$	13,575
BRC	07/2020	\$	2,307	JPY	247,313
BRC	08/2020		13,581		1,464,585
CBK	07/2020		1,268		136,552
GLM	07/2020	JPY	12,783	\$	120
JPM	07/2020	\$	148	JPY	15,967
MYI	07/2020	JPY	713,433	\$	6,626
MYI	07/2020	\$	54	JPY	5,760
MYI	08/2020		6,549		704,935
SCX	07/2020	JPY	1,471,060	\$	13,636
SCX	07/2020	\$	13,505	JPY	1,454,295
SCX	08/2020		13,581		1,464,585
TOR	07/2020		5,680		611,437
				\$	14
				\$	14

外国為替先渡し契約合計

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

2020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	\$	181
収益合計		181
費用:		
支払利息		18
費用合計		18
純投資損益		163
当期実現損益:		
投資有価証券		7
関連投資		9,138
店頭金融デリバティブ商品		(17,560)
外貨通貨		(24)
当期実現損益		(8,439)
当期末実現評価損益:		
投資有価証券		(1)
関連投資		(9,593)
店頭金融デリバティブ商品		(6,696)
外貨建資産および負債		(1)
当期末実現評価損益		(16,291)
当期実現および未実現評価損益		(24,730)
運用の結果による純資産の増減額	\$	(24,567)

期末純資産総額

J (AUD)	\$	8,038
J (BRL)		43,775
J (MXN)		30,406
J (NZD)		5,143
J (ZAR)		1,648

期末現在発行済受益証券数

J (AUD)	122
J (BRL)	2,083
J (MXN)	813
J (NZD)	88
J (ZAR)	56

期末1口当たり純資産価格

J (AUD)	\$	66.15
J (BRL)		21.02
J (MXN)		37.38
J (NZD)		58.39
J (ZAR)		29.45

※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114,823千米ドル

組入資産の明細

2020年6月30日

額面金額(単位:千)

評価額(単位:千)

投資有価証券 10.7%			
短期金融商品 10.7%			
定期預金 0.6%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
0.010% due 07/01/2020	\$	127	\$ 127
Bank of Nova Scotia			
0.010% due 07/01/2020		125	125
BNP Paribas Bank			
0.010% due 07/01/2020		12	12
Citibank N.A.			
0.010% due 07/01/2020		64	64
DBS Bank Ltd.			
0.010% due 07/01/2020		3	3
JPMorgan Chase Bank N.A.			
0.010% due 07/01/2020		127	127
National Australia Bank Ltd.			
0.010% due 07/01/2020		2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
0.010% due 07/01/2020		8	8
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
0.010% due 07/01/2020		59	59
			527
米国財務省短期証券 10.1%			
0.111% due 07/14/2020 (a)		3,500	3,500
0.117% due 08/20/2020 (b)		3,400	3,400
0.128% due 07/28/2020 (a)		2,100	2,100
			9,000
短期金融商品合計			
(取得原価\$9,527)			9,527
投資有価証券合計			
(取得原価\$9,527)			9,527
関連投資 92.4%			
投資信託 92.4%			
PIMCO パシフィックUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)			
(取得原価\$77,928)		5,655	82,231
関連投資合計			
(取得原価\$77,928)			82,231
投資合計 103.1%			
(取得原価\$87,455)		\$	91,758
金融デリバティブ商品 (1.9%)			
(取得原価またはプレミアム\$0)			(1,698)
その他の資産および負債 (1.2%)			
			(1,050)
純資産 100.0%			
		\$	89,010

口数(単位:千)

(a)クーポンは最終利回りである。

(b)クーポンは加重平均最終利回りである。

◎店頭金融デリバティブ商品

2020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
JPM	07/2020	\$	39	JPY	4,215	\$ 0	\$ 0
MYI	07/2020	JPY	16,419	\$	153	1	0
MYI	07/2020	\$	90	JPY	9,648	0	0
						\$ 1	\$ 0

●J (AUD)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	\$	8	AUD	11	\$ 0	\$ 0
CBK	07/2020	AUD	4,136	\$	2,829	0	(18)
CBK	08/2020	\$	2,803	AUD	4,097	19	0
GLM	07/2020		10		14	0	0
GLM	08/2020	AUD	14	\$	10	0	0
HUS	07/2020		85		58	0	0
HUS	07/2020	\$	277	AUD	411	6	0
JPM	07/2020		17		24	0	0
MYI	07/2020	AUD	3,716	\$	2,547	0	(12)
MYI	07/2020		14		10	0	0
MYI	07/2020	\$	2,601	AUD	3,919	98	0
MYI	08/2020		2,497		3,643	12	0
SCX	07/2020	AUD	3,891	\$	2,677	0	(2)
SCX	08/2020	\$	2,677	AUD	3,891	2	0
TOR	07/2020		2,605		3,919	94	0
UAG	07/2020		2,374		3,568	83	0
						\$ 314	\$ (32)

●J (BRL)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	BRL	67,476	\$	12,329	\$ 40	\$ 0
BOA	07/2020	\$	12,322	BRL	67,476	0	(33)
BOA	08/2020	BRL	110	\$	20	0	0
BOA	08/2020	\$	12,333	BRL	67,592	0	(42)
BPS	07/2020	BRL	76,805	\$	14,032	44	0
BPS	07/2020	\$	14,407	BRL	76,805	0	(419)
CBK	07/2020	BRL	87,314	\$	16,403	501	0
CBK	07/2020	\$	15,957	BRL	87,314	0	(55)
CBK	08/2020	BRL	126	\$	23	0	0
CBK	08/2020	\$	16,188	BRL	86,339	0	(487)
DUB	07/2020	BRL	86,203	\$	16,342	642	0
DUB	07/2020	\$	16,139	BRL	86,203	0	(440)
DUB	08/2020		16,324		86,203	0	(648)
GLM	07/2020	BRL	429	\$	84	6	0
GLM	07/2020	\$	78	BRL	429	0	0
HUS	07/2020	BRL	73,930	\$	13,501	37	0
HUS	07/2020	\$	13,901	BRL	73,930	0	(436)
HUS	08/2020		24		132	0	0
JPM	07/2020	BRL	2,976	\$	558	16	0
JPM	07/2020	\$	543	BRL	2,976	0	(1)
MYI	07/2020	BRL	8,133	\$	1,486	5	0
MYI	07/2020	\$	1,493	BRL	8,133	0	(12)
SCX	07/2020	BRL	2,656	\$	509	25	0
SCX	07/2020	\$	485	BRL	2,656	0	(1)
UAG	07/2020	BRL	14,231	\$	2,602	10	0
UAG	07/2020	\$	2,644	BRL	14,231	0	(52)
						\$ 1,326	\$ (2,626)

●J (MXN)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	MXN	235,400	\$	10,181	\$ 0	\$ (6)
BPS	07/2020	\$	102	MXN	2,265	0	(4)
BPS	08/2020		10,137		235,400	3	0
GLM	07/2020		9,752		218,073	0	(315)
HUS	07/2020	MXN	12,263	\$	547	16	0
HUS	07/2020	\$	10,012	MXN	226,237	0	(221)
JPM	07/2020	MXN	235,839	\$	10,190	0	(17)
JPM	07/2020	\$	1,124	MXN	24,710	0	(55)
JPM	08/2020		10,126		235,400	13	0
MYI	07/2020	MXN	1,319	\$	57	0	0
SCX	07/2020		4,515		197	2	0
SCX	07/2020	\$	10,040	MXN	226,237	0	(249)
SSB	07/2020	MXN	1,304	\$	60	3	0
SSB	07/2020	\$	1,079	MXN	23,856	0	(46)
SSB	07/2020		57		1,319	0	0
SSB	08/2020	MXN	1,319	\$	57	0	0
UAG	07/2020		227,040		9,814	0	(12)
UAG	08/2020	\$	9,885	MXN	229,661	9	(1)
						\$ 46	\$ (926)

●J (NZD)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	NZD	2,386	\$	1,528	\$ 0	\$ (9)
BPS	08/2020	\$	1,506	NZD	2,352	9	0
BRC	07/2020	NZD	15	\$	10	0	0
CBK	07/2020		2,817		1,805	0	(9)
CBK	08/2020	\$	1,794	NZD	2,800	9	0
GLM	07/2020	NZD	15	\$	10	0	0
HUS	07/2020	\$	1,835	NZD	2,954	66	0
JPM	07/2020		9		14	0	0
MYI	07/2020	NZD	2,837	\$	1,817	0	(9)
MYI	08/2020	\$	1,793	NZD	2,800	9	0
SCX	07/2020		1,587		2,558	60	0
UAG	07/2020		1,585		2,558	62	0
						\$ 215	\$ (27)

●J (ZAR)クラス外国為替先渡し契約

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	07/2020	\$	396	ZAR	6,930	\$	3	\$	0
HUS	07/2020		133		2,308		0		(1)
HUS	07/2020		538		9,440		6		0
HUS	07/2020		133		2,308		0		(1)
HUS	07/2020	ZAR	5,405	\$	312		1		0
HUS	08/2020	\$	311	ZAR	5,405		0		(1)
JPM	07/2020		8		143		0		0
MYI	07/2020	ZAR	3,879	\$	223		0		0
MYI	08/2020	\$	222	ZAR	3,879		0		0
SCX	07/2020		38		670		0		0
SOG	07/2020		395		6,930		4		0
UAG	07/2020		2		35		0		0
UAG	07/2020	ZAR	191	\$	11		0		0
						\$	14	\$	(3)
外国為替先渡し契約合計						\$	1,916	\$	(3,614)

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

2020年6月30日

額面金額(単位:千)				評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)				評価額(単位:千)	
投資有価証券 98.6%						社債・約束手形 82.9%					
バンクローン 10.3%						銀行・金融 11.8%					
Altice France S.A.						Ally Financial, Inc.					
4.185% due 08/14/2026		\$	985	\$	951	5.750% due 11/20/2025		675	723		
Commscope, Inc.						Brookfield Property REIT, Inc.					
3.428% due 04/06/2026			248		236	5.750% due 05/15/2026		600	508		
Envision Healthcare Corp.						CIT Group, Inc.					
3.928% due 10/10/2025			963		647	5.000% due 08/15/2022		1,000	1,024		
Flex Acquisition Co., Inc.						Credit Acceptance Corp.					
4.683% due 06/29/2025			249		234	5.125% due 12/31/2024		170	165		
Getty Images, Inc.						Credit Suisse Group AG					
4.688% due 02/19/2026			560		502	7.250% due 09/12/2025 (b)(c)		300	308		
iHeartCommunications, Inc.						Deutsche Bank AG					
3.178% due 05/01/2026			726		673	3.961% due 11/26/2025		200	210		
Illuminate Buyer LLC						Dresdner Funding Trust I					
4.250% due 06/16/2027			130		128	8.151% due 06/30/2031		140	193		
Jefferies Finance LLC						ESH Hospitality, Inc.					
3.188% due 06/03/2026			817		775	4.625% due 10/01/2027		180	169		
MPH Acquisition Holdings LLC						Fairstone Financial, Inc.					
3.750% due 06/07/2023			775		737	7.875% due 07/15/2024		775	762		
Nexstar Broadcasting, Inc.						Freedom Mortgage Corp.					
2.923% due 09/18/2026			360		344	8.125% due 11/15/2024		850	828		
Nouryon Finance BV						goeasy Ltd.					
3.188% due 10/01/2025			722		681	5.375% due 12/01/2024		150	146		
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.						Greystar Real Estate Partners LLC					
3.429% due 06/30/2025			662		620	5.750% due 12/01/2025		250	253		
Parexel International Corp.						HAT Holdings I LLC					
2.928% due 09/27/2024			447		425	5.250% due 07/15/2024		100	102		
Petco Animal Supplies, Inc.						Icahn Enterprises LP					
4.250% due 01/26/2023			638		523	5.250% due 05/15/2027		70	68		
Ply Gem Midco, Inc.						Intesa Sanpaolo SpA					
3.941% due 04/12/2025			398		380	5.017% due 06/26/2024		550	564		
Refinitiv U.S. Holdings, Inc.						Ladder Capital Finance Holdings LLLP					
3.428% due 10/01/2025			1,039		1,017	4.250% due 02/01/2027		100	80		
Regionalcare Hospital Partners Holdings, Inc.						MGM Growth Properties Operating Partnership LP					
3.928% due 11/17/2025			899		843	4.500% due 01/15/2028		225	215		
TransDigm, Inc.						4.625% due 06/15/2025		130	128		
2.428% due 12/09/2025			1,108		1,006	5.625% due 05/01/2024		400	415		
U.S. Renal Care, Inc.						MPT Operating Partnership LP					
5.178% due 06/26/2026			769		741	4.625% due 08/01/2029		875	881		
Zayo Group Holdings, Inc.						Nationstar Mortgage Holdings, Inc.					
3.178% due 03/09/2027			409		389	6.000% due 01/15/2027		150	143		
バンクローン合計						Navient Corp.					
(取得原価\$12,587)					11,852	7.250% due 09/25/2023		100	98		
						NMI Holdings, Inc.					
						7.375% due 06/01/2025		90	94		

額面金額(単位:千)		評価額(単位:千)	額面金額(単位:千)		評価額(単位:千)
Oxford Finance LLC			Altice France S.A.		
6.375% due 12/15/2022	425	393	7.375% due 05/01/2026	400	418
Park Intermediate Holdings LLC			AMC Networks, Inc.		
7.500% due 06/01/2025	150	154	4.750% due 08/01/2025	300	296
Provident Funding Associates LP			American Builders & Contractors Supply Co., Inc.		
6.375% due 06/15/2025	125	117	4.000% due 01/15/2028	40	39
Radian Group, Inc.			5.875% due 05/15/2026	66	66
4.875% due 03/15/2027	325	306	American Woodmark Corp.		
Royal Bank of Scotland Group PLC			4.875% due 03/15/2026	450	442
6.000% due 12/29/2025 (b)(c)	270	274	Amsted Industries, Inc.		
6.125% due 12/15/2022	750	819	4.625% due 05/15/2030	50	50
Ryman Hospitality Properties, Inc.			5.625% due 07/01/2027	40	41
4.750% due 10/15/2027	370	330	Antero Resources Corp.		
SBA Communications Corp.			5.375% due 11/01/2021	100	93
3.875% due 02/15/2027	360	359	5.625% due 06/01/2023	200	129
Societe Generale S.A.			Aramark Services, Inc.		
7.375% due 10/04/2023 (b)(c)	300	302	4.750% due 06/01/2026	250	241
Springleaf Finance Corp.			Arconic Corp.		
6.125% due 03/15/2024	350	356	6.000% due 05/15/2025	100	104
6.625% due 01/15/2028	600	595	Ardagh Packaging Finance PLC		
8.250% due 12/15/2020	200	207	5.250% due 08/15/2027	200	197
8.875% due 06/01/2025	100	107	Asbury Automotive Group, Inc.		
VICI Properties LP			4.500% due 03/01/2028	42	41
3.750% due 02/15/2027	180	170	Avantor, Inc.		
4.125% due 08/15/2030	530	506	6.000% due 10/01/2024	550	575
4.250% due 12/01/2026	500	480	Avon International Capital PLC		
		13,552	6.500% due 08/15/2022	375	369
			Avon International Operations, Inc.		
			7.875% due 08/15/2022	500	502
工業 83.0%			Axalta Coating Systems LLC		
1011778 B.C. Unlimited Liability Co.			4.750% due 06/15/2027	150	151
5.000% due 10/15/2025	350	349	B&G Foods, Inc.		
5.750% due 04/15/2025	200	210	5.250% due 09/15/2027	340	341
Acadia Healthcare Co., Inc.			Banjay Entertainment SASU		
5.500% due 07/01/2028	180	181	5.375% due 03/01/2025	300	294
Adient U.S. LLC			Bausch Health Americas, Inc.		
9.000% due 04/15/2025	100	108	8.500% due 01/31/2027	1,200	1,276
ADT Security Corp.			Bausch Health Cos., Inc.		
4.125% due 06/15/2023	450	452	5.750% due 08/15/2027	100	106
Advanced Drainage Systems, Inc.			7.000% due 03/15/2024	375	390
5.000% due 09/30/2027	60	61	7.000% due 01/15/2028	175	181
AECOM			7.250% due 05/30/2029	350	368
5.125% due 03/15/2027	125	135	BCD Acquisition, Inc.		
Albertsons Cos., Inc.			9.625% due 09/15/2023	500	479
3.500% due 02/15/2023	20	20	Beacon Roofing Supply, Inc.		
4.625% due 01/15/2027	210	210	4.875% due 11/01/2025	775	694
4.875% due 02/15/2030	150	154	Berry Global, Inc.		
5.875% due 02/15/2028	40	41	5.625% due 07/15/2027	80	82
Allied Universal Holdco LLC			Block Communications, Inc.		
6.625% due 07/15/2026	200	211	4.875% due 03/01/2028	100	99
Altice Financing S.A.					
5.000% due 01/15/2028	600	597			

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Bombardier, Inc.			Clearwater Paper Corp.		
7.500% due 12/01/2024	1,200	789	5.375% due 02/01/2025	100	101
Brink's Co.			Colt Merger Sub, Inc. (d)		
5.500% due 07/15/2025	80	82	5.750% due 07/01/2025	95	96
Buckeye Partners LP			6.250% due 07/01/2025	95	95
4.125% due 03/01/2025	190	183	CommScope Technologies LLC		
4.500% due 03/01/2028	130	122	5.000% due 03/15/2027	300	271
BWX Technologies, Inc.			CommScope, Inc.		
4.125% due 06/30/2028	170	170	7.125% due 07/01/2028 (d)	70	70
Callon Petroleum Co.			Community Health Systems, Inc.		
6.125% due 10/01/2024	30	11	6.250% due 03/31/2023	800	755
Camelot Finance S.A.			8.625% due 01/15/2024	100	98
4.500% due 11/01/2026	50	50	Connect Finco SARL		
Cargo Aircraft Management, Inc.			6.750% due 10/01/2026	250	237
4.750% due 02/01/2028	110	109	Constellium SE		
Cascades, Inc.			5.625% due 06/15/2028	250	246
5.125% due 01/15/2026	105	107	Core & Main Holdings LP		
5.375% due 01/15/2028	105	107	8.625% due 09/15/2024 (e)	150	151
CCO Holdings LLC			Covanta Holding Corp.		
4.500% due 08/15/2030	130	133	5.875% due 07/01/2025	150	152
4.750% due 03/01/2030	290	297	CSC Holdings LLC		
5.375% due 06/01/2029	800	845	5.250% due 06/01/2024	475	501
5.750% due 02/15/2026	200	207	5.500% due 05/15/2026	200	206
5.875% due 04/01/2024	25	26	5.750% due 01/15/2030	400	417
5.875% due 05/01/2027	400	418	5.875% due 09/15/2022	750	785
Genovus Energy, Inc.			DaVita, Inc.		
6.750% due 11/15/2039	100	97	4.625% due 06/01/2030	170	169
Centene Corp.			5.000% due 05/01/2025	450	461
4.625% due 12/15/2029	710	751	DCP Midstream Operating LP		
4.750% due 01/15/2025	290	297	5.125% due 05/15/2029	200	192
Centennial Resource Production LLC			5.375% due 07/15/2025	320	319
5.375% due 01/15/2026	525	280	5.625% due 07/15/2027	110	111
6.875% due 04/01/2027	100	53	Dell, Inc.		
CF Industries, Inc.			6.500% due 04/15/2038	100	108
4.950% due 06/01/2043	200	216	Diamond Resorts International, Inc.		
Chemours Co.			7.750% due 09/01/2023	250	240
6.625% due 05/15/2023	130	125	Diamond Sports Group LLC		
7.000% due 05/15/2025	225	215	5.375% due 08/15/2026	50	36
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC			6.625% due 08/15/2027	750	401
7.000% due 06/30/2024	250	285	DriveTime Automotive Group, Inc.		
Cheniere Energy Partners LP			8.000% due 06/01/2021	50	48
5.250% due 10/01/2025	375	374	Dun & Bradstreet Corp.		
5.625% due 10/01/2026	650	649	6.875% due 08/15/2026	200	211
Churchill Downs, Inc.			Edgewell Personal Care Co.		
5.500% due 04/01/2027	250	245	5.500% due 06/01/2028	110	113
Clarios Global LP			Elanco Animal Health, Inc.		
6.250% due 05/15/2026	190	197	5.650% due 08/28/2028	100	111
8.500% due 05/15/2027	40	40	Energizer Holdings, Inc.		
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.			4.750% due 06/15/2028 (d)	150	148
5.125% due 08/15/2027	100	96	6.375% due 07/15/2026	188	195

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
EnLink Midstream Partners LP			Installed Building Products, Inc.		
4.150% due 06/01/2025	225	174	5.750% due 02/01/2028	80	80
5.600% due 04/01/2044	225	138	International Game Technology PLC		
EQM Midstream Partners LP			5.250% due 01/15/2029	230	226
4.125% due 12/01/2026	100	92	IQVIA, Inc.		
6.000% due 07/01/2025	130	132	5.000% due 05/15/2027	225	231
Fair Isaac Corp.			Jaguar Holding Co. II		
4.000% due 06/15/2028	60	60	4.625% due 06/15/2025	90	92
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.			5.000% due 06/15/2028	60	62
4.500% due 09/15/2027	170	170	Jeld-Wen, Inc.		
Ford Motor Credit Co. LLC			4.625% due 12/15/2025	900	867
3.096% due 05/04/2023	1,100	1,047	4.875% due 12/15/2027	250	241
5.596% due 01/07/2022	200	202	Kaiser Aluminum Corp.		
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			4.625% due 03/01/2028	110	105
6.500% due 10/01/2025	600	542	KAR Auction Services, Inc.		
6.750% due 03/15/2022	775	746	5.125% due 06/01/2025	50	49
Freeport-McMoRan, Inc.			KB Home		
3.550% due 03/01/2022	118	118	7.625% due 05/15/2023	175	191
3.875% due 03/15/2023	250	251	Korn Ferry		
4.125% due 03/01/2028	60	58	4.625% due 12/15/2027	140	137
5.400% due 11/14/2034	100	99	Kraft Heinz Foods Co.		
5.450% due 03/15/2043	200	197	4.250% due 03/01/2031	200	213
Gap, Inc.			5.000% due 06/04/2042	600	633
8.625% due 05/15/2025	110	117	5.200% due 07/15/2045	700	760
8.875% due 05/15/2027	120	129	L Brands, Inc.		
Garda World Security Corp.			6.875% due 07/01/2025	240	248
4.625% due 02/15/2027	120	119	LABL Escrow Issuer LLC		
Gartner, Inc.			6.750% due 07/15/2026	125	130
4.500% due 07/01/2028	110	112	Lamar Media Corp.		
GFL Environmental, Inc.			3.750% due 02/15/2028	100	95
5.125% due 12/15/2026	160	166	Live Nation Entertainment, Inc.		
Griffon Corp.			4.750% due 10/15/2027	90	78
5.750% due 03/01/2028	310	307	6.500% due 05/15/2027	100	103
Harsco Corp.			Marriott Ownership Resorts, Inc.		
5.750% due 07/31/2027	200	201	4.750% due 01/15/2028	150	137
HCA, Inc.			6.125% due 09/15/2025	100	103
3.500% due 09/01/2030	460	444	Masonite International Corp.		
Hill-Rom Holdings, Inc.			5.750% due 09/15/2026	875	904
5.000% due 02/15/2025	500	517	Matador Resources Co.		
Hilton Grand Vacations Borrower LLC			5.875% due 09/15/2026	575	427
6.125% due 12/01/2024	500	504	Mattel, Inc.		
Hilton Worldwide Finance LLC			6.200% due 10/01/2040	50	43
4.625% due 04/01/2025	650	638	6.750% due 12/31/2025	375	390
Howmet Aerospace, Inc.			MEG Energy Corp.		
5.125% due 10/01/2024	1,025	1,062	7.125% due 02/01/2027	240	200
Hughes Satellite Systems Corp.			Melco Resorts Finance Ltd.		
7.625% due 06/15/2021	500	516	5.625% due 07/17/2027	625	633
iHeartCommunications, Inc.			MGM China Holdings Ltd.		
4.750% due 01/15/2028	200	185	5.875% due 05/15/2026	375	387
IHO Verwaltungs GmbH			MSCI, Inc.		
6.000% due 05/15/2027 (e)	400	408	4.750% due 08/01/2026	500	519

額面金額(単位:千) 評価額(単位:千)			額面金額(単位:千) 評価額(単位:千)		
MTS Systems Corp.			Prime Security Services Borrower LLC		
5.750% due 08/15/2027	200	184	5.250% due 04/15/2024	300	308
Murphy Oil USA, Inc.			5.750% due 04/15/2026	275	286
4.750% due 09/15/2029	100	103	PTC, Inc.		
Nabors Industries Ltd.			3.625% due 02/15/2025	120	119
7.250% due 01/15/2026	100	62	Qorvo, Inc.		
NCR Corp.			4.375% due 10/15/2029	210	215
6.375% due 12/15/2023	500	509	Range Resources Corp.		
Netflix, Inc.			9.250% due 02/01/2026	200	180
4.875% due 04/15/2028	500	535	RBS Global, Inc.		
5.875% due 11/15/2028	500	570	4.875% due 12/15/2025	335	338
Newell Brands, Inc.			Royal Caribbean Cruises Ltd.		
4.875% due 06/01/2025	110	115	9.125% due 06/15/2023	120	119
Nielsen Company Luxembourg SARL			Scientific Games International, Inc.		
5.000% due 02/01/2025	250	246	7.000% due 05/15/2028	30	24
Nielsen Finance LLC			Scotts Miracle-Gro Co.		
5.000% due 04/15/2022	575	574	4.500% due 10/15/2029	80	83
Nokia OYJ			Scripps Escrow, Inc.		
4.375% due 06/12/2027	800	847	5.875% due 07/15/2027	175	166
Norbord, Inc.			Sealed Air Corp.		
5.750% due 07/15/2027	425	435	4.000% due 12/01/2027	50	50
NortonLifeLock, Inc.			Select Medical Corp.		
3.950% due 06/15/2022	425	433	6.250% due 08/15/2026	240	243
Novelis Corp.			Sensata Technologies BV		
4.750% due 01/30/2030	300	287	5.625% due 11/01/2024	250	266
NuStar Logistics LP			Sigma Holdco BV		
6.000% due 06/01/2026	250	243	7.875% due 05/15/2026	300	299
Occidental Petroleum Corp.			Silgan Holdings, Inc.		
1.842% due 08/15/2022	930	856	4.125% due 02/01/2028	90	89
4.400% due 04/15/2046	700	489	Sirius XM Radio, Inc.		
8.000% due 07/15/2025 (d)	250	252	4.125% due 07/01/2030	70	70
8.875% due 07/15/2030 (d)	70	70	4.625% due 07/15/2024	250	257
Open Text Corp.			Southwestern Energy Co.		
5.875% due 06/01/2026	650	676	4.100% due 03/15/2022	500	479
Outfront Media Capital LLC			Spectrum Brands, Inc.		
5.000% due 08/15/2027	475	428	5.500% due 07/15/2030	100	100
Parkland Corp.			Spirit AeroSystems, Inc.		
5.875% due 07/15/2027	225	234	7.500% due 04/15/2025	200	198
PDC Energy, Inc.			Standard Industries, Inc.		
6.125% due 09/15/2024	100	93	4.375% due 07/15/2030	160	160
Performance Food Group, Inc.			5.000% due 02/15/2027	500	508
5.500% due 10/15/2027	140	135	Staples, Inc.		
Picasso Finance Sub, Inc.			7.500% due 04/15/2026	300	236
6.125% due 06/15/2025	160	164	Station Casinos LLC		
Post Holdings, Inc.			4.500% due 02/15/2028	230	195
4.625% due 04/15/2030	450	441	Stena International S.A.		
Presidio Holdings, Inc.			6.125% due 02/01/2025	200	192
4.875% due 02/01/2027	90	88	Studio City Finance Ltd.		
Prestige Brands, Inc.			7.250% due 02/11/2024	825	847
5.125% due 01/15/2028	80	79			

額面金額(単位:千) 評価額(単位:千)			額面金額(単位:千) 評価額(単位:千)		
Sunoco LP			Western Midstream Operating LP		
4.875% due 01/15/2023	125	124	4.650% due 07/01/2026	300	289
TEGNA, Inc.			5.450% due 04/01/2044	100	84
4.625% due 03/15/2028	40	37	WMG Acquisition Corp.		
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl			3.875% due 07/15/2030	230	233
5.500% due 03/01/2028	400	420	WPX Energy, Inc.		
Telesat Canada			4.500% due 01/15/2030	10	9
6.500% due 10/15/2027	130	128	5.250% due 09/15/2024	300	296
Tenet Healthcare Corp.			WR Grace & Co.-Conn		
8.125% due 04/01/2022	2,025	2,130	4.875% due 06/15/2027	130	132
T-Mobile USA, Inc.			Wyndham Destinations, Inc.		
4.500% due 02/01/2026	250	254	4.625% due 03/01/2030	30	28
4.750% due 02/01/2028	250	265	5.750% due 04/01/2027	275	266
5.375% due 04/15/2027	500	528	6.350% due 10/01/2025	325	329
6.500% due 01/15/2026	375	392	Wynn Las Vegas LLC		
Transocean Pontus Ltd.			5.500% due 03/01/2025	400	367
6.125% due 08/01/2025	181	159	Wynn Macau Ltd.		
Transocean, Inc.			5.500% due 10/01/2027	650	645
6.800% due 03/15/2038	30	9	Yum! Brands, Inc.		
8.000% due 02/01/2027	40	23	6.875% due 11/15/2037	100	108
Triumph Group, Inc.			Zayo Group Holdings, Inc.		
7.750% due 08/15/2025	300	227	4.000% due 03/01/2027	760	725
Uber Technologies, Inc.			Ziggo Bond Co. BV		
7.500% due 09/15/2027	50	50	5.125% due 02/28/2030	300	298
United Rentals North America, Inc.			Ziggo BV		
4.625% due 10/15/2025	250	252	4.875% due 01/15/2030	200	202
Univision Communications, Inc.			5.500% due 01/15/2027	225	228
5.125% due 05/15/2023	300	304	72,266		
5.125% due 02/15/2025	500	473			
6.625% due 06/01/2027	140	134	公益事業 8.1%		
UPC Holding BV			Archrock Partners LP		
5.500% due 01/15/2028	200	193	6.250% due 04/01/2028	200	182
Valvoline, Inc.			Blue Racer Midstream LLC		
4.250% due 02/15/2030	40	39	6.125% due 11/15/2022	750	748
VeriSign, Inc.			6.625% due 07/15/2026	425	380
5.250% due 04/01/2025	825	916	Calpine Corp.		
Vertical U.S. Newco, Inc.			4.500% due 02/15/2028	100	98
5.250% due 07/15/2027	200	200	5.125% due 03/15/2028	100	98
ViaSat, Inc.			CenturyLink, Inc.		
5.625% due 09/15/2025	500	480	5.125% due 12/15/2026	20	20
Viking Cruises Ltd.			5.800% due 03/15/2022	250	257
13.000% due 05/15/2025	240	254	6.450% due 06/15/2021	250	256
Viper Energy Partners LP			7.500% due 04/01/2024	500	550
5.375% due 11/01/2027	90	88	Clearway Energy Operating LLC		
Virgin Media Secured Finance PLC			4.750% due 03/15/2028	60	61
5.500% due 05/15/2029	1,000	1,047	CrownRock LP		
WESCO Distribution, Inc.			5.625% due 10/15/2025	100	90
7.125% due 06/15/2025	100	106	Endeavor Energy Resources LP		
7.250% due 06/15/2028	250	265	5.750% due 01/30/2028	90	87
Western Digital Corp.			6.625% due 07/15/2025	130	131
4.750% due 02/15/2026	200	207			

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Genesis Energy LP		
6.500% due 10/01/2025	100	86
NextEra Energy Operating Partners LP		
4.250% due 07/15/2024	250	253
Parsley Energy LLC		
4.125% due 02/15/2028	370	336
PBF Holding Co. LLC		
9.250% due 05/15/2025	100	107
PG&E Corp.		
5.250% due 07/01/2030	200	202
Sprint Capital Corp.		
8.750% due 03/15/2032	500	716
Sprint Communications, Inc.		
6.000% due 11/15/2022	900	950
7.000% due 08/15/2020	600	603
Sprint Corp.		
7.125% due 06/15/2024	100	113
7.875% due 09/15/2023	310	350
Talen Energy Supply LLC		
7.250% due 05/15/2027	450	449
Targa Resources Partners LP		
4.250% due 11/15/2023	500	479
6.500% due 07/15/2027	155	156
6.875% due 01/15/2029	255	268
Telecom Italia Capital S.A.		
6.375% due 11/15/2033	500	565
TerraForm Power Operating LLC		
4.750% due 01/15/2030	230	234
Transocean Proteus Ltd.		
6.250% due 12/01/2024	163	150
Vistra Operations Co. LLC		
5.000% due 07/31/2027	325	329
		9,304
社債・約束手形合計		95,122
(取得原価\$96,330)		

米国財務省債務証券 4.1%		
U.S. Treasury Bonds		
2.875% due 05/15/2043	400	523
3.125% due 02/15/2043	400	543
U.S. Treasury Notes		
2.125% due 09/30/2024	1,500	1,619
2.750% due 07/31/2023	1,900	2,050
		4,735
米国財務省債務証券合計		4,735
(取得原価\$4,395)		

	株数	評価額(単位:千)
普通株式 0.0%		
Groupe Novasep SAS	139,800	0
普通株式合計		0
(取得原価\$766)		
	額面金額(単位:千)	
短期金融商品 1.3%		
定期預金 0.0%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.010% due 07/01/2020	5	5
Bank of Nova Scotia		
0.010% due 07/01/2020	5	5
Citibank N.A.		
0.010% due 07/01/2020	2	2
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.010% due 07/01/2020	5	5
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.010% due 07/01/2020	2	2
		19
米国財務省短期証券 1.3%		
0.007% due 09/24/2020 (f)	1,200	1,200
0.100% due 07/30/2020 (g)	300	300
		1,500
短期金融商品合計		1,519
(取得原価\$1,519)		
投資有価証券合計 (a) 98.6%	\$	113,228
(取得原価\$115,597)		
金融デリバティブ商品 0.5%		600
(取得原価またはプレミアム\$0)		
その他の資産および負債 0.9%		995
純資産 100.0%	\$	114,823

- (a) 2020年6月30日現在の投資合計の地域別配分は、米国に純資産の79.3%、カナダに純資産の5.5%、その他諸国に合計で13.8%になっている。
- (b) 偶発転換証券
- (c) 無期限。日付は、該当する場合、次回の契約上の償還日である。
- (d) 発行日取引有価証券
- (e) 現物払いの有価証券
- (f) クーボンは加重平均最終利回りである。
- (g) クーボンは最終利回りである。

●制限付証券

2020年6月30日現在

単位:千

純資産に占める
市場価格の割合

発行体	取得日	取得原価	市場価格	
Groupe Novasep SAS	03/15/2012	\$ 766	\$ 0	0.00%

◎借入およびその他の金融取引

●リバース・レポ取引

2020年6月30日現在

単位:千

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入額	リバース・レポ取引に係る未払金
BRC	(0.250%)	03/25/2020	07/10/2020	\$ (274)	\$ (274)
リバース・レポ取引合計					\$ (274)

●担保付借入として会計処理される取引

単位:千

	翌日物および継続	30日以下	残存期間 31-90日	90日超	合計
リバース・レポ取引	\$ 0	\$ (274)	\$ 0	\$ 0	\$ (274)
U.S. Corporate Debt					
リバース・レポ取引合計	\$ 0	\$ (274)	\$ 0	\$ 0	\$ (274)
借入合計	\$ 0	\$ (274)	\$ 0	\$ 0	\$ (274)
リバース・レポ取引に係る未払金					\$ (274)

◎上場金融デリバティブ商品

●先物契約

単位:千

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
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2023	123	\$ 341	\$ 0	\$ (3)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2020	4	3	0	(1)
先物契約合計				\$ 344	\$ 0	\$ (4)

●スワップ契約

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) ー 売り

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	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-33 Index	5.000%	12/20/2024	\$ 4,692	\$ 48	\$ (283)	\$ 468	\$ 0
CDX.HY-34 Index	5.000%	06/20/2025	4,180	23	(4)	134	0
				\$ 71	\$ (287)	\$ 602	\$ 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	3.000%	06/19/2021	\$ 3,200	\$ (127)	\$ (90)	\$ 3	\$ 0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.750%	12/16/2021	7,500	115	100	0	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.500%	12/18/2021	3,950	(76)	(86)	0	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/18/2021	6,100	(208)	(95)	0	(1)
					\$ (296)	\$ (171)	\$ 3	\$ (1)
スワップ契約合計					\$ (225)	\$ (458)	\$ 605	\$ (1)

運用計算書

2020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)	\$	6,718
雑収入		0
収益合計		6,718

費用:

支払利息		8
訴訟費用		0
雑費用		0
費用合計		8

純投資損益		6,710
--------------	--	-------

当期実現損益:

投資有価証券(外国税額控除後)		506
上場金融デリバティブ商品		(1,830)
店頭金融デリバティブ商品		307
外貨通貨		0
当期実現損益		(1,017)

当期末実現評価損益:

投資有価証券(外国税額控除後)		(5,858)
上場金融デリバティブ商品		154
店頭金融デリバティブ商品		(675)
外貨建資産および負債		28
当期末実現評価損益		(6,351)
当期実現および未実現評価損益		(7,368)

運用の結果による純資産の増減額	\$	(658)
------------------------	----	-------

外国源泉徴収税	\$	0
---------	----	---

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13期（決算日2021年7月12日）

作成対象期間（2020年7月14日～2021年7月12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	株式への投資は行いません。 外貨建て資産への投資は行いません。

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			
9 期 (2017 年 7 月 11 日)	円		%	%	%	百万円
	10, 065		△0. 0	60. 8	—	140
10 期 (2018 年 7 月 11 日)	10, 062		△0. 0	34. 5	—	145
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

* 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

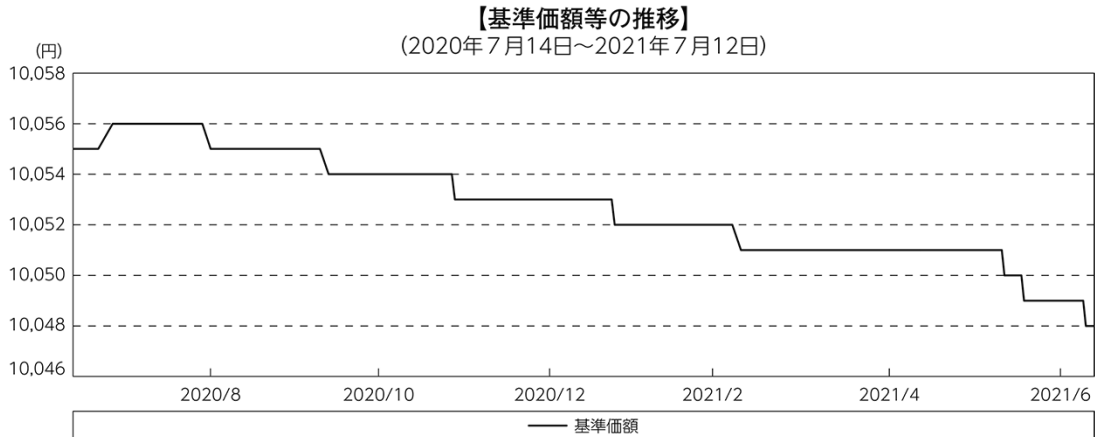
年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落	率			
(期 首) 2020 年 7 月 13 日	円		%	%	%	%
	10, 055		—	62. 0	—	—
7 月末	10, 056		0. 0	59. 3	—	—
8 月末	10, 055		0. 0	59. 4	—	—
9 月末	10, 055		0. 0	60. 5	—	—
10 月末	10, 054		△0. 0	59. 4	—	—
11 月末	10, 053		△0. 0	59. 4	—	—
12 月末	10, 053		△0. 0	59. 9	—	—
2021 年 1 月末	10, 052		△0. 0	59. 4	—	—
2 月末	10, 052		△0. 0	59. 9	—	—
3 月末	10, 051		△0. 0	54. 5	—	—
4 月末	10, 051		△0. 0	53. 0	—	—
5 月末	10, 051		△0. 0	53. 0	—	—
6 月末	10, 049		△0. 1	55. 3	—	—
(期 末) 2021 年 7 月 12 日	10, 048		△0. 1	55. 0	—	—

* 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、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して－0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は－0.01～－0.07%程度で推移しました。

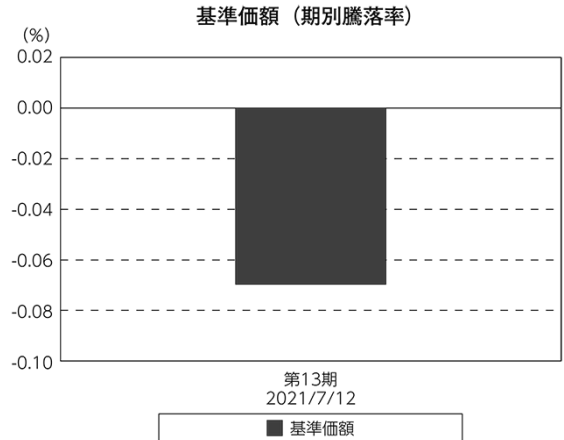
○当ファンドのポートフォリオ

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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 7 月14日～2021年 7 月12日)

該当事項はございません。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2020年 7 月14日～2021年 7 月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 27,894,011	千円 26,859,905 (44,000)
	特殊債券	20,090	— (23,000)

*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、上段の数字には含まれておりません。

○ 利害関係人との取引状況等

(2020年 7 月14日～2021年 7 月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
		うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 64	百万円 22	% 34.4	百万円 —	百万円 —	% —

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年7月12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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	990,000	990,000	53.9	—	53.9	—	—
	(990,000)	(990,000)	(53.9)	(—)	(53.9)	(—)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	20,000	20,050	1.1	—	—	—	1.1
	(20,000)	(20,050)	(1.1)	(—)	(—)	(—)	(1.1)
合 計	1,010,000	1,010,050	55.0	—	53.9	—	1.1
	(1,010,000)	(1,010,050)	(55.0)	(—)	(53.9)	(—)	(1.1)

* () 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
国債証券	%	千円	千円	
国債バスケット(変動利付・利付・国庫短期証券)※	—	990,000	990,000	—
小 計		990,000	990,000	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第2回	0.502	20,000	20,050	2021/12/24
小 計		20,000	20,050	
合 計		1,010,000	1,010,050	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

*※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2021年7月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	1,010,050	55.0
コール・ローン等、その他	826,070	45.0
投資信託財産総額	1,836,120	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 (2021年7月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,836,120,051
コール・ローン等	751,858,701
公社債(評価額)	1,010,050,750
未収利息	28,600
差入委託証拠金	74,182,000
(B) 負債	523
未払利息	523
(C) 純資産総額(A－B)	1,836,119,528
元本	1,827,284,353
次期繰越損益金	8,835,175
(D) 受益権総口数	1,827,284,353口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,048円

(注) 期首元本額は36,951,839円、期中追加設定元本額は3,584,838,527円、期中一部解約元本額は1,794,506,013円、1口当たり純資産額は1.0048円です。

○損益の状況 (2020年7月14日～2021年7月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 73,315
受取利息	△ 40,529
支払利息	△ 32,786
(B) 有価証券売買損益	△ 69,009
売買損	△ 69,009
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 142,324
(D) 前期繰越損益金	205,013
(E) 追加信託差損益金	17,566,473
(F) 解約差損益金	△ 8,793,987
(G) 計(C＋D＋E＋F)	8,835,175
次期繰越損益金(G)	8,835,175

* 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
マルチアセット投信(全天候型) 2106 (適格機関投資家専用)	1,791,223,007
財形給付金ファンド	29,672,244
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

ファンド名	当期末 元本額
	円
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
NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50運動型上場投信	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。