

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／内外／債券	
信託期間	2027年10月20日まで（2017年10月2日設定）	
運用方針	円建ての外国投資信託であるピムコ パミューダ インカム ファンド A - クラス Y (USD) の投資信託証券への投資を通じて、主として世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等に投資を行います。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）	ピムコ パミューダ インカム ファンド A - クラス Y (USD) およびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	ピムコ パミューダ インカム ファンド A - クラス Y (USD)	ピムコ パミューダ インカム ファンド (M) への投資を通じて、世界の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

ピムコ・インカム・ストラテジー・ ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)



第68期（決算日：2023年5月22日）
 第69期（決算日：2023年6月20日）
 第70期（決算日：2023年7月20日）
 第71期（決算日：2023年8月21日）
 第72期（決算日：2023年9月20日）
 第73期（決算日：2023年10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。
 さて、お手持ちの「ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）」は、去る10月20日に第73期の決算を行いましたので、法令に基づいて第68期～第73期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
 フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱の販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 中 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
44期(2021年5月20日)	9,953	20	0.7	—	—	99.2	2,073
45期(2021年6月21日)	10,116	20	1.8	—	—	99.0	2,069
46期(2021年7月20日)	10,047	20	△0.5	—	—	96.7	2,032
47期(2021年8月20日)	10,074	20	0.5	—	—	99.0	1,973
48期(2021年9月21日)	10,092	20	0.4	—	—	99.3	2,002
49期(2021年10月20日)	10,490	20	4.1	—	—	98.3	2,098
50期(2021年11月22日)	10,404	20	△0.6	—	—	99.0	1,916
51期(2021年12月20日)	10,309	20	△0.7	—	—	99.0	1,833
52期(2022年1月20日)	10,312	20	0.2	—	—	99.0	1,763
53期(2022年2月21日)	10,257	20	△0.3	—	—	99.5	1,715
54期(2022年3月22日)	10,195	20	△0.4	—	—	99.3	1,669
55期(2022年4月20日)	10,835	20	6.5	—	—	99.0	4,179
56期(2022年5月20日)	10,478	20	△3.1	—	—	99.0	4,080
57期(2022年6月20日)	10,825	20	3.5	—	—	98.8	4,449
58期(2022年7月20日)	11,105	20	2.8	—	—	99.6	4,772
59期(2022年8月22日)	11,294	20	1.9	—	—	99.2	4,892
60期(2022年9月20日)	11,540	20	2.4	—	—	99.0	5,935
61期(2022年10月20日)	11,604	20	0.7	—	—	99.1	6,583
62期(2022年11月21日)	11,134	20	△3.9	—	—	98.9	6,874
63期(2022年12月20日)	11,046	20	△0.6	—	—	100.4	7,167
64期(2023年1月20日)	10,554	20	△4.3	—	—	98.8	7,380
65期(2023年2月20日)	10,874	20	3.2	—	—	99.4	8,018
66期(2023年3月20日)	10,663	20	△1.8	—	—	98.7	8,207
67期(2023年4月20日)	10,877	20	2.2	—	—	99.2	8,812
68期(2023年5月22日)	11,174	20	2.9	—	—	98.6	9,493
69期(2023年6月20日)	11,496	20	3.1	—	—	99.1	11,068
70期(2023年7月20日)	11,475	20	△0.0	—	—	99.0	13,393
71期(2023年8月21日)	11,773	20	2.8	—	—	99.2	14,423
72期(2023年9月20日)	12,013	20	2.2	—	—	99.3	15,939
73期(2023年10月20日)	11,827	20	△1.4	—	—	98.9	16,370

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの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。

(注) 当ファンドは親投資信託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。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比	投 資 信 託 証 券 率
第68期	(期 首) 2023年4月20日	円 10,877	% -		% -		% -		% 99.2	
	4月末	10,869	△0.1		-		-		99.0	
	(期 末) 2023年5月22日	11,194	2.9		-		-		98.6	
第69期	(期 首) 2023年5月22日	11,174	-		-		-		98.6	
	5月末	11,242	0.6		-		-		100.4	
	(期 末) 2023年6月20日	11,516	3.1		-		-		99.1	
第70期	(期 首) 2023年6月20日	11,496	-		-		-		99.1	
	6月末	11,756	2.3		-		-		99.0	
	(期 末) 2023年7月20日	11,495	△0.0		-		-		99.0	
第71期	(期 首) 2023年7月20日	11,475	-		-		-		99.0	
	7月末	11,555	0.7		-		-		99.0	
	(期 末) 2023年8月21日	11,793	2.8		-		-		99.2	
第72期	(期 首) 2023年8月21日	11,773	-		-		-		99.2	
	8月末	11,925	1.3		-		-		99.6	
	(期 末) 2023年9月20日	12,033	2.2		-		-		99.3	
第73期	(期 首) 2023年9月20日	12,013	-		-		-		99.3	
	9月末	12,019	0.0		-		-		99.3	
	(期 末) 2023年10月20日	11,847	△1.4		-		-		98.9	

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託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。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

第68期～第73期：2023年4月21日～2023年10月20日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第 68 期 首	10,877円
第 73 期 末	11,827円
既払分配金	120円
騰 落 率	9.9%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ9.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

> 基準価額の主な変動要因

上昇要因

債券利子収入を享受したこと。
米ドルが対円で上昇したこと。

下落要因

信託報酬等の運用上の費用がかかったこと。
米国金利が上昇したこと。

第68期～第73期：2023年4月21日～2023年10月20日

投資環境について

▶ 債券市況

米国債券市況は下落しました。

米連邦準備制度理事会（F R B）による金融引き締め長期化観測が強まったことなどを背景に、期間を通じてみると米国の長期金利は上昇し、米国債券市況は下落しました。

スプレッド（国債に対する上乘せ金利）セクターにおいては、スプレッドが縮小したことはプラスなどに寄与したものの、米国金利が上昇したことなどがマイナスに影響し、米国ハイイールド社債、新興国債券は共に下落しました。

▶ 為替市況

期間を通じてみると円安・米ドル高となりました。

F R B が利上げを継続すると共に早期の利下げ観測をけん制したことなどを受けて米国金利が大きく上昇したことから、円安・米ドル高が進行しました。また、米国の消費や労働市場の底堅さを示す経済指標の発表が相次いだことも要因となり、期間を通じてみると円安・米ドル高となりました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足元のコール・レートは-0.010%となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド <為替ヘッジなし>（毎月決算型）

主として円建て外国投資信託であるピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD) への投資を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

▶ ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD)

世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債およびそれらの派生商品を高位に組み入れる運用を行いました。

金利戦略

適切な金利リスク量を見極め、市場環境に応じて機動的に調整しました。当期間においては、金融引き締め長期化観測が強まっている米国について、中期年限の金利リスクを中心に積み増しを行いました。一方で、相対的に投資妙味に欠けると判断した日本の金利リスクは売り持ちとしています。そのほか、米非政府系住

宅ローン担保証券などの変動利付債券を組み入れることで、金利上昇に対する耐性を確保しています。

セクター配分戦略

米政府関連債や米政府系住宅ローン担保証券といったリスクオフ時に底堅い値動きが期待出来る債券を組み入れポートフォリオの高い安定性を維持しています。社債についてはファンダメンタルズの健全な発行体を選好して投資を行い、また、長年にわたる住宅価格の上昇から恩恵を受ける米非政府系住宅ローン担保証券への投資を継続しております。また、利回りが相対的に高い新興国債券については、南アフリカやメキシコ等へ投資を継続しています。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド コール・ローン等短期金融商品を活用し、 利子等収益の確保を図りました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの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。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。なお、信託約款の規定に従い第2期までの収益分配は行いません。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第68期 2023年4月21日～ 2023年5月22日	第69期 2023年5月23日～ 2023年6月20日	第70期 2023年6月21日～ 2023年7月20日	第71期 2023年7月21日～ 2023年8月21日	第72期 2023年8月22日～ 2023年9月20日	第73期 2023年9月21日～ 2023年10月20日
当期分配金 （対基準価額比率）	20 (0.179%)	20 (0.174%)	20 (0.174%)	20 (0.170%)	20 (0.166%)	20 (0.169%)
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	－	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	2,356	2,394	2,432	2,552	2,778	2,814

（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。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド <為替ヘッジなし>（毎月決算型）

円建て外国投資信託への投資を通じて世界（新興国を含みます。）の幅広い種類の公社債およびそれらの派生商品を高位に組み入れた運用を行います。また、一部、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券の組み入れを維持し、毎月の分配をめざしていく方針です。

▶ ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD)

先進国では足元の景気に底堅さがみられるものの、これまでの金融引き締めによる影響が徐々に波及することで、2024年の景気は減速する可能性が高いとみております。なお、欧米の中央銀行による金融引き締めは最終局面に近いとみていますが、インフレ率が中央銀行の目標水準

まで低下するには時間を要すると想定されることから、利下げは慎重に進められるものと考えられます。米国については、コロナショックにより停滞がみられたサプライチェーンの改善が引き続きインフレ圧力の緩和に繋がる一方、生産性が大幅に改善しない限り、労働市場のひっ迫などによる賃金への上昇圧力を背景にインフレ率は米連邦準備制度理事会（FRB）の目標水準を上回って推移する可能性が高いとみています。ユーロ圏については、クレディ・スイス救済時にスイス当局が普通株より先にAT1債を無価値化するという対応を行ったことを背景に、今後の金融機関の資本調達コストが上昇し、域内における融資が縮小することなどが想定され、景気の重しになるとみています。

かかる環境下、投資においては引き続き慎重なリスク管理が求められると考えており、投資の元本保全を意識しつつ、魅力的な水準のインカム収入を獲得していくことは、中長期的にも引き続き重要なテーマであると考えています。

運用戦略としては、リスク取得に過度に傾斜しない投資指針を通じ、市場が軟調となる局面において下値を抑制すると共に、確信度の高いボトムアップの投資アイデアに基づく魅力的な投資機会の発掘に取り組んでいます。当戦略は、質の良い高利回り資産を中心とする「攻め」の

資産と、リスクオフ時にポートフォリオを安定化させる「守り」の資産のバランスを重視し、「良質なインカム」を着実に積み上げることで、引き続き元本の保全と安定的なインカムの提供を目指していきます。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2023年4月21日～2023年10月20日

1万口当たりの費用明細

項目	第68期～第73期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	107	0.923	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(59)	(0.511)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(46)	(0.395)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	107	0.925	

作成期中の平均基準価額は、11,591円です。

(注) 作成期間の費用（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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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。

(注) 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。

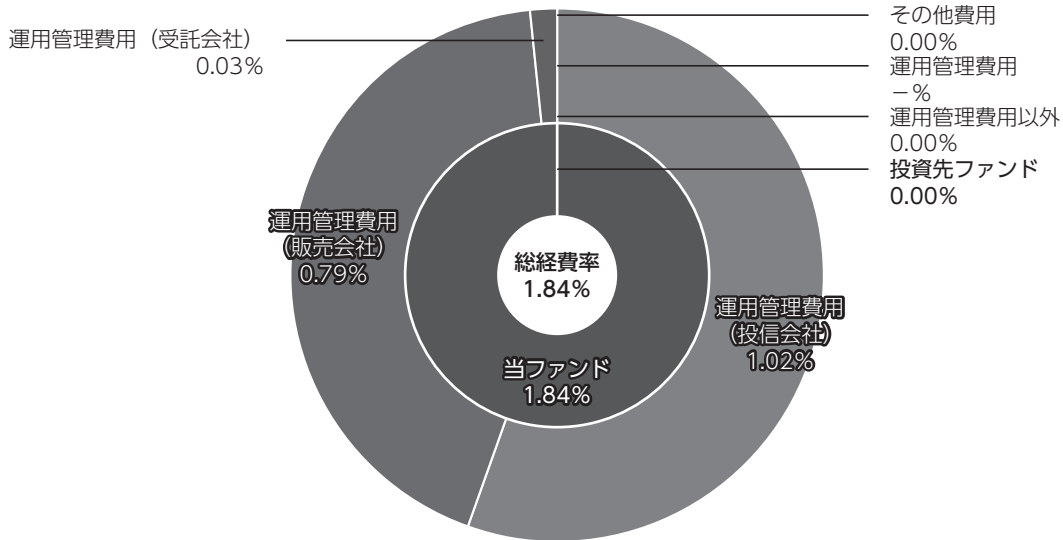
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(注) 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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.84%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.84
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.84
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.00

(注) ①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、この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) ①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) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

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

○売買及び取引の状況

(2023年4月21日～2023年10月20日)

投資信託証券

銘柄		第68期～第73期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ バリューストック インカム ファンド A - クラスY (USD)	千口 630	千円 6,795,644	千口 -	千円 -

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第68期～第73期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 7,062	千円 7,190	千口 -	千円 -

○利害関係人との取引状況等

(2023年4月21日～2023年10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10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		第67期末		第73期末		
		口数	金額	口数	評価額	比率
	ピムコ バリューストック インカム ファンド A - クラスY (USD)	千口 861	千円 1,491	千口 16,192,136	千円 16,192,136	% 98.9
	合計	861	1,491	16,192,136	16,192,136	98.9

(注) 比率はピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄		第67期末		第73期末	
		口数	金額	口数	評価額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 5,990	千円 13,053	千口 13,053	千円 13,289

○投資信託財産の構成

（2023年10月20日現在）

項 目	第73期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 16,192,136	% 98.5
マネー・マーケット・マザーファンド	13,289	0.1
コール・ローン等、その他	234,271	1.4
投資信託財産総額	16,439,696	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第68期末	第69期末	第70期末	第71期末	第72期末	第73期末
	2023年5月22日現在	2023年6月20日現在	2023年7月20日現在	2023年8月21日現在	2023年9月20日現在	2023年10月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	9,530,274,373	11,103,239,423	13,516,459,352	14,490,005,608	16,104,782,213	16,439,696,446
コール・ローン等	162,657,439	128,522,394	238,298,067	166,286,937	261,323,239	234,270,740
投資信託受益証券(評価額)	9,361,517,508	10,968,617,603	13,264,871,858	14,310,429,244	15,830,169,547	16,192,136,279
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	6,099,426	6,099,426	13,289,427	13,289,427	13,289,427	13,289,427
(B) 負債	36,590,062	34,994,367	122,735,421	66,096,333	165,307,093	69,141,232
未払金	—	—	79,900,000	—	115,700,000	—
未払収益分配金	16,991,818	19,256,594	23,344,428	24,502,666	26,537,379	27,682,620
未払解約金	4,836,130	1,013,021	—	19,001,214	—	16,823,935
未払信託報酬	14,735,596	14,698,210	19,455,799	22,551,818	23,028,119	24,590,694
未払利息	214	310	463	377	481	82
その他未払費用	26,304	26,232	34,731	40,258	41,114	43,901
(C) 純資産総額(A-B)	9,493,684,311	11,068,245,056	13,393,723,931	14,423,909,275	15,939,475,120	16,370,555,214
元本	8,495,909,464	9,628,297,365	11,672,214,040	12,251,333,417	13,268,689,951	13,841,310,247
次期繰越損益金	997,774,847	1,439,947,691	1,721,509,891	2,172,575,858	2,670,785,169	2,529,244,967
(D) 受益権総口数	8,495,909,464口	9,628,297,365口	11,672,214,040口	12,251,333,417口	13,268,689,951口	13,841,310,247口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,174円	11,496円	11,475円	11,773円	12,013円	11,827円

○損益の状況

項 目	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期
	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日	2023年9月21日～ 2023年10月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	51,851,946	57,920,106	85,594,308	89,851,164	97,328,639	101,236,631
受取配当金	51,858,501	57,930,705	85,607,204	89,863,389	97,341,198	101,242,996
受取利息	—	—	278	25	389	544
支払利息	△ 6,555	△ 10,599	△ 13,174	△ 12,250	△ 12,948	△ 6,909
(B) 有価証券売買損益	228,434,219	268,601,320	△ 97,862,645	307,907,692	250,926,777	△ 303,266,862
売買益	228,700,029	268,899,706	197,786	310,478,644	251,761,990	497,711
売買損	△ 265,810	△ 298,386	△ 98,060,431	△ 2,570,952	△ 835,213	△ 303,764,573
(C) 信託報酬等	△ 14,761,900	△ 14,724,442	△ 19,490,530	△ 22,592,076	△ 23,069,233	△ 24,634,595
(D) 当期損益金(A+B+C)	265,524,265	311,796,984	△ 31,758,867	375,166,780	325,186,183	△ 226,664,826
(E) 前期繰越損益金	77,396,107	323,950,163	611,984,700	550,608,784	895,209,773	1,188,938,531
(F) 追加信託差損益金	671,846,293	823,457,138	1,164,628,486	1,271,302,960	1,476,926,592	1,594,653,882
(配当等相当額)	(1,307,405,117)	(1,579,521,400)	(2,075,144,660)	(2,225,927,213)	(2,493,196,953)	(2,658,291,852)
(売買損益相当額)	(△ 635,558,824)	(△ 756,064,262)	(△ 910,516,174)	(△ 954,624,253)	(△1,016,270,361)	(△1,063,637,970)
(G) 計(D+E+F)	1,014,766,665	1,459,204,285	1,744,854,319	2,197,078,524	2,697,322,548	2,556,927,587
(H) 収益分配金	△ 16,991,818	△ 19,256,594	△ 23,344,428	△ 24,502,666	△ 26,537,379	△ 27,682,620
次期繰越損益金(G+H)	997,774,847	1,439,947,691	1,721,509,891	2,172,575,858	2,670,785,169	2,529,244,967
追加信託差損益金	671,846,293	823,457,138	1,164,628,486	1,271,302,960	1,476,926,592	1,594,653,882
(配当等相当額)	(1,307,405,117)	(1,579,521,400)	(2,075,144,658)	(2,225,927,213)	(2,493,196,953)	(2,658,291,852)
(売買損益相当額)	(△ 635,558,824)	(△ 756,064,262)	(△ 910,516,172)	(△ 954,624,253)	(△1,016,270,361)	(△1,063,637,970)
分配準備積立金	694,366,651	726,203,175	763,654,730	901,272,898	1,193,858,577	1,237,857,885
繰越損益金	△ 368,438,097	△ 109,712,622	△ 206,773,325	—	—	△ 303,266,800

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (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。

(注) (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。

<注記事項>

- ① 作成期首(前作成期末)元本額 8,102,148,522円
 作成期中追加設定元本額 6,184,242,036円
 作成期中一部解約元本額 445,080,311円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1,1827円です。

② 分配金の計算過程

項 目	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日	2023年9月21日～ 2023年10月20日
費用控除後の配当等収益額	49,120,937円	55,307,931円	66,103,713円	84,747,433円	90,880,645円	76,601,974円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	85,975,083円	234,305,538円	—円
収益調整金額	1,307,405,117円	1,579,521,400円	2,075,144,658円	2,225,927,213円	2,493,196,953円	2,658,291,852円
分配準備積立金額	662,237,532円	690,151,838円	720,895,445円	755,053,048円	895,209,773円	1,188,938,531円
当ファンドの分配対象収益額	2,018,763,586円	2,324,981,169円	2,862,143,816円	3,151,702,777円	3,713,592,909円	3,923,832,357円
1万口当たり収益分配対象額	2,376円	2,414円	2,452円	2,572円	2,798円	2,834円
1万口当たり分配金額	20円	20円	20円	20円	20円	20円
収益分配金総額	16,991,818円	19,256,594円	23,344,428円	24,502,666円	26,537,379円	27,682,620円

③ 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の60以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期
1 万口当たり分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

<参考> 投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ピムコ バミューダ インカム ファンド A - クラスY (USD)
運用方針	ピムコ バミューダ インカム ファンド (M) への投資を通じて、世界（新興国を含みます。以下同じ。）の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等に投資を行い、利子収益の確保および長期的な値上がり益の獲得をめざします。
主要運用対象	世界の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、総資産の 65%以上を世界の幅広い種類の公社債等およびそれらの派生商品等に投資します。 ・ 投資適格未満の公社債等への投資比率は総資産の 50%以内とします。ただし、資産担保証券およびモーゲージ証券についてはこの限りではありません。 ・ ポートフォリオの平均デュレーション[※]は、原則として0～8年の範囲で調整します。 <small>※デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいくほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。</small> ・ 米ドル以外の通貨エクスポージャーを総資産の 10%以内とします。 ・ 新興国の発行体が発行する銘柄への投資は総資産の 20%以内とします。 ・ 保有外貨建て資産に対し、原則として、為替ヘッジを行いません。
決算日	毎年 10 月 31 日
分配方針	原則として毎月分配を行う方針です。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Bermuda Trust II Annual Report October 31, 2022版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、各通貨毎のクラス分けされていないものは「ピムコ バミューダ インカム ファンド A」で掲載しています。また、「ピムコ バミューダ インカム ファンド (M)」を「マスターファンド」と表示する場合があります。

(1) 運用計算書

ピムコ バミューダ インカム ファンド A (2022年10月31日に終了する期間)

	ピムコ インカム	バミューダ ファンド A
	千米ドル	
投資収入：		
受取利息（外国税額控除後*）		3,963
受取配当金（外国税額控除後*）		0
雑収入		0
収入合計		3,963
費用：		
顧問料		0
顧問料W(USD)		188
管理報酬M(JPY アドバイザー)		547
管理報酬M(USD アドバイザー)		332
管理報酬P(JPY)		241
管理報酬R(USD)		93 ⁽¹⁾
管理報酬T(JPY)		5,769
管理報酬U(USD)		83 ⁽²⁾
管理報酬U2(JPY)		214 ⁽³⁾
管理報酬X(JPY)		30
管理事務費		0
管理事務費R(USD)		29 ⁽¹⁾
管理事務費W(USD)		58
販売報酬M(JPY アドバイザー)		474
販売報酬M(USD アドバイザー)		288
販売報酬P(JPY)		241
代行費用M(JPY アドバイザー)		37
代行費用M(USD アドバイザー)		22
支払利息		133
雑費		12
費用合計		8,791
投資純収入		(4,828)
実現純利益（損失）：		
投資有価証券		0
マスターファンド		440,185
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		(2,074,947)
外貨		(2,481)
実現純利益（損失）		(1,637,243)
未実現評価益（評価損）の純変動：		
投資有価証券		(1)
マスターファンド		(1,752,599)
為替取引、中央清算金融派生商品		0
店頭金融派生商品		(4,806)
外貨建資産および負債の換算に係る外貨		(100)
未実現評価益（評価損）の純変動		(1,757,506)
純利益（損失）		(3,394,749)
運用による純資産の純増（減）額		(3,399,577)
*外国税源泉徴収		0

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

⁽¹⁾ 2022年1月21日（設定）から2022年10月31日までの期間。

⁽²⁾ 2021年11月1日から2022年2月10日までの期間（終了）。

⁽³⁾ 2022年2月3日（設定）から2022年10月31日までの期間。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ バミューダ インカム ファンド A
(2022年10月31日に終了する期間)

ピムコ バミューダ
インカム ファンド A
千米ドル

純資産の増加（減少）：

運用：

投資純収入	(4, 828)
実現純利益（損失）	(1, 637, 243)
未実現評価益（評価損）の純変動	(1, 757, 506)
運用による純資産の純増（減）額	(3, 399, 577)

分配：

F (JPY)	(38, 633)
F (USD)	(86, 845)
J (JPY)	(10, 837)
J (USD)	(3, 870)
N (JPY)	(290, 646)
N (USD)	(141, 816)
NN (USD)	(5, 403)
P (JPY)	(349)
Q (JPY)	0
R (JPY)	0
R (USD)	0 ⁽¹⁾
S (JPY)	(5, 933)
U (USD)	(811) ⁽²⁾
U2 (JPY)	0 ⁽³⁾
X (JPY)	0
X (USD)	(5, 656)
Y (JPY)	(8, 330)
Y (USD)	(12, 662)
分配金額合計	(611, 791)

ファンドユニット取引：

ファンドユニット取引による純資産の純増（減）額	1, 051, 973
-------------------------	-------------

純資産の増（減）額合計

(2, 959, 395)

純資産：

期首	12, 875, 599
期末	9, 916, 204

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入してあります。

⁽¹⁾ 2022年1月21日（設定）から2022年10月31日までの期間。

⁽²⁾ 2021年11月1日から2022年2月10日までの期間（終了）。

⁽³⁾ 2022年2月3日（設定）から2022年10月31日までの期間。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)

(A) ピムコ バミューダ インカム ファンド A

(2022年10月31日現在)

元本 時価
(単位:千) (単位:千)

INVESTMENTS IN SECURITIES 4.7%		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 4.7%		
TIME DEPOSITS 4.7%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	\$ 72,714	\$ 72,714
Bank of Nova Scotia		
2.580% due 11/01/2022	5,987	5,987
Brown Brothers Harriman & Co.		
2.580% due 11/01/2022	39	39
Citibank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	60,870	60,870
DBS Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	37,928	37,928
JPMorgan Chase Bank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	81,160	81,160
Royal Bank of Canada		
2.580% due 11/01/2022	80,362	80,362
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
2.580% due 11/01/2022	61,645	61,645
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	62,794	62,794
		<u>463,499</u>
U.S. TREASURY BILLS 0.0%		
2.552% due 11/10/2022 (a)	2,825	2,823
U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS 0.0%		
3.278% due 01/10/2023 (a)	1,720	1,707
Total Short-Term Instruments		<u>468,029</u>
(Cost \$468,031)		
Total Investments in Securities		<u>468,029</u>
(Cost \$468,031)		
	口数	
	(単位:千)	
INVESTMENTS IN AFFILIATES 95.8%		
OTHER INVESTMENT COMPANIES 95.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
(Cost \$9,636,026)	682,263	9,497,093
Total Investments in Affiliates		<u>9,497,093</u>
(Cost \$9,636,026)		
Total Investments 100.5%		<u>\$ 9,965,122</u>
(Cost \$10,104,057)		
Financial Derivative		
Instruments (b) (2.0%)		(197,302)
(Cost or Premiums, net \$0)		
Other Assets and Liabilities, net 1.5%		<u>148,384</u>
Net Assets 100.0%		<u>\$ 9,916,204</u>

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
(a) Coupon represents a yield to maturity.

(b) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益		
				資産	負債	
BPS	11/2022	JPY 106,684	\$ 728	\$ 10	\$	0
BPS	11/2022	899,743	6,163	109		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BPS	11/2022	\$ 1,379	JPY 201,334	\$ 0	\$ (25)
BPS	11/2022	0	0	0	0
BPS	11/2022	933	136,228	0	(16)
MBC	11/2022	JPY 844,346	\$ 5,725	44	0
MBC	11/2022	38,092	258	2	0
MYI	11/2022	1,072,662	7,218	0	0
MYI	11/2022	\$ 253	JPY 37,641	0	0
				\$ 165	\$ (41)

F (JPY), J (JPY), M (JPY Advisory), N (JPY), P (JPY), Q (JPY), R (JPY), S (JPY), T (JPY), U2 (JPY), X (JPY), Y (JPY) AND Z (JPY) CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BDA	11/2022	JPY 874,671	\$ 5,984	\$ 99	\$ 0
BDA	11/2022	\$ 2,687	JPY 399,465	1	0
CBK	11/2022	JPY 10,974,574	\$ 75,552	1,716	0
CBK	11/2022	\$ 11,727	JPY 1,750,671	52	0
JPM	11/2022	JPY 210,644,904	\$ 1,435,595	18,400	0
JPM	12/2022	\$ 1,435,595	JPY 209,941,463	0	(18,442)
MBC	11/2022	JPY 253,278,894	\$ 1,723,284	19,251	0
MBC	11/2022	\$ 2,456,288	JPY 354,314,651	0	(72,498)
MBC	12/2022	1,439,739	211,607,321	0	(11,341)
MYI	11/2022	JPY 93,706	\$ 630	0	0
MYI	11/2022	\$ 1,013,884	JPY 146,309,231	0	(29,532)
RBC	11/2022	398,620	57,546,962	0	(11,450)
RBC	12/2022	JPY 334,137	\$ 2,275	20	0
SCX	11/2022	65,277,116	438,841	0	0
SCX	12/2022	\$ 438,481	JPY 65,010,705	0	0
SDG	11/2022	JPY 221,942,790	\$ 1,496,893	3,686	0
SDG	12/2022	\$ 1,496,893	JPY 221,204,896	0	(3,709)
SSB	11/2022	JPY 57,631,197	\$ 387,413	0	(323)
SSB	12/2022	\$ 387,413	JPY 57,440,745	325	0
TOR	11/2022	JPY 134,818,267	\$ 912,952	5,909	0
TOR	12/2022	\$ 912,952	JPY 134,369,643	0	(5,926)
UAG	11/2022	2,901,337	417,318,500	0	(93,664)
				\$ 49,459	\$ (246,885)
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 49,624	\$ (246,926)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
14.730% due 04/24/2024	RUB 5,057,901	\$ 40,988
Serbia Government International Bond		
1.650% due 03/03/2033	EUR 4,900	2,877
3.125% due 05/15/2027		4,434
South Africa Government International Bond		
8.000% due 01/31/2030	ZAR 61,300	2,865
8.250% due 03/31/2032		3,285
8.750% due 02/28/2048		34,700
8.875% due 02/28/2035		52,400
10.500% due 12/21/2026		2,153,900
State Agency of Roads of Ukraine		
6.250% due 06/24/2030 (h)	\$ 1,200	181
Turkey Government International Bond		
4.250% due 03/13/2025		30,894
5.250% due 03/13/2030		29,000
6.125% due 10/24/2028		10,100
7.625% due 04/26/2029		30,900
Turkiye Ihtacat Kredi Bankasi AJS		
8.250% due 01/24/2024		3,000
Ukraine Government International Bond		
4.375% due 01/27/2032 (h)	EUR 1,658	262
7.750% due 09/01/2025	\$ 4,390	951
United Kingdom Gilt		
1.250% due 07/31/2051	GBP 180	120
1.500% due 07/22/2047		80
1.750% due 01/22/2049		160
3.250% due 01/22/2044		150
3.500% due 01/22/2045		140
Venezuela Government International Bond (c)		
6.000% due 12/09/2049	\$ 3,367	219
7.000% due 03/31/2038		1,883
7.850% due 04/21/2025		5,349
7.750% due 04/13/2024		1,200
8.250% due 10/13/2024		5,991
9.000% due 05/07/2023		3,161
9.250% due 09/15/2027		4,274
9.250% due 05/07/2028		6,512
11.750% due 10/21/2026		680
11.950% due 08/05/2031		6,000
Total Sovereign Issues (Cost \$860,427)		596,820
株数		
COMMON STOCKS 1.3%		
Cairo Mezz PLC	847,444	96
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	7,568
Constellation Oil Services Holding S.A. (I)	421,249	46
Credit Suisse Group AG	601,156	2,492
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.	10,169,333	10,040
iHeartMedia, Inc. Class A	1,246,745	10,323
iHeartMedia, Inc. Class B	967,427	7,209
Intelsat S.A. (I)	963,915	26,990
National Bank of Greece S.A.	102,570	372
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (I)	151,112	27,423
Noble Corp. PLC	768,399	27,693
Stearns Holdings LLC	110,747	0
Voyager Aviation Holdings LLC	616	0

	株数	時価 (単位: 千)
Westmoreland Mining Holdings LLC (I)	8,912	\$ 98
Total Common Stocks (Cost \$176,368)		120,350
COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY 0.3%		
CBL & Associates Properties, Inc.		
Uniti Group, Inc.	6	172
VICI Properties, Inc.	110	850
	760	24,350
Total Commercial Real Estate Equity (Cost \$6,351)		25,372
EQUITY LINKED SECURITIES 0.0%		
Intelsat Jackson Holdings S.A.		
12/31/2049	210	1,040
Total Equity-Linked Securities (Cost \$0)		1,040
WARRANTS 0.0%		
Intelsat S.A.		
02/17/2027	26	91
Sequa Corp.		
12/31/2049	10	8
Stearns Holdings LLC		
12/31/2049	1	0
Windstream Services LLC		
09/21/2055	226	3,732
Total Warrants (Cost \$22,629)		3,831
PREFERRED SECURITIES 0.0%		
Cayenne Aviation LLC		
9.500%	3,693	1,057
Sequa Corp.		
15.000%	1,418	1,828
Total Preferred Securities (Cost \$2,292)		2,885
額面金額 (単位: 千)		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 11.0%		
COMMERCIAL PAPER 4.0%		
Federal Home Loan Bank		
3.060% due 01/03/2023	\$ 104,700	104,703
3.060% due 01/04/2023		77,700
3.070% due 01/06/2023		98,700
3.070% due 01/10/2023		98,600
		379,713
REPURCHASE AGREEMENTS (m) 6.2%		
		597,100
TIME DEPOSITS 0.6%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
1.410% due 11/01/2022	GBP 276	318
1.620% due 11/01/2022	AUD 1,199	767
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,180	5,180
Bank of Nova Scotia		
2.580% due 11/01/2022		427
2.810% due 11/01/2022	CAD 164	120
BNP Paribas Bank		
(0.240%) due 11/01/2022	CHF 1	1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1,602	1,583
0.420% due 11/01/2022	DKK 3	0
1.290% due 11/01/2022	NOK 562	54
1.620% due 11/01/2022	AUD 81	52
2.050% due 11/01/2022	NZD 509	296
5.150% due 11/01/2022	ZAR 8,091	440

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
Brown Brothers Harriman & Co.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 132	\$ 1
0.310% due 11/01/2022	EUR 1	1
0.850% due 11/01/2022	SEK 1	0
2.580% due 11/01/2022	\$ 3	3
Citibank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	4,337	4,337
DBS Bank Ltd.		
2.580% due 11/01/2022	2,702	2,702
HSBC Bank PLC		
0.310% due 11/01/2022	EUR 558	551
JPMorgan Chase Bank N.A.		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,782	5,782
MUFG Bank Ltd.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 251,387	1,691
Royal Bank of Canada		
2.580% due 11/01/2022	\$ 5,725	5,725
2.810% due 11/01/2022	CAD 129	94
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 2	0
0.310% due 11/01/2022	EUR 12,088	11,947
1.410% due 11/01/2022	GBP 222	256
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,392	4,392
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.270%) due 11/01/2022	¥ 44,520	300
1.410% due 11/01/2022	GBP 1,469	1,691
2.580% due 11/01/2022	\$ 4,474	4,474
		53,185
U.S. TREASURY BILLS 0.3%		
2.759% due 11/25/2022 (k)	13,900	13,870
2.901% due 12/01/2022 (j)(r)	13,300	13,262
		27,132
Total Short-Term Instruments (Cost \$1,057,127)		
		1,057,130
Total Investments in Securities (a) 126.3% (Cost \$13,587,614)		
	\$	12,119,648
Financial Derivative Instruments (o)(q) (1.5%) (Cost or Premiums, net \$(32,050))		
		(148,626)
Other Assets and Liabilities, net (24.8%)		
		(2,376,583)
Net Assets 100.0%		\$ 9,594,439

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) The allocation of Total Investments by geographic region as of October 31, 2022 is 99.6% of Net Assets in the United States, 5.2% of Net Assets in the United Kingdom and other countries comprising of 21.5% of Net Assets in aggregate.
- (b) All or portion of this amount represent unfunded loan commitments. The interest rate for the unfunded portion will be determined at the time of funding. See Note 4, Securities and Other Investments, in the Notes to Financial Statements for more information regarding unfunded loan commitments.
- (c) Security is in default.
- (d) Contingent convertible security.
- (e) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (f) Payment in-kind security.
- (g) Security is an Interest Only ("IO") or IO Strip.
- (h) When-issued security.
- (i) Principal amount of security is adjusted for inflation.
- (j) Coupon represents a yield to maturity.
- (k) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(l) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Constellation Oil Services Holding S.A.	N/A	N/A	06/10/2022	\$ 46	\$ 46	0.00%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/21/2021	717	493	0.01%
Intelsat S.A.	N/A	N/A	08/02/2018	75,855	26,990	0.28%
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	N/A	N/A	09/25/2020	4,866	27,423	0.28%
Westmoreland Mining Holdings LLC	N/A	N/A	03/28/2019	44	98	0.00%
WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL	6.768%	02/09/2023	05/16/2018	40,918	40,899	0.43%
Total Restricted Securities				\$ 122,446	\$ 95,949	1.00%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(m) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保債権	担保受取価値	レボ価値	レボ契約の 受取 ⁽¹⁾
BPS	2.990%	10/31/2022	11/01/2022	\$ 294,000	U.S. Treasury Notes 1.875% due 08/31/2024			
					U.S. Treasury Notes 2.250% due 11/15/2024	\$ (299,866)	\$ 294,000	\$ 294,024
JPS	3.060%	11/01/2022	11/02/2022	303,100	U.S. Treasury Bonds 2.000% due 02/15/2050	(308,258)	303,100	303,126
Total Repurchase Agreements						\$ (608,124)	\$ 597,100	\$ 597,150

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入利率 ⁽²⁾	借入日	満期日	借入元本 ⁽²⁾	リバースレボの支払
JML	0.500%	10/14/2022	TBD ⁽³⁾	EUR (123)	\$ (122)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (122)

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	残存期間				合計
	オーバーナイト/ 継続	30日迄	31-90日	90日以上	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
Total Borrowings	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (122)	\$ (122)
Payable for Reverse Repurchase Agreements					\$ (122)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/received as of October 31, 2022:

- (n) Securities with an aggregate market value of \$119 has been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of October 31, 2022.

取引相手	レポ契約の 受取	リバースレポ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの支払	合計借入 その他金融取引	担保の (受取) / 差入れ	ネット エクスポージャー ^(d)
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 294,024	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 294,024	\$ (299,866)	\$ (5,842)
JML	0	(122)	0	0	(122)	119	(3)
JPS	303,126	0	0	0	303,126	(308,258)	(5,132)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 597,150	\$ (122)	\$ 0	\$ 0			

^(a) Includes accrued interest.

^(b) Open maturity reverse repurchase agreement.

^(c) The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2022 was \$10,260 at a weighted average interest rate of 10.531%. Average borrowings may include sale buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

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

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

WRITTEN OPTIONS:

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

銘柄	ストライクプライス	満期日	契約数	プレミアム	市場価格
Call - 3-Month SOFR December 2023 Futures	\$ 98.000	12/15/2023	417	\$ (339)	\$ (120)
Put - 3-Month SOFR December 2023 Futures	96.500	12/15/2023	417	(390)	(1,346)
Total Written Options				\$ (729)	\$ (1,466)

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損) 益	変動証拠金	
					資産	負債
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2024	409	\$ 1,891	\$ 87	\$ 0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2025	212	836	24	0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2026	229	842	14	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2024	266	1,113	47	0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2025	216	814	16	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2024	354	1,541	71	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2025	193	742	14	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2026	215	780	13	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2024	247	1,002	34	0
3-Month SOFR September Futures	Short	12/2025	175	648	11	0
Australia Government 10-Year Bond December Futures	Short	12/2022	693	351	0	(324)
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2022	131	(584)	0	(33)
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2022	2,870	(11,748)	0	(919)
U.S. Treasury 20-Year Bond December Futures	Short	12/2022	712	10,773	256	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note December Futures	Long	12/2022	3	(28)	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond December Futures	Short	12/2022	32	704	36	0
Total Futures Contracts				\$ 9,677	\$ 623	\$ (1,277)

SWAP AGREEMENTS:

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

参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ^(b)		市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金		
			想定元本 ^(c)	EUR			資産	負債	
Airbus SE	1.000%	06/20/2028	1.325%	EUR	600	\$ (9)	\$ (23)	\$ 0	\$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2022	0.772%		9,200	\$ 14	3	1	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2023	0.827%		5,800	13	12	0	0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2024	1.088%		18,700	(4)	(5)	0	(4)
AT&T, Inc.	1.000%	12/20/2025	1.144%		200	(1)	(3)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	1.184%		400	(2)	(8)	0	(2)
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.268%		4,300	(42)	(11)	0	(3)
Bank of America Corp.	1.000%	12/20/2022	0.459%		10,400	19	(56)	0	(2)
Barclays Bank PLC	1.000%	12/20/2022	0.735%	EUR	11,500	17	(59)	0	(1)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽¹⁾ (Cont.)

参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽²⁾		想定元本 ⁽³⁾	市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金	
								資産	負債
Boeing Co.	1.000%	12/20/24	1.265%	\$	4,300	\$ (18)	\$ 21	\$ 1	\$ 0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2025	1.383%		5,200	(42)	31	0	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2025	1.463%		3,100	(37)	13	1	0
Boeing Co.	1.000%	06/20/2026	1.522%		8,400	(133)	(27)	1	0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	1.567%		1,200	(24)	(18)	0	(6)
Boeing Co.	1.000%	06/20/2027	1.642%		5,400	(134)	56	0	0
Bombardier, Inc.	5.000%	06/20/2024	3.444%		900	26	58	0	(18)
Bombardier, Inc.	5.000%	12/20/2024	3.705%		300	9	5	0	(25)
Ford Motor Co.	5.000%	12/20/2022	1.571%		1,300	14	(47)	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2022	1.531%		100	1	(11)	0	(8)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2024	2.628%		700	30	3	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2024	2.784%		5,500	272	(207)	0	0
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2025	2.961%		1,100	60	10	0	(4)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	12/20/2025	3.082%		8,400	493	166	0	(3)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2026	3.226%		100	6	2	0	(1)
Ford Motor Credit Co. LLC	5.000%	06/20/2027	3.471%		100	6	1	0	(1)
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.512%		17,200	114	30	0	(90)
General Motors Co.	5.000%	12/20/2026	1.906%		1,300	154	(61)	0	(2)
Hess Corp.	1.000%	12/20/2026	1.026%		3,200	1	37	0	(2)
Morgan Stanley	1.000%	12/20/2022	0.516%		2,400	5	(12)	0	(12)
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2022	1.448%	EUR	23,370	13	(408)	5	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2025	2.758%		20,000	(833)	410	1	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	06/20/2026	3.397%		5,200	(393)	16	13	0
Rolls-Royce PLC	1.000%	12/20/2026	3.611%		28,100	(2,583)	(1,242)	75	0
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2026	1.200%	\$	2,500	(16)	(72)	0	(15)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	06/20/2027	1.274%		5,400	(54)	(23)	0	(5)
Verizon Communications, Inc.	1.000%	12/20/2027	1.334%		5,000	(68)	(9)	0	(2)
						\$ (3,126)	\$ (1,428)	\$ 98	\$ (209)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現評価 (損) 益	変動証拠金		
						資産	負債	
CDX-EM-28 Index	1.000%	12/20/2022	\$ 29,325	\$ 29	\$ 455	\$ 0	\$ (1,452)	
CDX-EM-29 Index	1.000%	06/20/2023	52,275	(136)	1,235	0	(2,900)	
CDX-EM-30 Index	1.000%	12/20/2023	35,445	(254)	847	0	(1,821)	
CDX-EM-31 Index	1.000%	06/20/2024	19,350	(194)	557	0	(848)	
CDX-EM-32 Index	1.000%	12/20/2024	6,670	(134)	231	0	(470)	
CDX-EM-34 Index	1.000%	12/20/2025	46,828	(3,099)	(1,409)	0	(2,210)	
CDX-EM-35 Index	1.000%	06/20/2026	92	(5)	(2)	0	(5)	
CDX-EM-36 Index	1.000%	12/20/2026	142,140	(8,376)	(2,270)	0	(9,444)	
CDX-EM-37 Index	1.000%	06/20/2027	1,372	(99)	14	0	(14)	
CDX-EM-38 Index	1.000%	12/20/2027	52,700	(4,306)	70	0	(195)	
CDX-HY-34 Index	5.000%	06/20/2025	3,094	73	(37)	259	0	
CDX-HY-35 Index	5.000%	12/20/2025	990	28	(59)	0	(1,483)	
CDX-HY-36 Index	5.000%	06/20/2026	59,499	1,658	(3,943)	0	(1,503)	
CDX-HY-37 Index	5.000%	12/20/2026	13,068	346	(383)	715	0	
CDX-HY-38 Index	5.000%	06/20/2027	207,504	2,763	6,570	0	(2,749)	
CDX-HY-39 Index	5.000%	12/20/2027	412,200	(725)	13,687	0	(2,623)	
CDX-IG-37 Index	1.000%	12/20/2026	300	3	(4)	0	(6)	
CDX-IG-38 Index	1.000%	06/20/2027	111,500	962	511	112	0	
CDX-IG-39 Index	1.000%	12/20/2027	186,500	1,039	982	0	(212)	
iTraxx Asia ex-Japan IG Series 38 Index	1.000%	12/20/2027	40,400	(2,222)	(771)	0	(124)	
iTraxx Europe Crossover Series 38 Index	5.000%	12/20/2027	EUR 12,900	(202)	247	0	(9)	
iTraxx Europe Series 33 Index	1.000%	06/20/2025	16,540	88	(292)	0	(1)	
iTraxx Europe Series 37 Index	1.000%	06/20/2027	106,800	(237)	(596)	0	(10)	
iTraxx Europe Series 38 Index	1.000%	12/20/2027	35,150	(185)	191	0	(9)	
					\$ (13,185)	\$ 15,831	\$ 1,086	\$ (28,178)

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay ¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1.270%	11/04/2023	\$ 890,800	\$ (33,085)	\$ (16,566)	\$ 51	\$ 0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.000%	01/26/2024	26,500	(1,225)	(1,225)	0	(2)
Pay ²⁾	3-Month USD-LIBOR	1.700%	03/06/2024	59,600	(1,976)	(1,976)	0	(42)
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/18/2024	62,500	2,602	5,305	115	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/16/2025	62,600	4,970	4,970	113	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.300%	03/18/2025	62,600	4,967	4,967	113	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.000%	06/20/2025	117,800	7,369	9,789	5,696	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.928%	05/06/2026	25,800	3,019	3,019	51	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.940%	06/08/2026	35,000	4,100	4,100	72	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2026	251,400	33,694	29,844	535	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.030%	06/17/2026	43,000	4,918	4,918	96	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.010%	06/24/2026	39,800	4,577	4,577	85	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/15/2026	3,300	386	457	7	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.740%	12/16/2026	15,800	1,535	1,535	42	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.380%	01/04/2027	37,200	(4,162)	(4,162)	0	(96)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/11/2027	21,300	(2,219)	(2,219)	0	(46)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.570%	01/12/2027	13,400	(1,395)	(1,395)	1,376	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.425%	01/18/2027	25,400	(2,807)	(2,807)	0	(53)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.443%	01/18/2027	27,300	(2,997)	(2,997)	0	(64)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.350%	01/20/2027	19,000	2,159	2,159	38	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.418%	01/20/2027	12,700	(1,407)	(1,407)	0	(25)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/20/2027	84,500	(8,905)	(8,909)	0	(175)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.560%	02/05/2027	28,000	3,140	3,140	59	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.580%	02/16/2027	26,400	(2,946)	(2,946)	0	(57)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.450%	02/17/2027	62,000	7,251	7,251	136	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.700%	02/17/2027	248,100	(26,478)	(25,534)	0	(537)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.420%	02/24/2027	46,300	5,470	5,470	64	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.650%	02/24/2027	154,200	(16,767)	(16,204)	0	(174)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/20/2027	259,700	(19,995)	(36,453)	0	(5,180)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.490%	01/09/2028	190,500	(14,750)	(26,747)	23,869	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.280%	03/24/2028	73,200	(10,642)	(10,642)	0	(191)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.235%	05/12/2028	13,100	1,952	1,952	34	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	0.500%	06/16/2028	366,282	(69,256)	(48,720)	0	(1,804)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	12/15/2028	29,662	(4,285)	(4,953)	0	(90)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	01/12/2029	14,850	2,151	2,151	0	(2,103)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.700%	01/12/2029	54,000	(7,201)	(6,991)	6,855	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.518%	01/20/2029	7,600	(1,096)	(1,096)	0	(21)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/20/2029	10,600	(1,461)	(1,461)	0	(29)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.630%	01/26/2029	12,700	(1,749)	(1,749)	0	(36)
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.000%	06/19/2029	275,100	(17,133)	(48,950)	0	(6,856)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/23/2030	14,000	2,048	2,048	45	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.870%	01/23/2030	14,000	1,940	1,940	44	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.610%	02/28/2030	14,100	2,291	2,291	49	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.430%	03/17/2030	31,300	5,469	5,469	107	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/17/2030	9,500	1,790	1,595	30	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.678%	07/29/2030	12,400	2,911	2,911	38	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.674%	08/05/2030	12,000	2,821	2,821	37	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.000%	12/16/2030	7,588	1,640	1,587	25	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	13,609	(3,341)	(2,089)	0	(97)
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.750%	06/16/2031	335,400	82,108	55,541	1,387	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.450%	07/16/2031	23,600	4,534	4,534	77	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.370%	07/19/2031	10,500	2,085	2,085	34	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.360%	07/20/2031	15,700	3,128	3,128	52	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.405%	09/07/2031	25,500	5,180	5,180	0	(4,940)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	10/05/2031	15,500	(3,042)	(3,042)	0	(54)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/15/2031	15,400	(2,982)	(2,982)	0	(51)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.535%	10/22/2031	10,300	(1,997)	(1,997)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.545%	10/26/2031	10,300	(1,990)	(1,990)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.735%	01/12/2032	10,100	(1,800)	(1,800)	1,763	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.655%	01/24/2032	12,700	(2,350)	(2,350)	0	(42)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.768%	02/02/2032	9,600	(1,749)	(1,749)	0	(35)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.000%	02/18/2032	23,000	(3,795)	(3,795)	0	(84)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2032	12,800	2,634	2,212	144	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.500%	06/20/2048	7,900	1,673	2,768	148	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.910%	10/17/2049	11,400	3,647	3,653	56	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.895%	10/18/2049	11,400	3,679	3,644	62	0

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金 資産	負債
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.00%	01/15/2050	\$ 8,800	\$ 2,642	\$ 2,936	\$ 53	\$ 0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.625%	01/16/2050	22,500	8,221	6,724	130	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.750%	01/22/2050	47,500	16,323	14,566	280	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.625%	02/03/2050	42,500	15,813	12,989	247	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.875%	02/07/2050	2,700	888	868	16	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/17/2050	1,200	469	591	16	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.215%	10/13/2050	14,900		(6,610)	0	(81)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.144%	11/04/2050	9,000	(4,111)	(4,111)	0	(50)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	12/16/2050	128,700	56,255	43,073	720	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.485%	01/13/2051	13,900	(5,478)	(5,478)	0	(78)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.595%	01/13/2051	14,700	(5,506)	(5,506)	0	(84)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.523%	01/19/2051	8,900	(3,450)	(3,450)	0	(50)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.550%	01/21/2051	10,400	(3,980)	(3,980)	0	(58)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.580%	02/09/2051	98,800	(37,752)	(37,752)	0	(560)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/16/2051	386,100	169,197	103,740	2,428	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.945%	06/23/2051	22,200	6,985	6,985	136	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.785%	08/12/2051	13,100	4,574	4,574	76	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.815%	01/24/2052	2,500	(846)	(846)	0	(14)
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.867%	01/26/2052	2,500	(822)	(822)	0	(14)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	ZAR 305,500	(9)	252	0	(1)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2024	7,700	(5)	20	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.850%	01/07/2026	50,200	(249)	(249)	0	(6)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.848%	01/11/2026	148,000	(736)	(698)	0	(19)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	4.915%	02/01/2026	113,400	(570)	(544)	0	(14)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.065%	02/09/2026	57,500	(276)	(282)	0	(7)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.970%	03/10/2026	7,000	23	23	1	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	1,400	0	(5)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	09/19/2028	626,200	(1,480)	(1,833)	0	(129)
Pay	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	06/18/2024	AUD 28,000	289	(2,997)	17	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2024	39,200	(431)	(3,440)	27	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	12/17/2024	41,400	183	(4,433)	31	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	38,850	(345)	(3,937)	33	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.750%	06/17/2026	3,870	(117)	(397)	3	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.000%	03/21/2027	313,890	(9,622)	(37,946)	577	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.453%)	12/29/2023	EUR 4,300	164	164	14	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.425%)	06/28/2024	4,200	219	219	17	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	21,000	(771)	(771)	0	(86)
Receive	6-Month EURIBOR	(0.395%)	12/30/2024	1,900	132	132	10	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.363%)	06/30/2025	3,500	287	287	21	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.329%)	12/30/2025	2,300	224	224	16	0
Receive	6-Month EURIBOR	(0.294%)	06/30/2026	1,100	120	120	8	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.700%	04/11/2027	42,300	(3,703)	(3,703)	0	(324)
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027	63,000	(5,678)	(5,678)	0	(484)
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027	63,000	(5,684)	(5,684)	0	(493)
Pay	6-Month EURIBOR	1.000%	05/13/2027	85,900	(6,351)	(6,351)	0	(688)
Pay	6-Month EURIBOR	1.000%	05/18/2027	41,200	(3,060)	(3,060)	0	(335)
Receive	6-Month EURIBOR	(0.150%)	03/18/2030	123,000	25,299	21,738	1,365	0
Receive	6-Month EURIBOR	0.150%	06/17/2030	26,800	5,078	5,097	320	0
Pay	6-Month EURIBOR	2.000%	09/21/2032	194,130	(16,717)	(19,530)	0	(2,775)
Receive ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	1.750%	03/15/2033	241,200	27,271	2,755	3,476	0
Receive	6-Month EURIBOR	0.250%	03/18/2050	37,600	16,505	13,493	584	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.176%	04/27/2027	¥ 3,890,000	(35)	(35)	5	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	(0.020%)	09/20/2028	67,650,000	10,497	8,911	0	(220)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.000%	03/15/2029	75,360,000	13,062	12,318	0	(145)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.400%	06/15/2032	6,300,000	511	502	0	(20)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042	3,350,000	1,990	968	0	(110)
Receive	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.711%	04/27/2042	1,020,000	347	347	0	(36)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.830%	01/02/2023	BRL 165,400	(551)	(555)	0	(6)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.836%	01/02/2023	128,800	(425)	(425)	0	(5)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.855%	01/02/2023	42,900	(137)	(137)	0	(2)

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.670%	01/02/2023	BRL 13,200	\$ 8	\$ 8	\$ 0	\$ 0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.690%	01/02/2023	8,800	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.740%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.750%	01/02/2023	10,900	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.760%	01/02/2023	22,800	11	11	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.900%	01/02/2023	46,500	12	12	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.930%	01/02/2023	5,800	1	1	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.939%	01/02/2023	23,200	5	5	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.946%	01/02/2023	58,300	12	12	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.960%	01/02/2023	46,500	9	9	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	12.970%	01/02/2023	76,300	14	14	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.140%	01/02/2025	4,400	(13)	(13)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.160%	01/02/2025	2,900	(9)	(9)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/02/2025	3,600	(8)	(8)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.000%	01/02/2025	9,800	3	3	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.080%	01/02/2025	16,300	9	9	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.140%	01/02/2025	8,200	7	7	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.145%	01/02/2025	8,000	7	7	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.160%	01/02/2025	16,400	14	14	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.220%	01/04/2027	5,300	(10)	(10)	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.245%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.260%	01/04/2027	2,700	(5)	(5)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.700%	01/04/2027	1,400	1	1	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.715%	01/04/2027	5,900	4	4	4	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.870%	01/04/2027	14,100	22	22	9	0
Pay	IBMXID	7.880%	12/27/2022	MXN 780,300	(180)	(1,753)	0	(495)
Pay	IBMXID	7.640%	01/03/2023	31,200	(8)	(63)	0	(17)
Pay	IBMXID	7.645%	01/03/2023	49,400	(13)	(100)	0	(27)
Pay	IBMXID	7.745%	01/05/2023	33,200	(9)	(73)	0	(19)
Pay	IBMXID	7.805%	02/06/2023	76,600	(30)	(193)	0	(35)
Pay	IBMXID	7.820%	02/06/2023	37,700	(15)	(96)	0	(17)
Pay	IBMXID	6.350%	09/01/2023	39,100	(7)	(68)	0	(4)
Receive	IBMXID	8.675%	04/03/2024	851,700	1,060	1,060	64	0
Receive	IBMXID	8.660%	04/04/2024	352,700	442	442	0	(2)
Receive	IBMXID	8.750%	04/05/2024	265,800	317	317	0	(1)
Pay	IBMXID	5.980%	08/26/2024	11,300	(41)	(30)	0	(1)
Pay	IBMXID	7.670%	03/05/2025	662,400	(1,588)	(3,527)	0	(361)
Pay	IBMXID	7.710%	03/07/2025	435,800	(1,024)	(2,353)	0	(240)
Pay	IBMXID	7.715%	03/07/2025	433,300	(1,016)	(2,342)	0	(239)
Pay	IBMXID	7.570%	03/18/2025	612,000	(1,563)	(3,107)	0	(357)
Pay	IBMXID	5.160%	06/06/2025	39,200	(209)	(209)	4	0
Pay	IBMXID	5.950%	01/30/2026	104,300	(531)	(365)	0	(12)
Receive	IBMXID	8.410%	03/31/2027	102,000	174	174	7	0
Receive	IBMXID	8.730%	04/06/2027	108,200	121	121	8	0
Receive	IBMXID	7.495%	01/14/2032	52,800	298	82	7	0
Receive	IBMXID	7.498%	01/15/2032	218,400	1,231	335	29	0
Receive	IBMXID	8.732%	03/30/2032	54,100	95	95	6	0
Receive	IBMXID	8.701%	03/31/2032	127,000	236	236	14	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	2.450%	12/20/2024	\$ 428,400	7,067	7,097	310	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	2.350%	01/17/2025	214,000	3,597	3,574	123	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	1.600%	01/16/2026	167,700	7,043	4,909	161	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	2.300%	01/17/2026	120,700	3,552	3,526	118	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.620%	04/18/2027	26,900	(2,682)	(2,682)	0	(53)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.783%	04/22/2027	20,100	(1,860)	(1,860)	0	(40)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.788%	05/03/2027	20,600	(1,921)	(1,921)	0	(41)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	51,050	(6,742)	(5,892)	0	(102)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027	68,850	9,089	6,794	134	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.850%	08/30/2027	24,600	(1,258)	(1,258)	0	(52)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/07/2027	12,500	(529)	(529)	0	(27)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.955%	10/04/2027	25,100	(1,186)	(1,186)	0	(54)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.618%	02/09/2029	4,800	(600)	(600)	0	(12)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	6,100	(1,054)	(889)	0	(16)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	97,910	16,882	12,514	257	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2029	59,920	(7,531)	(3,814)	8	(131)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/08/2029	12,400	(619)	(619)	0	(36)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.100%	09/09/2029	12,400	(581)	(581)	0	(36)

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 支払/受取	変動金利 インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損) 益	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.650%	02/08/2032	\$ 16,100	\$ (2,658)	\$ (2,658)	\$ 0	\$ (59)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.730%	02/24/2032	15,200	(2,426)	(2,426)	0	(40)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.765%	03/16/2032	5,300	(839)	(839)	0	(19)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	2.385%	06/08/2032	10,400	1,172	1,172	37	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	56,640	(11,615)	(6,902)	0	(187)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032	46,970	9,556	7,800	711	0	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2032	78,300	(13,027)	(8,752)	0	(273)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.050%	09/06/2032	18,800	(1,153)	(1,153)	0	(71)	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052	96,100	29,365	20,305	559	0	
Receive ⁽ⁱ⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2033	GBP 75,300	12,646	756	576	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.096%	02/14/2052	5,500	(2,546)	(2,546)	0	(1)	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.060%	02/21/2052	2,500	(1,178)	(1,178)	0	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.101%	02/21/2052	2,500	(1,155)	(1,155)	0	0	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	1.175%	02/28/2052	5,200	(2,322)	(2,322)	0	0	
Receive ⁽ⁱⁱ⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	2.000%	03/15/2053	5,500	1,483	(202)	6	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	09/15/2031	34,900	(4,293)	(4,113)	540	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	10/15/2031	46,300	(4,995)	(4,935)	719	0	
Receive	UK Retail Price Index	0.000%	11/15/2031	23,300	(2,178)	(1,926)	380	0	
						\$ 227,206	\$ (11,119)	\$ 58,955	\$ (32,925)
Total Swap Agreements						\$ 210,895	\$ 3,284	\$ 60,139	\$ (61,312)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of October 31, 2022:

(p) Securities with an aggregate market value of \$98,845 and cash of \$171,779 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of October 31, 2022. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格 買いオプション	変動証拠金資産		合計	市場価格 売りオプション	変動証拠金負債		合計
		先物	スワップ			先物	スワップ	
\$ 0	\$ 623	\$ 60,139	\$ 60,762	\$ (1,466)	\$ (1,277)	\$ (61,312)	\$ (64,055)	

⁽ⁱ⁾ 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.

⁽ⁱⁱ⁾ 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.

⁽ⁱⁱⁱ⁾ 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.

^(iv) 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.

^(v) This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for Further information.

(q) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価 (損) 益	
				資産	負債
BOA	11/2022	\$ 2,512	AUD 3,883	\$ 0	\$ (29)
BOA	11/2022	118	CNH 849	0	(2)
BOA	11/2022	3,449	EUR 3,526	36	0
BOA	11/2022	985	PEN 3,842	0	(24)
BOA	11/2022	ZAR 57,968	\$ 3,651	498	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価(損)益	
						資産	負債
BOA	11/2022	ZAR	12,585	\$	730	\$	46
BOA	12/2022	PEN	87,093		22,790		1,054
BOA	12/2022		\$ 1,047	EUR	1,052		0
BOA	12/2022		3,086	GBP	2,684		0
BOA	12/2022		43,942	MXN	886,729		330
BOA	12/2022		73	PEN	278		0
BOA	01/2023	ZAR	38,083	\$	2,143		82
BOA	03/2023	TWD	231,566		7,865		632
BOA	03/2023	ZAR	95,583		5,413		261
BOA	05/2023	PEN	26,923		6,862		207
BPS	11/2022	AUD	2,912		1,835		0
BPS	11/2022	IDR	176,115,710		11,270		1
BPS	11/2022		\$ 18,087	GBP	16,119		472
BPS	11/2022		19,114	IDR	285,197,517		0
BPS	11/2022		37,394	NOK	359,438		0
BPS	11/2022		1,840	PEN	7,138		0
BPS	11/2022		36,525	SEK	370,111		0
BPS	11/2022	ZAR	175,146	\$	10,906		1,381
BPS	12/2022	CNH	1,813		262		14
BPS	12/2022	EUR	10,646		10,612		68
BPS	12/2022	MXN	12,233		595		0
BPS	12/2022		\$ 9,365	CLP	8,700,000		0
BPS	12/2022		262	CNY	1,811		0
BPS	12/2022		11,270	IDR	176,509,731		0
BPS	12/2022		1,532	PEN	6,078		0
BRC	11/2022		74,896	JPY	10,811,717		0
BRC	11/2022	ZAR	78,977	\$	4,921		626
CBK	11/2022	AUD	8,009		5,104		0
CBK	11/2022	BRL	293,224		55,697		0
CBK	11/2022	GBP	2,369		2,668		0
CBK	11/2022	PEN	9,258		2,325		4
CBK	11/2022		\$ 1,156	AUD	1,780		0
CBK	11/2022		56,015	BRL	293,224		0
CBK	11/2022		13,868	COP	62,570,000		0
CBK	11/2022		1,105	EUR	1,135		17
CBK	11/2022		12,594	GBP	11,321		441
CBK	11/2022		23	IDR	345,000		0
CBK	11/2022		240	PEN	928		0
CBK	11/2022		545		2,120		0
CBK	11/2022	ZAR	246,179	\$	15,003		1,620
CBK	12/2022	CNH	708		102		6
CBK	12/2022	MXN	1,362,666		66,837		0
CBK	12/2022	PEN	83,233		19,846		0
CBK	12/2022		\$ 8,906	CLP	8,087,236		0
CBK	12/2022		102	CNY	708		0
CBK	12/2022		2,625	PEN	10,257		0
CBK	12/2022		3,413		13,363		0
CBK	12/2022		7,121		27,834		0
CBK	01/2023		8,749	CLP	8,336,943		0
CBK	01/2023		1,726	PEN	6,931		0
CBK	01/2023		12,421		48,988		0
CBK	01/2023		1,957	ZAR	34,282		0
CBK	02/2023		11,135	BRL	60,092		92
DUB	12/2022	ZAR	107,612	\$	6,849		1,012
DUB	02/2023		33,493		2,006		197
GLM	11/2022	PEN	18,353		4,591		0
GLM	11/2022	ZAR	63,724		3,970		504
GLM	12/2022		\$ 151	CLP	136,490		0
GLM	12/2022		14,377	PEN	57,240		0
GLM	03/2023	MXN	1,037,938	\$	50,490		0
GLM	05/2023		\$ 4,535	PEN	18,353		3
GLM	05/2023	ZAR	58,866	\$	3,522		361
JPM	11/2022	BRL	611,420		117,288		794
JPM	11/2022		\$ 118,205	BRL	611,420		0
JPM	11/2022		336	CNH	2,408		0
JPM	11/2022		12,484	IDR	187,436,692		0
JPM	11/2022		13	INR	1,018		0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
JPM	01/2023	\$ 115,808	BRL 611,420	\$ 0	\$ (866)
JPM	02/2023	224,351	MXN 4,599,472	2,596	0
MBC	11/2022	AUD 2,188	\$ 1,412	13	0
MBC	11/2022	CHF 1,482	1,580	97	0
MBC	11/2022	COP 62,570,000	12,597	0	(150)
MBC	11/2022	EUR 4,304	4,214	0	(40)
MBC	11/2022	GBP 50,318	54,817	0	(3,116)
MBC	11/2022	\$ 1,417	AUD 2,188	0	(18)
MBC	11/2022	163	COP 800,585	0	0
MBC	11/2022	11,615	EUR 11,770	18	0
MBC	11/2022	38,798	GBP 35,120	1,637	0
MBC	11/2022	4,550	JPY 682,300	41	0
MBC	12/2022	CNH 915	\$ 131	6	0
MBC	12/2022	COP 800,585	162	0	(1)
MBC	12/2022	\$ 1,413	AUD 2,188	0	(13)
MBC	12/2022	131	CNY 913	0	(5)
MBC	12/2022	1,721	EUR 1,730	0	(8)
MBC	12/2022	2,250	GBP 1,945	0	(9)
MBC	01/2023	ZAR 24,365	\$ 1,354	37	0
MBC	03/2023	TWD 332,849	11,311	914	0
MBC	05/2023	\$ 304	CNH 2,041	0	(22)
MYI	11/2022	BRL 132,971	\$ 25,165	0	(170)
MYI	11/2022	GBP 309,463	335,743	0	(20,558)
MYI	11/2022	IDR 174,972	12	1	0
MYI	11/2022	\$ 22,210	AUD 34,198	0	(342)
MYI	11/2022	25,294	BRL 132,971	41	0
MYI	11/2022	18,343	EUR 18,810	248	0
MYI	11/2022	338,110	GBP 292,205	0	(1,680)
MYI	11/2022	10,082	IDR 149,149,809	0	(546)
MYI	11/2022	53,368	JPY 7,675,094	0	(1,731)
MYI	12/2022	CNH 412	\$ 59	3	0
MYI	12/2022	GBP 292,205	338,373	1,667	0
MYI	12/2022	TWD 293,227	9,712	617	0
MYI	12/2022	\$ 25,008	BRL 132,971	168	0
MYI	12/2022	59	CNY 411	0	(2)
MYI	01/2023	ZAR 9,917	\$ 537	1	0
MYI	02/2023	677,547	37,034	439	0
MYI	03/2023	TWD 302,717	10,279	823	0
MYI	04/2023	ZAR 4,413	238	0	0
RBC	11/2022	\$ 3,477	PEN 13,583	0	(78)
SCX	11/2022	CAD 124,031	\$ 90,928	0	0
SCX	11/2022	CLP 154,813	168	4	0
SCX	11/2022	COP 63,370,585	14,910	1,961	0
SCX	11/2022	IDR 291,285,429	18,742	103	0
SCX	11/2022	\$ 5,494	AUD 8,481	0	(70)
SCX	11/2022	33,178	CAD 45,592	246	0
SCX	11/2022	158	CLP 154,813	6	0
SCX	11/2022	8,340	GBP 7,385	162	0
SCX	11/2022	18,675	IDR 280,138,899	0	(749)
SCX	11/2022	12,127	181,931,834	0	(498)
SCX	11/2022	15,118	NOK 146,545	0	(1,016)
SCX	11/2022	12,521	SEK 128,305	0	(900)
SCX	11/2022	673	ZAR 12,119	0	(14)
SCX	12/2022	CNH 459	\$ 66	3	0
SCX	12/2022	TWD 548,129	18,199	1,197	0
SCX	12/2022	\$ 90,928	CAD 124,009	0	(1)
SCX	12/2022	66	CNY 458	0	(3)
SCX	12/2022	18,742	IDR 291,735,232	0	(122)
SCX	12/2022	199,734	JPY 29,589,031	0	(1)
SCX	12/2022	1,426	PEN 5,570	0	(36)
SCX	01/2023	CLP 154,813	\$ 156	0	(6)
SCX	04/2023	ZAR 56,849	3,090	31	0
SOG	11/2022	CHF 3,477	3,674	195	0
SOG	11/2022	EUR 693,317	666,061	0	(19,180)
SOG	11/2022	\$ 659,513	EUR 656,575	0	(10,588)
SOG	12/2022	EUR 656,575	\$ 660,926	10,621	0
SOG	01/2023	ZAR 18,081	1,019	41	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨		受取通貨		未実現評価(損)益		
						資産	負債	
TDR	11/2022	\$	57,353	CAD	78,280	\$	34	0
UAG	11/2022	AUD	44,269	\$	28,669		361	0
UAG	11/2022	\$	4,438	AUD	6,848		0	(59)
UAG	11/2022		5,637	EUR	5,805		100	0
UAG	11/2022		8,473	IDR	126,098,943		0	(411)
UAG	11/2022		72,172	JPY	10,373,569		0	(2,381)
UAG	11/2022	ZAR	135,711	\$	8,649		1,268	0
UAG	11/2022		64,863		3,970		445	0
UAG	12/2022	\$	28,692	AUD	44,269		0	(360)
UAG	12/2022		12,354	MXN	247,871		21	0
UAG	03/2023	ZAR	71,825	\$	4,019		150	0
Total Forward Foreign Currency Contracts							\$ 37,075	\$ (82,636)

PURCHASED OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.243%	08/05/2024	52,000	\$ 702	\$ 219
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.243%	08/05/2024	52,000	702	1,566
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.110%	07/26/2032	10,500	1,701	770
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.110%	07/26/2032	15,300	2,479	2,537
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.053%	07/20/2023	154,200	925	104
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	431
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.580%	07/19/2024	109,300	1,503	609
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.400%	07/20/2027	12,100	1,587	815
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.170%	07/19/2032	12,100	1,919	923
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.053%	07/20/2023	154,200	925	2,331
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.620%	07/22/2024	154,200	1,156	2,128
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.580%	07/19/2024	109,300	1,503	2,794
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.400%	07/20/2027	13,600	1,795	2,399
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.170%	07/19/2032	13,600	2,157	2,188
Total Purchased Options							\$ 20,220	\$ 19,814

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
BDA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.150%	12/01/2023	55,600	\$ (172)	\$ (39)
BDA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	12/01/2023	55,600	(172)	(501)
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.550%	04/11/2023	12,800	(13)	0
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/28/2023	69,500	(121)	(2)
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/11/2023	12,800	(39)	(123)
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/28/2023	69,500	(121)	(591)
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(31)
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.690%	04/02/2024	14,800	(116)	(211)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(42)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(55)
DUB	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.750%	12/14/2022	24,600	(189)	(13)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.920%	10/13/2023	34,700	(209)	(512)
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.790%	04/08/2024	23,300	(179)	(315)
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	12/14/2022	24,600	(189)	(600)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(63)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(91)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.688%	04/02/2024	29,800	(233)	(426)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.781%	04/05/2024	38,800	(300)	(527)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.550%	04/05/2023	71,800	(134)	(1)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.550%	04/11/2023	95,400	(182)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/24/2023	70,000	(75)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.700%	04/26/2023	65,600	(116)	(2)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Receive	0.550%	05/15/2023	63,400	(111)	(2)

INTEREST RATE SWAPPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利の 支払/受取	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0.870%	11/02/2022	2,294,300	\$ (4,567)	\$ 0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	1.270%	11/02/2022	383,600	(19)	0
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.785%	07/25/2023	67,000	(419)	(32)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(42)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.190%	10/23/2023	27,700	(193)	(47)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(49)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(38)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(33)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.250%	11/17/2023	54,600	(198)	(39)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.150%	11/20/2023	54,500	(190)	(35)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.250%	12/07/2023	55,600	(174)	(45)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(127)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(66)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.468%	07/25/2023	14,200	(339)	(53)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/05/2023	71,800	(134)	(685)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	04/11/2023	95,400	(182)	(918)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/24/2023	70,000	(198)	(591)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.250%	04/26/2023	65,600	(116)	(557)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month EURIBOR	Pay	2.100%	05/15/2023	63,400	(111)	(624)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	1.270%	11/02/2022	1,910,700	(3,800)	(70,932)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.785%	07/25/2023	67,000	(419)	(1,180)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.920%	10/13/2023	34,700	(213)	(512)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.018%	10/20/2023	28,100	(182)	(390)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.140%	10/23/2023	27,700	(195)	(359)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.190%	10/23/2023	27,700	(192)	(348)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.225%	10/23/2023	27,700	(192)	(341)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.973%	10/25/2023	27,600	(190)	(393)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.841%	10/27/2023	27,500	(188)	(417)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.088%	11/03/2023	27,500	(199)	(362)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.910%	11/10/2023	27,400	(182)	(396)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	11/17/2023	54,600	(198)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.650%	11/20/2023	54,500	(190)	(497)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.750%	12/07/2023	55,600	(174)	(465)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.697%	04/02/2024	59,600	(467)	(847)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.721%	04/08/2024	29,400	(222)	(411)
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.468%	07/25/2023	14,200	(339)	(900)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(44)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(45)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(41)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(71)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(70)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.800%	12/15/2022	24,600	(200)	(17)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(69)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(68)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.050%	07/19/2023	66,800	(401)	(1,017)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.052%	07/20/2023	66,800	(411)	(1,010)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.993%	10/11/2023	31,700	(214)	(454)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.700%	07/19/2023	14,100	(329)	(72)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.675%	07/20/2023	14,400	(335)	(801)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	3.700%	12/15/2022	24,600	(200)	(547)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.550%	07/19/2023	3,600	(260)	(582)
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.537%	07/20/2023	3,600	(262)	(588)
							\$ (25,144)	\$ (93,711)

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
BPS	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	14,800	\$ (18)	\$ (1)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	12,690	(16)	0

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS (Cont.)

取引相手	銘柄	買/売 プロテクション	エクササイズ レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	2.000%	12/21/2022	14,100	\$ (35)	\$ (4)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	12/21/2022	28,500	(35)	(10)
DUB	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	12/21/2022	29,200	(43)	(9)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.400%	11/16/2022	58,300	(66)	(3)
GST	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.500%	12/21/2022	58,300	(90)	(14)
GST	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	3.000%	03/15/2023	28,000	(50)	(12)
JPM	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.350%	11/16/2022	30,500	(37)	(1)
JPM	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.900%	11/16/2022	15,590	(14)	(1)
MYC	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.600%	12/21/2022	15,500	(23)	(3)
						\$ (427)	\$ (58)

OPTIONS ON SECURITIES

取引相手	銘柄	ストライクプライス	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
JPM	Put - Fannie Mae**	\$ 99,406	11/07/2022	20,100	\$ (157)	\$ (1,128)
SAL	Put - Fannie Mae**	98,375	11/07/2022	14,000	(78)	(642)
SAL	Put - Fannie Mae**	98,406	11/07/2022	14,000	(79)	(646)
					\$ (314)	\$ (2,416)

INTEREST RATE-CAPPED OPTIONS

取引相手	銘柄	エクササイズ レート	変動金利インデックス	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	\$ (897)	\$ (1,720)
FAR	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.224%	USD-SOFR-OIS Compound	08/08/2026	52,000	(897)	(383)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(2,469)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	3.018%	USD-SOFR-OIS Compound	07/24/2024	154,200	(1,154)	(264)
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,350)	(2,289)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.596%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2025	154,200	(1,351)	(610)
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap ⁽²⁾	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(3,180)
MYC	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2.550%	USD-SOFR-OIS Compound	07/23/2026	109,300	(1,933)	(965)
						\$ (10,669)	\$ (11,900)
						\$ (36,554)	\$ (108,085)

Total Written Options

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照エンティティ	固定(支払) 金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽⁵⁾	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値 資産 負債	
BOA	HSBC Holdings PLC	(1.000%)	06/20/2024	1.273%	EUR 200	\$ 3	\$ (3)	\$ 0	\$ 0

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

取引相手	参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ⁽⁵⁾	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値 資産 負債	
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 2,700	\$ (89)	\$ 94	\$ 5	\$ 0
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	100	(7)	3	0	(4)
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	200	(18)	4	0	(14)
BOA	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	5,800	(654)	105	0	(549)
BPS	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	24,100	(1,080)	1,125	45	0
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.335%	3,400	(163)	(144)	0	(307)
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	700	(62)	(11)	0	(73)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(15)	6	0	(9)
BPS	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2025	6.209%	400	(69)	22	0	(47)
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	7,100	(280)	294	14	0
BRC	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.672%	8,400	(433)	460	27	0
BRC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	4,800	(221)	(136)	0	(357)
BRC	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.469%	10,525	(24)	44	20	0
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	1,600	(108)	38	0	(70)
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	3,370	(300)	63	0	(237)
BRC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	25,410	(3,166)	761	0	(2,405)

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

取引相手	参照エンティティ	固定受取金利	満期日	2022年10月31日時点の インプライド クレジット スプレッド ^(%)	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損)益	スワップの価値 ⁽⁷⁾	
								資産	負債
BYL	Banca Monte Dei Paschi Di Siena SpA	5.000%	12/20/2022	6.023%	EUR 400	\$ (13)	\$ 14	\$ 1	\$ 0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	\$ 6,100	(237)	249	12	0
CBK	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	21,800	(376)	226	0	(150)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.131%	400	1	(1)	0	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2024	2.134%	1,500	(15)	91	0	(24)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2024	2.298%	4,300	17	(123)	0	(106)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2026	3.119%	5,900	(275)	164	0	(439)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	1,500	(54)	(77)	0	(131)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	400	(36)	8	0	(28)
CBK	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,400	(146)	13	0	(133)
DUB	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.638%	400	(18)	(5)	0	(23)
DUB	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,700	(196)	35	0	(161)
FBF	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	800	(31)	32	1	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	10,000	(103)	122	19	0
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.255%	1,300	(42)	38	0	(4)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	1.400%	16,700	(260)	144	0	(116)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2023	1.824%	4,700	(70)	33	0	(37)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	4,200	(156)	(223)	0	(379)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	1,900	(169)	(30)	0	(199)
GST	Equinix, Inc.	5.000%	06/20/2027	1.586%	3,800	531	20	551	0
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	1.378%	2,800	(54)	10	0	(44)
GST	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.532%	30,310	(230)	355	125	0
GST	Petrobras Global Finance BV	1.000%	12/20/2022	0.823%	2,200	(125)	128	3	0
GST	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2024	1.716%	11,600	(495)	379	0	(116)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	1,100	(100)	23	0	(77)
GST	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	12,000	(1,342)	206	0	(1,136)
JPM	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	400	(15)	(21)	0	(36)
JPM	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2023	5.214%	200	(14)	5	0	(9)
MBC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	1,300	(142)	19	0	(123)
MYC	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	0.461%	13,800	(479)	505	26	0
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2027	3.355%	4,500	(162)	(244)	0	(406)
MYC	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2027	3.507%	5,200	(464)	(83)	0	(547)
MYC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2026	2.638%	13,600	(600)	(189)	0	(788)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	06/20/2024	5.752%	900	(100)	36	0	(64)
MYC	Turkey Government International Bond	1.000%	12/20/2024	6.035%	900	(101)	16	0	(85)
						\$ (12,780)	\$ 4,176	\$ 849	\$ (9,433)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTIONSM

取引相手	参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損)益	スワップの価値 ⁽⁷⁾	
							資産	負債
BDA	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	\$ 7,292	\$ (1,419)	\$ 1,347	\$ 0	\$ (72)
BDA	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	62	(1)	2	1	0
BDA	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	3,400	(106)	107	1	0
DUB	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	5,440	(235)	237	2	0
DUB	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,221	(421)	395	0	(26)
DUB	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	66,100	(300)	(44)	0	(344)
FBF	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	84	(2)	2	0	0
FBF	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	2,900	(180)	181	1	0
FBF	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	12,618	(513)	486	0	(27)
FBF	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	79,000	(422)	(304)	0	(726)
FBF	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	17,500	(123)	(122)	0	(245)
GST	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	107	1	1	2	0
GST	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	22,600	(628)	625	0	(3)
GST	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	46,895	(1,600)	1,503	0	(97)
GST	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	126,300	(1,397)	740	0	(657)
GST	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	110,100	614	(1,623)	0	(1,009)
GST	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	6,300	(7)	(115)	0	(122)
GST	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	6,600	(56)	(159)	0	(215)
JPS	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	4,173	(171)	163	0	(8)
JPS	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	5,400	(101)	73	0	(28)
JPS	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	28,300	(224)	(36)	0	(260)
MEI	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	21	0	0	0	0
MEI	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	1,166	(64)	64	0	0
MEI	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	16,200	(870)	868	0	(2)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION⁽⁶⁾ (Cont.)

取引相手	参照指標	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値 ⁽⁷⁾	
							資産	負債
MEI	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	\$ 15,499	\$ (657)	\$ 625	\$ 0	\$ (32)
MYC	ABX.HE.AAA-06 Index	0.110%	05/25/2046	7	(1)	1	0	0
MYC	CDX.HY-33 Index	5.000%	12/20/2024	78,427	13,071	(5,433)	7,638	0
MYC	CMBX.AAA-6 Index	0.500%	05/11/2063	38	(1)	1	0	0
MYC	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	10,432	(515)	493	0	(22)
MYC	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	63,200	(1,929)	1,600	0	(329)
MYC	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	60,700	(517)	(28)	0	(545)
MYC	CMBX.AAA-13 Index	0.500%	12/16/2072	30,300	(12)	(605)	0	(617)
MYC	CMBX.AAA-15 Index	0.500%	11/18/2064	13,200	(112)	(318)	0	(430)
SAL	CMBX.AAA-9 Index	0.500%	09/17/2058	88,923	(57)	371	0	(186)
SAL	CMBX.AAA-10 Index	0.500%	11/17/2059	93,105	(57)	89	0	(484)
SAL	CMBX.AAA-11 Index	0.500%	11/18/2054	286,300	(1,597)	(1,031)	0	(2,628)
SAL	CMBX.AAA-12 Index	0.500%	08/17/2061	102,000	(464)	(964)	0	(1,428)
UAG	CMBX.AAA-7 Index	0.500%	01/17/2047	583	(26)	26	0	0
UAG	CMBX.AAA-8 Index	0.500%	10/17/2057	1,600	(96)	95	0	(1)
					\$ (2,211)	\$ (687)	\$ 7,645	\$ (10,543)

TOTAL RETURN SWAPS

取引相手	トータル リターン ⁽⁸⁾ 支払/受取	参照エンティティ	数・単位数	変動金利	想定元本	満期日	プレミアム 支払/(受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値	
									資産	負債
BOA	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	\$ 600	03/20/2023	\$ (1)	\$ 13	\$ 12	\$ 0
JPM	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	2,100	12/20/2022	(9)	(16)	0	(25)
MYC	Receive	iBoxx USD Liquid		Secured Overnight Financing Rate						
		High Yield Index	N/A	Index	2,100	12/20/2022	(9)	3	0	(6)
							\$ (19)	\$ 0	\$ 12	\$ (31)
							\$ (14,987)	\$ 3,486	\$ 8,506	\$ (20,007)

Total Swap Agreements

⁽⁸⁾ Option on when-issued security.

⁽⁹⁾ Notional amount represents the number of contracts.

⁽¹⁰⁾ The underlying instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

⁽¹¹⁾ 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.

⁽¹²⁾ 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.

⁽¹³⁾ 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.

⁽¹⁴⁾ 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.

⁽¹⁵⁾ 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.

⁽¹⁶⁾ Net exposure represents the net receivable/payable that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from DTC financial derivative instruments can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

マネー・マーケット・マザーファンド

《第37期》決算日2023年5月22日

[計算期間：2022年11月22日～2023年5月22日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、5月22日に第37期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第37期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
33期(2021年5月20日)	円 10,182	0.0	—	—	百万円 1,245
34期(2021年11月22日)	10,182	0.0	—	—	1,637
35期(2022年5月20日)	10,182	0.0	—	—	2,897
36期(2022年11月21日)	10,181	△0.0	—	—	2,660
37期(2023年5月22日)	10,181	0.0	—	—	2,921

(注) 当ファンドの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。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	債券率
(期首) 2022年11月21日	円 10,181	—	—	—	—
11月末	10,181	0.0	—	—	—
12月末	10,181	0.0	—	—	—
2023年1月末	10,181	0.0	—	—	—
2月末	10,181	0.0	—	—	—
3月末	10,181	0.0	—	—	—
4月末	10,181	0.0	—	—	—
(期末) 2023年5月22日	10,181	0.0	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

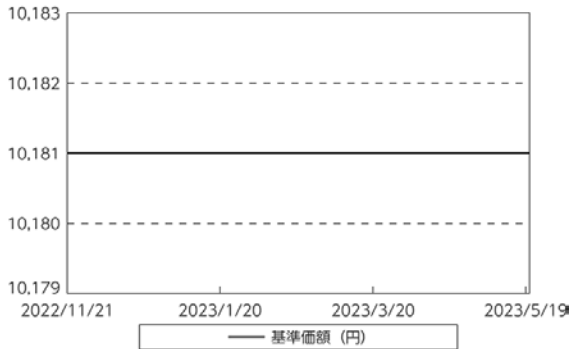
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ横ばいとなりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

利子等収益が積み上がったことが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.034%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

○今後の運用方針

- ・今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年11月22日～2023年5月22日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年11月22日～2023年5月22日)

その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	269,599,882	269,499,890

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月22日～2023年5月22日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
その他有価証券	1,999	2,000	—

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アコムです。

○組入資産の明細

(2023年5月22日現在)

国内その他有価証券

区分	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	2,299,997	78.7

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2023年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 2,299,997	% 78.7
コール・ローン等、その他	621,984	21.3
投資信託財産総額	2,921,981	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月22日現在)

項目	当期末
(A) 資産	2,921,981,522
コール・ローン等	621,984,405
その他有価証券(評価額)	2,299,997,117
(B) 負債	887
未払解約金	67
未払利息	820
(C) 純資産総額(A-B)	2,921,980,635
元本	2,870,024,150
次期繰越損益金	51,956,485
(D) 受益権総口数	2,870,024,150口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,181円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,613,319,906円
 期中追加設定元本額 285,598,635円
 期中一部解約元本額 28,894,391円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0181円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	1,799,691,123円
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	545,437,984円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	71,485,526円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	66,609,195円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	61,994,892円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	41,204,097円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	24,765,135円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	13,122,469円
ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	10,743,284円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	9,893,887円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,872,782円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,828,976円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(年2回決算型)	9,376,245円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,124,755円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	8,067,104円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)	7,489,236円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	7,196,270円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	6,895,341円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	6,887,212円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)	6,675,966円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	6,609,861円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	6,324,266円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,990,990円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	5,812,610円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	5,548,198円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	5,541,524円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	5,484,593円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	5,411,821円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(毎月分配型)	4,489,124円

○損益の状況 (2022年11月22日~2023年5月22日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 93,141
受取利息	8,257
支払利息	△ 101,398
(B) 当期損益金(A)	△ 93,141
(C) 前期繰越損益金	47,403,125
(D) 追加信託差損益金	5,169,295
(E) 解約差損益金	△ 522,794
(F) 計(B+C+D+E)	51,956,485
次期繰越損益金(F)	51,956,485

(注) (D)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) (E)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。

欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジなし）	4,289,171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	3,857,128円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	3,319,056円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型>（3ヵ月決算型）	3,063,931円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>（年1回決算型）	2,990,177円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>（毎月決算型）	2,966,566円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（毎月分配型）	2,895,129円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム（毎月分配型）	2,724,520円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>（年2回分配型）	2,711,846円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	2,590,474円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）	2,515,903円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	2,299,085円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,210,674円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）	2,178,993円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	2,119,621円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	2,065,331円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	2,007,890円
バリュエ・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>（毎月決算型）	1,936,118円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（年2回分配型）	1,721,384円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>（毎月分配型）	1,628,892円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>（年2回分配型）	1,616,484円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,491,640円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドB>	1,355,166円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	1,339,040円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム（年2回分配型）	1,171,788円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,149,232円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	1,145,161円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,074,934円
三菱UFJ J/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（年1回決算型）	1,020,693円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>（毎月分配型）	1,016,827円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド（毎月分配型）	907,086円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（年2回分配型）	870,254円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（毎月分配型）	845,131円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>（毎月分配型）	669,935円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（毎月分配型）	665,580円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	629,892円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース（為替ヘッジなし）（年1回決算型）	521,457円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり>（毎月決算型）	491,449円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>（毎月分配型）	416,840円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>（年2回分配型）	382,241円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>（毎月分配型）	334,809円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（年2回分配型）	323,246円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>（毎月分配型）	282,290円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>（年2回分配型）	278,281円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>（毎月分配型）	230,764円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	217,015円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	212,322円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>（年2回分配型）	208,430円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>（年2回分配型）	177,761円
欧州ハイイールド債券ファンド（為替ヘッジあり）（年1回決算型）	169,198円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>（資産成長型）	138,420円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（年2回分配型）	136,856円

三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	125,118円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	111,354円
三菱UFJ /マッコーリー オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	97,104円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース> (毎月分配型)	89,620円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	89,287円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (毎月分配型)	74,308円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	60,179円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	50,114円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	44,142円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	30,651円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	30,437円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース> (年2回分配型)	20,635円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10,795円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10,787円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9,829円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド (予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
グローバル・インカム・フルコース (為替リスク軽減型)	983円
グローバル・インカム・フルコース (為替ヘッジなし)	983円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
合計	2,870,024,150円

[お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。