

## 第4期

# 運用報告書(全体版)

## PIMCO ダイナミック・マルチアセット 戦略ファンド(資産成長型) (愛称 世界のマイスター(資産成長型))

【2024年9月10日決算】

### 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

皆様の「PIMCO ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(資産成長型)(愛称 世界のマイスター(資産成長型))」は、2024年9月10日に第4期決算を迎えましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

## SBI 岡三アセットマネジメント

〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ

フリーダイヤル ☎0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

お取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

[ホームページ]

<https://www.sbiokasan-am.co.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合	
信託期間	2020年10月30日から2040年9月10日までです。	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、世界各国(新興国を含みます。)の株式や債券(国債、政府機関債、社債、ハイ・イールド債券、モーゲージ債、物価連動債など)、通貨、商品および不動産関連の証券等の幅広い資産(デリバティブを含みます。)に投資を行い、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則としてほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。	
主要投資対象	当ファンド	ピムコ・パミュダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ(JPY)および日本マネー・マザーファンドを主要投資対象とします。
	ピムコ・パミュダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ(JPY)	世界各国(新興国を含みます。)の株式や債券(国債、政府機関債、社債、ハイ・イールド債券、モーゲージ債、物価連動債など)、通貨、商品および不動産関連の証券等の幅広い資産(デリバティブを含みます)を主要投資対象とします。
	日本マネー・マザーファンド	わが国の公社債および短期金融商品为主要投資対象とします。
投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎年9月10日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	基準価額		騰落率	債組入比率	債券率	投資信託 組入比率	純資産総額
		税金 分	込 配					
(設定日) 2020年10月30日	円 10,000		円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 1,623
1期(2021年9月10日)	10,714		0	7.1	0.1		99.1	15,321
2期(2022年9月12日)	9,354		0	△12.7	0.1		99.0	12,784
3期(2023年9月11日)	8,321		0	△11.0	0.2		98.7	8,648
4期(2024年9月10日)	8,504		0	2.2	0.3		98.7	6,680

(注) 基準価額および分配金（税引前）は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金（税引前）込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) 当ファンドは、各資産の投資比率が変動するため、ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないことから、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、債券組入比率は実質比率を記載しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

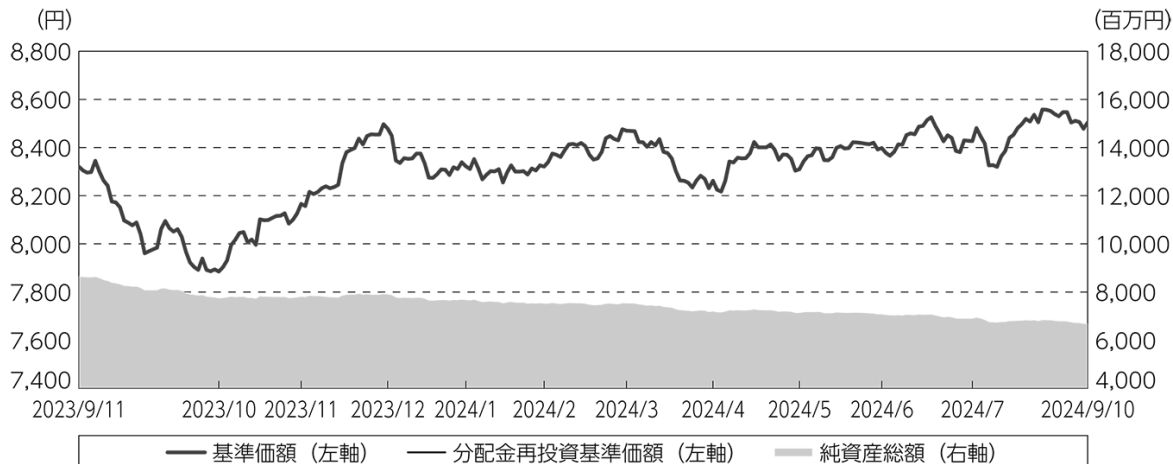
年月日	基準	基準価額		騰落率	債組入比率	債券率	投資信託 組入比率	託券率
		騰	落					
(期首) 2023年9月11日	円 8,321		% —	% —	% 0.2	% 98.7	% 98.7	% 98.7
9月末	8,077		△2.9		0.2		98.6	
10月末	7,885		△5.2		0.3		98.7	
11月末	8,166		△1.9		0.2		98.7	
12月末	8,479		1.9		0.2		98.9	
2024年1月末	8,322		0.0		0.2		98.8	
2月末	8,321		0.0		0.2		98.5	
3月末	8,470		1.8		0.2		98.8	
4月末	8,262		△0.7		0.2		98.8	
5月末	8,310		△0.1		0.2		98.7	
6月末	8,398		0.9		0.3		98.7	
7月末	8,427		1.3		0.3		98.7	
8月末	8,530		2.5		0.3		98.7	
(期末) 2024年9月10日	8,504		2.2		0.3		98.7	

(注) 騰落率は期首比。

## 運用経過

### 期中の基準価額等の推移

（2023年9月12日～2024年9月10日）



期首：8,321円

期末：8,504円（既払分配金（税引前）：0円）

騰落率：2.2%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首（2023年9月11日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主要投資対象である「ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ（JPY）」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

#### (主なプラス要因)

- ・米国を中心に戦略的に株式を分散投資したことや、米国や欧州などの金利リスクを取ったことなどがプラスに寄与しました。

#### (主なマイナス要因)

- ・欧米の株式を一部売り持ちしていたことや、米ドル売り円買いの為替ヘッジコストがかかったことなどがマイナスに影響しました。

## 投資環境

（2023年9月12日～2024年9月10日）

当期間中、グローバル金融市場では、株式は全般に上昇しました。また、国債利回りは低下、スプレッドは縮小しました。

世界の株式市場については、米国で早期利下げ観測が高まったことや、半導体関連企業を中心に企業決算が良好な結果となったことなどがプラス要因となり、期初から2024年3月にかけて上昇しました。その後は、インフレの鎮静化を背景に利上げ観測が後退したことに加え、生成AI（人工知能）関連銘柄の成長期待からハイテク株を中心に上昇し、米国株式市場では史上最高値を更新しました。期の後半にかけては、一部経済指標の鈍化などを背景に株式市場では調整局面が見られる展開となりましたが、早期の利下げ期待の高まりから株式市場は再度上昇基調に転じました。期を通じてみると、株式市場は全般に上昇しました。

世界の債券市場については、底堅い米景況感などを背景に、国債利回りは上昇する場面がみられた一方、米インフレ率の鈍化に加え、米連邦準備制度理事会（FRB）高官が利下げについて言及したことなどから、早期利下げに対する期待が高まり、期初から2024年3月にかけて国債利回りは低下しました。その後は、インフレのピークアウトが確認されたものの、粘着性の高いインフレ率を背景に金融引き締め環境の長期化が懸念され、金利が上昇する局面もみられました。しかしながら、経済指標の鈍化等を背景に欧州では6月に利下げを実施したことに加え、米国では9月からの利下げ開始が市場では織り込まれ、期の後半にかけては、再び金利は低下しました。また、株式市場が高値を更新するなか、ハイイールド債券、新興国債券のスプレッドは縮小し、いずれも価格は上昇する展開となりました。

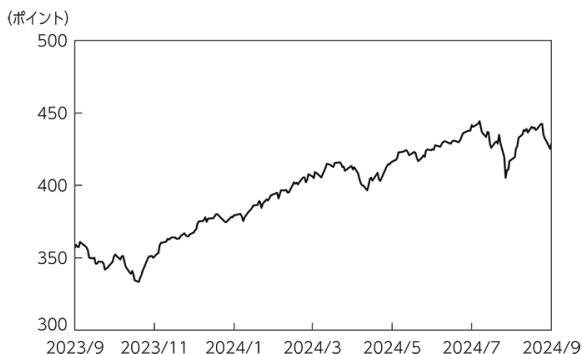
為替市場は、日米の金融政策の変更に関する思惑などから、米ドル/円は上下に振れる場面もありましたが、期初から2024年3月にかけてはほぼ横這いで推移しました。その後は、欧米の中央銀行による利下げが見込まれる一方で、日銀が利上げ継続の意向を示したことから、金利差の縮小の可能性が意識され、円高米ドル安、円高ユーロ安が進行しました。

商品市場は、原油価格は下落した一方で、金価格は上昇しました。

日本国内の短期金融市場は、期初からマイナス圏で推移していた1年国債利回りは、日銀が2024年3月の金融政策決定会合において、マイナス金利政策の解除を決定したことから、6月初旬には0.2%台前半に上昇しました。しかしその後は、早期の利上げ観測が後退したことから、1年国債利回りは0.1%台まで低下する場面もありましたが、株式市場が落ち着きを見せたことを受けて、利上げ観測が再燃し、0.2%台前半まで上昇して期末を迎えました。

当ファンドは、各資産の投資比率が変動するため、ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないことから、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。以下は参考指標として掲載しております。

【世界株式の推移】



【世界債券の推移】



※参考指標は、世界株式はMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引後配当込み、現地通貨ベース）、世界債券はFTSE世界BIG債券インデックス（円ヘッジベース）です。詳細につきましては、次ページをご覧ください。

世界株式は、為替ヘッジコスト（プレミアム）を控除しておりません。

### ＜当ファンドの参考指標について＞

MSCI指数はMSCI Inc. が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。PIMCO ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（資産成長型）（愛称 世界のマイスター（資産成長型））（以下、「当ファンド」といいます。）の開発は、S B I 岡三アセットマネジメント株式会社のみにより行われています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ会社（以下、総称して「LSEグループ」といいます。）は、いかなる形においても、当ファンドとの関係を有さず、またスポンサー、保証、販売もしくは販売促進を行うものではありません。FTSE Russellは、特定のLSEグループ会社の取引名です。FTSE世界BIG債券インデックス（円ヘッジベース）（以下、「本指数」といいます。）にかかるすべての権利は、指数を保有する該当LSEグループ会社に帰属します。「FTSE®」は、該当するLSEグループ会社の商標であり、ライセンス契約に基づき、他のあらゆるLSEグループ会社で使用します。本指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income, LLCまたはその関連会社、代理人もしくはパートナーによって、またはこれからの委託を受けて算出されています。LSE グループは、(a) 本指数の使用、本指数への依拠もしくは本指数の誤り、または (b) 当ファンドへの投資もしくはその運用から生じる、いかなるものに対する責任も負うものではありません。LSEグループは、当ファンドから得られる結果、またはS B I 岡三アセットマネジメント株式会社による提供の目的に対する本指数の適切性のいずれについても、主張、予想、保証、表明を行わないものとします。

### 当ファンドのポートフォリオ

(2023年9月12日～2024年9月10日)

#### ＜PIMCO ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（資産成長型）（愛称 世界のマイスター（資産成長型））＞

「ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ (JPY)」、「日本マネー・マザーファンド」を主要投資対象とし、「ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ (JPY)」を高位に組み入れて運用を行いました。

#### ○ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ (JPY)

株式部分については、一時的にボラティリティ（変動率）が大きくなる局面もありましたが、A I 関連銘柄を中心に投資比率は20%前後としました。

債券部分については、世界的にインフレがピークアウトしたことから、金融政策の転換が意識されるなか、米国では金利リスクを積み増しました。欧州においても、欧州中央銀行（ECB）の利下げ開始が織り込まれるなか、金利リスク量を積み増しました。また、業種や銘柄を厳選し投資妙味のあるクレジットにも、期間を通じて限定的に投資を行いました。

通貨については、バリュエーションに妙味のあるインドルピーに対し買いポジションを構築する一方、中国の景気不安の影響を受けやすい台湾ドルなどの売りポジションを構築しました。

#### ○日本マネー・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行い、国債および政府保証債を組み入れました。

### 当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年9月12日～2024年9月10日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

## 分配金

（2023年9月12日～2024年9月10日）

当ファンドは毎年9月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象収益として、分配を行います。

分配可能額、基準価額水準等を勘案し、当期につきましては、収益分配は見送りと致しました。

なお、収益分配に充てなかった留保益については、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

項 目	第4期
	2023年9月12日～ 2024年9月10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	212

（注）対基準価額比率は当期分配金（税引前）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

### <PIMCO ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド（資産成長型）（愛称 世界のマイスター（資産成長型））>

当ファンドの主要投資対象である「ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ（JPY）」の組入比率を高位に保つことを基本としますが、市況環境等によっては組入比率が高位にならない場合があります。

#### ○ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ（JPY）

世界各国（新興国を含みます。）の株式や債券（国債、政府機関債、社債、ハイ・イールド債券、モーゲージ債、物価連動債など）、通貨、商品および不動産関連の証券等の幅広い資産（デリバティブを含みます）に投資を行います。ポートフォリオの構築にあたっては、景気見通し、各資産のバリュエーション、資産間の相関などを考慮し、機動的な資産配分を行います。

当ファンドにおいては、株式部分では世界経済の地域的な変化を捉えつつエクスポージャーを調整する方針としています。また債券部分については国債など安全性の高い債券を中心にインカムゲインを積み上げつつ、将来的な金利低下局面では価格上昇益も期待できるポジションを基本的には維持しています。

当面の債券における金利戦略については、中長期的な金利戦略に変更はないものの米国で利下げ観測が高まるなか金融政策の影響を受けやすいとみられる短期ゾーンへの投資を継続する一方、中長期での米国財政赤字に対する懸念などから長期～超長期ゾーンの売り持ちを維持します。

株式戦略については、主要国のインフレ動向や景気への波及経路にばらつきが見られるようになるなか、特定のテーマだけでなく、より分散の効いたマクロ的なアプローチも有効になるとみています。

通貨戦略については、日本円への100%ヘッジを基本としながら、通貨の見通しを一部ポートフォリオに反映させています。実質金利が魅力的であり、バリュエーションにも妙味のあるインドルピーやブラジルリアルなどを積極姿勢とする一方、資源の輸入国である台湾や韓国などの通貨を売り建てるポジションを構築しています。

#### ○日本マネー・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益確保を目的に運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年9月12日～2024年9月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	153	1.843	委託した資金の運用の対価
( 販 売 会 社 )	(105)	(1.262)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(46)	(0.548)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
	(3)	(0.033)	
(b) そ の 他 費 用	1	0.013	(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 )	(1)	(0.013)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
( そ の 他 )	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	154	1.856	
期中の平均基準価額は、8,303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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各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、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各項目の費用は、当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。

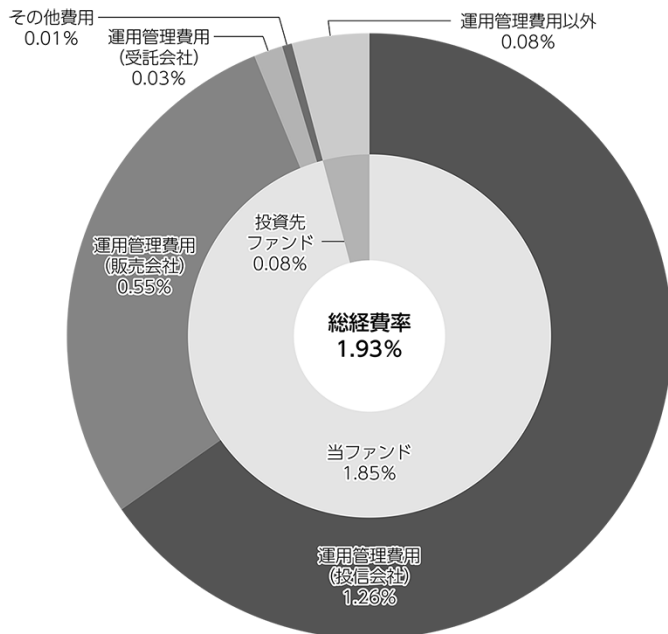
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



（参考情報）

○総経費率

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、売買委託手数料およ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1.93%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.93
①当ファンドの費用の比率	1.85
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	0.08

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

(注) 投資先ファンドの運用管理費用は、委託会社が受ける報酬から支払われるため、ありません。

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

## ○売買及び取引の状況

(2023年9月12日～2024年9月10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・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ (PI)	口 —	千円 —	口 251,300	千円 2,210,000

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未满是切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年9月12日～2024年9月10日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2024年9月10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
		口	口	千円	%
	ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラスJ (PI)	973,140	721,839	6,592,556	98.7
	合 計	973,140	721,839	6,592,556	98.7

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨て。

## 親投資信託残高

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
	日本マネー・マザーファンド	21,240	21,240	21,569

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2024年9月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 6,592,556	% 96.8
日本マネー・マザーファンド	21,569	0.3
コール・ローン等、その他	193,087	2.9
投資信託財産総額	6,807,212	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年9月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,807,212,522
コール・ローン等	193,085,302
投資信託受益証券(評価額)	6,592,556,793
日本マネー・マザーファンド(評価額)	21,569,499
未収利息	928
(B) 負債	127,148,640
未払解約金	60,901,729
未払信託報酬	65,777,132
その他未払費用	469,779
(C) 純資産総額(A-B)	6,680,063,882
元本	7,854,923,908
次期繰越損益金	△1,174,860,026
(D) 受益権総口数	7,854,923,908口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,504円

(注) 純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は1,174,860,026円です。

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、0.8504円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は10,393,471,462円、期中追加設定元本額は23,544,008円、期中一部解約元本額は2,562,091,562円です。

○損益の状況（2023年9月12日～2024年9月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	38,829
受取利息	54,198
支払利息	△ 15,369
(B) 有価証券売買損益	283,096,878
売買益	312,168,287
売買損	△ 29,071,409
(C) 信託報酬等	△ 138,910,380
(D) 当期損益金(A+B+C)	144,225,327
(E) 前期繰越損益金	△1,549,823,954
(F) 追加信託差損益金	230,738,601
(配当等相当額)	( 34,980,813)
(売買損益相当額)	( 195,757,788)
(G) 計(D+E+F)	△1,174,860,026
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△1,174,860,026
追加信託差損益金	230,738,601
(配当等相当額)	( 34,980,817)
(売買損益相当額)	( 195,757,784)
分配準備積立金	132,060,228
繰越損益金	△1,537,658,855

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

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

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

(注) 当ファンドが投資対象としている投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託する場合における当該委託に要する費用は60,748,394円です。

(注) 収益分配金

決算期	第4期
(a) 配当等収益(費用控除後)	63,048円
(b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後)	0円
(c) 信託約款に規定する収益調整金	34,980,817円
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	131,997,180円
分配対象収益(a+b+c+d)	167,041,045円
分配対象収益(1万口当たり)	212円
分配金額	0円
分配金額(1万口当たり)	0円

〈お知らせ〉

該当事項はございません。

**用語解説**

○**資産、負債、元本及び基準価額の状況**は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項目	説明
<b>資産</b>	ファンドが保有する財産の合計です。
コール・ローン等	金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。
各種有価証券等(評価額)	組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。
未収入金	入金が予定されている有価証券の売却代金などです。
未収配当金	入金が予定されている株式の配当金等です。
未収利息	入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。
<b>負債</b>	支払いが予定されている金額の合計です。
未払収益分配金	期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。
未払解約金	支払いが予定されている解約金です。
未払信託報酬	支払いが予定されている信託報酬の額です。
その他未払費用	支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。
<b>純資産総額(資産－負債)</b>	ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。
元本	ファンド全体の元本残高です。
次期繰越損益金	純資産総額と元本の差額(翌期に繰り越す損益金の合計額)です。
<b>受益権総口数</b>	受益者が保有する受益権口数の合計です。
1(万)口当たり基準価額	1(万)口当たりのファンドの時価です。

**用語解説**

○**損益の状況**は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項目	説明
<b>配当等収益</b>	ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。
受取配当金	保有する株式等の配当金等です。
受取利息	債券、コール・ローン等の利息等です。
<b>有価証券売買損益</b>	有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。
売買益	売買益と期末評価益の合計です。
売買損	売買損と期末評価損の合計です。
<b>信託報酬等</b>	信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それに掛かる消費税等相当額です。
<b>当期損益金</b>	当期における収支合計です。
<b>前期繰越損益金</b>	前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。
<b>追加信託差損益金</b>	受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
<b>計</b>	収益分配前の期中の収支の総合計です。
<b>収益分配金</b>	期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。
<b>次期繰越損益金</b>	翌期に繰り越す損益金の合計です。
追加信託差損益金	翌期に繰り越す追加信託差損益金です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
分配準備積立金	翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。
繰越損益金	翌期に繰り越す損益金の額です。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2024年9月10日現在）

<日本マネー・マザーファンド>

下記は、日本マネー・マザーファンド全体（744,170千口）の内容です。

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	70,000 ( 70,000)	69,994 ( 69,994)	9.3 ( 9.3)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	9.3 ( 9.3)
特殊債券 (除く金融債)	595,000 (595,000)	595,392 (595,392)	78.8 (78.8)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	78.8 (78.8)
合 計	665,000 (665,000)	665,387 (665,387)	88.1 (88.1)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	88.1 (88.1)

(注) ( )内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、当ファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

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

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第1195回国庫短期証券	—	70,000	69,994	2024/11/20
小 計		70,000	69,994	
特殊債券(除く金融債)				
第35回政府保証日本政策金融公庫債券	0.45	50,000	50,049	2025/3/14
第26回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.466	70,000	70,065	2024/12/12
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	80,000	80,020	2024/9/30
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	60,000	60,036	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	70,000	70,075	2024/12/27
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	75,000	75,068	2025/1/31
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.001	70,000	69,999	2024/9/27
第65回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.539	50,000	50,026	2024/10/16
第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.414	70,000	70,051	2025/2/17
小 計		595,000	595,392	
合 計		665,000	665,387	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

<参考情報>

ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド・クラス J (JPY)

<当ファンドの仕組みは次の通りです>

管理会社兼 投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
主要投資対象	世界各国（新興国を含みます。）の株式や債券（国債、政府機関債、社債、ハイ・イールド債券、モーゲージ債、物価連動債など）、通貨、商品および不動産関連の証券等の幅広い資産（デリバティブを含みます）
投資方針	①ポートフォリオの構築にあたっては、景気見通し、各資産のバリュエーション、資産間の相関などを考慮し、機動的な資産配分を行います。 ②投資プロセスの一環として、意図しない市場リスクの取得を避けるため、市場見通しと整合的な範囲でヘッジ取引を実施する場合があります。 ③外貨建資産について、原則としてファンドの純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
申込手数料	ありません。
管理報酬	ありません。
投資顧問報酬	ありません。
その他費用	信託財産に関する租税、組入有価証券の売買時の売買委託手数料、借入金の利息及び立て替え金の利息、訴訟費用及び損害賠償費用等

ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド

以下は、ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンドの監査済報告書の一部を、SBI岡三アセットマネジメントが翻訳したものです。SBI岡三アセットマネジメントは正確性、完全性を保証するものではありません。

損益計算書

自 2022年11月1日 至 2023年10月31日  
(単位：千米ドル)

<b>収益</b>	
受取利息	2,918
受取配当金 (外国税額控除後)	366
雑収入	0
<b>収益合計</b>	<b>3,284</b>
<b>費用</b>	
支払利息	83
雑損失	0
<b>費用合計</b>	<b>83</b>
<b>投資純損益</b>	<b>3,201</b>
<b>実現損益</b>	
投資有価証券	△13,214
関連投資	0
上場金融デリバティブ商品	△8,731
店頭金融デリバティブ商品	△5,694
外貨取引	△385
<b>実現純損益</b>	<b>△28,024</b>
<b>未実現損益</b>	
投資有価証券	13,714
関連投資	0
上場金融デリバティブ商品	1,698
店頭金融デリバティブ商品	2,214
外貨建資産および負債	77
<b>未実現純損益</b>	<b>17,703</b>
<b>純損益/純損失</b>	<b>△10,321</b>
<b>当期純損益</b>	<b>△7,120</b>
外国税額	123

※0は、四捨五入して千米ドル未満となった場合があります。



	SHARES	VALUE (000s)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 124.8%</b>		
<b>AUSTRALIA 0.1%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.1%</b>		
Calix Ltd.	27,390 \$	47
<b>Total Australia (Cost \$126)</b>		<b>47</b>
<b>BELGIUM 0.1%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.1%</b>		
Umicore S.A.	3,600	86
<b>Total Belgium (Cost \$137)</b>		<b>86</b>
<b>CANADA 1.9%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.5%</b>		
Ballard Power Systems, Inc.	10,300	34
Canadian Solar, Inc.	4,200	84
Canfor Corp.	10,221	104
West Fraser Timber Co. Ltd.	1,600	108
		<b>330</b>
	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.9%</b>		
Bank of Nova Scotia 4.750% due 02/02/2026 (h)	\$ 200	195
Toronto-Dominion Bank 4.443% due 01/20/2025 5.532% due 07/17/2026 (h)	EUR 300 \$ 120	318 119
		<b>632</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.5%</b>		
Export Development Canada 4.000% due 02/19/2026	GBP 300	355
<b>Total Canada (Cost \$1,615)</b>		<b>1,317</b>
<b>CAYMAN ISLANDS 4.9%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 4.9%</b>		
ACAS CLO Ltd. 6.547% due 10/18/2028	\$ 520	518
Catamaran CLO Ltd. 6.774% due 04/22/2030	540	539
Crestline Denali CLO XIV Ltd. 6.814% due 10/23/2031	787	786
Crestline Denali CLO XV Ltd. 6.707% due 04/20/2030	477	475
Mountain View CLO LLC 6.695% due 01/16/2031	693	688
OZLM IX Ltd. 6.777% due 10/20/2031	500	499
<b>Total Cayman Islands (Cost \$3,516)</b>		<b>3,505</b>
<b>CZECH REPUBLIC 0.4%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
EP Infrastructure A/S 1.698% due 07/30/2026 2.045% due 10/09/2028	EUR 200 100	186 86

	SHARES	VALUE (000s)
<b>Total Czech Republic (Cost \$275)</b>		<b>\$ 272</b>
<b>DENMARK 0.4%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.4%</b>		
Vestas Wind Systems A/S	14,750	319
<b>Total Denmark (Cost \$406)</b>		<b>319</b>
<b>FINLAND 1.3%</b>		
<b>COMMON STOCKS 1.3%</b>		
Neste OYJ	8,200	275
Stora Enso OYJ	15,100	181
UPM-Kymmene OYJ	8,800	296
Valmet OYJ	6,600	148
<b>Total Finland (Cost \$1,189)</b>		<b>900</b>
<b>FRANCE 1.2%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.5%</b>		
Rexel S.A.	7,000	143
Schneider Electric SE	1,400	215
		<b>358</b>
	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.6%</b>		
Arkea Home Loans SFH S.A. 3.000% due 03/30/2027	EUR 100	104
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 5.896% due 07/13/2026	\$ 200	198
Credit Agricole Public Sector SCF S.A. 3.750% due 07/13/2028	EUR 100	106
		<b>408</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.1%</b>		
Caisse des Depots et Consignations 3.375% due 11/25/2030	100	106
<b>Total France (Cost \$915)</b>		<b>872</b>
<b>GERMANY 0.8%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.5%</b>		
Siemens AG	1,100	146
SMA Solar Technology AG	1,880	115
thyssenkrupp AG	15,900	111
		<b>372</b>
	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
Deutsche Bank AG 7.146% due 07/13/2027	\$ 200	200
<b>Total Germany (Cost \$597)</b>		<b>572</b>

	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	VALUE (000s)
<b>IRELAND 2.6%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 2.6%</b>		
Ares European CLO X DAC 4.745% due 10/15/2031	EUR 99 \$	103
Black Diamond CLO DAC 4.761% due 05/15/2032 4.853% due 01/20/2032	100 60	104 63
BlueMountain Fuji EUR CLO III DAC 1.050% due 01/15/2031 4.685% due 01/15/2031	99 99	97 103
BNPP AM Euro CLO DAC 4.565% due 04/15/2031	100	104
Carlyle Euro CLO DAC 4.411% due 08/15/2030 4.665% due 01/15/2031 4.671% due 08/15/2032	91 99 250	94 103 258
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4.531% due 11/15/2031	200	207
Harvest CLO XI DAC 4.608% due 06/26/2030	78	81
Oak Hill European Credit Partners III Ltd. 4.893% due 07/22/2030	22	24
OCF Euro CLO DAC 4.882% due 09/22/2034	100	103
Palmer Square European Loan Funding DAC 4.695% due 07/15/2031 4.745% due 04/15/2031	79 73	82 76
Takeau CLO DAC 4.603% due 08/04/2034	100	104
Toro European CLO 6 DAC 4.908% due 01/12/2032	100	104
<b>Total Ireland (Cost \$2,091)</b>		<b>1,810</b>
<b>ISRAEL 0.3%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.3%</b>		
SolarEdge Technologies, Inc.	2,560	195
<b>Total Israel (Cost \$581)</b>		<b>195</b>
<b>ITALY 0.2%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.0%</b>		
Industrie De Nora SpA	2,030	29
	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
AMCO - Asset Management Co. SpA 4.625% due 02/06/2027	EUR 100	105
<b>Total Italy (Cost \$152)</b>		<b>134</b>
<b>JAPAN 1.2%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.8%</b>		
Hamamatsu Photonics KK	2,500	93
Hitachi Zosen Corp.	57,700	301
Panasonic Holdings Corp.	21,227	186
		<b>580</b>

	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	VALUE (000s)
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> 6.281% due 02/20/2026	\$ 300	\$ 300
<b>Total Japan</b> <b>(Cost \$1,145)</b>		<b>880</b>
<b>JERSEY, CHANNEL ISLANDS 1.1%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 1.1%</b>		
<b>Saranac CLO VI Ltd.</b> 6.807% due 08/13/2031	800	798
<b>Total Jersey, Channel Islands</b> <b>(Cost \$800)</b>		<b>798</b>
<b>LUXEMBOURG 0.5%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 0.3%</b>		
<b>PBD Germany Auto Lease Master S.A.-Compartment</b> 4.542% due 11/26/2030	EUR 169	179
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Highland Holdings Sarl</b> 0.000% due 11/12/2023	100	105
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1%</b>		
<b>Miravet Sarl-Compartment</b> 4.634% due 05/26/2065	67	70
<b>Total Luxembourg</b> <b>(Cost \$388)</b>		<b>354</b>
<b>NETHERLANDS 0.6%</b>		
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 0.3%</b>		
<b>Hill FL BV</b> 4.562% due 05/18/2030	210	222
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>ING Bank NV</b> 3.000% due 02/15/2026	200	209
<b>Total Netherlands</b> <b>(Cost \$435)</b>		<b>431</b>
SHARES		
<b>NORWAY 0.6%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.3%</b>		
<b>Aker Carbon Capture ASA</b>	129,371	123
<b>NEL ASA</b>	166,529	110
		<b>233</b>
PRINCIPAL AMOUNT (000s)		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>DNB Bank ASA</b> 3.625% due 02/16/2027	EUR 200	209
<b>Total Norway</b> <b>(Cost \$806)</b>		<b>442</b>
<b>ROMANIA 0.9%</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 0.9%</b>		
<b>Romania Government International Bond</b> 5.000% due 09/27/2026	600	638
<b>Total Romania</b> <b>(Cost \$656)</b>		<b>638</b>

	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	VALUE (000s)
<b>SINGAPORE 0.2%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.2%</b>		
<b>Temasek Financial I Ltd.</b> 3.250% due 02/15/2027	EUR 150	\$ 157
<b>Total Singapore</b> <b>(Cost \$161)</b>		<b>157</b>
SHARES		
<b>SOUTH KOREA 1.0%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.6%</b>		
<b>Hanwha Solutions Corp.</b>	5,068	108
<b>LG Chem Ltd.</b>	257	84
<b>Samsung Electronics Co. Ltd.</b>	4,600	229
		<b>421</b>
PRINCIPAL AMOUNT (000s)		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.4%</b>		
<b>SK Hynix, Inc.</b> 6.250% due 01/17/2026	\$ 300	299
<b>Total South Korea</b> <b>(Cost \$875)</b>		<b>720</b>
<b>SPAIN 0.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Banco Santander S.A.</b> 3.250% due 02/14/2028	EUR 100	104
<b>Total Spain</b> <b>(Cost \$107)</b>		<b>104</b>
<b>SUPRANATIONAL 0.5%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.5%</b>		
<b>Nordic Investment Bank</b> 3.875% due 02/19/2026	GBP 300	355
<b>Total Supranational</b> <b>(Cost \$366)</b>		<b>355</b>
SHARES		
<b>SWEDEN 0.4%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.4%</b>		
<b>Holmen AB</b>	7,800	294
<b>PowerCell Sweden AB</b>	4,958	20
<b>Total Sweden</b> <b>(Cost \$470)</b>		<b>314</b>
<b>SWITZERLAND 0.5%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.4%</b>		
<b>ABB Ltd.</b>	7,460	251
PRINCIPAL AMOUNT (000s)		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.1%</b>		
<b>Credit Suisse Group AG AT1 Claim (a)</b>	\$ 400	44
<b>Total Switzerland</b> <b>(Cost \$681)</b>		<b>295</b>

	SHARES	VALUE (000s)
<b>TAIWAN 1.1%</b>		
<b>COMMON STOCKS 1.1%</b>		
<b>Chipbond Technology Corp.</b>	11,392	\$ 24
<b>Delta Electronics, Inc.</b>	14,588	132
<b>Elan Microelectronics Corp.</b>	11,491	51
<b>Globalwafers Co. Ltd.</b>	4,391	65
<b>MediaTek, Inc.</b>	1,382	36
<b>Nanya Technology Corp.</b>	20,293	41
<b>Novatek Microelectronics Corp.</b>	3,796	54
<b>Realtek Semiconductor Corp.</b>	4,993	62
<b>Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.</b>	11,591	189
<b>Unimicron Technology Corp.</b>	10,600	47
<b>United Microelectronics Corp.</b>	77,281	111
<b>Total Taiwan</b> <b>(Cost \$1,055)</b>		<b>812</b>
<b>UNITED KINGDOM 0.7%</b>		
<b>COMMON STOCKS 0.2%</b>		
<b>DS Smith PLC</b>	23,500	81
<b>ITM Power PLC</b>	46,242	36
		<b>117</b>
PRINCIPAL AMOUNT (000s)		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 0.3%</b>		
<b>HSBC Holdings PLC</b> 5.887% due 08/14/2027	\$ 35	35
<b>Lloyds Bank PLC</b> 3.250% due 02/02/2026	EUR 200	209
		<b>244</b>
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.2%</b>		
<b>Tower Bridge Funding PLC</b> 5.999% due 11/20/2063	GBP 103	125
<b>Total United Kingdom</b> <b>(Cost \$594)</b>		<b>486</b>
SHARES		
<b>UNITED STATES 64.7%</b>		
<b>COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY 0.1%</b>		
<b>Weyerhaeuser Co. (h)</b>	4	109
<b>COMMON STOCKS 8.5%</b>		
<b>Applied Materials, Inc.</b>	1,400	185
<b>Arista Networks, Inc. (h)</b>	1,100	221
<b>Booking Holdings, Inc.</b>	60	167
<b>CF Industries Holdings, Inc. (h)</b>	2,600	208
<b>Cisco Systems, Inc. (h)</b>	3,800	198
<b>Cognizant Technology Solutions Corp. (h)</b>	2,900	187
<b>Elevance Health, Inc.</b>	500	225
<b>Enphase Energy, Inc. (h)</b>	3,800	302

ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ファンド

	SHARES	VALUE (000s)
EPAM Systems, Inc.	800	\$ 174
Exxon Mobil Corp. (h)	4,800	508
Fastenal Co. (h)	1,800	105
First Solar, Inc. (h)	2,500	356
Flex Ltd. (h)	7,400	190
FuelCell Energy, Inc.	25,700	28
GDX Logistics, Inc. (h)	2,200	111
Humana, Inc.	350	183
Incyte Corp. (h)	1,600	86
Keysight Technologies, Inc. (h)	1,400	171
KLA Corp.	350	164
Lam Research Corp.	330	194
Luminar Technologies, Inc. (h)	13,400	43
Molina Healthcare, Inc.	600	200
NetApp, Inc. (h)	2,600	189
Nucor Corp.	1,200	177
Paychex, Inc.	800	89
Plug Power, Inc. (h)	21,000	124
QuantumScape Corp. (h)	1,800	9
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	230	179
Robert Half, Inc. (h)	2,700	202
Sensata Technologies Holding PLC (h)	4,152	132
Steel Dynamics, Inc. (h)	1,900	202
Teradyne, Inc. (h)	1,900	158
Trimble, Inc. (h)	3,000	141
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	600	217
		<u>6,025</u>

PRINCIPAL  
AMOUNT  
(000s)

CONVERTIBLE BONDS & NOTES 0.3%		
Luminar Technologies, Inc. 1.250% due 12/15/2026 (b)	\$ 300	176
Sunnova Energy International, Inc. 2.625% due 02/15/2028	100	49
		<u>225</u>
CORPORATE BONDS & NOTES 4.7%		
American Express Co. 4.900% due 02/13/2026	300	294
6.101% due 02/13/2026 (h)	300	298
Amgen, Inc. 5.150% due 03/02/2028 (h)	100	97
CVS Health Corp. 5.000% due 02/20/2026	700	687
Goldman Sachs Group, Inc. 4.722% due 02/07/2025	EUR 400	424
KeyBank N.A. 4.700% due 01/26/2026 (h)	\$ 300	279
Morgan Stanley Bank N.A. 5.479% due 07/16/2025	250	249

	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	VALUE (000s)
<b>National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.</b> 4.450% due 03/13/2026 (h)	\$ 74	72
<b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b> 5.741% due 11/03/2023	200	200
<b>Oracle Corp.</b> 4.500% due 05/06/2028	21	20
<b>State Street Corp.</b> 4.857% due 01/26/2026	400	393
<b>Union Pacific Corp.</b> 4.750% due 02/21/2026	300	296
		<u>3,309</u>

MORTGAGE-BACKED SECURITIES 5.2%		
<b>BIG Commercial Mortgage Trust</b> 6.676% due 02/15/2039	600	588
<b>BX Commercial Mortgage Trust</b> 6.325% due 01/17/2039	600	586
<b>BX Trust</b> 6.084% due 04/15/2039	1,087	1,043
<b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b> 6.749% due 03/15/2036	1,000	904
<b>New Orleans Hotel Trust</b> 6.371% due 04/15/2032	600	577
		<u>3,698</u>

U.S. GOVERNMENT AGENCIES 33.3%		
<b>Fannie Mae, TBA (c)</b> 4.000% due 12/01/2053	4,700	4,063
4.500% due 12/01/2053	4,900	4,378
5.000% due 12/01/2053	5,700	5,253
5.500% due 12/01/2053	7,200	6,829
<b>Freddie Mac</b> 6.000% due 08/01/2053	3,200	3,118
		<u>23,641</u>

U.S. TREASURY OBLIGATIONS 12.6%		
<b>Treasury Inflation Protected Securities (d)</b> 0.625% due 07/15/2032	3,804	3,259
1.125% due 01/15/2033	1,546	1,371
1.625% due 10/15/2027	4,457	4,309
		<u>8,939</u>
<b>Total United States</b> <b>(Cost \$48,418)</b>		<u>45,946</u>

SHORT-TERM INSTRUMENTS 35.5%		
COMMERCIAL PAPER 0.7%		
<b>Universal Music Group NV</b> 4.130% due 11/30/2023 (e)	EUR 500	527
		<u>15,500</u>
REPURCHASE AGREEMENTS (f) 21.8%		
		<u>15,500</u>

TIME DEPOSITS 1.8%		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b> 3.000% due 11/01/2023	AUD 152	97
3.850% due 11/01/2023	NZD 1	1
<b>Bank of Nova Scotia</b> 4.080% due 11/01/2023	CAD 108	78
4.830% due 11/01/2023	\$ 28	28
<b>BNP Paribas Bank</b> 0.550% due 11/01/2023	CHF 3	4
3.000% due 11/01/2023	AUD 100	63
3.120% due 11/01/2023	HKD 1	0
3.330% due 11/01/2023	NOK 2	0

	PRINCIPAL AMOUNT (000s)	VALUE (000s)
6.430% due 11/01/2023	ZAR 2	\$ 0
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b> (0.370%) due 11/01/2023	¥ 1	0
4.420% due 11/01/2023	GBP 0	1
4.830% due 11/01/2023	\$ 2	2
<b>Citibank N.A.</b> 4.830% due 11/01/2023	\$ 120	120
<b>DBS Bank Ltd.</b> 4.830% due 11/01/2023	102	102
<b>DnB Bank ASA</b> 2.990% due 11/01/2023	SEK 3	0
<b>HSBC Bank PLC</b> 3.100% due 11/01/2023	EUR 10	11
4.420% due 11/01/2023	GBP 1	2
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b> 4.830% due 11/01/2023	\$ 218	218
<b>MUFG Bank Ltd.</b> (0.370%) due 11/01/2023	¥ 9	0
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b> (0.370%) due 11/01/2023	EUR 57	0
3.100% due 11/01/2023	EUR 100	105
4.830% due 11/01/2023	\$ 12	12
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b> (0.370%) due 11/01/2023	¥ 225	1
3.100% due 11/01/2023	EUR 37	39
4.420% due 11/01/2023	GBP 72	88
4.830% due 11/01/2023	\$ 278	278
		<u>1,250</u>
JAPAN TREASURY BILLS (e) 11.2%		
(0.186%) due 12/04/2023	¥ 1,030,000	6,802
(0.169%) due 12/25/2023	170,000	1,123
		<u>7,925</u>
<b>Total Short-Term Instruments</b> <b>(Cost \$25,487)</b>		<u>25,202</u>
<b>Total Investments in Securities 123.8%</b> <b>(Cost \$94,044)</b>	\$	<u>87,963</u>
<b>Financial Derivative</b> <b>Instruments (g)(i) (0.0%)</b> <b>(Cost or Premiums, net \$48)</b>		<u>(2)</u>
<b>Other Assets and Liabilities, net (23.8%)</b>		<u>(16,931)</u>
<b>Net Assets 100.0%</b>	\$	<u>71,030</u>

**NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:**

- \* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.  
 (a) Security is in default.  
 (b) Contingent convertible security.  
 (c) When-issued security.  
 (d) Principal amount of security is adjusted for inflation.  
 (e) Coupon represents a yield to maturity.

**BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS**

**(f) REPURCHASE AGREEMENTS:**

Counterparty	Lending Rate	Settlement Date	Maturity Date	Principal Amount	Collateralized By	Collateral Received, at Value	Repurchase Agreements, at Value	Repurchase Agreement Proceeds to be Received <sup>(1)</sup>
BOS	5.340%	10/31/2023	11/01/2023	\$ 15,500	U.S. Treasury Bonds 2.250% due 08/15/2046	\$ (15,561)	\$ 15,500	\$ 15,502
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (15,561)</b>	<b>\$ 15,500</b>	<b>\$ 15,502</b>

**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, 2023:

Counterparty	Repurchase Agreement Proceeds to be Received	Payable for Reverse Repurchase Agreements	Payable for Sale-Buyback Transactions	Payable for Short Sales	Total Borrowings and Other Financing Transactions	Collateral Pledged/(Received)	Net Exposure <sup>(2)</sup>
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 15,502	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 15,502	\$ (15,561)	\$ (59)
<b>Total Borrowings and Other Financing Transactions</b>	<b>\$ 15,502</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 0</b>			

<sup>(1)</sup> Includes accrued interest.

<sup>(2)</sup> 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.

The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2023 was \$20 at a weighted average interest rate of 4.772%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

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

**PURCHASED OPTIONS:**

**FUTURE STYLE OPTIONS**

Description	Strike Price	Expiration Date	# of Contracts	Cost	Market Value
Put - Euro-BTP 10-Year Bond December 2023 Futures	EUR 100,000	11/24/2023	18	\$ 1	\$ 0
Put - Euro-Bund 10-Year Bond December 2023 Futures	115,000	11/24/2023	90	1	1
				<b>\$ 2</b>	<b>\$ 1</b>

**OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS**

Description	Strike Price	Expiration Date	# of Contracts	Cost	Market Value
Put - Canada Government 10-Year Bond December 2023 Futures	CAD 61,000	11/17/2023	36	\$ 0	\$ 0

**OPTIONS ON INDICES**

Description	Strike Price	Expiration Date	Notional Amount <sup>(1)</sup>	Cost	Market Value
Put - Euro STOXX 50 Index	EUR 4,100.00	12/15/2023	0	\$ 28	\$ 41

OPTIONS ON INDICES (Cont.)

Description	Strike Price	Expiration Date	Notional Amount <sup>(1)</sup>	Cost	Market Value
Put - Euro STOXX 50 Index	EUR 3,900.00	01/19/2024	0	\$ 28	\$ 25
Put - Euro STOXX 50 Index	4,050.00	01/19/2024	0	28	41
Put - S&P 500 Index	\$ 4,400.00	12/15/2023	0	74	127
Put - S&P 500 Index	8,950.00	12/15/2023	0	51	138
Put - S&P 500 Index	4,000.00	12/29/2023	0	57	47
Put - S&P 500 Index	4,400.00	12/29/2023	0	35	85
Put - S&P 500 Index	4,450.00	12/29/2023	0	59	126
Put - S&P 500 Index	4,250.00	01/19/2024	0	79	94
				\$ 439	\$ 724
<b>Total Purchased Options</b>				<b>\$ 441</b>	<b>\$ 725</b>

WRITTEN OPTIONS:

OPTIONS ON INDICES

Description	Strike Price	Expiration Date	Notional Amount <sup>(1)</sup>	Premiums (Received)	Market Value
Call - Euro STOXX 50 Index	EUR 4,275.00	11/17/2023	0	\$ (13)	\$ (2)
Call - Euro STOXX 50 Index	4,400.00	12/15/2023	0	(16)	(2)
Call - Euro STOXX 50 Index	4,300.00	01/19/2024	0	(14)	(14)
Call - Euro STOXX 50 Index	4,450.00	01/19/2024	0	(14)	(4)
Put - Euro STOXX 50 Index	3,800.00	11/17/2023	0	(9)	(3)
Put - Euro STOXX 50 Index	3,900.00	12/15/2023	0	(13)	(17)
Put - Euro STOXX 50 Index	3,700.00	01/19/2024	0	(16)	(13)
Put - Euro STOXX 50 Index	3,850.00	01/19/2024	0	(15)	(21)
Call - S&P 500 Index	\$ 4,700.00	12/15/2023	0	(37)	0
Call - S&P 500 Index	4,800.00	12/15/2023	0	(33)	0
Call - S&P 500 Index	4,600.00	12/29/2023	0	(24)	(4)
Call - S&P 500 Index	4,750.00	12/29/2023	0	(35)	0
Call - S&P 500 Index	4,650.00	01/19/2024	0	(21)	(3)
Put - S&P 500 Index	3,800.00	12/29/2023	0	(33)	(21)
Put - S&P 500 Index	4,050.00	12/29/2023	0	(25)	(29)
Put - S&P 500 Index	4,225.00	12/29/2023	0	(20)	(45)
Put - S&P 500 Index	4,700.00	12/29/2023	0	(14)	(11)
Put - S&P 500 Index	4,000.00	01/19/2024	0	(41)	(42)
<b>Total Written Options</b>				<b>\$ (393)</b>	<b>\$ (221)</b>

FUTURES CONTRACTS:

Description	Type	Expiration Month	# of Contracts	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
					Asset	Liability
Australia Government 10-Year Bond December Futures	Long	12/2023	189	\$ (789)	\$ 0	\$ (113)
Canada Government 10-Year Bond December Futures	Long	12/2023	36	(71)	0	(8)
Euro STOXX 50 December Futures	Short	12/2023	51	94	0	(20)
Euro STOXX 600 Automobiles & Parts December Futures	Short	12/2023	40	83	0	(3)
Euro-BTP 10-Year Bond December Futures	Long	12/2023	18	(95)	13	0
Euro-Bund 10-Year Bond December Futures	Long	12/2023	90	(274)	32	0
S&P 500 E-mini Index December Futures	Long	12/2023	58	(633)	68	0
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2023	53	(45)	0	(5)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note December Futures	Short	12/2023	38	204	10	0
<b>Total Futures Contracts</b>				<b>\$ (1,526)</b>	<b>\$ 123</b>	<b>\$ (149)</b>

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION<sup>(1)</sup>

Index/Tranches	Fixed Deal Receive Rate	Maturity Date	Notional Amount <sup>(2)</sup>	Market Value <sup>(3)</sup>	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin	
						Asset	Liability
CDX.IG-41 Index	1.000%	12/20/2028	\$ 27,900	\$ 289	\$ (49)	\$ 22	\$ 0

INTEREST RATE SWAPS

Pay/Receive		Fixed Rate	Maturity Date	Notional Amount	Market Value	Unrealized Appreciation/ (Depreciation)	Variation Margin		
Floating Rate	Floating Rate Index						Asset	Liability	
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	2.500%	06/19/2029	CAD 1,900	\$ (149)	\$ (316)	\$ 0	\$ (11)	
Pay	6-Month EURIBOR	2.547%	03/09/2033	EUR 400	(22)	(22)	1	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	06/21/2030	\$ 7,000	665	453	11	0	
Receive <sup>(4)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2030	3,600	213	208	6	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	2.750%	06/21/2053	2,500	675	457	12	0	
Receive <sup>(4)</sup>	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	12/20/2053	600	106	115	3	0	
Pay <sup>(4)</sup>	Sterling Overnight Interbank Average Rate	5.000%	03/20/2029	GBP 4,800	150	24	4	0	
						\$ 1,638	\$ 919	\$ 37	\$ (11)
<b>Total Swap Agreements</b>						<b>\$ 1,927</b>	<b>\$ 870</b>	<b>\$ 59</b>	<b>\$ (11)</b>

各クラスの状態

作成基準日：2023年10月31日

	基準価額	純資産総額
	千米ドル	千米ドル
ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ ファンド・クラスJ (JPY)	55.09	71,021
ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ ファンド (USD)	90.17	9
		千米ドル
ピムコ・バミューダ・ダイナミック・マルチアセット・ストラテジー・ ファンドの純資産総額		71,030

日本マネー・マザーファンド  
第18期 運用状況のご報告  
決算日：2023年10月10日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として安定運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	株式および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
		騰	落			
14期 (2019年10月10日)	円 10,180	% △0.1	% 97.5		% —	百万円 680
15期 (2020年10月12日)	10,172	△0.1	88.9		—	429
16期 (2021年10月11日)	10,166	△0.1	92.3		—	445
17期 (2022年10月11日)	10,159	△0.1	85.6		—	446
18期 (2023年10月10日)	10,153	△0.1	89.5		—	424

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っていません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 債券先物比率=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
		騰	落		
(期首) 2022年10月11日	円 10,159	% —	% 85.6		% —
10月末	10,159	0.0	94.9		—
11月末	10,158	△0.0	94.8		—
12月末	10,158	△0.0	85.9		—
2023年1月末	10,157	△0.0	73.4		—
2月末	10,156	△0.0	63.7		—
3月末	10,156	△0.0	62.9		—
4月末	10,156	△0.0	75.5		—
5月末	10,155	△0.0	86.6		—
6月末	10,155	△0.0	85.9		—
7月末	10,155	△0.0	81.0		—
8月末	10,154	△0.0	81.3		—
9月末	10,154	△0.0	89.5		—
(期末) 2023年10月10日	10,153	△0.1	89.5		—

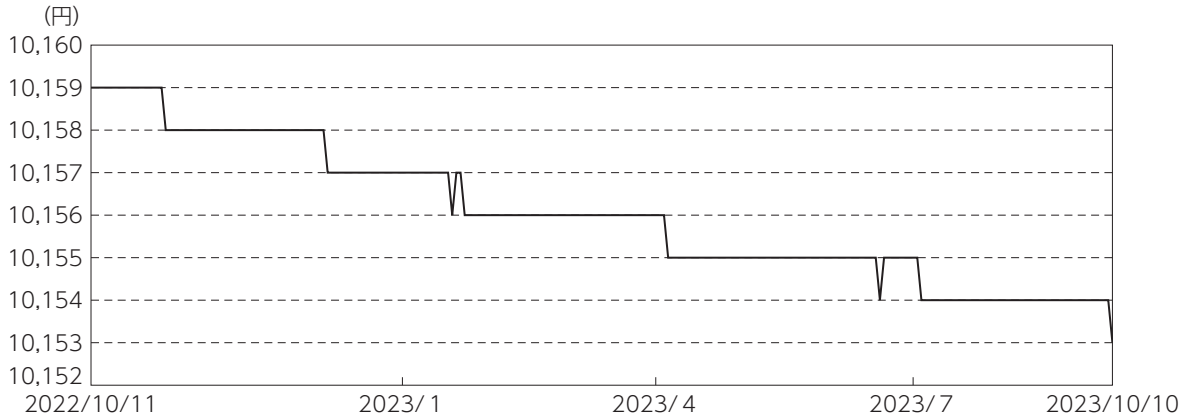
(注) 騰落率は期首比。



## 運用経過

## 期中の基準価額の推移

(2022年10月12日～2023年10月10日)



## ○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

## (主なプラス要因)

- ・特にありません。

## (主なマイナス要因)

- ・日銀のマイナス金利政策の影響により、市中金利がマイナス圏で推移したことが、マイナス要因となりました。

**投資環境**

(2022年10月12日～2023年10月10日)

短期金融市場では、日銀が2022年12月の金融政策決定会合において金融緩和政策の一部修正を行ったことから、1年国債利回りが一時プラス圏に上昇する場面が見られました。しかし、2023年1月の金融政策決定会合において、マイナス金利を含む金融緩和政策の継続を決定したことから、1年国債利回りは再度マイナス圏へ低下しました。その後、植田日銀新総裁が就任した後の金融政策決定会合において、現状の金融緩和政策の維持が決定されたことから、1年国債利回りが-0.1%台半ばへ低下しました。ただ、7月の金融政策決定会合において、長短金利操作（YCC、イールドカーブ・コントロール）の運用柔軟化が決定されたことを受け、金融緩和の修正期待が高まったことから、1年国債利回りは-0.06%近辺まで上昇しました。

**当ファンドのポートフォリオ**

(2022年10月12日～2023年10月10日)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。当期間中は、政府保証債を組み入れました。

**当ファンドのベンチマークとの差異**

(2022年10月12日～2023年10月10日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

**今後の運用方針****(投資環境の見通し)**

国内短期金融市場は、当面日銀によるマイナス金利政策の継続が見込まれますが、日銀の植田総裁はマイナス金利解除のための物価・賃金データが2023年末までに揃う可能性があると言っていることから、日銀の利上げリスクが意識される展開を想定しています。こうした投資環境の中、1年国債利回りは0%をやや下回る水準で推移すると予想します。

**(運用方針)**

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益確保を目的に運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年10月12日～2023年10月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.002 (0.002)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	0	0.002	

期中の平均基準価額は、10,156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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

## ○売買及び取引の状況

(2022年10月12日～2023年10月10日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	特殊債券	千円 456,094	千円 — (456,100)

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ( ) 内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年10月12日～2023年10月10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10日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	379,000 (379,000)	379,809 (379,809)	89.5 (89.5)	— (—)	— (—)	— (—)	89.5 (89.5)
合 計	379,000 (379,000)	379,809 (379,809)	89.5 (89.5)	— (—)	— (—)	— (—)	89.5 (89.5)

(注) ( )内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

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

## (B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券（除く金融債）</b>	%	千円	千円	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	50,000	50,050	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	50,000	50,081	2023/12/28
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	64,000	64,153	2024/ 1 /31
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	45,000	45,121	2024/ 2 /29
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	60,000	60,179	2024/ 3 /29
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	60,000	60,213	2024/ 4 /12
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	50,000	50,010	2023/10/20
合 計		379,000	379,809	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年10月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 379,809	% 89.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	44,453	10.5
投 資 信 託 財 産 総 額	424,262	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	424,262,538 円
コール・ローン等	43,980,682
公社債(評価額)	379,809,145
未収利息	405,914
前払費用	66,797
(B) 負債	877
未払利息	41
その他未払費用	836
(C) 純資産総額(A-B)	424,261,661
元本	417,847,995
次期繰越損益金	6,413,666
(D) 受益権総口数	417,847,995口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,153円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.0153円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は439,685,657円、期中追加設定元本額は55,640,772円、期中一部解約元本額は77,478,434円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

アジア・オセアニア好配当成長株オープン (毎月分配型)	185,091,215円
米国短期ハイ・イールド債券オープン	113,984,849円
新興国連続増配成長株オープン	39,895,881円
世界半導体関連フォーカスファンド	27,575,340円
PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(資産成長型)	21,240,275円
グローバル仮想世界株式戦略ファンド(愛称 フェューチャーメタバース)	17,416,664円
PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(年2回決算型)	8,820,553円
アジア・オセアニア好配当成長株オープン(1年決算型)	3,823,218円

## ○損益の状況 (2022年10月12日～2023年10月10日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,482,864 円
受取利息	2,512,687
支払利息	△ 29,823
(B) 有価証券売買損益	△2,690,220
売買損	△2,690,220
(C) その他費用等	△ 6,792
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 214,148
(E) 前期繰越損益金	6,990,152
(F) 追加信託差損益金	859,228
(G) 解約差損益金	△1,221,566
(H) 計(D+E+F+G)	6,413,666
次期繰越損益金(H)	6,413,666

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

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

(注) 損益の状況の中で(G)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。

## ＜お知らせ＞

- ・SBI岡三アセットマネジメント株式会社への商号変更等に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。(実施日:2023年7月1日)
- ・2024年1月から開始されるNISA成長投資枠への対応を目的として、デリバティブ取引に係る利用目的の明確化に関する投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2023年7月8日)