

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	2028年9月8日まで（2013年10月25日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。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	三菱UFJ/ピムコトータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（年1回決算型）	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）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・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ（JPY）	ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンドへの投資を通じて、様々な償還期限の債券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。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。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※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）

三菱UFJ/ピムコ 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）

第10期（決算日：2023年9月8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「三菱UFJ/ピムコ 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）」は、去る9月8日に第10期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況を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国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12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、お取扱い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5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			債組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産額
		税分配分	み騰落	期中率				
	円	円	円	%	%	%	%	百万円
6期(2019年9月9日)	12,439	0	0	4.9	—	—	99.3	2,717
7期(2020年9月8日)	13,052	0	0	4.9	—	—	99.2	2,470
8期(2021年9月8日)	13,448	0	0	3.0	—	—	99.1	2,321
9期(2022年9月8日)	15,177	0	0	12.9	—	—	99.0	2,384
10期(2023年9月8日)	15,145	0	0	△ 0.2	—	—	98.9	2,278

(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) 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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2022年9月8日	15,177	—	—	—	99.0
9月末	14,633	△3.6	—	—	98.7
10月末	14,609	△3.7	—	—	99.1
11月末	14,112	△7.0	—	—	99.2
12月末	13,718	△9.6	—	—	99.0
2023年1月末	13,766	△9.3	—	—	99.0
2月末	14,062	△7.3	—	—	99.3
3月末	13,917	△8.3	—	—	99.3
4月末	14,147	△6.8	—	—	99.0
5月末	14,600	△3.8	—	—	99.5
6月末	15,041	△0.9	—	—	99.1
7月末	14,642	△3.5	—	—	99.1
8月末	15,104	△0.5	—	—	98.8
(期 末) 2023年9月8日	15,145	△0.2	—	—	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) 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10期：2022年9月9日～2023年9月8日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第10期首	15,177円
第10期末	15,145円
既払分配金	0円
騰落率	-0.2%

※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0.2%の下落となりました。

> 基準価額の変動要因

上昇要因

米ドルが対円で上昇したことがプラスとなりました。

下落要因

米国債券市況が下落したことがマイナスとなりました。
信託報酬がマイナスとなりました。

第10期：2022年9月9日～2023年9月8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。

期間の初めから2022年末ごろにかけて米連邦準備制度理事会（F R B）により政策金利が大幅に引き上げられたことや、一部経済指標の堅調な結果などから、利上げの長期化観測が強まったことなどを背景に、当期間を通じてみると米国債券市況は下落しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

米国の一部経済指標の結果から同国の景気減速が意識されたことや、日銀による金融緩和修正観測の強まりなどから、2022年末にかけてドルは対円で下落基調

で推移しましたが、米債務上限問題への懸念が和らいだことや、F R Bによる金融引き締め長期化観測の強まりなどがプラスとなり、当期間を通じて見ると、米ドルは対円で上昇しました。

▶ 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、足下のコール・レートは-0.066%となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ／ピムコ 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)

主として円建ての外国投資信託であるピムコ・トータル・リターン・ファンドⅡ－クラスJ（J P Y）の投資信託証券への投資を通じて、世界（新興国を含みます。）の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を高位に組み入れました。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。

なお、2023年8月末時点で、円建ての外国投資信託を通じて投資した信用リスク管理上、政府機関の発行または保証する有価証券と同等と判断した銘柄の実質的な組入比率は、ファニーメイは24.9%、フレディ・マックは21.4%としました。（ネットベース）

▶ ピムコ・トータル・リターン・ファンドⅡ － クラスJ (JPY)

金利戦略およびセクター配分戦略

当期間は概ね期間を通じて、ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）を市場平均対比で短めとしました。

債券セクターでは、米国金利の上昇等を背景に下落したモーゲージ証券等の保有等がマイナスとなりました。

- ▶ 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。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10期 2022年9月9日～2023年9月8日
当期分配金（対基準価額比率）	- (-%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	5,896

(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。)

▶ 三菱UFJ／ピムコ 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)

運用の基本方針にしたがって、引き続き円建て外国投資信託への投資を通じて米ドル建てを中心とする投資適格債券等を高位に組み入れた運用を行うほか、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、決算時に分配金額を決定します。

▶ ピムコ・トータル・リターン・ファンドⅡ - クラスJ (JPY)

米地方銀行の破綻を受けて金融当局が中小の金融機関に対する規制を強化することで貸出姿勢が慎重化する可能性がある点や高金利環境の下で企業の資金調達が更に困難となり得る点を鑑みて、2024年初には景気後退に入る可能性が高いと考えています。また、欧米の中央銀行の利上げ停止のタイミングが近付きつつあるとみていますが、利下げを開始するためにはインフレ率が中央銀行の目標水準にまで低下する必要がある、金融緩和へのシフトまでには相応の時間を要すると予想しています。

デュレーションは市場平均対比で短めとしています。状況に応じて柔軟にコントロールします。

社債については市場全体に対しては消極

姿勢とし、金融社債等を中心に選択的な保有を継続するほか、バリュエーションが魅力的な水準にあると判断したモーゲージ証券等への選別的投資を継続する方針です。

▶ 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。

2022年9月9日～2023年9月8日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	221	1.540	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(122)	(0.847)	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)	(95)	(0.660)	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)	(5)	(0.033)	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	0.003	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	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	221	1.543	

期中の平均基準価額は、14,367円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(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。

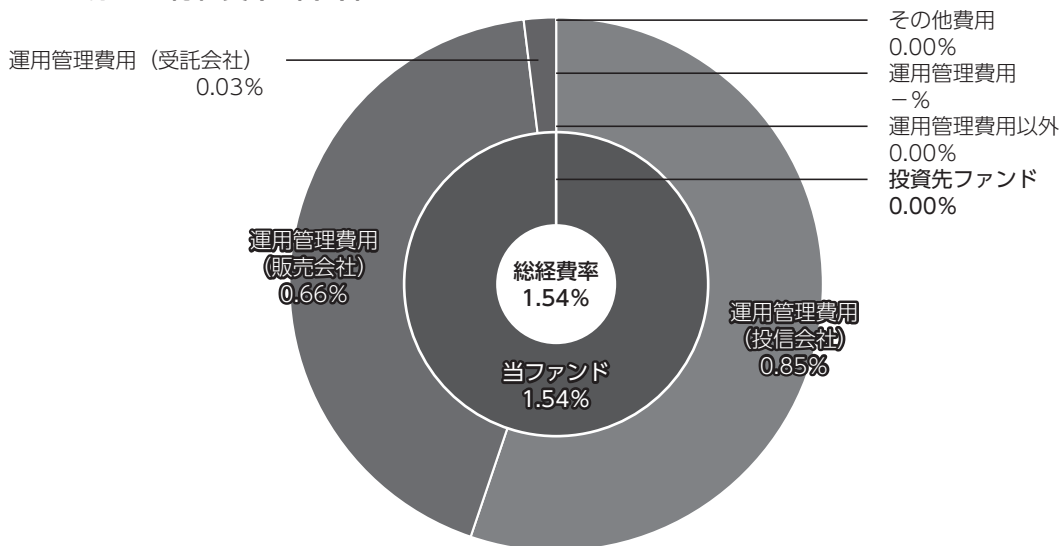
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.54%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.54
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.54
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

(2022年9月9日～2023年9月8日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	千口 10	千円 116,884	千口 13	千円 144,600

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月9日～2023年9月8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

<マネー・マーケット・マザーファンド>

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とはアコムです。

○組入資産の明細

(2023年9月8日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	201	199	2,254,759	98.9
	合計	201	199	2,254,759	98.9

(注) 比率は三菱UFJ／ピムコ 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) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 2,065	千口 2,065	千円 2,102

○投資信託財産の構成

(2023年9月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 2,254,759	% 98.1
マネー・マーケット・マザーファンド	2,102	0.1
コール・ローン等、その他	41,287	1.8
投資信託財産総額	2,298,148	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,298,148,689
コール・ローン等	41,286,408
投資信託受益証券(評価額)	2,254,759,568
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	2,102,713
(B) 負債	19,201,939
未払解約金	2,020,078
未払信託報酬	17,149,985
未払利息	90
その他未払費用	31,786
(C) 純資産総額(A-B)	2,278,946,750
元本	1,504,714,820
次期繰越損益金	774,231,930
(D) 受益権総口数	1,504,714,820口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,145円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,571,139,862円
 期中追加設定元本額 109,778,756円
 期中一部解約元本額 176,203,798円
 また、1口当たり純資産額は、期末15,145円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年9月9日～ 2023年9月8日
費用控除後の配当等収益額	67,003,506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
収益調整金額	370,696,145円
分配準備積立金額	449,556,557円
当ファンドの分配対象収益額	887,256,208円
1万口当たり収益分配対象額	5,896円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－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49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。

○損益の状況 (2022年9月9日～2023年9月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	101,139,355
受取配当金	101,153,687
受取利息	260
支払利息	△ 14,592
(B) 有価証券売買損益	△ 62,372,791
売買益	16,237,000
売買損	△ 78,609,791
(C) 信託報酬等	△ 34,135,703
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,630,861
(E) 前期繰越損益金	449,556,557
(F) 追加信託差損益金	320,044,512
(配当等相当額)	(370,696,145)
(売買損益相当額)	(△ 50,651,633)
(G) 計(D+E+F)	774,231,930
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	774,231,930
追加信託差損益金	320,044,512
(配当等相当額)	(370,696,145)
(売買損益相当額)	(△ 50,651,633)
分配準備積立金	516,560,063
繰越損益金	△ 62,372,645

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (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。

*三菱UFJ国際投信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】

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。

<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・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)
運用方針	ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンドへの投資を通じて、様々な償還期限の債券等に実質的に分散投資を行い、最大限のトータル・リターンを追求します。
主要運用対象	様々な償還期限の債券等
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、総資産の65%以上を様々な償還期限の債券等（その派生商品等を含みます。）に分散投資します。 ・ 投資適格未満の債券等への投資比率は、総資産の20%以内とします。ただし、投資する債券等は取得時においてB-格相当以上の格付けを取得しているものに限りします。 ・ 米ドル以外の通貨建ての有価証券への投資比率は、総資産の30%以内とします。ただし、米ドル以外の通貨への実質的な投資比率は、原則として総資産の20%以内とします。 ・ 新興国関連有価証券等への投資比率は、総資産の15%以内とします。 ・ ポートフォリオの平均デュレーション[※]は、原則としてブルームバーグ米国総合インデックスのデュレーション±2年以内で調整します。 <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> ・ デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ・ 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	原則として毎年5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 Luxembourg Trust IV Annual Report 31 May 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・トータル・リターン・ファンドII」で掲載しています。また、「ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド」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・トータル・リターン・ファンドII

(2021年6月1日～2022年5月31日)

	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII
	千米ドル
投資収入：	
マスターファンドからの配当収入	0
その他収入	0
収入合計	0
費用：	
管理費	0
税金	0
分配金	0
エージェンシー費	0
支払利息	0
その他費用	0
費用合計	0
投資純収入	0
実現純利益(損失)：	
投資有価証券	3,237
為替および為替予約取引	(4,507)
実現純利益(損失)	(1,270)
未実現評価益(評価損)の純変動：	
投資有価証券	(10,123)
為替および為替予約取引	249
未実現評価益(評価損)の純変動	(9,874)
運用による純資産の純増(減)額	(11,144)

(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。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ・トータル・リターン・ファンドII

(2021年6月1日～2022年5月31日)

	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII
	千米ドル
純資産期首	102,708
投資信託証券の発行	160
分配金額	(2,682)
分配金再投資	2,682
投資信託証券の償還	(16,614)
運用による増(減)額	(11,144)
純資産期末	75,110

(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。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)
 (A) ピムコ・トータル・リターン・ファンドII
 (2022年5月31日現在)

銘柄	口数 (単位: 千)	対純資産 比率 (%)
INVESTMENT FUNDS		
COLLECTIVE INVESTMENT SCHEMES		
PIMCO Total Return Strategy Fund (a)	590,551	\$ 73,338 97.64
Total Investment Funds		\$ 73,338 97.64

OTC FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*, except number of contracts)

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

HEDGED FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

As at 31 May 2022, the Class J (JPY, Hedged) Units had the following forward foreign currency contracts outstanding:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現 純評価(損)益	対純資産 比率 (%)
BOA	06/2022	¥ 17,760	\$ 137	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0.00
	06/2022	\$ 169	¥ 22,160	3	0	3	0.00
BPS	06/2022	¥ 135,431	\$ 1,044	0	(9)	(9)	(0.01)
	06/2022	\$ 7,293	¥ 944,005	45	0	45	0.06
BRC	07/2022	7,301	937,990	0	0	0	0.00
	06/2022	681	87,070	0	(4)	(4)	(0.01)
HUS	06/2022	¥ 97,384	\$ 763	7	(1)	6	0.01
	07/2022	\$ 642	¥ 81,659	0	(7)	(7)	(0.01)
SCX	06/2022	7,191	930,832	45	0	45	0.06
	07/2022	7,301	937,990	0	0	0	0.00
TOR	06/2022	¥ 811,803	\$ 6,387	76	0	76	0.10
	06/2022	\$ 7,386	¥ 944,955	0	(41)	(41)	(0.05)
	07/2022	6,387	810,703	0	(76)	(76)	(0.10)
				\$ 176	\$ (139)	\$ 37	0.05
Total OTC Financial Derivative Instruments						\$ 37	0.05
Total Investments						\$ 73,375	97.69
Other Current Assets & Liabilities						\$ 1,735	2.31
Net Assets						\$ 75,110	100.00

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (amounts in thousands*):

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

(a) Affiliated to the Fund.

Collateral (Received)/Pledged for OTC Financial Derivative Instruments

The following is a summary by counterparty of the fair value of OTC financial derivative instruments and collateral (received)/pledged as at 31 May 2022:

取引相手	店頭派生商品の 価値	担保(受取) 差入れ	ネット エクスポージャー ⁽¹⁾
BOA	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BPS	36	0	36
BRC	(4)	0	(4)
HUS	(1)	0	(1)
SCX	45	0	45
TOR	(41)	0	(41)

⁽¹⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. See Note 5, Market and Credit Risk, in the Notes to Financial Statements for more information regarding credit and counterparty risk.

(B) ピムコ・トータル・リターン・ストラテジー・ファンド
(2022年5月31日現在)

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
TRANSFERABLE SECURITIES			
ARGENTINA			
SOVEREIGN ISSUES			
Provincia de Buenos Aires 48.551% due 12/04/2025	ARS 409	\$ 2	0.00
AUSTRALIA			
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
FirstMac Mortgage Funding Trust 1.602% due 08/03/2049	AUD 2,000	1,438	0.45
AZERBAIJAN			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Steas Funding DAC 7.230% due 11/03/2026	\$ 800	790	0.24
BERMUDA			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Aircastle Ltd. 2.850% due 26/01/2028	1,300	1,130	0.35
CANADA			
SOVEREIGN ISSUES			
Province of Ontario 3.150% due 02/06/2022	CAD 1,000	791	0.25
Province of Quebec 3.500% due 01/12/2022	300	239	0.07
Total Canada		1,030	0.32
DENMARK			
CORPORATE BONDS & NOTES			
TDC Net AS 5.056% due 31/05/2028	€ 800	868	0.27
DOMINICAN REPUBLIC			
SOVEREIGN ISSUES			
Dominican Republic Government International Bond 4.500% due 30/01/2030	\$ 1,000	881	0.27
FINLAND			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Kojamo Oyj 1.875% due 27/05/2027	€ 1,500	1,513	0.47
FRANCE			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Altearea S.C.A. 1.875% due 17/01/2028	1,500	1,336	0.41
BNP Paribas S.A. 1.904% due 30/09/2028	\$ 1,400	1,218	0.38
BPCE S.A. 4.000% due 12/09/2023	1,400	1,409	0.44
Credit Agricole S.A. 0.500% due 21/09/2029	€ 1,000	932	0.29
L'Oreal S.A. 0.875% due 29/06/2026	800	839	0.26
RCI Banque S.A. 2.000% due 11/07/2024	1,200	1,281	0.40
Rexel S.A. 2.125% due 15/12/2028	1,000	941	0.29
Societe Generale S.A. 1.488% due 14/12/2026	\$ 1,200	1,074	0.33
Total France		9,030	2.80
GERMANY			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Deutsche Bank AG 1.000% due 19/11/2025	€ 1,100	1,134	0.35
1.750% due 19/11/2030	1,100	1,035	0.32
2.300% due 16/11/2022	\$ 900	901	0.28
3.961% due 26/11/2025	1,300	1,280	0.40
Volkswagen Bank GmbH 1.032% due 01/08/2022	€ 1,000	1,073	0.33

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
NOVONIA SE			
1.375% due 28/01/2026	€ 800	\$ 828	0.26
Total Germany		6,251	1.94
INDIA			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3.949% due 12/02/2030	\$ 600	514	0.16
reNew Wind Energy AP2 4.500% due 14/07/2028	1,000	865	0.27
Total India		1,379	0.43
IRELAND			
ASSET-BACKED SECURITIES			
Aqueduct European CLO DAC 0.640% due 20/07/2030	€ 1,501	1,592	0.49
Ares European CLO DAC 0.780% due 15/10/2031	1,000	1,052	0.33
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0.650% due 15/07/2030	1,120	1,186	0.37
Bosphorus CLO DAC 0.820% due 15/12/2030	1,600	1,698	0.53
Bridgepoint CLO DAC 1.210% due 15/01/2034	1,000	1,063	0.33
Cairn CLO DAC 0.650% due 20/10/2028	70	75	0.02
CVC Cordatus Loan Fund DAC 0.650% due 15/10/2031	1,100	1,153	0.36
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 0.900% due 20/01/2032	1,000	1,054	0.33
Harvest CLO DAC 0.850% due 15/01/2032	1,100	1,159	0.36
Invesco Euro CLO DAC 0.650% due 15/07/2031	1,100	1,160	0.36
Marlay Park CLO DAC 0.740% due 15/10/2030	1,400	1,484	0.46
OCF Euro CLO DAC 0.880% due 22/09/2034	1,200	1,264	0.39
Palmer Square European Loan Funding DAC 0.720% due 15/10/2031	900	947	0.29
0.790% due 15/04/2031	923	978	0.30
Palmerston Park CLO DAC 0.650% due 18/04/2030	769	815	0.25
Purple Finance CLO DAC 0.800% due 25/01/2031	1,399	1,487	0.46
Segovia European CLO DAC 0.770% due 18/01/2031	2,646	2,810	0.87
0.880% due 20/07/2032	1,000	1,055	0.33
Toro European CLO DAC 0.740% due 15/10/2030	550	583	0.18
0.920% due 12/01/2032	1,000	1,050	0.33
		23,665	7.34
CORPORATE BONDS & NOTES			
AIB Group PLC 2.875% due 30/05/2031	1,200	1,216	0.37
SMBC Aviation Capital Finance DAC 3.000% due 15/07/2022	\$ 800	800	0.25
		2,016	0.62
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Primrose Residential DAC 0.215% due 24/03/2061	€ 1,362	1,440	0.45
Total Ireland		27,121	8.41
ISRAEL			
SOVEREIGN ISSUES			
Israel Government International Bond 3.800% due 13/05/2060	\$ 3,400	3,064	0.95
ITALY			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Atlantia SpA 1.875% due 12/02/2028	€ 1,100	1,037	0.32

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIQ SpA			
2.125% due 28/11/2024	€ 1,300	\$ 1,341	0.42
Intesa Sanpaolo SpA 4.000% due 23/09/2029	\$ 1,400	1,286	0.40
UniCredit SpA 7.830% due 04/12/2023	2,600	2,727	0.84
Unipol Gruppo SpA 3.250% due 23/09/2030	€ 1,300	1,374	0.43
Total Italy		7,765	2.41
JAPAN			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1.412% due 17/07/2025	\$ 1,700	1,581	0.49
Mizuho Financial Group, Inc. 2.201% due 10/07/2031	1,100	917	0.28
3.752% due 19/07/2023	AUD 1,700	1,224	0.38
Nissan Motor Co. Ltd. 4.810% due 17/09/2030	\$ 1,400	1,314	0.41
ORIX Corp. 1.919% due 20/04/2026	€ 900	950	0.29
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1.474% due 08/07/2025	\$ 1,300	1,214	0.38
		7,200	2.23
SOVEREIGN ISSUES			
Japan Finance Organization for Municipalities			
3.375% due 27/09/2023	1,400	1,415	0.44
Total Japan		8,615	2.67
LUXEMBOURG			
CORPORATE BONDS & NOTES			
CPI Property Group S.A. 2.750% due 12/05/2026	€ 2,600	2,606	0.81
Logicor Financing SARL 2.000% due 17/01/2034	900	752	0.23
2.750% due 15/01/2030	€ 1,200	1,369	0.42
Total Luxembourg		4,727	1.46
NETHERLANDS			
ASSET-BACKED SECURITIES			
Grosvenor Place CLO BV 0.720% due 30/10/2029	€ 503	537	0.16
CORPORATE BONDS & NOTES			
Cooperatieve Rabobank UA 4.375% due 04/08/2025	\$ 1,000	1,006	0.31
CTP NV 0.500% due 21/06/2025	€ 1,000	946	0.29
0.625% due 27/09/2026	1,000	900	0.28
Enel Finance International NV 0.375% due 28/05/2029	1,000	921	0.29
1.875% due 12/07/2028	\$ 1,200	1,049	0.32
ING Groep NV 1.962% due 02/10/2023	1,400	1,407	0.44
VIA Outlets BV 1.750% due 15/11/2028	€ 1,400	1,316	0.41
		7,545	2.34
Total Netherlands		8,082	2.50
NORWAY			
CORPORATE BONDS & NOTES			
Yara International ASA 4.750% due 01/06/2028	\$ 1,600	1,588	0.49
PERU			
SOVEREIGN ISSUES			
Peru Government International Bond 6.350% due 12/08/2028	PEN 3,700	961	0.30
8.200% due 12/08/2026	1,000	288	0.09
Total Peru		1,249	0.39

銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)	銘柄	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	対純資産 比率(%)
JPMorgan Chase & Co. 2.947% due 24/02/2028 3.559% due 23/04/2024 3.797% due 23/07/2024	\$ 900	857	0.27	WRKCo, Inc. 4.650% due 15/03/2026 Wynn Las Vegas LLC 5.500% due 01/03/2025	\$ 1,600	1,646	0.51	1.038% due 20/10/2065 1.968% due 20/04/2067 3.000% due 15/10/2049 4.000% due 15/02/2050	\$ 529	528	0.16
Mariott International, Inc. 3.500% due 15/10/2032	1,400	1,259	0.39	MUNICIPAL BONDS & NOTES				Uniform Mortgage-Backed Security 3.500% due 01/05/2035 4.000% due 01/09/2030 - 01/09/2031	940	951	0.29
Micron Technology, Inc. 5.327% due 06/02/2029	1,300	1,343	0.42	Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015 7.750% due 01/01/2042	170	183	0.06	5.500% due 01/01/2033 - 01/04/2034	48	49	0.01
Mid-America Apartments LP 3.600% due 01/06/2027 3.950% due 15/03/2029	1,700	1,660	0.51	New York State Urban Development Corp., Revenue Notes, Series 2020 1.496% due 15/03/2027	1,400	1,266	0.39	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2.500% due 01/06/2052 3.000% due 01/07/2052 3.500% due 01/06/2052 4.000% due 01/07/2052	4,700 54,200 34,100 10,100	4,325 51,535 33,403 10,073	1.34 15.98 10.36 3.12
Morgan Stanley 3.620% due 17/04/2025	900	901	0.28		1,449	0.45					
MPLX LP 3.500% due 01/12/2022	1,200	1,205	0.37	NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES				U.S. TREASURY OBLIGATIONS			
National Retail Properties, Inc. 4.300% due 15/10/2028	1,200	1,195	0.37	Citigroup Mortgage Loan Trust 3.419% due 25/09/2037	173	166	0.05	U.S. Treasury Bonds			
Norfolk Energy Capital Holdings, Inc. 3.550% due 01/05/2027	1,500	1,487	0.46	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 2.665% due 25/08/2035	5	4	0.00	1.375% due 15/11/2040 1.375% due 15/08/2050 1.625% due 15/11/2050 1.875% due 15/02/2041 2.000% due 15/11/2041 2.000% due 15/02/2050 2.750% due 15/08/2042 2.750% due 15/11/2042 2.875% due 15/05/2043 2.875% due 15/08/2045 3.125% due 15/08/2044 3.375% due 15/05/2044 4.250% due 15/05/2039 4.375% due 15/11/2039 4.625% due 15/02/2040	6,200 4,900 2,700 3,000 1,500 4,100 2,000 4,200 1,200 1,900 5,600 11,800 700 2,000 500	4,560 3,274 1,930 2,405 1,219 3,226 1,831 3,837 1,118 1,758 5,409 11,876 810 2,342 603	1.41 1.01 0.60 0.74 0.38 1.00 0.57 1.19 0.35 0.54 1.68 3.68 0.25 0.73 0.19
Omega Healthcare Investors, Inc. 4.500% due 15/01/2025	1,200	1,198	0.37	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 1.346% due 25/01/2036	316	318	0.10	U.S. Treasury Notes			
ONEOK, Inc. 6.350% due 15/01/2031	1,400	1,527	0.47	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 2.006% due 25/02/2033	110	111	0.03	2.125% due 30/09/2024 2.250% due 15/08/2027	12,600 1,100	12,462 1,068	3.87 0.33
Owens Corning 4.200% due 01/12/2024	1,500	1,522	0.47	GR Mortgage Loan Trust 3.037% due 25/06/2034 3.177% due 25/09/2035	19 38	19 37	0.01 0.01		59,728	18.52	
Pacific Gas & Electric Co. 3.150% due 01/01/2026 3.750% due 15/02/2024 4.550% due 01/07/2030	800 1,600 700	754 1,589 652	0.23 0.49 0.20	HomeBanc Mortgage Trust 1.366% due 25/12/2036	109	109	0.03	Total United States	260,531	80.77	
PayPal Holdings, Inc. 2.650% due 01/10/2026	1,400	1,351	0.42	JPMorgan Mortgage Trust 2.302% due 25/07/2035	0	0	0.00	SHORT-TERM INSTRUMENTS			
Penske Truck Leasing Co. LP 3.450% due 01/07/2024	1,200	1,191	0.37	JPMorgan Mortgage Trust 2.418% due 25/08/2035 2.695% due 25/08/2034 2.926% due 25/04/2035	127 2 56	128 2 54	0.04 0.00 0.02	ARGENTINA TREASURY BILLS			
Public Service Co. of Colorado 1.900% due 15/01/2031	1,100	945	0.29	MortgageIT Trust 1.526% due 25/12/2035	144	139	0.04	51.049% due 30/09/2022 (a)(b)	1,000	4	0.00
Santander Holdings USA, Inc. 3.400% due 18/01/2023	1,200	1,202	0.37	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates 6.500% due 25/02/2035	391	368	0.11	ISRAELI TREASURY BILLS			
SBA Tower Trust 2.328% due 15/07/2052	1,100	993	0.31	PHH Alternative Mortgage Trust 1.326% due 25/02/2037	536	405	0.13	(0.005% due 03/08/2022 (a)(b))	ILS 5,300	1,591	0.50
St. Green Realty Corp. 4.500% due 01/12/2022	1,100	1,104	0.34	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2.878% due 25/04/2035	74	72	0.02	U.S. TREASURY BILLS			
Southern California Gas Co. 3.200% due 15/06/2025	1,500	1,486	0.46	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1.586% due 25/10/2045 2.695% due 25/12/2035 2.949% due 25/09/2035	434 484 57	421 482 55	0.13 0.15 0.02	0.611% due 19/07/2022 (a)(b)(e) 0.633% due 19/07/2022 (a)(b)(e)	\$ 201 100	201 100	0.06 0.03
Southern Power Co. 0.900% due 15/01/2026	1,000	904	0.28	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2.652% due 15/08/2049	1,100	1,047	0.33		301	0.09	
United Airlines Pass-Through Trust 2.875% due 07/04/2030	1,067	975	0.30	U.S. GOVERNMENT AGENCIES				Total Short-Term Instruments	1,896	0.59	
Vhware, Inc. 1.000% due 15/08/2024 4.650% due 15/05/2027	1,200 1,000	1,135 1,022	0.35 0.32	Fannie Mae 1.606% due 25/10/2041 2.165% due 01/05/2038	404 227	407 236	0.13 0.07	Total Transferable Securities	\$ 410,488	127.26	
Volkswagen Group of America Finance LLC 4.750% due 13/11/2028	1,100	1,123	0.35	Freddie Mac 1.195% due 15/07/2034 2.700% due 01/08/2023 4.000% due 01/02/2030 - 01/04/2042	844 1,579 51	841 1,577 51	0.26 0.49 0.02				
Wells Fargo & Co. 3.550% due 29/09/2025	1,300	1,300	0.40	Ginnie Mae 0.898% due 20/02/2067 0.938% due 20/04/2064	584 414	582 412	0.18 0.13				

REPURCHASE AGREEMENTS

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受取担保 価値	レボ契約の 価値	レボ契約の 受取 ⁽¹⁾	対純資産 比率(%)
BSN	0.790%	31/05/2022	01/06/2022	\$ 2,500	U.S. Treasury Notes 4.250% due 15/11/2040	\$ (2,554)	\$ 2,500	\$ 2,500	0.78
Total Repurchase Agreements						\$ (2,554)	\$ 2,500	\$ 2,500	0.78

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS DEALT IN ON A REGULATED MARKET (amounts in thousands*, except number of contracts)

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

FUTURES

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	06/2022	244	\$ 2,475	0.77
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2022	42	31	0.01
Euro-Buxl 30-Year Bond June Futures	Short	06/2022	13	443	0.14
Japan Government 10-Year Bond June Futures	Short	06/2022	11	(12)	0.00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2022	162	56	0.02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	86	10	0.00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09/2022	55	10	0.00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09/2022	63	12	0.00
				\$ 3,025	0.94

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	時価	対純資産 比率(%)
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note July Futures	\$ 118.000	24/06/2022	26	\$ (13)	\$ (10)	(0.01)
Total Financial Derivative Instruments Dealt in on a Regulated Market					\$ 3,015	0.93

CENTRALLY CLEARED FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*)

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

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

参照資産	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
General Electric Co.	1.000%	20/12/2023	\$ 600	\$ 20	0.01
General Electric Co.	1.000	20/06/2024	300	3	0.00
General Electric Co.	1.000	20/12/2024	1,300	30	0.01
				\$ 53	0.02

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

インデックス/トランシェ	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	5.000%	20/06/2027	€ 10,900	\$ (280)	(0.09)

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	未実現評価(損)益	対純資産 比率(%)
Receive ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0.750%	21/09/2052	£ 6,400	\$ 897	0.28
Pay	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0.800	15/03/2032	3,800	(429)	(0.13)
Receive	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0.900	15/03/2052	1,400	297	0.09
Pay	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.000	18/06/2022	¥ 70,000	0	0.00
Pay	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.123	22/08/2039	109,610	(84)	(0.03)
Receive ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.250	17/03/2031	10,840,000	466	0.14
Receive	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.500	15/03/2042	203,000	2	0.00
Receive	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.662	19/04/2042	18,000	1	0.00
Receive ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0.800	15/06/2052	52,000	10	0.00
Pay ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1.320	21/12/2023	\$ 5,400	(55)	(0.02)
Pay	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1.788	03/05/2027	3,000	(98)	(0.03)
Pay	1-Year BRL-CDI	11.980	04/01/2027	BRL 32,300	(7)	0.00
Pay	1-Year BRL-CDI	12.070	02/01/2025	18,700	(10)	0.00
Pay ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1.270	04/11/2023	\$ 36,300	(12)	0.00
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.800	22/08/2023	13,200	404	0.13
Pay ⁽²⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0.750	15/06/2032	€ 25,800	(1,797)	(0.56)
Pay	6-Month EUR-EURIBOR	1.000	18/05/2027	2,600	(57)	(0.02)
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.000	18/06/2022	¥ 70,000	0	0.00
					\$ (472)	(0.15)
Total Centrally Cleared Financial Derivative Instruments					\$ (699)	(0.22)

⁽¹⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash, securities or other deliverable obligations equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

(2) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

(3) 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.

OTC FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS (amounts in thousands*, except number of contracts)

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

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	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	コスト	時価	対純資産 比率(%)
NGF	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	2.851%	04/08/2022	900	\$ 9	\$ 9	0.00

WRITTEN OPTIONS

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

取引相手	銘柄	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
BOA	Call - OTC AUD versus USD	\$ 0.722	08/07/2022	2,240	\$ (12)	\$ (19)	(0.01)
BRC	Call - OTC AUD versus USD	0.738	11/08/2022	800	(5)	(5)	0.00
CBK	Put - OTC USD versus NOK	NOK 9.390	14/07/2022	1,800	(16)	(32)	(0.01)
DUB	Call - OTC USD versus BRL	BRL 5.720	12/08/2022	350	(6)	(1)	0.00
	Put - OTC USD versus NOK	NOK 9.245	13/07/2022	2,500	(20)	(27)	(0.01)
MBC	Call - OTC USD versus BRL	BRL 5.615	09/08/2022	1,000	(15)	(4)	0.00
MYI	Call - OTC USD versus BRL	5.555	08/07/2022	3,630	(51)	(5)	0.00
	Call - OTC USD versus BRL	5.288	29/08/2022	2,000	(33)	(27)	(0.01)
					\$ (158)	\$ (120)	(0.04)

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	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	2.250%	25/08/2022	7,400	\$ (38)	\$ (26)	(0.01)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	2.850	25/08/2022	7,400	(38)	(47)	(0.02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	2.310	19/08/2022	1,300	(12)	(7)	0.00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	3.010	19/08/2022	1,300	(11)	(9)	0.00
							\$ (99)	\$ (89)	(0.03)

OPTIONS ON SECURITIES

取引相手	銘柄	行使金利	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム	時価	対純資産 比率(%)
BOA	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3.000% due 01/06/2052	\$ 95.047	06/06/2022	800	\$ (6)	\$ (2)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/07/2052	99.141	07/07/2022	501	(3)	(2)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/07/2052	101.141	07/07/2022	501	(3)	(1)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/08/2052	97.625	04/08/2022	3,600	(20)	(10)	(0.01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/08/2052	97.695	04/08/2022	1,600	(10)	(4)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.500% due 01/08/2052	99.750	04/08/2022	1,800	(8)	(6)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.500% due 01/08/2052	101.750	04/08/2022	1,800	(6)	(9)	0.00
JPM	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3.000% due 01/06/2052	96.406	06/06/2022	900	(6)	(10)	0.00
	Put - OTC Fannie Mae, TBA 3.000% due 01/06/2052	97.617	06/06/2022	900	(5)	(20)	(0.01)
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3.000% due 01/08/2052	92.656	04/08/2022	1,500	(13)	(6)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3.000% due 01/08/2052	93.098	04/08/2022	2,900	(23)	(14)	(0.01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/08/2052	97.859	04/08/2022	1,300	(8)	(4)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/08/2052	98.344	04/08/2022	1,100	(5)	(5)	0.00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3.500% due 01/06/2052	96.453	06/06/2022	800	(4)	0	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3.500% due 01/06/2052	98.453	06/06/2022	1,600	(6)	(2)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3.500% due 01/07/2052	96.000	07/07/2022	1,600	(8)	(3)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/07/2052	97.305	07/07/2022	1,900	(12)	(2)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/07/2052	99.156	07/07/2022	899	(7)	(4)	0.00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.000% due 01/07/2052	101.156	07/07/2022	899	(5)	(2)	0.00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4.500% due 01/07/2052	99.078	07/07/2022	800	(4)	0	0.00
					\$ (162)	\$ (106)	(0.03)

(1) Notional Amount represents the number of contracts.

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

取引相手	参照資産	固定受取金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	プレミアム支払(受取)	未実現評価(損)益	時価	対純資産比率(%)
BOA	South Africa Government International Bond	1.000%	20/12/2026	\$ 2,000	\$ (93)	\$ (3)	\$ (96)	(0.03)
GST	Colombia Government International Bond	1.000	20/06/2027	1,400	(64)	(3)	(67)	(0.02)
MYC	Colombia Government International Bond	1.000	20/06/2027	200	(11)	2	(9)	0.00
	South Africa Government International Bond	1.000	20/12/2026	2,000	(90)	(6)	(96)	(0.03)
					\$ (258)	\$ (10)	\$ (268)	(0.08)

⁽¹⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash, securities or other deliverable obligations equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

⁽²⁾ The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価(損)益	対純資産比率(%)
BOA	06/2022	\$ 30,774	£ 24,343	\$ 0	\$ (95)	\$ (95)	(0.03)
	07/2022	£ 24,343	\$ 30,779	95	0	95	0.03
	08/2022	\$ 35	BRL 185	3	0	3	0.00
BPS	08/2022	1,686	NOK 16,056	23	0	23	0.01
	08/2022	115	PEN 438	4	0	4	0.00
	05/2023	PEN 438	\$ 112	0	(4)	(4)	0.00
	06/2022	CLP 1,270,837	\$ 1,552	11	0	11	0.00
	06/2022	€ 994	\$ 1,047	0	(18)	(18)	(0.01)
	06/2022	\$ 803	€ 754	4	0	4	0.00
	07/2022	€ 648	\$ 699	3	0	3	0.00
	07/2022	MXN 189	\$ 9	0	(1)	(1)	0.00
	07/2022	\$ 301	€ 280	0	(1)	(1)	0.00
	08/2022	1,162	NOK 11,375	49	0	49	0.02
BSS	06/2022	272	PEN 995	0	(3)	(3)	0.00
	07/2022	BRL 66,100	\$ 11,604	0	(2,221)	(2,221)	(0.69)
CBK	07/2022	\$ 12,114	BRL 66,100	1,711	0	1,711	0.53
	06/2022	653	€ 620	11	0	11	0.00
	06/2022	75	PEN 286	3	0	3	0.00
	07/2022	460	NOK 4,509	20	0	20	0.01
	08/2022	ILS 5,300	\$ 1,654	58	0	58	0.02
	08/2022	PEN 438	\$ 108	0	(10)	(10)	0.00
	08/2022	\$ 35	BRL 185	3	0	3	0.00
	08/2022	\$ 1,015	PEN 3,842	20	0	20	0.01
	10/2022	PEN 1,205	\$ 305	0	(17)	(17)	(0.01)
	11/2022	2,901	\$ 731	0	(44)	(44)	(0.01)
DUB	12/2022	3,328	\$ 837	0	(49)	(49)	(0.01)
	02/2023	7,977	\$ 2,007	0	(108)	(108)	(0.03)
	06/2022	€ 24,939	\$ 31,378	0	(53)	(53)	(0.02)
	06/2022	PEN 283	\$ 677	1	0	1	0.00
	07/2022	\$ 631	NOK 15	0	15	15	0.01
	07/2022	77	PEN 283	0	(1)	(1)	0.00
	08/2022	BRL 371	\$ 70	0	(7)	(7)	0.00
	06/2022	1,023	\$ 216	0	0	0	0.00
	06/2022	CNH 9,462	\$ 1,386	0	(29)	(29)	(0.01)
	06/2022	\$ 208	BRL 1,023	8	0	8	0.00
GLM	06/2022	ZAR 53,521	\$ 3,493	64	0	64	0.02
	07/2022	BRL 1,023	\$ 206	0	(8)	(8)	0.00
	07/2022	\$ 961	PEN 3,600	12	0	12	0.00
	08/2022	68	\$ 253	1	0	1	0.00
	06/2022	AUD 640	\$ 451	0	(8)	(8)	0.00
	06/2022	CAD 1,321	\$ 1,024	0	(21)	(21)	(0.01)
	06/2022	CNH 6,003	\$ 888	0	(10)	(10)	0.00
	06/2022	\$ 3,284	€ 3,132	71	0	71	0.02
	06/2022	346	€ 277	3	0	3	0.00
	08/2022	BRL 1,060	\$ 203	0	(16)	(16)	(0.01)
HUS	08/2022	¥ 42,000	\$ 333	4	0	4	0.00
	08/2022	\$ 412	BRL 2,023	4	0	4	0.00
	05/2023	CNH 4,717	\$ 703	0	(1)	(1)	0.00
	06/2022	15,035	\$ 2,199	0	(50)	(50)	(0.02)
	06/2022	\$ 402	£ 319	0	0	0	0.00
	08/2022	¥ 32,715	\$ 250	0	(5)	(5)	0.00
	08/2022	\$ 203	BRL 1,061	16	0	16	0.01
	06/2022	BRL 1,023	\$ 217	1	0	1	0.00
	06/2022	€ 63,939	\$ 67,926	0	(569)	(569)	(0.18)
	06/2022	\$ 216	BRL 1,023	0	0	0	0.00
JPM	07/2022	BRL 3,872	\$ 739	0	(69)	(69)	(0.02)
	08/2022	2,022	\$ 412	0	(4)	(4)	0.00
RYL	06/2022	\$ 191	€ 179	1	0	1	0.00
SCX	06/2022	74	PEN 283	3	0	3	0.00
	07/2022	370	BRL 1,930	33	0	33	0.01

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価益	未実現評価損	未実現純評価 (損)益	対純資産 比率(%)		
SOG	06/2022	\$ 64,646	€ 60,248	\$ 0	\$ (105)	\$ (105)	(0.03)		
	07/2022	€ 60,248	\$ 64,755	106	0	106	0.03		
	08/2022	\$ 1,786	NOK 17,516	79	0	79	0.03		
UAG	06/2022	ZAR 22,579	\$ 1,449	2	0	2	0.00		
	07/2022	NOK 10,597	\$ 1,091	0	(37)	(37)	(0.01)		
	07/2022	\$ 370	BRL 1,931	34	0	34	0.01		
	08/2022	1,456	CLP 1,272,977	67	0	67	0.02		
						\$ 2,543	\$ (3,564)	\$ (1,021)	(0.31)
Total OTC Financial Derivative Instruments							\$ (1,595)	(0.49)	
Total Investments							\$ 413,709	128.26	
Other Current Assets & Liabilities							\$ (91,144)	(28.26)	
Net Assets							\$ 322,565	100.00	

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (amounts in thousands*):

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

^ Security is in default.

(a) Zero coupon security.

(b) Coupon represents a yield to maturity.

(c) Contingent convertible security.

(d) Security with an aggregate fair value of \$874 has been pledged as collateral under the terms of the Master Repurchase Agreements and/or Global Master Repurchase Agreements as at 31 May 2022.

(e) Security with an aggregate fair value of \$301 and cash of \$1,480 have been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as at 31 May 2022.

Cash of \$5,846 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as at 31 May 2022.

Reverse Repurchase Agreements as at 31 May 2022:

取引相手	借入利率	借入日	満期日	借入元本	リバースレボの 支払	対純資産 比率(%)
BRC	(1.100)%	23/05/2022	TBD ⁽¹⁾	€ (826)	\$ (884)	(0.27)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (884)	(0.27)

⁽¹⁾ Open maturity reverse repurchase agreement.

Collateral (Received)/Pledged for OTC Financial Derivative Instruments

The following is a summary by counterparty of the fair value of OTC financial derivative instruments and collateral (received)/pledged as at 31 May 2022:

取引相手	店頭派生商品の 価値	担保の(受取) 差入れ	ネット エクスポージャー ⁽¹⁾
BOA	\$ (123)	\$ 0	\$ (123)
BPS	(2)	0	(2)
BRC	44	0	44
BSS	(513)	510	(3)
CBK	(145)	20	(125)
DUB	(73)	0	(73)
GLM	(41)	531	490
GST	(67)	0	(67)
HUS	26	0	26
JPM	(69)	280	211
MBC	(4)	0	(4)
MSC	(29)	0	(29)
MYC	(105)	0	(105)
MYI	(673)	440	(233)
NGF	9	0	9
RYL	1	0	1
SAL	(13)	0	(13)
SCX	36	0	36
SOG	80	0	80
UAG	66	0	66

⁽¹⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. See Note 6, Market and Credit Risk, in the Notes to Financial Statements for more information regarding credit and counterparty risk.

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 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率					
33期(2021年5月20日)	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 円	価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落	率				
(期首) 2022年11月21日	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。

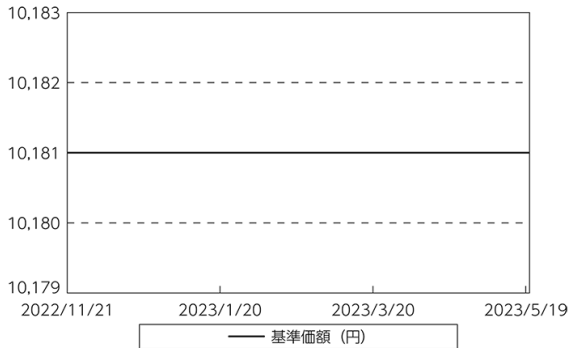
○運用経過

●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 米国バンクロンファンド 通貨選択シリーズ<マネーマーケットファンド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。