

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(年2回決算型) (愛称 世界のマイスター(年2回決算型))

【2022年9月12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(年2回決算型)(愛称 世界のマイスター
(年2回決算型))」は、2022年9月12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。



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営業部 セールスサポートグループへ
フリーダイヤル ☎0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.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を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 | 年2回、3月および9月の各月の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) | 価 額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 | 純 資 産 総 額 |
|----------------------|--------------|-----|--------|----------------|---------|--------|--------------------|--------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 落 率 | | | | |
| (設定日) 2020年10月30日 | 円 10,000 | | 円 — | % — | % — | % — | 百万円 688 | |
| 1期(2021年3月10日) | 10,191 | | 190 | 3.8 | 0.1 | 97.5 | 3,644 | |
| 2期(2021年9月10日) | 10,262 | | 250 | 3.1 | 0.1 | 97.9 | 6,416 | |
| 3期(2022年3月10日) | 9,509 | | 0 | △7.3 | 0.1 | 98.7 | 5,831 | |
| 4期(2022年9月12日) | 8,961 | | 0 | △5.8 | 0.1 | 98.9 | 5,636 | |

(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 | 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 |
|---------------------|------------|--------|--------|----------|-----------|--------------------|
| | | 騰 落 率 | 率 | | | |
| (期 首) 2022年3月10日 | 円 9,509 | % — | % — | % 0.1 | % 98.7 | |
| 3月末 | 9,457 | △0.5 | | 0.1 | 98.9 | |
| 4月末 | 9,209 | △3.2 | | 0.2 | 98.9 | |
| 5月末 | 9,299 | △2.2 | | 0.1 | 98.3 | |
| 6月末 | 8,904 | △6.4 | | 0.2 | 98.9 | |
| 7月末 | 9,208 | △3.2 | | 0.1 | 99.0 | |
| 8月末 | 8,941 | △6.0 | | 0.1 | 99.0 | |
| (期 末) 2022年9月12日 | 8,961 | △5.8 | | 0.1 | 98.9 | |

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

（2022年3月11日～2022年9月12日）



期首：9,509円

期末：8,961円（既払分配金(税引前)：0円）

騰落率：△ 5.8%（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（2022年3月10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)

- ・株式で「脱炭素・持続可能性」のテーマ投資の銘柄群が上昇し、プラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・株式で「次世代産業2.0」などのテーマ投資の銘柄群が下落したことや、米国、カナダ、オーストラリアなどで金利が上昇し、組み入れていた債券の価格が下落したことが、マイナスに影響しました。

投資環境

（2022年3月11日～2022年9月12日）

当期間中、世界の株式市場については、期の前半、ロシア・ウクライナ間の停戦への期待感などを背景に一時的に上昇したものの、その後は欧米の中央銀行が金融引き締めに積極的なスタンスを示したことなどをを受けて、企業収益の圧迫や景気後退への警戒感がマイナス要因となり下落しました。期の後半は、引き続き欧米の中央銀行による金融引き締めが加速するとの見通しがマイナス要因となったものの、米国の2022年7月の米消費者物価指数（CPI）の伸びが鈍化したことを受けてインフレがピークアウトしたとの見方が広がったことや、事前予想を上回る米企業決算などがプラス要因となり、株式市場は小幅に上昇しました。

世界の債券市場については、インフレ上昇を受けて欧米の中央銀行がタカ派的な姿勢を強めたことや、ジャクソンホール会議においてパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長が利上げの継続が必要であるとして、性急な利下げに否定的な姿勢を示したことなどが金利上昇要因となりました。国債利回りの上昇を受けて、高格付け債券、ハイ・イールド債券や新興国債券の価格はいずれも下落しました。

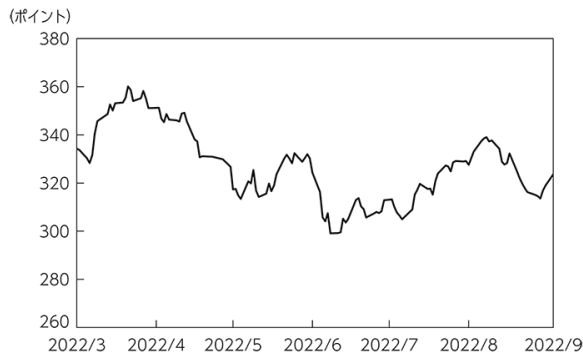
為替市場は、米国債利回りの上昇を背景に米ドル高が進行する展開となりました。

商品市場は、金融引き締めの加速を受け景気後退への懸念が高まったことから、原油価格は下落しました。金価格は、米ドル高を背景に下落しました。

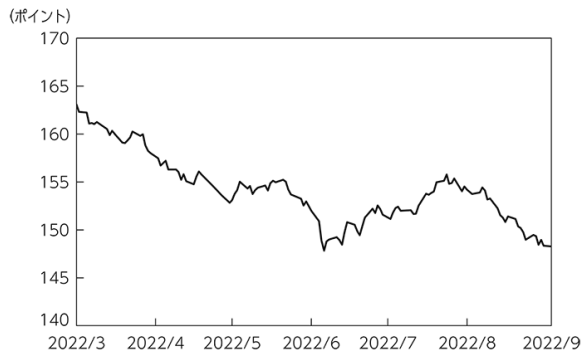
日本国内の短期金融市場は、日銀によるマイナス金利政策の継続を背景に、短期金利がマイナス圏での推移となりました。

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。

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）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。

FTSE世界BIG債券インデックス（円ヘッジベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

当ファンドのポートフォリオ

（2022年3月11日～2022年9月12日）

<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）（愛称 世界のマイスター（年2回決算型））>

「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）

当期間中、株式については、期初はインフレ上昇やロシアによるウクライナ侵攻などを受けて先行き不透明感が高まっていることを踏まえ20%程度としました。期の後半は景気後退懸念の高まりなどを受けて、足元ではネットで0%近辺まで引き下げました。

債券については、金利が上昇したことにより投資妙味が出てきたとの見方から、国債など安全性の高い債券を中心に金利リスクを積み増しました。一方、足元では欧米の中央銀行による更なる大幅な利上げが見込まれる中で金利リスクをやや引き下げました。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、今後の継続的な利上げが見込まれる米ドルやノルウェークローネなどに対し買いポジションを構築した一方、2023年には欧州がマイナス成長に陥るとみていることからユーロ、イギリスポンド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、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3月11日～2022年9月12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、本項目は記載しておりません。

分配金

（2022年3月11日～2022年9月12日）

当ファンドは年2回、3月および9月の各月の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 |
|-----------|---------------------------|
| | 2022年3月11日～ 2022年9月12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 | — |

（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（年2回決算型）（愛称 世界のマイスター（年2回決算型））>

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。

株式戦略については、株価指数先物の売り建てなどを活用することで、ネットでの株式組入比率は低位で推移させる一方、買い持ち部分では長期的な成長分野への投資を継続しています。今後数年間の変革の時代において、経済の不確実性やボラティリティが高まり地域・業種間の格差が拡大していくことが想定される中でも、産業・経済構造の変化を捉え持続的な成長が期待される企業群を中心に投資を行っています。具体的には、「グリーン&デジタル」を柱とし、個別の株式投資テーマとしては再生可能エネルギーや電気自動車のエコシステムなどに注目する「次世代産業2.0」や、技術革新と活用の更なる加速が追い風となる半導体、キャッシュフロー創出力が高い銘柄を含む「ハイ・クオリティ」を投資テーマの中核としています。その他、世界の国内総生産（GDP）の75%以上が炭素排出ゼロを宣言する中で注目される「脱炭素・持続可能性」といったテーマも有望とみています。

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。今後の継続的な利上げが見込まれる米ドルやノルウェークローネなどに対し積極姿勢で臨む一方、2023年にはマイナス成長に陥るとみていることからユーロ、イギリスポンドを消極姿勢とする方針です。

○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

（2022年3月11日～2022年9月12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 ） | (59) | (0.645) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (26) | (0.280) | 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 ） | (2) | (0.017) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 1 | 0.007 | (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) | (0.007) | 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 | 87 | 0.949 | |
| 期中の平均基準価額は、9,169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。

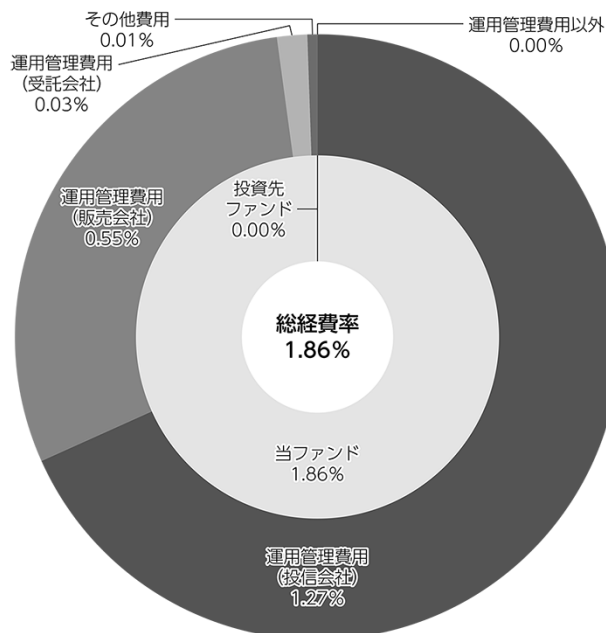
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.86%です。



(単位: %)

| | |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③) | 1.86 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.86 |
| 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) 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

(2022年3月11日～2022年9月12日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|--|--------|---------|--------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | ビムコ・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) | 51,446 | 505,000 | 40,924 | 405,000 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月11日～2022年9月12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

(2022年9月12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 |
| | ビムコ・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) | 565,185 | 575,707 | 5,576,306 | 98.9 |
| | 合 計 | 565,185 | 575,707 | 5,576,306 | 98.9 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----|---------------|---------|-------|-------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 日本マネー・マザーファンド | 8,820 | 8,820 | 8,961 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年9月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 5,576,306 | % 97.8 |
| 日本マネー・マザーファンド | 8,961 | 0.2 |
| コール・ローン等、その他 | 118,107 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 5,703,374 | 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（2022年9月12日現在）

| 項目 | 当期末 | 円 |
|--------------------|----------------|---|
| (A) 資産 | 5,703,374,558 | |
| コール・ローン等 | 118,106,110 | |
| 投資信託受益証券(評価額) | 5,576,306,767 | |
| 日本マネー・マザーファンド(評価額) | 8,961,681 | |
| (B) 負債 | 67,249,645 | |
| 未払解約金 | 13,693,048 | |
| 未払信託報酬 | 53,174,941 | |
| 未払利息 | 141 | |
| その他未払費用 | 381,515 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,636,124,913 | |
| 元本 | 6,289,741,759 | |
| 次期繰越損益金 | △ 653,616,846 | |
| (D) 受益権総口数 | 6,289,741,759口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,961円 | |

(注) 純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は653,616,846円です。

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、0.8961円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は6,132,481,401円、期中追加設定元本額は855,181,592円、期中一部解約元本額は697,921,234円です。

○損益の状況（2022年3月11日～2022年9月12日）

| 項目 | 当期 | 円 |
|------------------|---------------|---|
| (A) 配当等収益 | △ 13,989 | |
| 受取利息 | 292 | |
| 支払利息 | △ 14,281 | |
| (B) 有価証券売買損益 | △259,175,839 | |
| 売買益 | 19,775,376 | |
| 売買損 | △278,951,215 | |
| (C) 信託報酬等 | △ 53,560,789 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △312,750,617 | |
| (E) 前期繰越損益金 | △405,644,589 | |
| (F) 追加信託差損益金 | 64,778,360 | |
| (配当等相当額) | (△ 8,205) | |
| (売買損益相当額) | (64,786,565) | |
| (G) 計(D+E+F) | △653,616,846 | |
| (H) 収益分配金 | 0 | |
| 次期繰越損益金(G+H) | △653,616,846 | |
| 追加信託差損益金 | 64,778,360 | |
| (配当等相当額) | (△ 7,829) | |
| (売買損益相当額) | (64,786,189) | |
| 繰越損益金 | △718,395,206 | |

(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23,449,670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) | 0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 | 0円 |
| (d) 信託約款に規定する分配準備積立金 | 0円 |
| 分配対象収益(a+b+c+d) | 0円 |
| 分配対象収益(1万口当たり) | 0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 |
|---------------------|---|
| 資産 | 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。 |
| 負債 | 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。 |
| 純資産総額(資産－負債) | 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。 |
| 受益権総口数 | 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 |
|-----------------|---|
| 配当等収益 | 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。 |
| 有価証券売買損益 | 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。 |
| 信託報酬等 | 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。 |
| 当期損益金 | 当期における収支合計です。 |
| 前期繰越損益金 | 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。 |
| 追加信託差損益金 | 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。 |
| 計 | 収益分配前の期中の収支の総合計です。 |
| 収益分配金 | 期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。 |
| 次期繰越損益金 | 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

（2022年9月12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(454,449千円)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 |
| 特殊債券 (除く金融債) | 千円 304,000 (304,000) | 千円 305,475 (305,475) | % 66.2 (66.2) | % — (—) | % — (—) | % — (—) | % 66.2 (66.2) |
| 合 計 | 304,000 (304,000) | 305,475 (305,475) | 66.2 (66.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 66.2 (66.2) |

(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 | |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | | |
| 第2回政府保証新関西国際空港債券 | 0.882 | 50,000 | 50,369 | 2023/6/27 | |
| 第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.734 | 50,000 | 50,114 | 2022/12/28 | |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.834 | 50,000 | 50,176 | 2023/1/31 | |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.815 | 100,000 | 100,385 | 2023/2/17 | |
| 第51回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.835 | 54,000 | 54,430 | 2023/8/14 | |
| 合 計 | | 304,000 | 305,475 | | |

(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、岡三アセットマネジメントが翻訳したものです。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 2020年10月30日 至 2021年10月31日
(単位：千米ドル)

| | |
|-----------------|----------------|
| 収益 | |
| 受取利息 (外国税額控除後) | 81 |
| 受取配当金 (外国税額控除後) | 756 |
| 収益合計 | 837 |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | 0 |
| 事務管理報酬 | 0 |
| 支払利息 | 0 |
| 諸経費 | 0 |
| 費用合計 | 0 |
| 投資純損益 | 837 |
| 実現損益 | |
| 投資有価証券 | 3,276 |
| 関連投資 | 0 |
| 上場金融デリバティブ商品 | △ 2,229 |
| 店頭金融デリバティブ商品 | △ 8,038 |
| 外貨取引 | 269 |
| 実現純損益 | △ 6,722 |
| 未実現損益 | |
| 投資有価証券 | 2,199 |
| 関連投資 | 0 |
| 上場金融デリバティブ商品 | △ 2,829 |
| 店頭金融デリバティブ商品 | △ 2,962 |
| 外貨建資産および負債 | △ 18 |
| 未実現純損益 | △ 3,610 |
| 純損益/純損失 | △10,332 |
| 当期純損益 | △ 9,495 |
| 外国税額 | 183 |

| | SHARES | VALUE (000s) |
|---|-------------------------------|-----------------|
| INVESTMENTS IN SECURITIES 100.7% | | |
| AUSTRIA 0.4% | | |
| COMMON STOCKS 0.4% | | |
| ams AG | 37,600 | \$ 746 |
| Total Austria (Cost \$828) | | 746 |
| BRAZIL 0.1% | | |
| COMMON STOCKS 0.1% | | |
| Vale S.A. | 9,400 | 120 |
| Total Brazil (Cost \$172) | | 120 |
| CANADA 1.2% | | |
| COMMON STOCKS 1.2% | | |
| Canfor Corp. | 25,600 | 530 |
| Lundin Mining Corp. | 47,191 | 410 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | 15,200 | 1,215 |
| Total Canada (Cost \$2,263) | | 2,155 |
| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | |
| CAYMAN ISLANDS 7.3% | | |
| ASSET-BACKED SECURITIES 7.3% | | |
| Ammc CLO 20 Ltd. 0.992% due 04/17/2029 | \$ 736 | 737 |
| Apidos CLO XXVI 1.022% due 07/18/2029 | 800 | 800 |
| Benefit Street Partners CLO XII Ltd. 1.074% due 10/15/2030 | 500 | 500 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 1.075% due 08/14/2030 | 800 | 799 |
| CARLYLE U.S. CLO Ltd. 1.132% due 04/20/2031 | 800 | 800 |
| Catamaran CLO Ltd. 1.228% due 04/22/2030 | 796 | 797 |
| Crestline Denali CLO XIV Ltd. 1.264% due 10/23/2031 | 800 | 800 |
| Crestline Denali CLO XV Ltd. 1.162% due 04/20/2030 | 800 | 800 |
| Goldentree Loan Management U.S. CLO 2 Ltd. 0.000% due 11/20/2030 | 700 | 700 |
| KKR CLO 18 Ltd. 1.062% due 07/18/2030 | 500 | 500 |
| Mountain View CLO LLC 1.162% due 01/16/2031 | 800 | 800 |
| MP CLO VII Ltd. 1.012% due 10/18/2028 | 791 | 792 |
| Oaktree CLO Ltd. 0.000% due 10/20/2032 (a) | 500 | 500 |
| OZLM IX Ltd. 1.232% due 10/20/2031 | 500 | 500 |
| Palmer Square Loan Funding Ltd. 0.000% due 10/15/2029 0.971% due 07/20/2029 | 800 800 | 800 801 |
| Symphony Static CLO I Ltd. 0.000% due 10/25/2029 (a) | 500 | 500 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|-------------------------------|-----------------|
| CHINA 6.0% | | |
| COMMON STOCKS 6.0% | | |
| 3SBio, Inc. | 211,700 | 194 |
| 51job, Inc. | 550 | 33 |
| Baidu, Inc. | 4,425 | 718 |
| BeiGene Ltd. | 10,300 | 285 |
| BYD Co. Ltd. | 33,796 | 1,293 |
| COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. | 382,622 | 593 |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd. | 202,000 | 211 |
| Daqo New Energy Corp. | 12,700 | 988 |
| Genscript Biotech Corp. | 143,300 | 634 |
| Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. | 17,900 | 349 |
| Innovent Biologics, Inc. | 18,100 | 162 |
| JD Health International, Inc. | 40,976 | 360 |
| JinkoSolar Holding Co. Ltd. | 24,500 | 1,466 |
| Luye Pharma Group Ltd. New Horizon Health Ltd. | 385,400 65,540 | 184 238 |
| Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. | 156,800 | 267 |
| Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. | 49,000 | 231 |
| WuXi AppTec Co. Ltd. | 15,660 | 334 |
| Wuxi Biologics Cayman, Inc. | 20,300 | 308 |
| Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. | 426,300 | 954 |
| Xinyi Energy Holdings Ltd. | 701,300 | 414 |
| XPeng, Inc. | 18,400 | 858 |
| Total China (Cost \$10,934) | | 11,074 |
| DENMARK 1.0% | | |
| COMMON STOCKS 1.0% | | |
| AP Moller - Maersk A/S | 327 | 949 |
| Vestas Wind Systems A/S | 21,150 | 915 |
| Total Denmark (Cost \$1,731) | | 1,864 |

| | SHARES | VALUE (000s) |
|---|-------------------------------|-------------------|
| FINLAND 2.8% | | |
| COMMON STOCKS 2.8% | | |
| Fortum OYJ | 25,300 | \$ 753 |
| Stora Enso OYJ | 97,500 | 1,624 |
| UPM-Kymmene OYJ | 48,600 | 1,717 |
| Valmet OYJ | 26,300 | 1,069 |
| Total Finland (Cost \$5,274) | | 5,163 |
| FRANCE 0.2% | | |
| COMMON STOCKS 0.2% | | |
| Schneider Electric SE | 2,600 | 449 |
| Total France (Cost \$382) | | 449 |
| GERMANY 0.5% | | |
| COMMON STOCKS 0.5% | | |
| Infinion Technologies AG | 13,800 | 647 |
| SMA Solar Technology AG | 6,400 | 339 |
| Total Germany (Cost \$888) | | 986 |
| HONG KONG 0.4% | | |
| COMMON STOCKS 0.4% | | |
| Alibaba Health Information Technology Ltd. | 327,800 | 411 |
| Orient Overseas International Ltd. | 11,400 | 210 |
| SITC International Holdings Co. Ltd. | 54,984 | 186 |
| Total Hong Kong (Cost \$1,279) | | 807 |
| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | |
| IRELAND 2.0% | | |
| ASSET-BACKED SECURITIES 1.3% | | |
| Ares European CLO X DAC 0.780% due 10/15/2031 | EUR 100 | 116 |
| Black Diamond CLO DAC 0.860% due 01/20/2032 0.980% due 05/15/2032 | 100 100 | 116 116 |
| BlueMountain Fuji EUR CLO III DAC 0.720% due 01/15/2031 1.050% due 01/15/2031 | 100 100 | 115 115 |
| Cairn CLO X DAC 0.780% due 10/15/2031 | 100 | 116 |
| Carlyle Euro CLO DAC 0.630% due 08/15/2030 0.700% due 01/15/2031 0.890% due 08/15/2032 | 100 100 250 | 116 116 289 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 0.750% due 11/15/2031 | 200 | 232 |
| Dryden 52 Euro CLO DAC 0.860% due 05/15/2034 | 100 | 115 |
| Harvest CLO XI DAC 0.650% due 06/28/2030 | 100 | 115 |
| Oak Hill European Credit Partners III Ltd. 0.900% due 07/22/2030 | 74 | 86 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|-------------------------|--------------|
| OCP Euro CLO DAC | | |
| 0.880% due 09/22/2034 | EUR 100 | \$ 114 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | |
| 0.000% due 07/15/2031 (a) | 100 | 116 |
| 0.780% due 04/15/2031 | 100 | 115 |
| Tikehau CLO BV | | |
| 0.870% due 08/04/2034 | 100 | 114 |
| Toro European CLO 6 DAC | | |
| 0.920% due 01/12/2032 | 100 | 115 |
| | | 2,337 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|-------------------------------------|--------|-------------------------|--------------|
| COMMON STOCKS 0.7% | | | |
| Aptiv PLC | 7,400 | | 1,279 |
| Total Ireland (Cost \$3,452) | | | 3,616 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|-------------------------------------|-------------------------|--------------|
| ISRAEL 1.0% | | |
| COMMON STOCKS 0.9% | | |
| SolarEdge Technologies, Inc. | 4,560 | 1,617 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|------------------------------------|-------------------------|--------------|
| SOVEREIGN ISSUES 0.1% | | |
| Bank of Israel Bill - Makam | | |
| 0.000% due 06/08/2022 | ILS 400 | 127 |
| Total Israel (Cost \$1,326) | | 1,744 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|------------------------------------|---------|-------------------------|--------------|
| JAPAN 8.4% | | | |
| COMMON STOCKS 7.3% | | | |
| Advantest Corp. | 8,600 | | 705 |
| Daifuku Co. Ltd. | 3,300 | | 304 |
| Disco Corp. | 1,000 | | 269 |
| FANUC Corp. | 800 | | 158 |
| Fujitsu Ltd. | 2,100 | | 363 |
| Hamamatsu Photonics KK | 10,200 | | 605 |
| Hitachi Zosen Corp. | 88,500 | | 694 |
| Ibiden Co. Ltd. | 5,300 | | 318 |
| Kajima Corp. | 24,100 | | 297 |
| Komatsu Ltd. | 7,700 | | 202 |
| Kubota Corp. | 8,900 | | 190 |
| Makita Corp. | 10,700 | | 496 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 36,900 | | 495 |
| Nexon Co. Ltd. | 19,400 | | 330 |
| Nintendo Co. Ltd. | 1,110 | | 490 |
| Nitto Denko Corp. | 8,800 | | 687 |
| Otsuka Corp. | 6,100 | | 300 |
| Otsuka Holdings Co. Ltd. | 6,400 | | 253 |
| Panasonic Corp. | 114,827 | | 1,419 |
| Rohm Co. Ltd. | 6,400 | | 585 |
| Secom Co. Ltd. | 3,600 | | 245 |
| Shimano, Inc. | 1,700 | | 474 |
| Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. | 5,800 | | 1,034 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--------------------------------|--------|-------------------------|---------------|
| Shionogi & Co. Ltd. | 8,800 | \$ | 574 |
| SMC Corp. | 490 | | 292 |
| Sony Group Corp. | 400 | | 46 |
| Subaru Corp. | 12,400 | | 243 |
| Suzuki Motor Corp. | 1,800 | | 80 |
| Tokyo Electron Ltd. | 3,090 | | 1,439 |
| | | | 13,587 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|-------------------------|---------------|
| SOVEREIGN ISSUES 1.1% | | |
| Development Bank of Japan, Inc. | | |
| 2.500% due 10/18/2022 | \$ 1,900 | 1,936 |
| Total Japan (Cost \$15,498) | | 15,523 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|-------------------------|--------------|
| JERSEY, CHANNEL ISLANDS 0.4% | | |
| ASSET-BACKED SECURITIES 0.4% | | |
| Saranac CLO VI Ltd. | | |
| 1.000% due 08/13/2031 | 800 | 800 |
| Total Jersey, Channel Islands (Cost \$800) | | 800 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|-------------------------|--------------|
| LUXEMBOURG 0.1% | | |
| MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1% | | |
| Miravet Sarl-Compartment | | |
| 0.301% due 05/26/2065 | EUR 90 | 105 |
| Total Luxembourg (Cost \$107) | | 105 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|-------------------------------------|-------------------------|--------------|
| NETHERLANDS 0.8% | | |
| ASSET-BACKED SECURITIES 0.1% | | |
| BNPP AM Euro CLO BV | | |
| 0.600% due 04/15/2031 | 100 | 115 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|--------|-------------------------|--------------|
| COMMON STOCKS 0.7% | | | |
| ASML Holding NV | 830 | | 675 |
| NXP Semiconductors NV | 3,100 | | 623 |
| | | | 1,298 |
| Total Netherlands (Cost \$1,240) | | | 1,413 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|------------------------------------|-------------------------|--------------|
| NORWAY 0.7% | | |
| COMMON STOCKS 0.7% | | |
| Aker Carbon Capture ASA | 258,492 | 935 |
| NEL ASA | 179,400 | 379 |
| Total Norway (Cost \$1,138) | | 1,314 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|-------------------------|--------------|
| SOUTH KOREA 1.5% | | |
| COMMON STOCKS 1.5% | | |
| LG Chem Ltd. | 1,340 | 962 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 24,300 | 1,455 |
| Samsung SDI Co. Ltd. | 446 | 281 |
| Total South Korea (Cost \$2,941) | | 2,698 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|--------|-------------------------|--------------|
| SPAIN 0.2% | | | |
| COMMON STOCKS 0.2% | | | |
| Siemens Gamesa Renewable Energy S.A. | 11,100 | \$ | 302 |
| Total Spain (Cost \$374) | | | 302 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|----------------------------|-------------------------|--------------|
| SWEDEN 1.6% | | |
| COMMON STOCKS 0.6% | | |
| Holmen AB | 21,000 | 932 |
| PowerCell Sweden AB | 10,700 | 239 |
| | | 1,171 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|------------------------------------|-------------------------|--------------|
| SOVEREIGN ISSUES 1.0% | | |
| Svensk Exportkredit AB | | |
| 0.750% due 04/06/2023 | \$ 1,900 | 1,909 |
| Total Sweden (Cost \$3,225) | | 3,080 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---------------------------|--------|-------------------------|--------------|
| SWITZERLAND 0.6% | | | |
| COMMON STOCKS 0.1% | | | |
| ABB Ltd. | 5,300 | | 176 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|-------------------------|--------------|
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.5% | | |
| Credit Suisse AG | | |
| 6.500% due 08/08/2023 (b) | CHF 500 | 545 |
| Credit Suisse Group AG | | |
| 7.500% due 12/11/2023 (b)(c) | 400 | 437 |
| | | 982 |
| Total Switzerland (Cost \$1,179) | | 1,158 |

| | SHARES | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|---------|-------------------------|--------------|
| TAIWAN 4.8% | | | |
| COMMON STOCKS 4.8% | | | |
| Chipbond Technology Corp. | 157,392 | | 365 |
| Delta Electronics, Inc. | 43,188 | | 381 |
| Elan Microelectronics Corp. | 73,491 | | 442 |
| Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. | 327,478 | | 1,179 |
| Globalwafers Co. Ltd. | 24,391 | | 669 |
| Lotes Co. Ltd. | 18,853 | | 393 |
| MediaTek, Inc. | 11,392 | | 375 |
| Nanya Technology Corp. | 186,293 | | 447 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 20,096 | | 301 |
| Realtek Semiconductor Corp. | 25,993 | | 468 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 91,591 | | 1,944 |
| Unimicron Technology Corp. | 60,600 | | 415 |
| United Microelectronics Corp. | 519,281 | | 1,078 |
| Win Semiconductors Corp. | 25,494 | | 329 |

| | SHARES | VALUE (000s) |
|---|-------------------------------|-----------------|
| Total Taiwan (Cost \$8,853) | | \$ 8,786 |
| UNITED KINGDOM 1.0% | | |
| COMMON STOCKS 0.7% | | |
| AstraZeneca PLC | 114 | 14 |
| Mondi PLC | 47,300 | 1,183 |
| | | 1,197 |
| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | |
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Santander UK Group Holdings PLC 7.375% due 06/24/2022 (b)(c) GBP | 200 | 282 |
| MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1% | | |
| Tower Bridge Funding PLC 0.000% due 11/20/2063 | 200 | 275 |
| Total United Kingdom (Cost \$1,781) | | 1,754 |
| | SHARES | |
| UNITED STATES 18.8% | | |
| COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY 0.2% | | |
| Weyerhaeuser Co. | 12 | 432 |
| COMMON STOCKS 18.4% | | |
| AbbVie, Inc. | 2,500 | 287 |
| Alphabet, Inc. | 130 | 386 |
| Ambarella, Inc. | 8,100 | 1,505 |
| AMETEK, Inc. | 1,500 | 199 |
| Amgen, Inc. | 1,300 | 269 |
| ANSYS, Inc. | 700 | 266 |
| Anthem, Inc. | 2,100 | 914 |
| Applied Materials, Inc. | 6,400 | 875 |
| Arista Networks, Inc. | 2,700 | 1,106 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 2,200 | 494 |
| Biogen, Inc. | 800 | 213 |
| Caterpillar, Inc. | 950 | 194 |
| Cirrus Logic, Inc. | 6,100 | 493 |
| Coinbase Global, Inc. | 3,000 | 958 |
| Deere & Co. | 550 | 188 |
| Desktop Metal, Inc. | 11,800 | 81 |
| Eaton Corp. PLC | 1,200 | 198 |
| Emerson Electric Co. | 2,000 | 194 |
| Enphase Energy, Inc. | 3,700 | 857 |
| Exact Sciences Corp. | 2,900 | 276 |
| Exelixis, Inc. | 24,800 | 533 |
| First Solar, Inc. | 14,100 | 1,686 |
| Flex Ltd. | 10,800 | 179 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 27,100 | 1,022 |
| Galaxy Digital Holdings Ltd. | 4,296 | 117 |
| Generac Holdings, Inc. | 1,100 | 548 |
| Gilead Sciences, Inc. | 4,400 | 285 |
| Halozyne Therapeutics, Inc. | 11,800 | 442 |

| | SHARES | VALUE (000s) |
|-------------------------------------|--------|-----------------|
| Hologic, Inc. | 5,900 | 433 |
| Humana, Inc. | 2,130 | 987 |
| Incyte Corp. | 5,900 | 395 |
| Intel Corp. | 13,500 | 662 |
| IPG Photonics Corp. | 1,700 | 270 |
| Jacobs Engineering Group, Inc. | 1,500 | 211 |
| Lam Research Corp. | 1,400 | 789 |
| Luminar Technologies, Inc. | 56,100 | 919 |
| Marathon Digital Holdings, Inc. | 5,800 | 303 |
| Martin Marietta Materials, Inc. | 500 | 196 |
| Marvell Technology, Inc. | 8,400 | 575 |
| MasTec, Inc. | 2,200 | 196 |
| Mueller Water Products, Inc. | 12,400 | 204 |
| NetApp, Inc. | 11,500 | 1,027 |
| Neurocrine Biosciences, Inc. | 3,000 | 316 |
| Nuance Communications, Inc. | 8,600 | 473 |
| Nucor Corp. | 2,700 | 301 |
| PayPal Holdings, Inc. | 3,400 | 791 |
| Plug Power, Inc. | 13,600 | 520 |
| Power Integrations, Inc. | 4,300 | 444 |
| QuantumScape Corp. | 4,400 | 127 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. | 2,000 | 1,280 |
| Reliance Steel & Aluminum Co. | 1,700 | 248 |
| Riot Blockchain, Inc. | 8,800 | 240 |
| Seagen, Inc. | 1,900 | 335 |
| Sensata Technologies Holding PLC | 5,200 | 287 |
| Skyworks Solutions, Inc. | 3,800 | 635 |
| Square, Inc. | 2,200 | 560 |
| Synopsys, Inc. | 1,080 | 360 |
| Teradyne, Inc. | 4,900 | 677 |
| Tesla, Inc. | 900 | 1,003 |
| Trimble, Inc. | 3,100 | 271 |
| U.S. Steel Corp. | 9,900 | 261 |
| Union Pacific Corp. | 900 | 217 |
| United Therapeutics Corp. | 1,700 | 324 |
| Velodyne Lidar, Inc. | 49,200 | 300 |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. | 5,300 | 980 |
| Vulcan Materials Co. | 1,100 | 209 |
| Worthington Industries, Inc. | 4,000 | 217 |
| Zebra Technologies Corp. | 880 | 470 |
| | | 33,778 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|---|-------------------------------|-----------------|
| CORPORATE BONDS & NOTES 0.2% | | |
| Expedia Group, Inc. 6.250% due 05/01/2025 | \$ 100 | \$ 114 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 0.450% due 11/03/2023 (a) | 200 | 200 |
| | | 314 |
| Total United States (Cost \$31,783) | | 34,524 |
| SHORT-TERM INSTRUMENTS 38.9% | | |
| TIME DEPOSITS 0.5% | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. (0.210% due 11/01/2021) | AUD 20 | 15 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 10 | 10 |
| Bank of Nova Scotia 0.005% due 11/01/2021 | 1 | 1 |
| BNP Paribas Bank (1.410% due 11/01/2021) | CHF 0 | 1 |
| (0.790% due 11/01/2021) | EUR 9 | 10 |
| (0.280% due 11/01/2021) | ¥ 148 | 1 |
| 0.000% due 11/01/2021 | HKD 171 | 22 |
| 0.005% due 11/01/2021 | GBP 14 | 19 |
| 0.005% due 11/01/2021 | NOK 4 | 0 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 71 | 71 |
| 0.200% due 11/01/2021 | NZD 1 | 0 |
| Brown Brothers Harriman & Co. (0.350% due 11/01/2021) | SEK 5 | 1 |
| (0.280% due 11/01/2021) | ¥ 1 | 0 |
| Citibank N.A. 0.005% due 11/01/2021 | \$ 69 | 69 |
| DBS Bank Ltd. 0.005% due 11/01/2021 | 29 | 29 |
| DnB Bank ASA (0.790% due 11/01/2021) | EUR 4 | 5 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 1 | 1 |
| HSBC Bank 0.000% due 11/01/2021 | HKD 303 | 39 |
| HSBC Bank PLC (0.790% due 11/01/2021) | EUR 20 | 23 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. 0.005% due 11/01/2021 | \$ 138 | 138 |
| MUFG Bank Ltd. (0.280% due 11/01/2021) | ¥ 2,027 | 18 |
| National Australia Bank Ltd. 0.005% due 11/01/2021 | \$ 3 | 3 |
| Royal Bank of Canada 0.005% due 11/01/2021 | CAD 19 | 16 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 14 | 14 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. (0.790% due 11/01/2021) | EUR 12 | 14 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 272 | 272 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. (0.790% due 11/01/2021) | EUR 39 | 45 |
| (0.280% due 11/01/2021) | ¥ 243 | 2 |
| 0.005% due 11/01/2021 | GBP 4 | 6 |
| 0.005% due 11/01/2021 | \$ 48 | 48 |
| | | 893 |
| AUSTRALIA TREASURY BILLS 1.6% | | |
| (0.010% due 11/26/2021 (d)) | AUD 3,800 | 2,854 |

| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | VALUE (000s) |
|--|-------------------------------|-----------------|
| GREECE TREASURY BILLS 0.5% | | |
| (0.395%) due 01/28/2022 (d) | EUR 800 | \$ 927 |
| ISRAEL TREASURY BILLS 0.6% | | |
| (0.005%) due 08/03/2022 (e) | ILS 3,200 | 1,013 |
| 0.011% due 04/06/2022 (d) | 400 | 127 |
| | | 1,140 |
| ITALY TREASURY BILLS 2.9% | | |
| (0.547%) due 11/30/2021 (e) | EUR 1,500 | 1,736 |
| (0.514%) due 01/31/2022 (d) | 3,100 | 3,593 |
| | | 5,329 |
| JAPAN TREASURY BILLS (d) 9.2% | | |
| (0.120%) due 01/17/2022 | ¥ 180,000 | 1,579 |
| (0.117%) due 12/13/2021 | 15,000 | 132 |
| (0.114%) due 12/20/2021 | 20,000 | 175 |
| (0.111%) due 11/08/2021 | 1,710,000 | 14,997 |
| | | 16,883 |
| U.S. TREASURY BILLS (d) 21.3% | | |
| 0.045% due 03/24/2022 (i) | \$ 2,200 | 2,200 |
| 0.050% due 01/27/2022 | 1,500 | 1,500 |
| 0.050% due 02/17/2022 | 4,500 | 4,499 |
| 0.050% due 03/10/2022 | 6,600 | 6,599 |
| 0.050% due 03/17/2022 | 8,700 | 8,698 |
| 0.050% due 03/31/2022 | 5,200 | 5,199 |
| 0.051% due 03/03/2022 | 5,300 | 5,299 |
| 0.051% due 04/14/2022 | 2,600 | 2,599 |
| 0.060% due 04/28/2022 | 2,600 | 2,599 |
| | | 39,192 |
| U.S. TREASURY CASH MANAGEMENT BILLS (d)(i) 2.3% | | |
| 0.035% due 01/25/2022 | 1,500 | 1,499 |
| 0.040% due 01/11/2022 | 1,492 | 1,492 |
| 0.041% due 01/04/2022 (g) | 1,200 | 1,200 |
| | | 4,191 |
| Total Short-Term Instruments | | 71,409 |
| (Cost \$71,946) | | |
| Total Investments in Securities 100.7% | \$ 185,061 | |
| (Cost \$182,862) | | |
| Financial Derivative | | |
| Instruments (f)(h) (1.9%) | | (3,432) |
| (Cost or Premiums, net \$(20)) | | |
| Other Assets and Liabilities, net 1.2% | | 2,139 |
| Net Assets 100.0% | \$ | 183,768 |

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS (AMOUNTS IN THOUSANDS*, EXCEPT NUMBER OF CONTRACTS):

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) When-issued security.
 (b) Contingent convertible security.
 (c) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
 (d) Coupon represents a yield to maturity.
 (e) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

The average amount of borrowings outstanding during the period ended October 31, 2021 was \$2 at a weighted average interest rate of 0.172%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

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

FUTURES CONTRACTS:

| Description | Type | Expiration Month | # of Contracts | Unrealized Appreciation/ (Depreciation) | Variation Margin | |
|--|-------|------------------|----------------|---|------------------|-----------------|
| | | | | | Asset | Liability |
| Australia Government 10-Year Bond December Futures | Long | 12/2021 | 110 | \$ (747) | \$ 0 | \$ (251) |
| Canada Government 10-Year Bond December Futures | Long | 12/2021 | 28 | (137) | 0 | (10) |
| Euro STOXX 50 December Futures | Short | 12/2021 | 526 | (371) | 0 | (24) |
| Euro-Bund 10-Year Bond December Futures | Long | 12/2021 | 37 | (189) | 0 | (61) |
| FTSE 100 Index December Futures | Short | 12/2021 | 50 | (230) | 3 | 0 |
| NASDAQ 100 E-mini December Futures | Short | 12/2021 | 26 | (535) | 0 | (38) |
| S&P 500 E-mini December Futures | Short | 12/2021 | 57 | (418) | 0 | (27) |
| U.S. Treasury 10-Year Note December Futures | Short | 12/2021 | 18 | 52 | 1 | 0 |
| Total Futures Contracts | | | | \$ (2,575) | \$ 4 | \$ (411) |

SWAP AGREEMENTS:

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

| Index/Tranches | Fixed Deal Receive Rate | Maturity Date | Notional Amount ⁽²⁾ | Market Value ⁽³⁾ | Unrealized Appreciation/ (Depreciation) | Variation Margin | |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|--------------------------------|-----------------------------|---|------------------|-----------|
| | | | | | | Asset | Liability |
| CDX.HY-36 Index | 5.000% | 06/20/2026 | \$ 1,800 | \$ 170 | \$ 7 | \$ 0 | \$ (3) |
| CDX.HY-37 Index | 5.000% | 12/20/2026 | 3,700 | 352 | 10 | 0 | (6) |
| CDX.IG-35 Index | 1.000% | 12/20/2025 | 200 | 5 | 0 | 0 | (2) |
| CDX.IG-36 Index | 1.000% | 06/20/2026 | 3,900 | 99 | 2 | 0 | (2) |
| CDX.IG-37 Index | 1.000% | 12/20/2026 | 10,300 | 257 | 8 | 0 | (3) |
| iTraxx Europe Series 35 Index | 1.000% | 06/20/2026 | EUR 4,000 | 123 | 0 | 0 | (3) |
| iTraxx Europe Series 36 Index | 1.000% | 12/20/2026 | 7,400 | 227 | 10 | 0 | (5) |
| | | | | \$ 1,233 | \$ 37 | \$ 0 | \$ (24) |

INTEREST RATE SWAPS

| Pay/Receive | Floating Rate | Floating Rate Index | Fixed Rate | Maturity Date | Notional Amount | Market Value | Unrealized Appreciation/ (Depreciation) | Variation Margin | |
|------------------------------|---------------|---------------------|------------|---------------|-----------------|-----------------|---|------------------|----------------|
| | | | | | | | | Asset | Liability |
| Pay | 3-Month | Canadian Bank Bill | 1.000% | 06/16/2026 | CAD 2,971 | \$ (96) | \$ (44) | \$ 0 | \$ (6) |
| Pay | 3-Month | Canadian Bank Bill | 2.500% | 06/19/2029 | 3,300 | 101 | (195) | 0 | (6) |
| Pay | 3-Month | Canadian Bank Bill | 1.250% | 06/16/2031 | 3,728 | (232) | (48) | 0 | (9) |
| Pay | 6-Month | JPY-LIBOR | 0.200% | 06/19/2029 | ¥ 260,000 | 21 | (4) | 2 | 0 |
| | | | | | | \$ (206) | \$ (291) | \$ 2 | \$ (21) |
| Total Swap Agreements | | | | | | \$ 1,027 | \$ (254) | \$ 2 | \$ (45) |

各クラスの状態

作成基準日：2021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) | 94.25 | 183,757 |
| 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) | 107.95 | 11 |
| | | 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 | | 183,768 |

マザーファンドの運用報告書につきましては、ベビーファンドの運用報告書と作成対象期間が異なる場合には、データ・コメント等に不一致が生じる場合がありますのでご了承ください。

日本マナー・マザーファンド 第16期 運用状況のご報告 決算日：2021年10月11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 | 純資産総額 |
|-------------------|-------------|-----|-----------|-----------|--------|------------|
| | | 騰 | 落 | | | |
| 12期 (2017年10月10日) | 円 10,194 | | % △0.1 | % 72.4 | % — | 百万円 761 |
| 13期 (2018年10月10日) | 10,187 | | △0.1 | 86.0 | — | 778 |
| 14期 (2019年10月10日) | 10,180 | | △0.1 | 97.5 | — | 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 |

(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

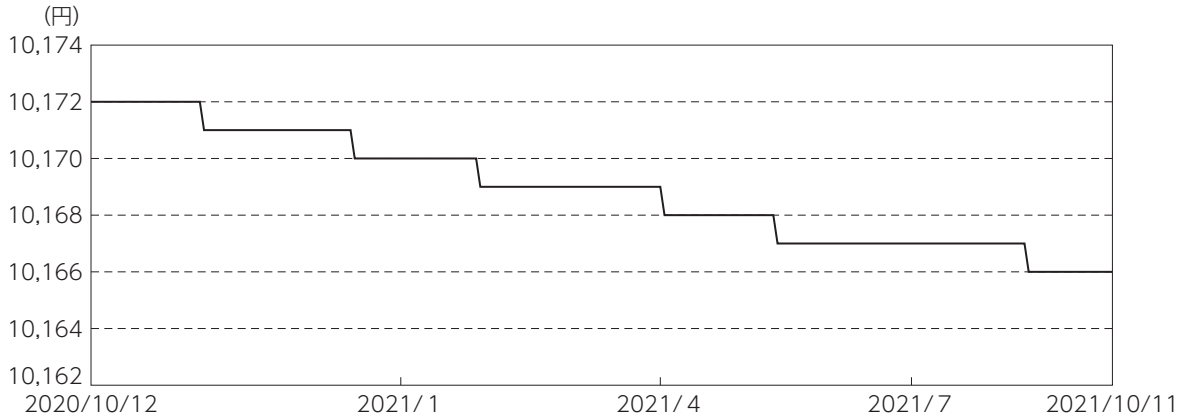
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|---------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2020年10月12日 | 円 10,172 | | % — | % 88.9 | % — |
| 10月末 | 10,172 | | 0.0 | 76.4 | — |
| 11月末 | 10,171 | | △0.0 | 76.1 | — |
| 12月末 | 10,171 | | △0.0 | 87.2 | — |
| 2021年1月末 | 10,170 | | △0.0 | 86.5 | — |
| 2月末 | 10,170 | | △0.0 | 63.3 | — |
| 3月末 | 10,169 | | △0.0 | 84.7 | — |
| 4月末 | 10,169 | | △0.0 | 82.5 | — |
| 5月末 | 10,168 | | △0.0 | 94.1 | — |
| 6月末 | 10,167 | | △0.0 | 67.4 | — |
| 7月末 | 10,167 | | △0.0 | 67.7 | — |
| 8月末 | 10,167 | | △0.0 | 67.6 | — |
| 9月末 | 10,166 | | △0.1 | 92.3 | — |
| (期末) 2021年10月11日 | 10,166 | | △0.1 | 92.3 | — |

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額の推移

(2020年10月13日～2021年10月11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、保有債券の利回り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

(2020年10月13日～2021年10月11日)

短期金融市場では、日銀がマイナス金利政策を継続していることへの影響から、1年国債利回りが概ね-0.10%をやや下回る水準で推移する展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2020年10月13日～2021年10月11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

(2020年10月13日～2021年10月11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、日銀によるマイナス金利政策の継続が見込まれることから、主要な投資対象であるわが国の公社債および短期金融商品の利回りがマイナス圏での推移となり、今後も厳しい運用環境が続くと予想されます。

(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

(2020年10月13日～2021年10月11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) | % 0.001 (0.001) | (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 | 0.001 | |

期中の平均基準価額は、10,168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

(2020年10月13日～2021年10月11日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|------|---------------|----------------------|
| 国 内 | 特殊債券 | 千円 412,077 | 千円 — (380,000) |

(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

(2020年10月13日～2021年10月11日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2021年10月11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) | 409,000 (409,000) | 410,573 (410,573) | 92.3 (92.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 92.3 (92.3) |
| 合 計 | 409,000 (409,000) | 410,573 (410,573) | 92.3 (92.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 92.3 (92.3) |

(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 |
| 特殊債券（除く金融債） | % | 千円 | 千円 | |
| 第11回政府保証原子力損害賠償支援機構債 | 0.001 | 50,000 | 50,020 | 2022/5/20 |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.0 | 50,000 | 50,072 | 2021/11/30 |
| 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.9 | 120,000 | 120,354 | 2022/1/31 |
| 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.9 | 80,000 | 80,297 | 2022/2/28 |
| 第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.801 | 109,000 | 109,828 | 2022/8/31 |
| 合 計 | | 409,000 | 410,573 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年10月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 410,573 | % 92.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 34,491 | 7.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 445,064 | 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 (2021年10月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 445,064,140 |
| コール・ローン等 | 33,769,356 |
| 公社債(評価額) | 410,573,313 |
| 未収利息 | 554,014 |
| 前払費用 | 167,457 |
| (B) 負債 | 1,018 |
| 未払利息 | 31 |
| その他未払費用 | 987 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 445,063,122 |
| 元本 | 437,805,475 |
| 次期繰越損益金 | 7,257,647 |
| (D) 受益権総口数 | 437,805,475口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,166円 |

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.0166円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は422,513,077円、期中追加設定元本額は30,060,828円、期中一部解約元本額は14,768,430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) | 325,834,704円 |
| 米国短期ハイ・イールド債券オープン | 49,037,879円 |
| 新興国連続増配成長株オープン | 26,594,229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 |
| 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) | 4,512,263円 |
| 米国優先リート17-07(為替ヘッジあり) | 1,765,572円 |

○損益の状況 (2020年10月13日～2021年10月11日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,280,442 |
| 受取利息 | 3,306,015 |
| 支払利息 | △ 25,573 |
| (B) 有価証券売買損益 | △3,550,429 |
| 売買損 | △3,550,429 |
| (C) その他費用等 | △ 6,454 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 276,441 |
| (E) 前期繰越損益金 | 7,272,821 |
| (F) 追加信託差損益金 | 509,172 |
| (G) 解約差損益金 | △ 247,905 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 7,257,647 |
| 次期繰越損益金(H) | 7,257,647 |

(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>

該当事項はございません。