

# 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型

## 運用報告書(全体版)

第24期(決算日2023年2月20日)

作成対象期間(2022年8月19日~2023年2月20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   | 2011年3月3日から2026年2月18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バミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)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 マザーファンド受益証券への投資を通じて、新興国のインフラ関連企業の債券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バミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)受益証券への投資を中心とし、各々3分の1程度ずつとし、合計の投資比率は、概ね90%以上を目処とします。 |  |
| 主な投資対象 | 野村PIMCO<br>新興国インフラ関連債券投信<br>(アジア通貨コース) 年2回決算型  | PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)受益証券、PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマースナル・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バミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)   | PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)受益証券への投資を通じて、新興国のインフラ関連企業の債券を実質的な主要投資対象とします。  |
|        | PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)   |  |
|        | PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)   |  |
|        | 野村マネー 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<br>新興国インフラ関連債券投信<br>(アジア通貨コース) 年2回決算型<br>野村マネー マザーファンド   | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への直接投資は行いません。<br>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<br>(分配落) | 価 額          |         | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|--------------|--------------|---------|----------------|----------------|--------------------|--------------|
|                 |              | 税 込<br>分 配 金 | 騰 落 中 率 |                |                |                    |              |
|                 | 円            | 円            | %       | %              | %              | %                  | 百万円          |
| 20期(2021年2月18日) | 19,906       | 10           | 13.5    | 0.0            | —              | 97.8               | 549          |
| 21期(2021年8月18日) | 20,990       | 10           | 5.5     | 0.0            | —              | 98.0               | 460          |
| 22期(2022年2月18日) | 21,412       | 10           | 2.1     | 0.0            | —              | 98.1               | 417          |
| 23期(2022年8月18日) | 22,052       | 10           | 3.0     | 0.0            | —              | 98.3               | 428          |
| 24期(2023年2月20日) | 22,503       | 10           | 2.1     | 0.0            | —              | 98.4               | 415          |

\* 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<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>組 入 比 率 |
|------------|--------|-------|-----|----------------|----------------|--------------------|
|            |        | 騰 落 率 | 率   |                |                |                    |
| (期 首)      | 円      | %     | %   | %              | %              | %                  |
| 2022年8月18日 | 22,052 | —     | 0.0 | —              | —              | 98.3               |
| 8月末        | 22,263 | 1.0   | 0.0 | —              | —              | 98.3               |
| 9月末        | 21,675 | △1.7  | 0.0 | —              | —              | 98.4               |
| 10月末       | 21,571 | △2.2  | 0.0 | —              | —              | 98.6               |
| 11月末       | 21,725 | △1.5  | 0.0 | —              | —              | 98.7               |
| 12月末       | 21,518 | △2.4  | 0.0 | —              | —              | 98.9               |
| 2023年1月末   | 22,531 | 2.2   | 0.0 | —              | —              | 99.0               |
| (期 末)      |        |       |     |                |                |                    |
| 2023年2月20日 | 22,513 | 2.1   | 0.0 | —              | —              | 98.4               |

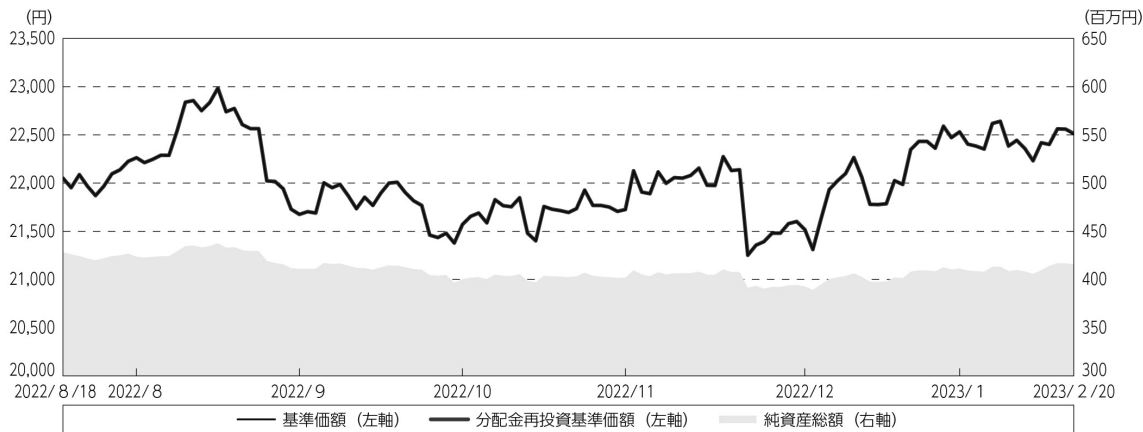
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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



期 首：22,052円

期 末：22,503円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 2.1%（分配金再投資ベース）

(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（2022年8月18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新興国のインフラ関連企業<sup>※</sup>の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新興国のインフラ関連企業の債券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／アジア通貨（中国元、インドネシアルピア、インドルピー）の為替変動

※当ファンドにおいて「インフラ関連企業」とは、産業や生活の基盤となる設備やサービスの提供を行なう企業や、インフラの発展に伴って恩恵を受けると考えられる企業をいいます。

## ○投資環境

新興国債券市場は、中国のロックダウン（都市封鎖）などにより世界の景気減速懸念が高まったことや、高止まりするインフレから更なる利上げへの警戒感が高まったことなどから下落する局面があったものの、その後は、中国当局が打ち出した新型コロナウイルス感染抑制策の緩和と不動産セクター向け支援策が好感されたことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）議事要旨を受けFRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが軟化するとの見方が強まったことなどから上昇し、当作成期間を通じて、小幅な下落になりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型]

[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)] の受益証券、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)] の受益証券、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)] の受益証券および [野村マネー 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バミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)] の受益証券、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)] の受益証券、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)] の受益証券に各々3分の1程度ずつ投資を行ない投資比率を概ね90%以上に維持しました。

[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(CNY)]、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)]、[PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)]

PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド（M）を通じて新興国のインフラ関連企業の債券を主要投資対象とし、トータルリターンの最大化を目指して運用を行ないました。

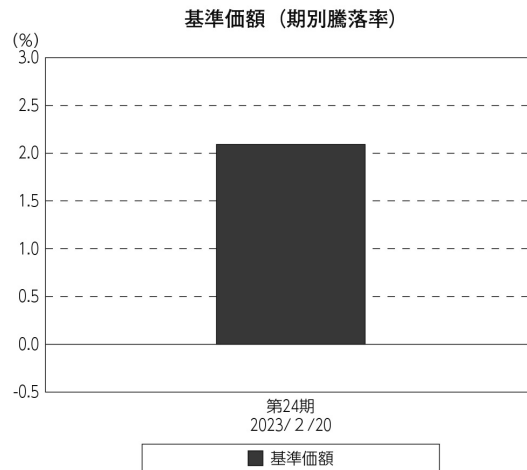
### [野村マネー マザーファンド]

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、利子・配当収入や基準価額水準等を勘案し、信託報酬などの諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。

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いません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目       | 第24期                      |
|-----------|---------------------------|
|           | 2022年8月19日～<br>2023年2月20日 |
| 当期分配金     | 10                        |
| (対基準価額比率) | 0.044%                    |
| 当期の収益     | 10                        |
| 当期の収益以外   | —                         |
| 翌期繰越分配対象額 | 23,131                    |

(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新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型】

〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(GNY)〕の受益証券、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)〕の受益証券、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)〕の受益証券および〔野村マネー 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バミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(GNY)〕の受益証券、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)〕の受益証券、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)〕の受益証券に各々3分の1程度ずつ投資を行ない投資比率を概ね90%以上に維持します。また、外貨建資産について、原則として、実質的に当該資産にかかる通貨を売り、アジア通貨（中国元、インドネシアルピア、インドルピー）を買う為替取引を行なう外国投資信託に各々3分の1程度ずつ投資を行ないます。

〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(GNY)〕、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(INR)〕、〔PIMCOバミューダ・エマージング・マーケッツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J(IDR)〕

新興国のインフラ関連企業の債券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たポートフォリオを維持して運用を行ないます。

インフレ圧力が根強く主要中央銀行が引き締めの金融政策を継続する中では、先進国は今後1年間で景気後退に陥る可能性が高いと考えています。なお、家計や企業のファンダメンタルズ（基礎的諸条件）が堅調なことから、今回の景気後退は2008年の金融危機や2020年の新型コロナショックほど深刻なものにはならないとみています。一方、過去のショック時と比較して既に政府債務や中央銀行のバランスシートが肥大化しているなか、金融・財政政策による景気へのサポート余地は限定的なことから景気後退の期間は長期化し、その後の回復にも相応の時間を要するとみています。

エマージング諸国については、ブラジルをはじめとする一部の国ではFRBに先立って利上げを開始したことに加え、資源価格の上昇が落ち着いてきたことなどからインフレがピークアウトの兆しをみせており、2023年の成長率は2022年からやや持ち直すとの見通しです。また、エマージング債券市場ではクレジットスプレッド（利回り格差）が相応に拡大しており、今後の地政学的リスクの高まりなどによるボラティリティ（市場変動性）の上昇に対するクッションとしての役割を果たすことが期待されます。ただし、エマージング諸国間において金融・財政

政策、国内の政治情勢、地政学的リスクの影響度合いの観点からパフォーマンスには大きな差異が生じるものとみており、投資対象の選別がより一層重要になると考えています。

新興国には相対的に魅力度の高い投資機会が残されていると考えておりますが、引き続き、グローバルな産業動向や国ごとの経済政策とその成果を見極めた上で、個別国の差異に注目した選別投資が重要であると考えます。また、個別国の経済にとって重要な企業であっても、国の外貨準備などのファンダメンタルズによっては相対的に支払い能力などに差が生じるため、各国の財政状況や対外収支などにに基づき、投資対象国を注意深く選別してまいります。そして、対外収支、外貨準備等のファンダメンタルズが良好な国の企業の中でも、安定したキャッシュフロー（現金収支）と国際競争力を有し、バリュエーション（投資価値評価）上の魅力がある企業を愛好します。

格付対比で利回りが魅力的である南アフリカ等を積極方針とします。一方、貿易摩擦等が意識される中国や、利回り面での魅力が乏しいとみているカタールをはじめとした中東諸国等を消極姿勢とします。

引き続き、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たポートフォリオを維持して運用を行ないます。

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 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

(2022年 8 月19日～2023年 2 月20日)

| 項 目                   | 当 期      |            | 項 目 の 概 要                                    |
|-----------------------|----------|------------|--|
|                       | 金 額      | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>210 | %<br>0.959 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                     |
| （ 投 信 会 社 ）           | (139)    | (0.633)    | 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 ）           | ( 67)    | (0.308)    | 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)     | (0.017)    | 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                   | 210      | 0.960      |  |
| 期中の平均基準価額は、21,880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。

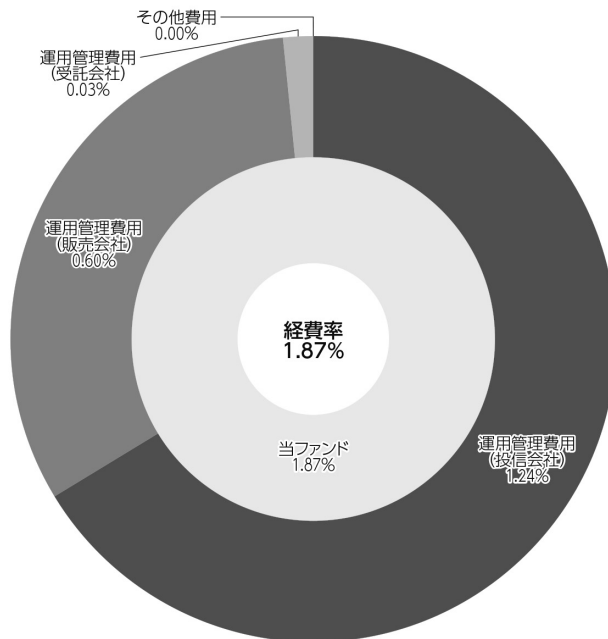
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## （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1.87%です。



(単位：%)

| 経費率 (①+②)          | 1.87 |
|--------------------|------|
| ①当ファンドの費用の比率       | 1.87 |
| 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

(2022年8月19日～2023年2月20日)

## 投資信託証券

| 銘柄 |   | 買付    |        | 売付    |        |
|----|---|-------|--------|-------|--------|
|    |   | 口数    | 金額     | 口数    | 金額     |
| 国内 | PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (CNY) | 1,325 | 7,093  | 1,592 | 8,437  |
|    | PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (IDR) | 1,441 | 7,098  | 1,711 | 8,437  |
|    | PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (INR) | 1,723 | 7,098  | 2,068 | 8,439  |
| 合計 |   | 4,489 | 21,290 | 5,371 | 25,314 |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年8月19日～2023年2月20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2月20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  |  | 当期末     |        |         |      |
|---|--|---------|--------|---------|------|
|   |  | 期首(前期末) | 当期     |         |      |
|   |  | 口数      | 口数     | 評価額     | 比率   |
|   |  | 口       | 口      | 千円      | %    |
| PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (CNY) |  | 25,748  | 25,481 | 136,476 | 32.8 |
| PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (IDR) |  | 27,796  | 27,526 | 135,950 | 32.7 |
| PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB-J (INR) |  | 33,639  | 33,294 | 136,771 | 32.9 |
| 合計  |  | 87,183  | 86,301 | 409,198 | 98.4 |

\*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。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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 マザーファンド | 千口<br>98 | 千口<br>98 | 千円<br>100 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年2月20日現在)

| 項 目           | 当 期 末         |           |
|---------------|---------------|-----------|
|               | 評 価 額         | 比 率       |
| 投資信託受益証券      | 千円<br>409,198 | %<br>96.3 |
| 野村マネー マザーファンド | 100           | 0.0       |
| コール・ローン等、その他  | 15,493        | 3.7       |
| 投資信託財産総額      | 424,791       | 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2月20日現在）

| 項目                 | 当期末          |
|--------------------|--------------|
|                    | 円            |
| (A) 資産             | 424,791,536  |
| コール・ローン等           | 15,492,438   |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 409,198,902  |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 100,196      |
| (B) 負債             | 8,906,486    |
| 未払金                | 4,784,208    |
| 未払収益分配金            | 184,809      |
| 未払信託報酬             | 3,932,933    |
| 未払利息               | 3            |
| その他未払費用            | 4,533        |
| (C) 純資産総額(A-B)     | 415,885,050  |
| 元本                 | 184,809,940  |
| 次期繰越損益金            | 231,075,110  |
| (D) 受益権総口数         | 184,809,940口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 22,503円      |

(注) 期首元本額は194,138,929円、期中追加設定元本額は2,406,448円、期中一部解約元本額は11,735,437円、1口当たり純資産額は2,2503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26,033,998円。(野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型・年2回決算型/ (資源国通貨コース) 毎月分配型・年2回決算型/ (アジア通貨コース) 毎月分配型・年2回決算型/ (米ドルコース) 毎月分配型・年2回決算型の合計額)

## ○損益の状況（2022年8月19日～2023年2月20日）

| 項目               | 当期             |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 19,192,187     |
| 受取配当金            | 19,193,629     |
| 支払利息             | △ 1,442        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 6,874,320    |
| 売買益              | 659,275        |
| 売買損              | △ 7,533,595    |
| (C) 信託報酬等        | △ 3,937,466    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 8,380,401      |
| (E) 前期繰越損益金      | 117,271,254    |
| (F) 追加信託差損益金     | 105,608,264    |
| (配当等相当額)         | ( 212,616,584) |
| (売買損益相当額)        | (△107,008,320) |
| (G) 計(D+E+F)     | 231,259,919    |
| (H) 収益分配金        | △ 184,809      |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 231,075,110    |
| 追加信託差損益金         | 105,608,264    |
| (配当等相当額)         | ( 212,616,584) |
| (売買損益相当額)        | (△107,008,320) |
| 分配準備積立金          | 214,879,188    |
| 繰越損益金            | △ 89,412,342   |

\* 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(2022年8月19日～2023年2月20日)は以下の通りです。

| 項目                           | 当期                        |
|------------------------------|---------------------------|
|                              | 2022年8月19日～<br>2023年2月20日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 15,254,883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             | 212,616,584円              |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 199,809,114円              |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 427,680,581円              |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 23,141円                   |
| g. 分配金                       | 184,809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バミューダ・エマージング・マーケット・アンド・  
インフラストラクチャー・ボンド・ファンド  
A-J(JPY)／A-J(USD)／B-J(BRL)／B-J(AUD)／  
B-J(ZAR)／B-J(CNY)／B-J(INR)／B-J(IDR)

2022年6月30日決算  
(計算期間：2021年7月1日～2022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・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)受益証券への投資を通じて、新興国のインフラ関連企業の債券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               | 新興国のインフラ関連企業の債券を主要投資対象とします。  |
| 管理会社<br>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               | メイブルズ・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<br>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バミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドA

## 運用計算書

2022年6月30日に終了した期間

|                        | (金額単位：千米ドル) |         |
|------------------------|-------------|---------|
| <b>収益：</b>             |             |         |
| 受取利息(外国税控除後)*          | \$          | 3       |
| 収益合計                   |             | 3       |
| <b>費用：</b>             |             |         |
| 支払利息                   |             | 0       |
| 雑費用                    |             | 0       |
| 費用合計                   |             | 0       |
| <b>純投資損益</b>           |             | 3       |
| <b>当期実現損益：</b>         |             |         |
| 投資有価証券(外国税控除後)*        |             | 0       |
| 関連投資                   |             | 1,351   |
| 上場金融デリバティブ商品           |             | 0       |
| 店頭金融デリバティブ商品           |             | (2,931) |
| 外貨通貨                   |             | 2       |
| 当期実現損益                 |             | (1,578) |
| <b>当期末実現評価損益：</b>      |             |         |
| 投資有価証券                 |             | (1)     |
| 関連投資                   |             | (5,041) |
| 上場金融デリバティブ商品           |             | 0       |
| 店頭金融デリバティブ商品           |             | (521)   |
| 外貨建資産および負債             |             | 1       |
| 当期末実現評価損益              |             | (5,562) |
| 当期実現および未実現評価損益         |             | (7,140) |
| <b>運用の結果による純資産の増減額</b> | \$          | (7,137) |
| *外国税                   | \$          | 0       |

|                     | (単位：千 1口単位を除く) |        |
|---------------------|----------------|--------|
| <b>期末純資産総額</b>      |                |        |
| J (JPY)             | \$             | 13,065 |
| J (USD)             |                | 4,527  |
| <b>期末現在発行済受益証券数</b> |                |        |
| J (JPY)             |                | 381    |
| J (USD)             |                | 76     |
| <b>期末1口当たり純資産価格</b> |                |        |
| J (JPY)             | \$             | 34.27  |
| J (USD)             |                | 59.19  |

※PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)の期末純資産額は52,340千米ドル。

## 組入資産の明細

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) | 口数<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千)    |
|---|----------------|---------------|--------------|------------------|
| 2022年6月30日  |                |               |              |                  |
| <b>投資有価証券 6.0%</b>  |                |               |              |                  |
| <b>短期金融商品 6.0%</b>  |                |               |              |                  |
| <b>コマーシャル・ペーパー 3.4%</b>   |                |               |              |                  |
| <b>Federal Home Loan Bank</b>   |                |               |              |                  |
| 1.000% due 07/01/2022 (a)   | \$ 600         | \$ 600        |              |                  |
| <b>定期預金 0.9%</b>  |                |               |              |                  |
| <b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>                       |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 4              | 4             |              |                  |
| <b>Bank of Nova Scotia</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 6              | 6             |              |                  |
| <b>Citibank N.A.</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 23             | 23            |              |                  |
| <b>DBS Bank Ltd.</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 19             | 19            |              |                  |
| <b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>   |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 45             | 45            |              |                  |
| <b>Royal Bank of Canada</b>   |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 2              | 2             |              |                  |
| <b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>                                      |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 20             | 20            |              |                  |
| <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>                                    |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 43             | 43            |              |                  |
|   |                | <u>162</u>    |              |                  |
| <b>米国財務省短期証券 (a) 1.7%</b>   |                |               |              |                  |
| 0.603% due 07/19/2022   | 93             | 93            |              |                  |
| 1.105% due 09/01/2022   | 200            | 199           |              |                  |
|   |                | <u>292</u>    |              |                  |
| <b>短期金融商品合計</b>   |                | <u>1,054</u>  |              |                  |
| (取得原価\$1,055)   |                |               |              |                  |
| <b>投資有価証券合計</b>   |                | <u>1,054</u>  |              |                  |
| (取得原価\$1,055)   |                |               |              |                  |
| <b>関連投資 93.6%</b>   |                |               |              |                  |
| <b>その他の投資会社 93.6%</b>   |                |               |              |                  |
| PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・<br>インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)<br>(取得原価\$16,917) |                |               | 1,389        | 16,478           |
| <b>関連投資合計</b>   |                |               |              | <u>16,478</u>    |
| (取得原価\$16,917)  |                |               |              |                  |
| <b>投資合計 99.6%</b>   |                |               |              | <u>\$ 17,532</u> |
| (取得原価\$17,972)  |                |               |              |                  |
| <b>金融デリバティブ商品 (4.9%)</b>  |                |               |              | (859)            |
| (取得原価またはプレミアム\$0)   |                |               |              |                  |
| <b>その他の資産および負債 5.3%</b>   |                |               |              | <u>935</u>       |
| <b>純資産 100.0%</b>   |                |               |              | <u>\$ 17,608</u> |

(a) クーポンは最終利回りを表す。



## ◎店頭金融デリバティブ商品

2022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   |
| MYI  | 07/2022 | \$ 37 | JPY 5,039 | \$ 0    | \$ 0 |

## ●J(JPY)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                | 07/2022 | JPY 7,558   | \$ 57       | \$ 1         | \$ 0            |
| BPS                | 07/2022 | 621,040     | 4,582       | 11           | 0               |
| BPS                | 07/2022 | \$ 4,980    | JPY 640,054 | 0            | (269)           |
| BPS                | 08/2022 | 4,348       | 589,762     | 0            | 0               |
| BRC                | 07/2022 | JPY 258,299 | \$ 1,904    | 3            | 0               |
| BRC                | 08/2022 | \$ 1,896    | JPY 256,753 | 0            | (3)             |
| CBK                | 07/2022 | JPY 8,863   | \$ 67       | 1            | 0               |
| MBC                | 07/2022 | 123,863     | 909         | 0            | (3)             |
| MBC                | 07/2022 | \$ 435      | JPY 55,375  | 0            | (28)            |
| MBC                | 08/2022 | 905         | 123,153     | 3            | 0               |
| MYI                | 07/2022 | JPY 148,197 | \$ 1,090    | 0            | (1)             |
| MYI                | 08/2022 | \$ 379      | JPY 51,567  | 1            | 0               |
| RBC                | 07/2022 | JPY 145,694 | \$ 1,072    | 0            | 0               |
| RBC                | 08/2022 | \$ 1,072    | JPY 145,450 | 0            | 0               |
| SCX                | 07/2022 | JPY 528,090 | \$ 3,882    | 0            | (5)             |
| SCX                | 07/2022 | \$ 4,958    | JPY 637,019 | 0            | (269)           |
| SCX                | 08/2022 | 3,876       | 526,459     | 6            | 0               |
| TOR                | 07/2022 | JPY 177,571 | \$ 1,315    | 8            | 0               |
| TOR                | 07/2022 | \$ 4,674    | JPY 593,276 | 0            | (307)           |
| TOR                | 08/2022 | 1,315       | 177,286     | 0            | (8)             |
| <b>外国為替先渡し契約合計</b> |         |             |             | <b>\$ 34</b> | <b>\$ (893)</b> |

## PIMCOバミューダ・エマーヅング・マケツツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンドB

## 運用計算書

2022年6月30日に終了した期間

(金額単位：千米ドル)

|                        |    |         |
|------------------------|----|---------|
| <b>収益：</b>             |    |         |
| 受取利息(外国税控除後)*          | \$ | 10      |
| 収益合計                   |    | 10      |
| <b>費用：</b>             |    |         |
| 支払利息                   |    | 0       |
| 雑費用                    |    | 0       |
| 費用合計                   |    | 0       |
| <b>純投資損益</b>           |    | 10      |
| <b>当期実現損益：</b>         |    |         |
| 投資有価証券(外国税控除後)*        |    | 0       |
| 関連投資                   |    | 1,626   |
| 上場金融デリバティブ商品           |    | 0       |
| 店頭金融デリバティブ商品           |    | (302)   |
| 外貨通貨                   |    | 23      |
| 当期実現損益                 |    | 1,347   |
| <b>当期末実現評価損益：</b>      |    |         |
| 投資有価証券                 |    | 0       |
| 関連投資                   |    | (8,721) |
| 上場金融デリバティブ商品           |    | 0       |
| 店頭金融デリバティブ商品           |    | (699)   |
| 外貨建資産および負債             |    | 0       |
| 当期末実現評価損益              |    | (9,420) |
| 当期実現および未実現評価損益         |    | (8,073) |
| <b>運用の結果による純資産の増減額</b> | \$ | (8,063) |
| *外国税                   | \$ | 0       |

(単位：千 1口単位を除く)

|                |    |       |
|----------------|----|-------|
| <b>期末純資産総額</b> |    |       |
| J (AUD)        | \$ | 5,301 |
| J (BRL)        |    | 5,294 |
| J (CNY)        |    | 7,773 |
| J (IDR)        |    | 7,377 |
| J (INR)        |    | 7,487 |
| J (ZAR)        |    | 5,233 |

**期末現在発行済受益証券数**

|         |     |
|---------|-----|
| J (AUD) | 229 |
| J (BRL) | 340 |
| J (CNY) | 194 |
| J (IDR) | 203 |
| J (INR) | 250 |
| J (ZAR) | 244 |

**期末1口当たり純資産価格**

|         |    |       |
|---------|----|-------|
| J (AUD) | \$ | 23.19 |
| J (BRL) |    | 15.55 |
| J (CNY) |    | 40.08 |
| J (IDR) |    | 36.29 |
| J (INR) |    | 29.96 |
| J (ZAR) |    | 21.42 |

※PIMCOバミューダ・エマーヅング・マケツツ・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)の期末純資産額は52,340千米ドル。

## 組入資産の明細

2022年6月30日

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) | 口数<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千)    |
|---|----------------|---------------|--------------|------------------|
| <b>投資有価証券 10.2%</b>   |                |               |              |                  |
| <b>短期金融商品 10.2%</b>   |                |               |              |                  |
| <b>定期預金 0.6%</b>  |                |               |              |                  |
| <b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>                   |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | \$ 6           | \$ 6          |              |                  |
| <b>Bank of Nova Scotia</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 8              | 8             |              |                  |
| <b>Citibank N.A.</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 33             | 33            |              |                  |
| <b>DBS Bank Ltd.</b>  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 28             | 28            |              |                  |
| <b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>                                       |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 66             | 66            |              |                  |
| <b>Royal Bank of Canada</b>   |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 3              | 3             |              |                  |
| <b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>                                  |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 30             | 30            |              |                  |
| <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>                                |                |               |              |                  |
| 1.060% due 07/01/2022   | 63             | 63            |              |                  |
|   |                | <b>237</b>    |              |                  |
| <b>米国財務省短期証券 (a) 9.6%</b>   |                |               |              |                  |
| 0.751% due 07/12/2022   | 900            | 900           |              |                  |
| 0.862% due 07/21/2022   | 800            | 800           |              |                  |
| 1.255% due 09/08/2022   | 500            | 498           |              |                  |
| 1.758% due 09/29/2022   | 1,500          | 1,494         |              |                  |
|   |                | <b>3,692</b>  |              |                  |
| <b>短期金融商品合計<br/>(取得原価\$3,929)</b>                                     |                | <b>3,929</b>  |              |                  |
| <b>投資有価証券合計<br/>(取得原価\$3,929)</b>                                     |                | <b>3,929</b>  |              |                  |
| <b>関連投資 93.2%</b>   |                |               |              |                  |
| <b>その他の投資会社 93.2%</b>   |                |               |              |                  |
| PIMCOバミューダ・エマーゼング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)<br>(取得原価\$37,234) |                |               | 3,024        | 35,862           |
| <b>関連投資合計<br/>(取得原価\$37,234)</b>                                      |                |               |              | <b>35,862</b>    |
| <b>投資合計 103.4%</b>  |                |               |              | <b>\$ 39,791</b> |
| (取得原価\$41,163)  |                |               |              |                  |
| <b>金融デリバティブ商品 (3.1%)<br/>(取得原価またはプレミアム\$0)</b>                        |                |               |              | <b>(1,195)</b>   |
| <b>その他の資産および負債 (0.3%)</b>   |                |               |              | <b>(131)</b>     |
| <b>純資産 100.0%</b>   |                |               |              | <b>\$ 38,465</b> |

(a) クーポンは最終利回りを表す。

## ◎店頭金融デリバティブ商品

2022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    |    |   |    |   |
| MBC  | 07/2022 | \$   | 58   | JPY     | 7,886 | \$ | 0 | \$ | 0 |

## ●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  | 07/2022 | AUD  | 2,205 | \$      | 1,536 | \$ | 20 | \$ | 0    |       |
| BOA  | 07/2022 | \$   | 1,999 | AUD     | 2,776 |    | 0  |    | (90) |       |
| BOA  | 08/2022 |      | 1,396 |         | 2,010 |    | 0  |    | (13) |       |
| BPS  | 07/2022 | AUD  | 6     | \$      | 4     |    | 0  |    | 0    |       |
| BPS  | 07/2022 | \$   | 11    | AUD     | 16    |    | 0  |    | 0    |       |
| CBK  | 07/2022 | AUD  | 2     | \$      | 1     |    | 0  |    | 0    |       |
| JPM  | 07/2022 |      | 1,464 |         | 1,007 |    | 1  |    | 0    |       |
| JPM  | 08/2022 | \$   | 1,008 | AUD     | 1,464 |    | 0  |    | (1)  |       |
| MBC  | 07/2022 | AUD  | 223   | \$      | 160   |    | 7  |    | 0    |       |
| MBC  | 07/2022 |      | 6     |         | 4     |    | 0  |    | 0    |       |
| MBC  | 07/2022 | \$   | 2,094 | AUD     | 2,914 |    | 0  |    | (90) |       |
| MBC  | 07/2022 |      | 4     |         | 6     |    | 0  |    | 0    |       |
| MBC  | 08/2022 | AUD  | 6     | \$      | 4     |    | 0  |    | 0    |       |
| MYI  | 07/2022 |      | 1,930 |         | 1,329 |    | 2  |    | 0    |       |
| MYI  | 08/2022 | \$   | 1,063 | AUD     | 1,544 |    | 0  |    | (2)  |       |
| SCX  | 07/2022 | AUD  | 1,751 | \$      | 1,204 |    | 0  |    | 0    |       |
| SCX  | 07/2022 | \$   | 75    | AUD     | 104   |    | 0  |    | (3)  |       |
| SCX  | 08/2022 |      | 1,205 |         | 1,751 |    | 0  |    | 0    |       |
| TOR  | 07/2022 | AUD  | 1,365 | \$      | 940   |    | 1  |    | 0    |       |
| TOR  | 08/2022 | \$   | 936   | AUD     | 1,359 |    | 0  |    | (1)  |       |
| UAG  | 07/2022 |      | 1,964 |         | 2,749 |    | 0  |    | (73) |       |
|      |         |      |       |         |       |    | \$ | 31 | \$   | (273) |

## ●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     |    |    |    |       |       |
| BPS  | 07/2022 | BRL  | 9,837  | \$      | 1,881  | \$ | 0  | \$ | 0     |       |
| BPS  | 07/2022 | \$   | 2,022  | BRL     | 9,837  |    | 0  |    | (141) |       |
| BPS  | 08/2022 |      | 148    |         | 768    |    | 0  |    | (2)   |       |
| BRC  | 07/2022 | BRL  | 210    | \$      | 43     |    | 3  |    | 0     |       |
| BRC  | 07/2022 | \$   | 40     | BRL     | 210    |    | 0  |    | 0     |       |
| CBK  | 07/2022 | BRL  | 9,683  | \$      | 1,874  |    | 22 |    | 0     |       |
| CBK  | 07/2022 | \$   | 1,946  | BRL     | 9,683  |    | 0  |    | (95)  |       |
| CBK  | 08/2022 |      | 1,828  |         | 9,522  |    | 0  |    | (24)  |       |
| GLM  | 07/2022 | BRL  | 10,279 | \$      | 1,993  |    | 27 |    | 0     |       |
| GLM  | 07/2022 | \$   | 2,038  | BRL     | 10,279 |    | 0  |    | (72)  |       |
| GLM  | 08/2022 | BRL  | 1,394  | \$      | 264    |    | 0  |    | 0     |       |
| GLM  | 08/2022 | \$   | 1,812  | BRL     | 9,464  |    | 0  |    | (18)  |       |
| JPM  | 07/2022 | BRL  | 193    | \$      | 37     |    | 0  |    | 0     |       |
| JPM  | 07/2022 | \$   | 38     | BRL     | 193    |    | 0  |    | (1)   |       |
| MYI  | 07/2022 | BRL  | 9,522  | \$      | 1,852  |    | 31 |    | 0     |       |
| MYI  | 07/2022 | \$   | 1,831  | BRL     | 9,522  |    | 0  |    | (10)  |       |
| MYI  | 08/2022 |      | 1,837  |         | 9,522  |    | 0  |    | (32)  |       |
| RBC  | 08/2022 | BRL  | 21     | \$      | 4      |    | 0  |    | 0     |       |
| SCX  | 07/2022 |      | 57     |         | 11     |    | 0  |    | 0     |       |
| SCX  | 07/2022 | \$   | 11     | BRL     | 57     |    | 0  |    | 0     |       |
| TOR  | 07/2022 | BRL  | 194    | \$      | 37     |    | 0  |    | 0     |       |
| TOR  | 07/2022 | \$   | 37     | BRL     | 194    |    | 0  |    | 0     |       |
| TOR  | 08/2022 |      | 37     |         | 194    |    | 0  |    | 0     |       |
| UAG  | 07/2022 | BRL  | 19     | \$      | 4      |    | 0  |    | 0     |       |
| UAG  | 07/2022 | \$   | 4      | BRL     | 19     |    | 0  |    | 0     |       |
|      |         |      |        |         |        |    | \$ | 83 | \$    | (395) |

## ●J(CNY)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  | 07/2022 | CNY  | 2,879  | \$      | 430    | \$ | 0  | \$ | 0    |      |
| BOA  | 07/2022 | \$   | 14     | CNY     | 94     |    | 0  |    | 0    |      |
| BOA  | 08/2022 | CNY  | 107    | \$      | 16     |    | 0  |    | 0    |      |
| BOA  | 08/2022 | \$   | 430    | CNY     | 2,881  |    | 0  |    | 0    |      |
| BPS  | 07/2022 | CNY  | 18,687 | \$      | 2,788  |    | 0  |    | (3)  |      |
| BPS  | 08/2022 | \$   | 2,569  | CNY     | 17,231 |    | 0  |    | 0    |      |
| BRC  | 07/2022 | CNY  | 54     | \$      | 8      |    | 0  |    | 0    |      |
| CBK  | 07/2022 |      | 399    |         | 59     |    | 0  |    | (1)  |      |
| HUS  | 07/2022 |      | 153    |         | 23     |    | 0  |    | 0    |      |
| JPM  | 07/2022 |      | 17,118 |         | 2,554  |    | 0  |    | (2)  |      |
| JPM  | 07/2022 | \$   | 2,934  | CNY     | 19,543 |    | 0  |    | (16) |      |
| JPM  | 08/2022 |      | 2,554  |         | 17,127 |    | 0  |    | (1)  |      |
| RBC  | 07/2022 | CNY  | 74     | \$      | 11     |    | 0  |    | 0    |      |
| RBC  | 07/2022 | \$   | 11     | CNY     | 74     |    | 0  |    | 0    |      |
| SCX  | 07/2022 | CNY  | 18,429 | \$      | 2,747  |    | 0  |    | (4)  |      |
| SCX  | 07/2022 | \$   | 2,912  | CNY     | 19,424 |    | 0  |    | (11) |      |
| SCX  | 08/2022 | CNY  | 2,232  | \$      | 333    |    | 0  |    | 0    |      |
| SCX  | 08/2022 | \$   | 2,602  | CNY     | 17,475 |    | 3  |    | 0    |      |
| SOG  | 07/2022 | CNY  | 349    | \$      | 52     |    | 0  |    | 0    |      |
| UAG  | 07/2022 |      | 53     |         | 8      |    | 0  |    | 0    |      |
| UAG  | 07/2022 | \$   | 2,851  | CNY     | 18,994 |    | 0  |    | (15) |      |
|      |         |      |        |         |        |    | \$ | 3  | \$   | (53) |

## ●J(IDR)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  | 07/2022 | IDR  | 3,638,337  | \$      | 250        | \$ | 6  | \$ | 0    |       |
| BOA  | 08/2022 |      | 238,045    |         | 16         |    | 0  |    | 0    |       |
| BPS  | 07/2022 |      | 37,658,257 |         | 2,534      |    | 10 |    | 0    |       |
| BPS  | 08/2022 | \$   | 2,504      | IDR     | 37,242,451 |    | 0  |    | (16) |       |
| CBK  | 07/2022 | IDR  | 4,785,729  | \$      | 320        |    | 0  |    | 0    |       |
| CBK  | 07/2022 | \$   | 2,886      | IDR     | 42,012,675 |    | 0  |    | (70) |       |
| CBK  | 08/2022 | IDR  | 4,969,551  | \$      | 332        |    | 0  |    | 0    |       |
| CBK  | 08/2022 | \$   | 309        | IDR     | 4,631,189  |    | 0  |    | 0    |       |
| GLM  | 07/2022 |      | 2,713      |         | 39,521,160 |    | 0  |    | (64) |       |
| HUS  | 07/2022 | IDR  | 38,494,059 | \$      | 2,570      |    | 0  |    | (10) |       |
| HUS  | 07/2022 | \$   | 12         | IDR     | 172,951    |    | 0  |    | 0    |       |
| HUS  | 08/2022 |      | 2,485      |         | 37,305,094 |    | 7  |    | 0    |       |
| RBC  | 07/2022 | IDR  | 116,507    | \$      | 8          |    | 0  |    | 0    |       |
| SOG  | 07/2022 |      | 37,029,921 |         | 2,485      |    | 3  |    | 0    |       |
| SOG  | 07/2022 | \$   | 2,731      | IDR     | 39,766,810 |    | 0  |    | (65) |       |
| SOG  | 08/2022 |      | 2,485      |         | 37,067,489 |    | 0  |    | (9)  |       |
|      |         |      |            |         |            |    | \$ | 26 | \$   | (234) |

## ●J(INR) 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  | 07/2022 | INR  | 10,615  | \$      | 136     | \$ | 2 | \$ | 0     |
| BOA  | 07/2022 | \$   | 2,884   | INR     | 224,477 |    | 0 |    | (42)  |
| BOA  | 08/2022 | INR  | 1,267   | \$      | 16      |    | 0 |    | 0     |
| BPS  | 07/2022 |      | 4,275   |         | 55      |    | 1 |    | 0     |
| CBK  | 07/2022 |      | 202,432 |         | 2,561   |    | 0 |    | (2)   |
| CBK  | 07/2022 | \$   | 69      | INR     | 5,344   |    | 0 |    | (1)   |
| CBK  | 08/2022 |      | 2,508   |         | 198,777 |    | 0 |    | 0     |
| GLM  | 07/2022 | INR  | 627     | \$      | 8       |    | 0 |    | 0     |
| GLM  | 07/2022 | \$   | 2,735   | INR     | 213,245 |    | 0 |    | (36)  |
| HUS  | 07/2022 | INR  | 228,807 | \$      | 2,898   |    | 1 |    | 0     |
| HUS  | 08/2022 | \$   | 2,849   | INR     | 225,520 |    | 0 |    | (3)   |
| SCX  | 07/2022 | INR  | 200,684 | \$      | 2,542   |    | 2 |    | 0     |
| SCX  | 08/2022 | \$   | 2,507   | INR     | 198,438 |    | 0 |    | (4)   |
| SOG  | 07/2022 | INR  | 4,295   | \$      | 55      |    | 0 |    | 0     |
| SOG  | 07/2022 | \$   | 2,733   | INR     | 212,962 |    | 0 |    | (38)  |
| UAG  | 07/2022 | INR  | 4,737   | \$      | 61      |    | 1 |    | 0     |
| UAG  | 08/2022 |      | 25,569  |         | 323     |    | 0 |    | 0     |
|      |         |      |         | \$      |         |    | 7 | \$ | (126) |

## ●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                | 07/2022 | ZAR  | 1,825  | \$      | 117    | \$ | 6          | \$ | 0              |
| CBK                | 07/2022 | \$   | 1,976  | ZAR     | 30,734 |    | 0          |    | (100)          |
| GLM                | 07/2022 |      | 1,974  |         | 30,902 |    | 0          |    | (88)           |
| GLM                | 07/2022 | ZAR  | 30,638 | \$      | 1,876  |    | 6          |    | 0              |
| GLM                | 08/2022 | \$   | 1,766  | ZAR     | 29,031 |    | 0          |    | 0              |
| JPM                | 07/2022 | ZAR  | 177    | \$      | 11     |    | 0          |    | 0              |
| MBC                | 07/2022 | \$   | 2,054  | ZAR     | 32,185 |    | 0          |    | (90)           |
| MBC                | 07/2022 | ZAR  | 65     | \$      | 4      |    | 0          |    | 0              |
| MBC                | 07/2022 |      | 29,026 |         | 1,766  |    | 0          |    | (5)            |
| MBC                | 08/2022 | \$   | 1,766  | ZAR     | 29,111 |    | 5          |    | 0              |
| MYI                | 07/2022 |      | 11     |         | 174    |    | 0          |    | 0              |
| MYI                | 07/2022 |      | 4      |         | 65     |    | 0          |    | 0              |
| MYI                | 07/2022 | ZAR  | 4,579  | \$      | 283    |    | 3          |    | 0              |
| MYI                | 08/2022 |      | 65     |         | 4      |    | 0          |    | 0              |
| SCX                | 07/2022 | \$   | 68     | ZAR     | 1,065  |    | 0          |    | (3)            |
| SCX                | 07/2022 | ZAR  | 28,965 | \$      | 1,800  |    | 32         |    | 0              |
| SCX                | 08/2022 | \$   | 1,800  | ZAR     | 29,050 |    | 0          |    | (32)           |
| SOG                | 07/2022 | ZAR  | 3,650  | \$      | 223    |    | 0          |    | 0              |
| SOG                | 08/2022 | \$   | 219    | ZAR     | 3,598  |    | 1          |    | 0              |
| TOR                | 07/2022 | ZAR  | 63     | \$      | 4      |    | 0          |    | 0              |
| UAG                | 07/2022 |      | 593    |         | 37     |    | 1          |    | 0              |
|                    |         |      |        | \$      |        |    | 54         | \$ | (318)          |
| <b>外国為替先渡し契約合計</b> |         |      |        | \$      |        |    | <b>204</b> | \$ | <b>(1,399)</b> |

## ◎店頭金融デリバティブ商品要約

以下は2022年6月30日現在の金融デリバティブ商品および差入/(受入)担保の取引相手別市場価格の要約である。

| 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<br>ティブの<br>市場価格総額 | 差入/<br>(受入)<br>担保 | ネット・<br>エクス<br>ポージャー <sup>(1)</sup> |
|------|------------|-------------|------------|--------|--------------|-------------|------------|------------|-------------------------|-------------------|-------------------------------------|
|      | 為替先渡<br>契約 | 買建<br>オプション | スワップ<br>契約 | 店頭合計   | 先渡外国<br>為替契約 | 売建<br>オプション | スワップ<br>契約 | 店頭合計       |                         |                   |                                     |
| BOA  | \$ 28      | \$ 0        | \$ 0       | \$ 28  | \$ (145)     | \$ 0        | \$ 0       | \$ (145)   | \$ (117)                | \$ 0              | \$ (117)                            |
| BPS  | 17         | 0           | 0          | 17     | (162)        | 0           | 0          | (162)      | (145)                   | 0                 | (145)                               |
| BRC  | 3          | 0           | 0          | 3      | 0            | 0           | 0          | 0          | 3                       | 0                 | 3                                   |
| CBK  | 22         | 0           | 0          | 22     | (293)        | 0           | 0          | (293)      | (271)                   | 0                 | (271)                               |
| GLM  | 33         | 0           | 0          | 33     | (278)        | 0           | 0          | (278)      | (245)                   | 0                 | (245)                               |
| HUS  | 8          | 0           | 0          | 8      | (13)         | 0           | 0          | (13)       | (5)                     | 0                 | (5)                                 |
| JPM  | 1          | 0           | 0          | 1      | (21)         | 0           | 0          | (21)       | (20)                    | 0                 | (20)                                |
| MBC  | 12         | 0           | 0          | 12     | (185)        | 0           | 0          | (185)      | (173)                   | 0                 | (173)                               |
| MYI  | 36         | 0           | 0          | 36     | (44)         | 0           | 0          | (44)       | (8)                     | 0                 | (8)                                 |
| RBC  | 0          | 0           | 0          | 0      | 0            | 0           | 0          | 0          | 0                       | 0                 | 0                                   |
| SCX  | 37         | 0           | 0          | 37     | (57)         | 0           | 0          | (57)       | (20)                    | 0                 | (20)                                |
| SOG  | 4          | 0           | 0          | 4      | (112)        | 0           | 0          | (112)      | (108)                   | 0                 | (108)                               |
| TOR  | 1          | 0           | 0          | 1      | (1)          | 0           | 0          | (1)        | 0                       | 0                 | 0                                   |
| UAG  | 2          | 0           | 0          | 2      | (88)         | 0           | 0          | (88)       | (86)                    | 0                 | (86)                                |
| 店頭合計 | \$ 204     | \$ 0        | \$ 0       | \$ 204 | \$ (1,399)   | \$ 0        | \$ 0       | \$ (1,399) |                         |                   |                                     |

<sup>(1)</sup> ネット・エクスポージャーは債務不履行事由における取引相手に対する債権債務となる未収金/(未払金)純額である。店頭金融デリバティブ商品からのエクスポージャーは、同一法人との同一のマスター契約に基づく取引全体でのみ相殺することができる。

## PIMCOバミューダ・エマーシング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)

## 組入資産の明細

|   | 額面金額<br>(単位:千) | 評価額<br>(単位:千) |  | 額面金額<br>(単位:千) | 評価額<br>(単位:千) |
|---|----------------|---------------|--|----------------|---------------|
| 2022年6月30日  |                |               |  |                |               |
| <b>投資有価証券 97.8%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>アルゼンチン 2.0%</b>  |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.1%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>YPF S.A.</b>   |                |               |  |                |               |
| 6.950% due 07/21/2027   | \$ 1,000       | \$ 569        |  |                |               |
| <b>ソブリン債 0.9%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Argentina Government International Bond</b>                    |                |               |  |                |               |
| 0.500% due 07/09/2030   | 62             | 13            |  |                |               |
| 1.125% due 07/09/2035   | 40             | 8             |  |                |               |
| <b>Provincia de Neuquen Argentina</b>                             |                |               |  |                |               |
| 4.625% due 04/27/2030   | 723            | 434           |  |                |               |
|   |                | <u>455</u>    |  |                |               |
| <b>アルゼンチン合計</b>   |                | <u>1,024</u>  |  |                |               |
| (取得原価\$1,421)   |                |               |  |                |               |
| <b>オーストラリア 0.6%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.6%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Mineral Resources Ltd.</b>                                     |                |               |  |                |               |
| 8.000% due 11/01/2027   | 300            | 293           |  |                |               |
| <b>オーストラリア合計</b>  |                | <u>293</u>    |  |                |               |
| (取得原価\$300)   |                |               |  |                |               |
| <b>アゼルバイジャン 0.2%</b>  |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.2%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Steas Funding 1 DAC</b>  |                |               |  |                |               |
| 7.230% due 03/17/2026   | 100            | 94            |  |                |               |
| <b>アゼルバイジャン合計</b>   |                | <u>94</u>     |  |                |               |
| (取得原価\$99)  |                |               |  |                |               |
| <b>バミューダ 0.8%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.8%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Geopark Ltd.</b>   |                |               |  |                |               |
| 5.500% due 01/17/2027   | 500            | 420           |  |                |               |
| <b>バミューダ合計</b>  |                | <u>420</u>    |  |                |               |
| (取得原価\$471)   |                |               |  |                |               |
| <b>ブラジル 4.2%</b>  |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 3.8%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Banco Daycoval S.A.</b>  |                |               |  |                |               |
| 4.250% due 12/13/2024   | 500            | 481           |  |                |               |
| <b>Banco do Brasil S.A.</b>                                       |                |               |  |                |               |
| 3.875% due 10/10/2022   | 500            | 501           |  |                |               |
| <b>CSN Inova Ventures</b>   |                |               |  |                |               |
| 6.750% due 01/28/2028   | 400            | 350           |  |                |               |
| <b>CSN Resources S.A.</b>   |                |               |  |                |               |
| 4.625% due 06/10/2031   | 200            | 142           |  |                |               |
| <b>Odebrecht Oil &amp; Gas Finance Ltd.</b>                       |                |               |  |                |               |
| 0.000% due 08/01/2022 (a)   | 50             | 0             |  |                |               |
| <b>Oi S.A.</b>  |                |               |  |                |               |
| 10.000% due 07/27/2025 (b)  | 200            | 98            |  |                |               |
| <b>Petrobras Global Finance BV</b>                                |                |               |  |                |               |
| 6.625% due 01/16/2034   | GBP 400        | 447           |  |                |               |
|   |                | <u>2,019</u>  |  |                |               |
| <b>仕組債 0.4%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Vale S.A.</b>  |                |               |  |                |               |
| 3.202% due 03/30/2170 (a)   | BRL 2,300      | 189           |  |                |               |
| <b>ブラジル合計</b>   |                | <u>2,208</u>  |  |                |               |
| (取得原価\$2,681)   |                |               |  |                |               |
| <b>英領ヴァージン諸島 1.4%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.4%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Champion Path Holdings Ltd.</b>                                |                |               |  |                |               |
| 4.850% due 01/27/2028   | \$ 200         | 117           |  |                |               |
| <b>Studio City Co. Ltd.</b>                                       |                |               |  |                |               |
| 7.000% due 02/15/2027   | 200            | 174           |  |                |               |
| <b>Studio City Finance Ltd.</b>                                   |                |               |  |                |               |
| 5.000% due 01/15/2029   | 900            | 466           |  |                |               |
| <b>英領ヴァージン諸島合計</b>  |                | <u>757</u>    |  |                |               |
| (取得原価\$1,308)   |                |               |  |                |               |
| <b>カナダ 1.3%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.3%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Canacol Energy Ltd.</b>  |                |               |  |                |               |
| 5.750% due 11/24/2028   | 200            | 162           |  |                |               |
| <b>First Quantum Minerals Ltd.</b>                                |                |               |  |                |               |
| 6.875% due 10/15/2027   | 600            | 538           |  |                |               |
| <b>カナダ合計</b>  |                | <u>700</u>    |  |                |               |
| (取得原価\$800)   |                |               |  |                |               |
| <b>ケイマン諸島 9.1%</b>  |                |               |  |                |               |
| <b>社債・約束手形 9.1%</b>   |                |               |  |                |               |
| <b>Agile Group Holdings Ltd.</b>                                  |                |               |  |                |               |
| 7.875% due 07/31/2024 (a)   | 200            | 44            |  |                |               |
| <b>Arabian Centres Sukuk Ltd.</b>                                 |                |               |  |                |               |
| 5.375% due 11/26/2024   | 650            | 620           |  |                |               |
| <b>Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.</b>                      |                |               |  |                |               |
| 0.000% due 06/05/2034   | 843            | 535           |  |                |               |
| <b>Country Garden Holdings Co. Ltd.</b>                           |                |               |  |                |               |
| 3.875% due 10/22/2030   | 200            | 84            |  |                |               |
| <b>Health &amp; Happiness H&amp;H International Holdings Ltd.</b> |                |               |  |                |               |
| 5.625% due 10/24/2024   | 400            | 350           |  |                |               |
| <b>IHS Holding Ltd.</b>   |                |               |  |                |               |
| 5.625% due 11/29/2026   | 200            | 165           |  |                |               |
| <b>Kaisa Group Holdings Ltd. (c)</b>                              |                |               |  |                |               |
| 8.500% due 09/30/2022   | 300            | 42            |  |                |               |
| 9.750% due 09/28/2023   | 400            | 55            |  |                |               |
| <b>Melco Resorts Finance Ltd.</b>                                 |                |               |  |                |               |
| 4.875% due 06/06/2025   | 700            | 524           |  |                |               |
| 5.375% due 12/04/2029   | 200            | 121           |  |                |               |
| 5.750% due 07/21/2028   | 400            | 258           |  |                |               |
| <b>MGM China Holdings Ltd.</b>                                    |                |               |  |                |               |
| 5.250% due 06/18/2025   | 800            | 615           |  |                |               |
| <b>New Metro Global Ltd.</b>                                      |                |               |  |                |               |
| 6.800% due 08/05/2023   | 300            | 205           |  |                |               |
| <b>Odebrecht Holdco Finance Ltd.</b>                              |                |               |  |                |               |
| 0.000% due 09/10/2058   | 1,217          | 11            |  |                |               |



|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b> |                |               |
| 6.720% due 12/01/2022                           | 144            | 139           |
| 7.720% due 12/01/2026 (b)                       | 733            | 183           |
| <b>OEC Finance Ltd. (b)</b>                     |                |               |
| 4.375% due 10/25/2029                           | 111            | 3             |
| 7.125% due 12/26/2046                           | 956            | 24            |
| <b>Powerlong Real Estate Holdings Ltd.</b>      |                |               |
| 5.950% due 04/30/2025                           | 200            | 32            |
| <b>Sunac China Holdings Ltd. (c)</b>            |                |               |
| 6.500% due 01/10/2025                           | 200            | 30            |
| 7.500% due 02/01/2024                           | 300            | 46            |
| <b>Wynn Macau Ltd.</b>                          |                |               |
| 4.875% due 10/01/2024                           | 900            | 670           |
| <b>ケイマン諸島合計</b>                                 |                | <b>4,756</b>  |
| (取得原価\$8,414)                                   |                |               |
| <b>チリ 0.4%</b>                                  |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.4%</b>                             |                |               |
| <b>Alfa Desarrollo SpA</b>                      |                |               |
| 4.550% due 09/27/2051                           | 299            | 215           |
| <b>チリ合計</b>                                     |                | <b>215</b>    |
| (取得原価\$299)                                     |                |               |
| <b>中国 1.4%</b>                                  |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.4%</b>                             |                |               |
| <b>Yango Justice International Ltd.</b>         |                |               |
| 7.500% due 04/15/2024 (c)                       | 200            | 16            |
| <b>Zoomlion HK SPV Co. Ltd.</b>                 |                |               |
| 6.125% due 12/20/2022                           | 700            | 701           |
| <b>中国合計</b>                                     |                | <b>717</b>    |
| (取得原価\$904)                                     |                |               |
| <b>コロンビア 3.6%</b>                               |                |               |
| <b>社債・約束手形 3.4%</b>                             |                |               |
| <b>Banco Davivienda S.A.</b>                    |                |               |
| 6.650% due 04/22/2031 (a) (d)                   | 600            | 481           |
| <b>Ecopetrol S.A.</b>                           |                |               |
| 4.625% due 11/02/2031                           | 200            | 152           |
| 5.875% due 05/28/2045                           | 500            | 341           |
| 6.875% due 04/29/2030                           | 900            | 798           |
|   |                | <b>1,772</b>  |
| <b>ソブリン債 0.2%</b>                               |                |               |
| <b>Colombia Government International Bond</b>   |                |               |
| 3.875% due 02/15/2061                           | 200            | 115           |
| <b>コロンビア合計</b>                                  |                | <b>1,887</b>  |
| (取得原価\$2,555)                                   |                |               |
| <b>キプロス 0.7%</b>                                |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.7%</b>                             |                |               |
| <b>MHP SE</b>                                   |                |               |
| 7.750% due 05/10/2024                           | 700            | 367           |
| <b>キプロス合計</b>                                   |                | <b>367</b>    |
| (取得原価\$701)                                     |                |               |
| <b>ドミニカ共和国 0.2%</b>                             |                |               |
| <b>ソブリン債 0.2%</b>                               |                |               |
| <b>Dominican Republic International Bond</b>    |                |               |
| 5.300% due 01/21/2041                           | 150            | 104           |
| <b>ドミニカ共和国合計</b>                                |                | <b>104</b>    |
| (取得原価\$147)                                     |                |               |

|  | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|--|----------------|---------------|
| <b>グアテマラ 0.3%</b>                              |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.3%</b>                            |                |               |
| <b>CT Trust</b>                                |                |               |
| 5.125% due 02/03/2032                          | 200            | 161           |
| <b>グアテマラ合計</b>                                 |                | <b>161</b>    |
| (取得原価\$200)                                    |                |               |
| <b>香港 1.6%</b>                                 |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.6%</b>                            |                |               |
| <b>Fortune Star BVI Ltd.</b>                   |                |               |
| 3.950% due 10/02/2026                          | EUR 100        | 62            |
| 4.350% due 05/06/2023                          | 200            | 166           |
| 5.950% due 10/19/2025                          | \$ 200         | 128           |
| <b>Huarong Finance 2019 Co. Ltd.</b>           |                |               |
| 2.125% due 09/30/2023                          | 200            | 191           |
| <b>Yanlord Land HK Co. Ltd.</b>                |                |               |
| 5.125% due 05/20/2026                          | 400            | 305           |
| <b>香港合計</b>                                    |                | <b>852</b>    |
| (取得原価\$1,116)                                  |                |               |
| <b>インド 1.9%</b>                                |                |               |
| <b>社債・約束手形 1.9%</b>                            |                |               |
| <b>JSW Steel Ltd.</b>                          |                |               |
| 5.050% due 04/05/2032                          | 450            | 335           |
| <b>Muthoot Finance Ltd.</b>                    |                |               |
| 6.125% due 10/31/2022                          | 300            | 300           |
| <b>Shriram Transport Finance Co. Ltd.</b>      |                |               |
| 4.150% due 07/18/2025                          | 200            | 175           |
| 5.100% due 07/16/2023                          | 200            | 191           |
| <b>インド合計</b>                                   |                | <b>1,001</b>  |
| (取得原価\$1,153)                                  |                |               |
| <b>インドネシア 3.3%</b>                             |                |               |
| <b>社債・約束手形 3.3%</b>                            |                |               |
| <b>Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT</b>    |                |               |
| 3.750% due 03/30/2026 (d)                      | 600            | 546           |
| <b>Cikarang Listrindo Tbk PT</b>               |                |               |
| 4.950% due 09/14/2026                          | 400            | 371           |
| <b>LLPL Capital Pte Ltd.</b>                   |                |               |
| 6.875% due 02/04/2039                          | 174            | 162           |
| <b>Medco Oak Tree Pte Ltd.</b>                 |                |               |
| 7.375% due 05/14/2026                          | 700            | 639           |
| <b>インドネシア合計</b>                                |                | <b>1,718</b>  |
| (取得原価\$1,932)                                  |                |               |
| <b>アイルランド 0.2%</b>                             |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.2%</b>                            |                |               |
| <b>Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC</b> |                |               |
| 5.950% due 04/15/2030 (c) (d)                  | 700            | 77            |
| <b>Sovcombank Via SovCom Capital DAC (c)</b>   |                |               |
| 3.400% due 01/26/2025                          | 400            | 28            |
| 8.000% due 04/07/2030 (d)                      | 200            | 14            |
| <b>アイルランド合計</b>                                |                | <b>119</b>    |
| (取得原価\$1,314)                                  |                |               |
| <b>イスラエル 3.7%</b>                              |                |               |
| <b>社債・約束手形 3.7%</b>                            |                |               |
| <b>Delek Overriding Royalty Leviathan Ltd.</b> |                |               |
| 7.494% due 12/30/2023                          | 200            | 201           |
| <b>Energean Israel Finance Ltd.</b>            |                |               |
| 4.500% due 03/30/2024                          | 200            | 189           |

|                            | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|----------------------------|----------------|---------------|
| 4.875% due 03/30/2026      | 400            | 354           |
| 5.375% due 03/30/2028      | 500            | 425           |
| <b>Leviathan Bond Ltd.</b> |                |               |
| 6.125% due 06/30/2025      | 200            | 189           |
| 6.500% due 06/30/2027      | 600            | 556           |
| <b>イスラエル合計</b>             |                | <b>1,914</b>  |
| (取得原価\$2,104)              |                |               |

| <b>チャンネル諸島ジャージー島 0.6%</b>         |         |            |
|-----------------------------------|---------|------------|
| <b>社債・約束手形 0.6%</b>               |         |            |
| <b>Corsair International Ltd.</b> |         |            |
| 4.850% due 01/28/2027             | EUR 200 | 197        |
| 5.200% due 01/28/2029             | 100     | 98         |
| <b>チャンネル諸島ジャージー島合計</b>            |         | <b>295</b> |
| (取得原価\$335)                       |         |            |

| <b>ルクセンブルク 3.8%</b>                            |         |    |
|--|---------|----|
| <b>普通株 0.1%</b>                                |         |    |
| <b>株数</b>                                      |         |    |
| <b>Constellation Oil Services Holding S.A.</b> | 272,161 | 30 |

|  | 額面金額<br>(単位：千) |  |
|--|----------------|--|
|--|----------------|--|

| <b>社債・約束手形 3.7%</b>                             |        |              |
|---|--------|--------------|
| <b>Andrade Gutierrez International S.A. (c)</b> |        |              |
| 9.500% due 12/30/2024                           | \$ 344 | 191          |
| 11.000% due 05/20/2049                          | 1      | 0            |
| <b>Constellation Oil Services Holding S.A.</b>  |        |              |
| 3.000% due 12/31/2026 (b)                       | 224    | 166          |
| <b>Guara Norte Sari</b>                         |        |              |
| 5.198% due 06/15/2034                           | 374    | 304          |
| <b>Nexa Resources S.A.</b>                      |        |              |
| 6.500% due 01/18/2028                           | 500    | 478          |
| <b>Petrorio Luxembourg Trading Sari</b>         |        |              |
| 6.125% due 06/09/2026                           | 400    | 369          |
| <b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b>   |        |              |
| 5.250% due 05/23/2023 (c) (d)                   | 500    | 35           |
| <b>Unigel Luxembourg S.A.</b>                   |        |              |
| 8.750% due 10/01/2026                           | 400    | 396          |
|   |        | <b>1,939</b> |
|   |        | <b>1,969</b> |

|                  |  |  |
|------------------|--|--|
| <b>ルクセンブルク合計</b> |  |  |
| (取得原価\$2,723)    |  |  |

| <b>モーリシャス 3.7%</b>                   |     |              |
|--------------------------------------|-----|--------------|
| <b>社債・約束手形 3.7%</b>                  |     |              |
| <b>Greenko Dutch BV</b>              |     |              |
| 3.850% due 03/29/2026                | 776 | 660          |
| <b>Greenko Power II Ltd.</b>         |     |              |
| 4.300% due 12/13/2028                | 196 | 157          |
| <b>India Green Energy Holdings</b>   |     |              |
| 5.375% due 04/29/2024                | 400 | 374          |
| <b>MTN Mauritius Investment Ltd.</b> |     |              |
| 4.755% due 11/11/2024                | 750 | 731          |
| <b>モーリシャス合計</b>                      |     | <b>1,922</b> |
| (取得原価\$2,167)                        |     |              |

| <b>メキシコ 4.1%</b>                             |     |     |
|--|-----|-----|
| <b>社債・約束手形 4.1%</b>                          |     |     |
| <b>Banco Mercantil del Norte S.A. (a)(d)</b> |     |     |
| 7.625% due 01/10/2028                        | 200 | 186 |
| 8.375% due 10/14/2030                        | 300 | 290 |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>BVVA Bancomer S.A.</b>                         |                |               |
| 5.125% due 01/18/2033 (d)                         | 750            | 636           |
| <b>Cibanco S.A. Ibm</b>                           |                |               |
| 4.962% due 07/18/2029                             | 200            | 179           |
| <b>Cydsa SAB de C.V.</b>                          |                |               |
| 6.250% due 10/04/2027                             | 200            | 178           |
| <b>Metalsa S.A. de C.V.</b>                       |                |               |
| 3.750% due 05/04/2031                             | 200            | 142           |
| <b>Petroleos Mexicanos</b>                        |                |               |
| 5.950% due 01/28/2031                             | 100            | 73            |
| 6.500% due 06/02/2041                             | 100            | 63            |
| 6.750% due 09/21/2047                             | 200            | 124           |
| <b>Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V.</b> |                |               |
| 7.500% due 11/12/2025                             | 300            | 263           |
| <b>メキシコ合計</b>                                     |                | <b>2,134</b>  |
| (取得原価\$2,571)                                     |                |               |

| <b>モロッコ 1.8%</b>      |     |            |
|-----------------------|-----|------------|
| <b>社債・約束手形 1.8%</b>   |     |            |
| <b>OCF S.A.</b>       |     |            |
| 5.125% due 06/23/2051 | 500 | 333        |
| 6.875% due 04/25/2044 | 700 | 586        |
| <b>モロッコ合計</b>         |     | <b>919</b> |
| (取得原価\$1,271)         |     |            |

| <b>国際機関 1.3%</b>                          |     |            |
|---|-----|------------|
| <b>社債・約束手形 1.3%</b>                       |     |            |
| <b>ATP Tower Holdings LLC</b>             |     |            |
| 4.050% due 04/27/2026                     | 400 | 331        |
| <b>Digicel International Finance Ltd.</b> |     |            |
| 8.750% due 05/25/2024                     | 357 | 333        |
| <b>国際機関合計</b>                             |     | <b>664</b> |
| (取得原価\$718)                               |     |            |

| <b>オランダ 6.2%</b>                                     |           |              |
|--|-----------|--------------|
| <b>社債・約束手形 6.2%</b>                                  |           |              |
| <b>DTEK Finance PLC</b>                              |           |              |
| 7.500% due 12/31/2027 (b)                            | 333       | 80           |
| <b>IHS Netherlands Holdco BV</b>                     |           |              |
| 8.000% due 09/18/2027                                | 900       | 791          |
| <b>InterCement Financial Operations BV</b>           |           |              |
| 5.750% due 07/17/2024                                | 200       | 152          |
| <b>Metinvest BV</b>                                  |           |              |
| 5.625% due 06/17/2025                                | EUR 300   | 179          |
| 8.500% due 04/23/2026                                | \$ 500    | 262          |
| <b>NGD Holdings BV</b>                               |           |              |
| 6.750% due 12/31/2026                                | 127       | 56           |
| <b>Prosus NV</b>                                     |           |              |
| 3.257% due 01/19/2027                                | 300       | 261          |
| 4.987% due 01/19/2052                                | 200       | 144          |
| <b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV</b> |           |              |
| 3.750% due 05/09/2027                                | EUR 1,500 | 1,332        |
| <b>オランダ合計</b>  |           | <b>3,257</b> |
| (取得原価\$4,400)  |           |              |

| <b>ナイジェリア 2.1%</b>           |        |     |
|------------------------------|--------|-----|
| <b>バンクローン 0.6%</b>           |        |     |
| <b>Bank of Industry Ltd.</b> |        |     |
| 7.745% due 12/11/2023        | \$ 333 | 335 |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>社債・約束手形 1.5%</b>                             |                |               |
| <b>Access Bank PLC</b>                          |                |               |
| 6.125% due 09/21/2026                           | 400            | 325           |
| <b>SEPLAT Energy PLC</b>                        |                |               |
| 7.750% due 04/01/2026                           | 300            | 269           |
| <b>United Bank for Africa PLC</b>               |                |               |
| 6.750% due 11/19/2026                           | 200            | 177           |
|   |                | <u>771</u>    |
| <b>ナイジェリア合計</b>                                 |                | <u>1,106</u>  |
| (取得原価\$1,242)                                   |                |               |
| <b>オマーン 0.4%</b>                                |                |               |
| <b>ソブリン債 0.4%</b>                               |                |               |
| <b>Oman Government International Bond</b>       |                |               |
| 6.250% due 01/25/2031                           | 200            | 194           |
| <b>オマーン合計</b>                                   |                | <u>194</u>    |
| (取得原価\$200)                                     |                |               |
| <b>ペルー 0.9%</b>                                 |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.9%</b>                             |                |               |
| <b>InRetail Consumer</b>                        |                |               |
| 3.250% due 03/22/2028                           | 400            | 333           |
| <b>Peru LNG Srl</b>                             |                |               |
| 5.375% due 03/22/2030                           | 200            | 162           |
| <b>ペルー合計</b>                                    |                | <u>495</u>    |
| (取得原価\$590)                                     |                |               |
| <b>ルーマニア 0.2%</b>                               |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.2%</b>                             |                |               |
| <b>RCS &amp; RDS S.A.</b>                       |                |               |
| 3.250% due 02/05/2028                           | EUR 100        | 82            |
| <b>ルーマニア合計</b>                                  |                | <u>82</u>     |
| (取得原価\$110)                                     |                |               |
| <b>セルビア 0.1%</b>                                |                |               |
| <b>ソブリン債 0.1%</b>                               |                |               |
| <b>Serbia Government International Bond</b>     |                |               |
| 1.650% due 03/03/2033                           | 100            | 66            |
| <b>セルビア合計</b>                                   |                | <u>66</u>     |
| (取得原価\$118)                                     |                |               |
| <b>シンガポール 0.5%</b>                              |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.5%</b>                             |                |               |
| <b>ABJA Investment Co. Pte Ltd.</b>             |                |               |
| 5.450% due 01/24/2028                           | \$ 300         | 285           |
| <b>シンガポール合計</b>                                 |                | <u>285</u>    |
| (取得原価\$272)                                     |                |               |
| <b>南アフリカ 7.4%</b>                               |                |               |
|   | 株数             |               |
| <b>普通株 0.6%</b>                                 |                |               |
| <b>Petra Diamonds Ltd.</b>                      | 303,217        | 330           |
|   | 額面金額<br>(単位：千) |               |
| <b>社債・約束手形 5.2%</b>                             |                |               |
| <b>Absa Group Ltd.</b>                          |                |               |
| 6.375% due 05/27/2026 (a) (d)                   | 200            | 182           |
| <b>Development Bank of Southern Africa Ltd.</b> |                |               |
| 8.600% due 10/21/2024                           | ZAR 7,300      | 437           |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Growthpoint Properties International Pty Ltd.</b>      |                |               |
| 5.872% due 05/02/2023                                     | \$ 500         | 500           |
| <b>Sasol Financing USA LLC</b>                            |                |               |
| 5.875% due 03/27/2024                                     | 1,100          | 1,079         |
| 6.500% due 09/27/2028                                     | 600            | 544           |
|   |                | <u>2,742</u>  |
| <b>ソブリン債 1.6%</b>   |                |               |
| <b>South Africa Government International Bond</b>         |                |               |
| 10.500% due 12/21/2026                                    | ZAR 12,800     | 827           |
| <b>南アフリカ合計</b>  |                | <u>3,899</u>  |
| (取得原価\$4,144)   |                |               |
| <b>スペイン 0.5%</b>  |                |               |
| <b>社債・約束手形 0.5%</b>                                       |                |               |
| <b>International Airport Finance S.A.</b>                 |                |               |
| 12.000% due 03/15/2033                                    | \$ 296         | 289           |
| <b>スペイン合計</b>   |                | <u>289</u>    |
| (取得原価\$297)   |                |               |
| <b>トルコ 6.5%</b>   |                |               |
| <b>社債・約束手形 6.5%</b>                                       |                |               |
| <b>Akbank T.A.S.</b>                                      |                |               |
| 5.125% due 03/31/2025                                     | 700            | 618           |
| <b>Arcelik A/S</b>  |                |               |
| 5.000% due 04/03/2023                                     | 200            | 197           |
| <b>QNB Finansbank A/S</b>                                 |                |               |
| 6.875% due 09/07/2024                                     | 1,300          | 1,305         |
| <b>Turk Telekomunikasyon A/S</b>                          |                |               |
| 8.875% due 02/28/2025                                     | 1,100          | 986           |
| <b>Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust</b> |                |               |
| 4.200% due 03/15/2027                                     | 349            | 290           |
| <b>トルコ合計</b>  |                | <u>3,396</u>  |
| (取得原価\$3,594)   |                |               |
| <b>ウクライナ 0.1%</b>   |                |               |
| <b>ソブリン債 0.1%</b>   |                |               |
| <b>Ukraine Government International Bond</b>              |                |               |
| 4.375% due 01/27/2030                                     | EUR 100        | 26            |
| 7.750% due 09/01/2024                                     | \$ 100         | 26            |
| <b>ウクライナ合計</b>  |                | <u>52</u>     |
| (取得原価\$183)   |                |               |
| <b>アラブ首長国連邦 2.5%</b>                                      |                |               |
| <b>社債・約束手形 2.5%</b>                                       |                |               |
| <b>Kuwait Projects Co. SPC Ltd.</b>                       |                |               |
| 4.229% due 10/29/2026                                     | 600            | 505           |
| <b>Oztel Holdings SPC Ltd.</b>                            |                |               |
| 6.625% due 04/24/2028                                     | 800            | 808           |
| <b>アラブ首長国連邦合計</b>   |                | <u>1,313</u>  |
| (取得原価\$1,386)   |                |               |
| <b>イギリス 2.7%</b>  |                |               |
| <b>社債・約束手形 2.7%</b>                                       |                |               |
| <b>Jaguar Land Rover Automotive PLC</b>                   |                |               |
| 6.875% due 11/15/2026                                     | EUR 100        | 92            |
| 7.750% due 10/15/2025                                     | \$ 200         | 185           |
| <b>MARB BondCo PLC</b>                                    |                |               |
| 3.950% due 01/29/2031                                     | 400            | 308           |
| <b>Petra Diamonds U.S. Treasury PLC</b>                   |                |               |
| 10.500% due 03/08/2026 (b)                                | 308            | 310           |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Tullow Oil PLC</b>                               |                |               |
| 10.250% due 05/15/2026                              | 200            | 192           |
| <b>Vedanta Resources Finance II PLC</b>             |                |               |
| 8.950% due 03/11/2025                               | 400            | 317           |
| <b>イギリス合計</b>                                       |                | <b>1,404</b>  |
| (取得原価\$1,608)                                       |                |               |
| <b>アメリカ 6.5%</b>                                    |                |               |
| <b>社債・約束手形 5.8%</b>                                 |                |               |
| <b>Gran Tierra Energy, Inc.</b>                     |                |               |
| 7.750% due 05/23/2027                               | 200            | 171           |
| <b>Kosmos Energy Ltd.</b>                           |                |               |
| 7.125% due 04/04/2026                               | 1,000          | 851           |
| <b>Rio Oil Finance Trust Series 2014-1</b>          |                |               |
| 9.250% due 07/06/2024                               | 178            | 184           |
| <b>Rio Oil Finance Trust Series 2018-1</b>          |                |               |
| 8.200% due 04/06/2028                               | 940            | 979           |
| <b>Stillwater Mining Co.</b>                        |                |               |
| 4.000% due 11/16/2026                               | 1,000          | 836           |
|   |                | <b>3,021</b>  |
| <b>米国財務省証券 0.7%</b>                                 |                |               |
| <b>U.S. Treasury Notes</b>                          |                |               |
| 3.000% due 09/30/2025                               | 400            | 400           |
| <b>アメリカ合計</b>                                       |                | <b>3,421</b>  |
| (取得原価\$3,667)                                       |                |               |
| <b>短期金融商品 9.0%</b>                                  |                |               |
| <b>定期預金 2.5%</b>                                    |                |               |
| <b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b> |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                               | 30             | 30            |
| <b>Bank of Nova Scotia</b>                          |                |               |
| 0.560% due 07/04/2022                               | CAD 42         | 33            |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 42          | 42            |
| <b>BNP Paribas Bank</b>                             |                |               |
| (0.780%) due 07/01/2022                             | EUR 20         | 21            |
| 0.370% due 07/04/2022                               | HKD 1          | 0             |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 1           | 1             |
| <b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>            |                |               |
| 3.850% due 07/01/2022                               | ZAR 61         | 4             |
| <b>Citibank N.A.</b>                                |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 170         | 170           |
| <b>DBS Bank Ltd.</b>                                |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                               | 144            | 144           |
| <b>HSBC Bank PLC</b>                                |                |               |
| (0.780%) due 07/01/2022                             | EUR 7          | 7             |
| <b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>                     |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 341         | 341           |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千)    |
|---|----------------|------------------|
| <b>Royal Bank of Canada</b>                         |                |                  |
| 1.060% due 07/01/2022                               | 16             | 16               |
| <b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>                |                |                  |
| (0.780%) due 07/01/2022                             | EUR 19         | 20               |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 151         | 151              |
| <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>              |                |                  |
| (0.780%) due 07/01/2022                             | EUR 2          | 2                |
| 1.060% due 07/01/2022                               | \$ 324         | 324              |
| <b>The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd.</b> |                |                  |
| 0.370% due 07/04/2022                               | HKD 22         | 3                |
|   | D              |                  |
|   |                | <b>1,309</b>     |
| <b>アルゼンチン財務省短期証券 0.0%</b>                           |                |                  |
| 51.282% due 09/30/2022 (e)                          | ARS 2,100      | 7                |
| <b>米国財務省短期証券 6.5%</b>                               |                |                  |
| 0.666% due 07/19/2022 (e)                           | \$ 1,300       | 1,299            |
| 0.766% due 07/12/2022 (f)                           | 1,700          | 1,700            |
| 1.063% due 08/25/2022 (e)                           | 400            | 399              |
|   |                | <b>3,398</b>     |
| <b>短期金融商品合計</b>                                     |                | <b>4,714</b>     |
| (取得原価\$4,717)                                       |                |                  |
| <b>投資有価証券合計 97.8%</b>                               |                | <b>\$ 51,183</b> |
| (取得原価\$64,232)                                      |                |                  |
| <b>金融デリバティブ商品 0.3%</b>                              |                | <b>141</b>       |
| (取得原価またはプレミアム\$(12))                                |                |                  |
| <b>その他の資産および負債 1.9%</b>                             |                | <b>1,016</b>     |
| <b>純資産 100.0%</b>                                   |                | <b>\$ 52,340</b> |

\* 残高ゼロは実際の金額が千未満で切り捨てられたことを反映している可能性がある。

- (a) 永久債：記載の日付(該当する場合は)は次回の償還日である。  
(b) 現物払い有価証券  
(c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。  
(d) 偶発転換証券  
(e) クーボンは最終利回りを表す。  
(f) クーボンは加重平均最終利回りを表す。

## ◎制限付証券

2022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<br>対する市場<br>価格の比率 |
|--|--------|------------|------------|---------------|---------------|------------------------|
| Constellation Oil Services Holding S. A. | N/A    | N/A        | 06/10/2022 | \$ 30         | \$ 30         | 0.06%                  |
| Development Bank of Southern Africa Ltd. | 8.600% | 10/21/2024 | 10/07/2021 | 490           | 437           | 0.83%                  |
| <b>制限付証券合計</b>                           |        |            |            | <b>\$ 520</b> | <b>\$ 467</b> | <b>0.89%</b>           |

## ◎上場金融デリバティブ商品

2022年6月30日現在

## ●先物契約

単位：千(契約数を除く)

| 銘柄   | 種類    | 決済月     | 契約数 | 未実現評価損益       | 変動証拠金        |                |
|--|-------|---------|-----|---------------|--------------|----------------|
|  |       |         |     |               | 資産           | 負債             |
| Euro-Bobl 5-Year Note September Futures            | Short | 09/2022 | 5   | \$ 8          | \$ 0         | \$ (11)        |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures           | Short | 09/2022 | 5   | 21            | 0            | (19)           |
| U. S. Treasury 5-Year Note September Futures       | Short | 09/2022 | 9   | 6             | 0            | (5)            |
| U. S. Treasury 10-Year Note September Futures      | Long  | 09/2022 | 83  | (58)          | 67           | 0              |
| U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures | Short | 09/2022 | 17  | 22            | 0            | (16)           |
| <b>先物契約合計</b>                                      |       |         |     | <b>\$ (1)</b> | <b>\$ 67</b> | <b>\$ (51)</b> |

## ●スワップ契約

信用指数に係るクレジットデフォルトスワッププロテクションの売り<sup>(1)</sup>

単位：千

| インデックス/トランシェ                            | 固定受取<br>金利 | 満期日        | 想定元本 <sup>(2)</sup> | 市場価格 <sup>(3)</sup> | 未実現<br>評価損益    | 変動証拠金       |               |
|---|------------|------------|---------------------|---------------------|----------------|-------------|---------------|
|   |            |            |                     |                     |                | 資産          | 負債            |
| iTraxx Europe Crossover Series 37 Index | 5.000%     | 06/20/2027 | EUR 100             | \$ (3)              | \$ (5)         | \$ 0        | \$ (1)        |
| iTraxx Europe Series 36 Index           | 1.000%     | 12/20/2026 | 600                 | (3)                 | (4)            | 0           | (2)           |
| iTraxx Europe Series 37 Index           | 1.000%     | 06/20/2027 | 900                 | (8)                 | (10)           | 0           | (2)           |
|   |            |            |                     | <b>\$ (14)</b>      | <b>\$ (19)</b> | <b>\$ 0</b> | <b>\$ (5)</b> |

## 金利スワップ

単位：千

| 支払/受取<br>変動金利   | 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<br>評価損益     | 変動証拠金       |               |
|-----------------|---------------------|--------|------------|-----------|----------------|-----------------|-------------|---------------|
|                 |                     |        |            |           |                |                 | 資産          | 負債            |
| 支払              | 3-Month USD-LIBOR   | 2.250% | 12/20/2022 | \$ 3,260  | \$ (7)         | \$ (101)        | \$ 1        | \$ 0          |
| 受取              | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7.205% | 04/22/2027 | ZAR 2,100 | 4              | 4               | 0           | 0             |
| 受取              | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7.210% | 04/22/2027 | ZAR 1,600 | \$ 3           | \$ 3            | \$ 0        | \$ 0          |
|                 |                     |        |            |           | <b>\$ 0</b>    | <b>\$ (94)</b>  | <b>\$ 1</b> | <b>\$ 0</b>   |
| <b>スワップ契約合計</b> |                     |        |            |           | <b>\$ (14)</b> | <b>\$ (113)</b> | <b>\$ 1</b> | <b>\$ (5)</b> |

- (1) 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.
- (2) 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.
- (3) The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

## ◎店頭金融デリバティブ商品

2022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 |           |            |           |             |
| BOA                | 07/2022 | ZAR  | 2,271 | \$   | 151     | \$ | 13        | \$         | 0         |             |
| BPS                | 07/2022 | GBP  | 360   |      |         |    | 16        |            | 0         |             |
| BPS                | 07/2022 | \$   | 2,740 | EUR  | 2,603   |    | 0         |            | (19)      |             |
| BPS                | 08/2022 | EUR  | 2,454 | \$   | 2,586   |    | 15        |            | 0         |             |
| BPS                | 08/2022 | GBP  | 360   |      |         |    | 0         |            | 0         |             |
| BPS                | 08/2022 | ZAR  | 9,052 |      |         |    | 17        |            | 0         |             |
| BPS                | 11/2022 |      | 2,443 |      |         |    | 4         |            | 0         |             |
| BRC                | 11/2022 |      | 1,772 |      |         |    | 4         |            | 0         |             |
| CBK                | 07/2022 | EUR  | 48    |      |         |    | 1         |            | 0         |             |
| DUB                | 02/2023 | ZAR  | 488   |      |         |    | 0         |            | 0         |             |
| GLM                | 09/2022 | \$   | 46    | HKD  | 357     |    | 0         |            | 0         |             |
| GLM                | 10/2022 | ZAR  | 3,839 | \$   | 244     |    | 12        |            | 0         |             |
| GLM                | 05/2023 |      | 858   |      |         |    | 1         |            | 0         |             |
| MBC                | 07/2022 | EUR  | 39    |      |         |    | 0         |            | 0         |             |
| SCX                | 07/2022 | ZAR  | 838   |      |         |    | 4         |            | 0         |             |
| SOG                | 07/2022 | EUR  | 2,516 |      | 2,704   |    | 74        |            | 0         |             |
| UAG                | 07/2022 | \$   | 65    | ZAR  | 1,041   |    | 0         |            | (1)       |             |
| UAG                | 09/2022 |      | 17    | HKD  | 129     |    | 0         |            | 0         |             |
| UAG                | 11/2022 | ZAR  | 946   | \$   | 58      |    | 1         |            | 0         |             |
| <b>外国為替先渡し契約合計</b> |         |      |       |      |         |    | <b>\$</b> | <b>162</b> | <b>\$</b> | <b>(20)</b> |

## ●売建オプション契約

クレジット・デフォルト・スワップション

単位：千

| 取引相手               | 銘柄                                  | プロテクションの<br>買い/売り | 行使金利   | 満期日        | 想定元本 <sup>(1)</sup> | プレミアム<br>(受取) | 市場価格          |
|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--------|------------|---------------------|---------------|---------------|
| BOA                | Put - iTraxx Europe Series 37 Index | 売り                | 1.400% | 08/17/2022 | 400                 | \$ (1)        | \$ (1)        |
| <b>売建オプション契約合計</b> |                                     |                   |        |            |                     | <b>\$ (1)</b> | <b>\$ (1)</b> |

## ●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－買い<sup>(2)</sup>

単位：千

| 取引相手 | 参照債務                                 | 固定(支払)<br>金利 | 満期日        | 2022/6/30時点の<br>信用スプレッド <sup>(4)</sup> | 想定元本 <sup>(5)</sup> | プレミアム<br>支払/(受取) | 未実現<br>評価損益 | スワップ契約時価 |      |
|------|--------------------------------------|--------------|------------|--|---------------------|------------------|-------------|----------|------|
|      |                                      |              |            |  |                     |                  |             | 資産       | 負債   |
| BOA  | Mexico Government International Bond | (1.000%)     | 12/20/2023 | 0.965%                                 | \$ 550              | \$ 9             | \$ (9)      | \$ 0     | \$ 0 |

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－売り<sup>(3)</sup>

単位：千

| 取引相手            | 参照債務                            | 固定受取<br>金利 | 満期日        | 2022/6/30時点の<br>信用スプレッド <sup>(4)</sup> | 想定元本 <sup>(5)</sup> | プレミアム<br>支払/(受取) | 未実現<br>評価損益   | スワップ契約時価    |                |
|-----------------|---------------------------------|------------|------------|--|---------------------|------------------|---------------|-------------|----------------|
|                 |                                 |            |            |  |                     |                  |               | 資産          | 負債             |
| BRC             | America Movil SAB de C.V.       | 1.000%     | 12/20/2025 | 1.222%                                 | \$ 400              | \$ (10)          | \$ 7          | \$ 0        | \$ (3)         |
| BRC             | QNB Finance Ltd.                | 1.000%     | 06/20/2023 | 0.609%                                 | 100                 | 1                | 0             | 1           | 0              |
| JPM             | State Oil Co. Of The Azerbaijan | 1.000%     | 12/20/2023 | 3.275%                                 | 300                 | (11)             | 1             | 0           | (10)           |
|                 |                                 |            |            |  |                     | \$ (20)          | \$ 8          | \$ 1        | \$ (13)        |
| <b>スワップ契約合計</b> |                                 |            |            |  |                     | <b>\$ (11)</b>   | <b>\$ (1)</b> | <b>\$ 1</b> | <b>\$ (13)</b> |

(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.

## PIMCOバミューダ・エマージング・マーケット・アンド・インフラストラクチャー・ボンド・ファンド(M)

## 運用計算書

2022年6月30日に終了した期間

(金額単位：千米ドル)

|                        |    |          |
|------------------------|----|----------|
| <b>収益：</b>             |    |          |
| 受取利息(外国税控除後)*          | \$ | 4,053    |
| 収益合計                   |    | 4,053    |
| <b>費用：</b>             |    |          |
| 支払利息                   |    | 0        |
| 雑費用                    |    | 0        |
| 費用合計                   |    | 0        |
| <b>純投資損益</b>           |    | 4,053    |
| 当期実現損益：                |    |          |
| 投資有価証券(外国税控除後)*        |    | 226      |
| 関連投資                   |    | 0        |
| 上場金融デリバティブ商品           |    | (210)    |
| 店頭金融デリバティブ商品           |    | 629      |
| 外貨通貨                   |    | 48       |
| 当期実現損益                 |    | 693      |
| <b>当期未実現評価損益：</b>      |    |          |
| 投資有価証券                 |    | (15,444) |
| 関連投資                   |    | 0        |
| 上場金融デリバティブ商品           |    | (82)     |
| 店頭金融デリバティブ商品           |    | 11       |
| 外貨建資産および負債             |    | (15)     |
| 当期未実現評価損益              |    | (15,530) |
| 当期実現および未実現評価損益         |    | (14,837) |
| <b>運用の結果による純資産の増減額</b> | \$ | (10,784) |
| * 外国税                  | \$ | 7        |



# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022年8月19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   | 本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、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。                                       |

**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 | 債券先物比率 | 純総資産額  |
|-----------------|--------|----|------|-------|--------|--------|
|                 |        | 騰落 | 中率   |       |        |        |
|                 | 円      |    | %    | %     | %      | 百万円    |
| 16期(2018年8月20日) | 10,206 |    | △0.0 | 38.7  | —      | 13,511 |
| 17期(2019年8月19日) | 10,205 |    | △0.0 | 59.3  | —      | 8,458  |
| 18期(2020年8月19日) | 10,203 |    | △0.0 | 68.2  | —      | 3,175  |
| 19期(2021年8月19日) | 10,200 |    | △0.0 | 60.1  | —      | 9,159  |
| 20期(2022年8月19日) | 10,199 |    | △0.0 | 57.5  | —      | 7,850  |

\*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

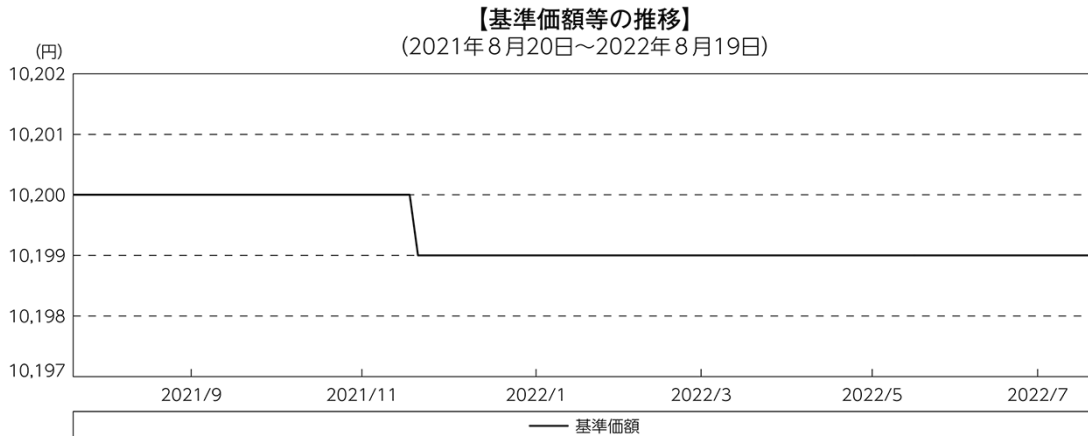
| 年月日                | 基準     | 価額 |      | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|----|------|-------|--------|
|                    |        | 騰落 | 率    |       |        |
| (期首)<br>2021年8月19日 | 円      |    | %    | %     | %      |
|                    | 10,200 |    | —    | 60.1  | —      |
| 8月末                | 10,200 |    | 0.0  | 56.8  | —      |
| 9月末                | 10,200 |    | 0.0  | 55.1  | —      |
| 10月末               | 10,200 |    | 0.0  | 51.6  | —      |
| 11月末               | 10,200 |    | 0.0  | 54.5  | —      |
| 12月末               | 10,199 |    | △0.0 | 52.1  | —      |
| 2022年1月末           | 10,199 |    | △0.0 | 57.1  | —      |
| 2月末                | 10,199 |    | △0.0 | 57.5  | —      |
| 3月末                | 10,199 |    | △0.0 | 59.5  | —      |
| 4月末                | 10,199 |    | △0.0 | 60.1  | —      |
| 5月末                | 10,199 |    | △0.0 | 62.0  | —      |
| 6月末                | 10,199 |    | △0.0 | 55.6  | —      |
| 7月末                | 10,199 |    | △0.0 | 53.7  | —      |
| (期末)<br>2022年8月19日 | 10,199 |    | △0.0 | 57.5  | —      |

\*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による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。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12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

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%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0~-0.05%程度で推移しました。

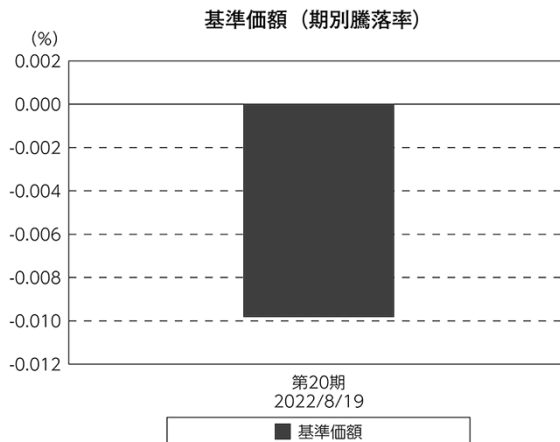
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

(2021年8月20日～2022年8月19日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2021年8月20日～2022年8月19日)

## 公社債

|    |                | 買付額             | 売付額                    |
|----|----------------|-----------------|------------------------|
| 国内 | 地方債証券          | 千円<br>4,055,682 | 千円<br>—<br>(4,600,000) |
|    | 特殊債券           | 7,031,417       | —<br>(6,457,000)       |
|    | 社債券（投資法人債券を含む） | 2,136,048       | —<br>(3,130,000)       |

\*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す。

\*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年8月20日～2022年8月19日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分  | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B |               | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |               |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |               | 百万円                | $\frac{B}{A}$ |           | 百万円                | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円<br>13,223 | 百万円<br>30          | %<br>0.2      | 百万円<br>—  | 百万円<br>—           | %<br>—        |

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。

(2022年8月19日現在)

## ○組入資産の明細

## 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BB格以下<br>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                       | %              | %                  | %         | %        | %              |
| 地方債証券               | 750,000<br>( 750,000)    | 750,520<br>( 750,520)    | 9.6<br>( 9.6)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 9.6<br>( 9.6)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 2,430,000<br>(2,430,000) | 2,431,889<br>(2,431,889) | 31.0<br>(31.0) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 31.0<br>(31.0) |
| 金融債券                | 530,000<br>( 530,000)    | 530,049<br>( 530,049)    | 6.8<br>( 6.8)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 6.8<br>( 6.8)  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 800,000<br>( 800,000)    | 800,923<br>( 800,923)    | 10.2<br>(10.2) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 10.2<br>(10.2) |
| 合 計                 | 4,510,000<br>(4,510,000) | 4,513,382<br>(4,513,382) | 57.5<br>(57.5) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 57.5<br>(57.5) |

\* ( )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                     | 柄                  | 当 期 末 |           |           |            |
|------------------------|--------------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                        |                    | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| <b>地方債証券</b>           |                    | %     | 千円        | 千円        |            |
| 東京都                    | 公募第711回            | 0.82  | 300,000   | 300,218   | 2022/9/20  |
| 福岡県                    | 公募平成24年度第4回        | 0.84  | 50,000    | 50,007    | 2022/8/24  |
| 千葉県                    | 公募平成24年度第5回        | 0.82  | 100,000   | 100,074   | 2022/9/22  |
| 共同発行市場地方債 公募第114回      |                    | 0.82  | 300,000   | 300,220   | 2022/9/22  |
| 小 計                    |                    |       | 750,000   | 750,520   |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>     |                    |       |           |           |            |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 財投機関債第96回          | 0.796 | 300,000   | 300,221   | 2022/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継      | 財投機関債第13回          | 2.28  | 150,000   | 150,305   | 2022/9/20  |
| 地方公共団体金融機構債券           | 第40回               | 0.825 | 110,000   | 110,101   | 2022/9/28  |
| 地方公共団体金融機構債券           | 第41回               | 0.801 | 100,000   | 100,146   | 2022/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券           | 第42回               | 0.801 | 40,000    | 40,086    | 2022/11/28 |
| 日本政策金融公庫社債             | 第30回財投機関債          | 0.825 | 300,000   | 300,456   | 2022/10/26 |
| 都市再生債券                 | 財投機関債第68回          | 0.854 | 200,000   | 200,159   | 2022/9/20  |
| 都市再生債券                 | 財投機関債第71回          | 0.767 | 200,000   | 200,131   | 2022/9/20  |
| 日本学生支援債券               | 財投機関債第60回          | 0.001 | 300,000   | 300,000   | 2022/9/20  |
| 日本学生支援債券               | 財投機関債第61回          | 0.001 | 100,000   | 100,000   | 2022/11/18 |
| 国際協力機構債券               | 第14回財投機関債          | 0.825 | 300,000   | 300,221   | 2022/9/20  |
| 東日本高速道路                | 第48回               | 0.09  | 100,000   | 100,032   | 2022/12/20 |
| 西日本高速道路                | 第37回               | 0.09  | 130,000   | 130,016   | 2022/9/20  |
| 西日本高速道路                | 第38回               | 0.09  | 100,000   | 100,010   | 2022/9/20  |
| 小 計                    |                    |       | 2,430,000 | 2,431,889 |            |
| <b>金融債券</b>            |                    |       |           |           |            |
| 商工債券                   | 利付第811回い号          | 0.17  | 30,000    | 30,018    | 2022/12/27 |
| しんきん中金債券               | 利付第333回            | 0.09  | 200,000   | 200,011   | 2022/8/26  |
| 商工債券                   | 利付(3年)第236回        | 0.02  | 300,000   | 300,019   | 2022/9/27  |
| 小 計                    |                    |       | 530,000   | 530,049   |            |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b> |                    |       |           |           |            |
| 伊藤忠商事                  | 第67回社債間限定同順位特約付    | 0.964 | 100,000   | 100,052   | 2022/9/9   |
| 東京三菱銀行                 | 第57回特定社債間限定同順位特約付  | 2.22  | 100,000   | 100,408   | 2022/10/27 |
| 三井不動産                  | 第46回社債間限定同順位特約付    | 0.964 | 200,000   | 200,063   | 2022/8/30  |
| 三菱地所                   | 第111回担保提供制限等財務上特約無 | 0.929 | 300,000   | 300,205   | 2022/9/14  |
| 電源開発                   | 第35回社債間限定同順位特約付    | 1.126 | 100,000   | 100,193   | 2022/10/20 |
| 小 計                    |                    |       | 800,000   | 800,923   |            |
| 合 計                    |                    |       | 4,510,000 | 4,513,382 |            |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 4,513,382 | 57.5  |
| コール・ローン等、その他 | 3,340,370 | 42.5  |
| 投資信託財産総額     | 7,853,752 | 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 (2022年8月19日現在)

| 項目              | 当期末<br>円       |
|-----------------|----------------|
| (A) 資産          | 7,853,752,692  |
| コール・ローン等        | 3,326,621,034  |
| 公社債(評価額)        | 4,513,382,357  |
| 未収利息            | 7,215,305      |
| 前払費用            | 6,533,996      |
| (B) 負債          | 3,470,854      |
| 未払解約金           | 3,470,000      |
| 未払利息            | 854            |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 7,850,281,838  |
| 元本              | 7,697,164,972  |
| 次期繰越損益金         | 153,116,866    |
| (D) 受益権総口数      | 7,697,164,972口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,199円        |

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

## ○損益の状況 (2021年8月20日～2022年8月19日)

| 項目             | 当期<br>円      |
|----------------|--------------|
| (A) 配当等収益      | 23,315,784   |
| 受取利息           | 23,990,043   |
| 支払利息           | △ 674,259    |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 24,456,523 |
| 売買損            | △ 24,456,523 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 1,140,739  |
| (D) 前期繰越損益金    | 179,893,174  |
| (E) 追加信託差損益金   | 63,852,596   |
| (F) 解約差損益金     | △ 89,488,165 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 153,116,866  |
| 次期繰越損益金(G)     | 153,116,866  |

\*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<br>元本額<br>円 |
|--|-----------------|
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用) | 1,997,050,289   |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用) | 1,941,761,887   |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用) | 1,503,668,510   |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用) | 1,248,281,712   |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーパブル・ファンド)             | 441,709,194     |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付) | 188,174,367     |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーパブル・ファンド)              | 128,372,175     |
| 野村DC運用戦略ファンド                           | 85,180,134      |
| 野村世界高金利通貨投信                            | 34,318,227      |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                     | 7,492,405       |
| ネクストコア                                 | 2,282,012       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型         | 984,834         |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型     | 984,834         |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型     | 984,834         |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型        | 984,834         |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型    | 984,834         |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型    | 984,834         |
| 野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型                 | 984,543         |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型             | 984,543         |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型             | 984,543         |
| 野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型                | 984,543         |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型            | 984,543         |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型            | 984,543         |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型         | 984,252         |

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額<br>円 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型      | 984,252         |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型  | 984,252         |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型       | 984,252         |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型     | 984,252         |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 984,252         |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型            | 983,768         |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型            | 983,768         |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型               | 983,768         |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型           | 983,768         |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型           | 983,768         |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型              | 983,672         |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型          | 983,672         |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型          | 983,672         |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型             | 983,672         |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型         | 983,672         |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型         | 983,672         |
| 野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース              | 983,381         |
| 野村テンプレートン・トータル・リターン Cコース              | 983,381         |
| 野村テンプレートン・トータル・リターン Dコース              | 983,381         |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型           | 983,091         |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型      | 983,091         |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型          | 983,091         |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型     | 983,091         |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型           | 982,898         |



| ファンド名                                | 当期末     |
|--------------------------------------|---------|
|                                      | 元本額     |
|                                      | 円       |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型     | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型  | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型         | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型    | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,898 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型                | 982,801 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)          | 982,609 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)             | 982,609 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)           | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型               | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型           | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型           | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型          | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型          | 982,609 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型      | 982,609 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型  | 982,609 |
| 野村新世界高金利通貨投信                         | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型           | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型         | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型     | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型    | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型       | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型        | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型    | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型             | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型         | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型              | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型            | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型        | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型          | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型          | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型        | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型    | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型   | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型      | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型   | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型             | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型       | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型     | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型            | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型      | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型          | 982,608 |
| 野村アジアCB投信(毎月分配型)                     | 982,608 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型  | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型          | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型     | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型         | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型    | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型           | 982,607 |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型           | 982,607 |
| 野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型           | 982,607 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型      | 982,607 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型  | 982,607 |
| 野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型        | 982,415 |
| 野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型            | 982,415 |
| 野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型       | 982,415 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型         | 982,029 |

| ファンド名                                | 当期末     |
|--------------------------------------|---------|
|                                      | 元本額     |
|                                      | 円       |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型    | 982,029 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型        | 982,029 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型   | 982,029 |
| 野村カルミニャック・ファンド Aコース                  | 981,547 |
| 野村カルミニャック・ファンド Bコース                  | 981,547 |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型             | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型            | 981,451 |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型                 | 981,451 |
| 野村エマージング債券プレミアム年2回決算型                | 981,451 |
| ノムラ THE USA Aコース                     | 981,258 |
| ノムラ THE USA Bコース                     | 981,258 |
| 野村グローバルボンド投信 Bコース                    | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース                    | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース                    | 980,489 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型        | 980,297 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型     | 980,297 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型       | 980,297 |
| グローバル・ストック Bコース                      | 979,528 |
| グローバル・ストック Dコース                      | 979,528 |
| 野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型          | 626,503 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型               | 491,401 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型         | 398,357 |
| 野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型         | 373,897 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型             | 177,539 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型          | 149,947 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型            | 132,547 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型           | 123,377 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型        | 100,946 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型     | 98,262  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型         | 98,261  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)毎月分配型         | 98,261  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型          | 98,261  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型        | 98,261  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型      | 98,261  |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型        | 98,261  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型         | 98,261  |
| 野村新米国ハイ・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  | 98,261  |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型           | 98,261  |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型      | 98,261  |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型          | 98,261  |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型    | 98,261  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型     | 98,261  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型     | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 98,261  |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型               | 98,261  |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース              | 98,261  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 98,261  |
| 野村米国ハイ・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   | 98,260  |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型       | 98,260  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型       | 98,260  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型     | 98,260  |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型          | 98,260  |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース                    | 98,049  |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース                    | 98,049  |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース                    | 98,049  |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース                 | 98,020  |

| ファンド名                            | 当期末    |
|----------------------------------|--------|
|                                  | 元本額    |
|                                  | 円      |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース             | 98,020 |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース          | 98,011 |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース          | 98,011 |
| (年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)         | 98,001 |
| (年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)         | 98,001 |
| グローバル・ストック Aコース                  | 97,953 |
| グローバル・ストック Cコース                  | 97,953 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型     | 63,772 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型     | 48,092 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型        | 41,054 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型   | 27,600 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型         | 23,859 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型      | 18,851 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型  | 14,308 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型    | 13,741 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)            | 10,000 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型    | 9,826  |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型 | 9,826  |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース        | 9,818  |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース        | 9,818  |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型         | 9,809  |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型      | 9,809  |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型        | 9,809  |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型    | 9,808  |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型   | 9,808  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型  | 9,808  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 9,808  |

| ファンド名                                    | 当期末   |
|--|-------|
|  | 元本額   |
|  | 円     |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型                 | 9,807 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型                | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型        | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型       | 9,807 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型            | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型         | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型           | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型        | 9,805 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型              | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型             | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型        | 9,803 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)                 | 9,801 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)         | 9,801 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型      | 9,797 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型     | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Aコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Bコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Cコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Dコース                  | 9,797 |
| 野村ファンドラップ債券プレミア                          | 9,795 |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア                     | 9,795 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)      | 9,794 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)      | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型                | 3,114 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型                 | 966   |

## 〇お知らせ

該当事項はございません。