

野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型

運用報告書(全体版)

第25期(決算日2022年2月25日)

作成対象期間(2021年8月26日～2022年2月25日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券		
信託期間	2009年9月9日から2024年8月26日までです。		
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるPIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J(JPY)受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り事業債(「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J(JPY)受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。		
主な投資対象	野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J(JPY)受益証券および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。	
	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J(JPY)	PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)受益証券への投資を通じて、米ドル建ての高利回り事業債を実質的な主要投資対象とします。	
主な投資制限	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。	
	野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 野村マネーポートフォリオ マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。 株式への投資は行ないません。	
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。		

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 込 分 配 金	騰 落 率					
21期(2020年2月25日)	円 17,080	円 10	% 2.1	% 0.0	% —	% 99.2		百万円 641
22期(2020年8月25日)	16,672	10	△2.3	0.0	—	99.0		653
23期(2021年2月25日)	17,447	10	4.7	0.0	—	98.7		661
24期(2021年8月25日)	18,123	10	3.9	0.0	—	99.3		590
25期(2022年2月25日)	17,423	10	△3.8	0.0	—	99.1		557

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率
		騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2021年8月25日	円		%	%	%	%	%
8月末	18,123	—	0.0	—	99.3		
9月末	18,211	0.5	0.0	—	99.3		
10月末	18,192	0.4	0.0	—	99.5		
11月末	18,175	0.3	0.0	—	99.6		
12月末	17,970	△0.8	0.0	—	99.0		
2022年1月末	18,272	0.8	0.0	—	99.2		
(期末) 2022年2月25日	17,755	△2.0	0.0	—	99.3		
	17,433	△3.8	0.0	—	99.1		

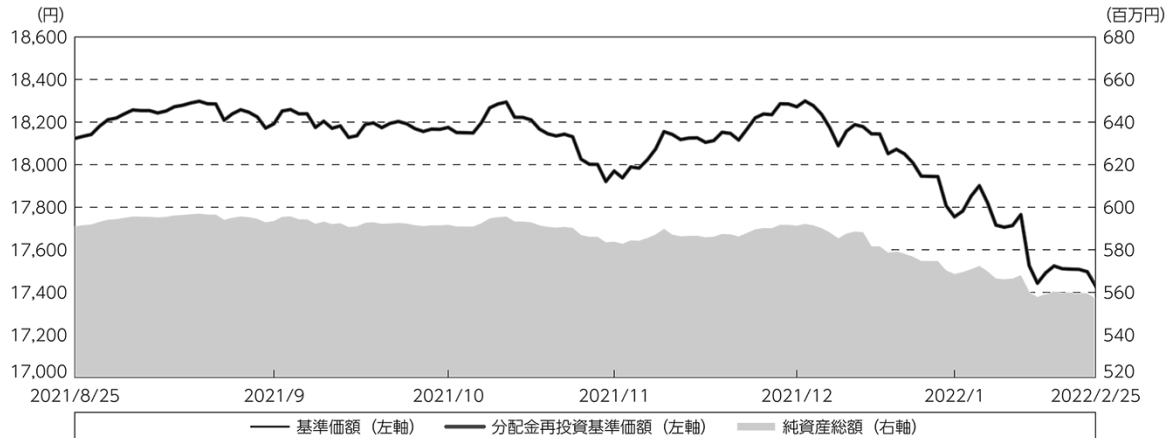
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：18,123円

期 末：17,423円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△ 3.8%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年8月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

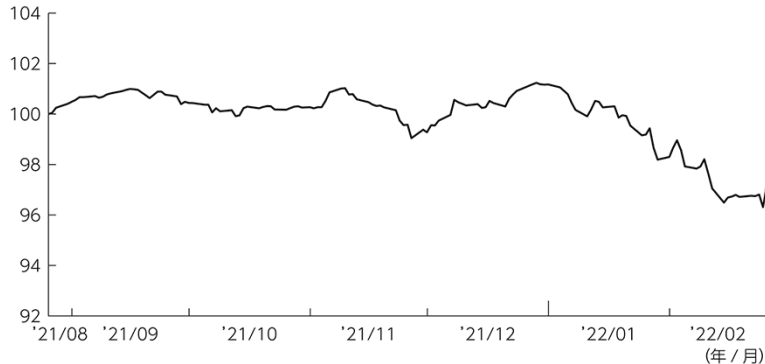
- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利息収入）
- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

○投資環境

<米国ハイ・イールド債市場>

米国ハイ・イールド債市場の騰落は以下のようになりました。

<米国ハイ・イールド債市場の推移>



※ハイ・イールド債市場：ICE BofA US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index。当作成期首を100として指数化。
 (出所：ブルームバーグ/出所および許可：ICE Data Indices, LLC)

インフレや米金融政策正常化についての見通しに左右され、10月にかけてほぼ横ばいで推移しました。11月に入り、新型コロナウイルスの新たな変異株（オミクロン株）の発見で世界的にリスク回避の動きが強まったことなどを背景に下落しましたが、12月、オミクロン株は重症化リスクが低いとの調査結果などを受け反発しました。2022年1月以降は、インフレ加速が警戒されるなか、早期の金融引き締め観測が広がり、米長期金利が高水準をつけたことや、ウクライナ情勢の緊迫化を背景にリスク回避の動きが強まったことなどから軟調に推移し、当作成期間において値下がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型]

[PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)] および [野村マネーポートフォリオ マザーファンド] の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)] の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

[PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)]

主要投資対象である [PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド (M)] のハイ・イールド債ポートフォリオでは、ハイ・イールド債券を概ね高位に組み入れました。

外部環境の変化に対し耐性を持たせることに配慮したセクター選別を継続しました。具体的には、継続的な家財修繕やリフォーム需要の高まりを享受できる建設資材セクターや、新型コロナウイルスの影響から自宅での時間が増えていることを背景にゲーム業界への投資比率を引き続きオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）としています。一方、景気後退局面において需要の縮小が見込まれる自動車セクター、インターネットを通して商品を購入する消費者の割合が増加するなか、消費者行動の変化への対応が遅れている一部の小売セクターへの投資比率をアンダーウェイト（ベンチマークに比べ低めの投資比率）としました。

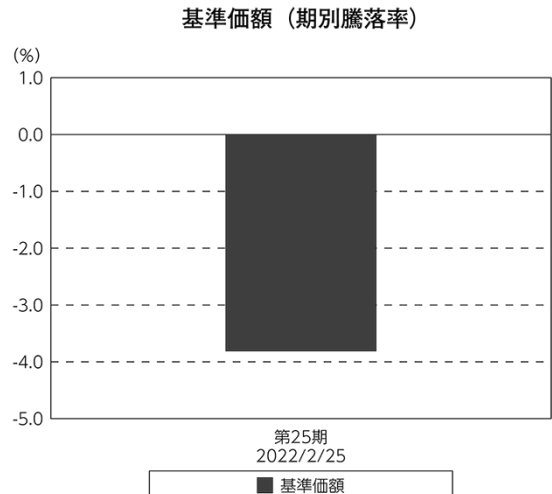
[野村マネーポートフォリオ マザーファンド]

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案して決定しました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第25期
	2021年8月26日～ 2022年2月25日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.057%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	13,035

（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

【野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型】

【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J（JPY）】受益証券および【野村マネーポートフォリオ マザーファンド】受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J（JPY）】受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

【PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J（JPY）】

米ドル建ての高利回り事業債（「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル建て資産について、原則として対円で為替ヘッジを行ないます。

米国については、2022年の成長率は家計支援のための現金給付による消費押し上げ効果が剥落することなどから、2021年に比べて鈍化すると予想しています。また、国内の一部で新型コロナウイルスの感染者が急増していることや、「ビルド・バック・ベター（よりよき再建）法案」と名付けられた大規模な財政政策の交渉が決裂したことなどが短期的には景気の下押し材

料となるとみております。また、金融政策については、FRB（米連邦準備制度理事会）は3月に利上げを開始、2022年後半にはバランスシートの縮小に着手すると考えています。

米国ハイ・イールド債券については、経済活動の再開に伴う企業のファンダメンタルズ（基礎的条件）の回復やデフォルト（債務不履行）率が低位で推移していることに加え、原油価格が堅調に推移していることなどもプラス材料です。一方で、スプレッド（利回り格差）水準はコロナショック前の水準に達しており、米国の金融政策が金融引き締めに移行していることや金利上昇などを背景に、リスク性資産の価格変動が大きくなるリスクには注視する必要があると考えています。

運用に関しては、慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行なう方針です。具体的には、堅調な米住宅市況の恩恵を享受しやすい建設資材、定期課金により安定的なキャッシュフロー（現金収支）が望めるメディア・ケーブルへの投資比率を高めとします。一方、脱炭素社会への転換など構造転換局面にある自動車、Eコマース（電子商取引）市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売への投資比率を低く抑える方針です。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

[野村マネーポートフォリオ マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご留意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年8月26日～2022年2月25日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 154	% 0.848	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(100)	(0.555)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(50)	(0.277)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	154	0.849	
期中の平均基準価額は、18,095円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

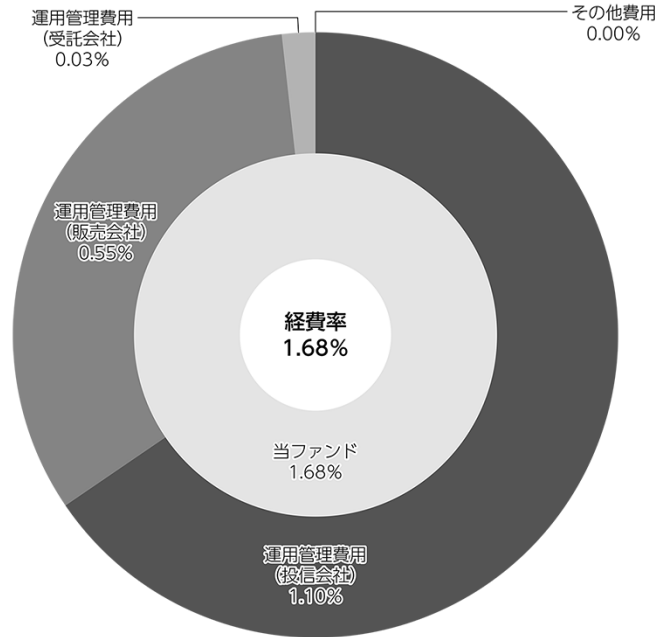
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.68%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	1.68
①当ファンドの費用の比率	1.68
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

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

○売買及び取引の状況

(2021年8月26日～2022年2月25日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)	口 1,510	千円 11,608	口 2,068	千円 15,836

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年8月26日～2022年2月25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2月25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	%
	PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)	75,897	75,339	551,933	99.1
	合 計	75,897	75,339	551,933	99.1

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

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
	野村マネーポートフォリオ マザーファンド	99	99	100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年2月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 551,933	% 98.1
野村マネーポートフォリオ マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	10,405	1.9
投資信託財産総額	562,438	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年2月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	562,438,282
コール・ローン等	10,404,411
投資信託受益証券(評価額)	551,933,514
野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額)	100,357
(B) 負債	5,302,772
未払収益分配金	319,775
未払信託報酬	4,976,559
未払利息	3
その他未払費用	6,435
(C) 純資産総額(A-B)	557,135,510
元本	319,775,041
次期繰越損益金	237,360,469
(D) 受益権総口数	319,775,041口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,423円

(注) 期首元本額は326,098,381円、期中追加設定元本額は209,793円、期中一部解約元本額は6,533,133円、1口当たり純資産額は1.7423円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,908,844円。

○損益の状況 (2021年8月26日～2022年2月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	13,544,342
受取配当金	13,544,953
受取利息	1
支払利息	△ 612
(B) 有価証券売買損益	△ 30,652,570
売買益	103,980
売買損	△ 30,756,550
(C) 信託報酬等	△ 4,982,994
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 22,091,222
(E) 前期繰越損益金	69,847,060
(F) 追加信託差損益金	189,924,406
(配当等相当額)	(327,938,178)
(売買損益相当額)	(△138,013,772)
(G) 計(D+E+F)	237,680,244
(H) 収益分配金	△ 319,775
次期繰越損益金(G+H)	237,360,469
追加信託差損益金	189,924,406
(配当等相当額)	(327,938,178)
(売買損益相当額)	(△138,013,772)
分配準備積立金	88,916,656
繰越損益金	△ 41,480,593

*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まず。

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

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

(注) 分配金の計算過程（2021年8月26日～2022年2月25日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年8月26日～ 2022年2月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	8,561,438円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	327,938,178円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	80,674,993円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	417,174,609円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	13,045円
g. 分配金	319,775円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	10円
----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA-J (JPY)
PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB-J(AUD)/J(NZD)/
J(BRL)/J(ZAR)/J(MXN)

2021年6月30日決算

(計算期間:2020年7月1日～2021年6月30日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	英領バミューダ諸島籍円建て外国投資信託
運 用 方 針	PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)受益証券への投資を通じて、米ドル建てのハイ・イールド・ボンド(高利回り事業債)に実質的に投資を行ない、トータルリターンを最大化を目指します。
投 資 対 象	米ドル建ての高利回り事業債
管 理 会 社 投 資 顧 問 会 社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 会 社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ(バミューダ)リミテッド
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 受 託 銀 行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名 義 書 換 事 務 受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・エー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドA

運用計算書

2021年6月30日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:		
受取利息	\$	1
収益合計		1
費用:		
支払利息		0
費用合計		0
純投資損益		1
当期実現損益:		
投資有価証券		0
関連投資		2,963
店頭金融デリバティブ商品		(636)
外貨通貨		1
当期実現損益		2,328
当期末実現評価損益:		
投資有価証券		0
関連投資		1,362
店頭金融デリバティブ商品		(342)
外貨建資産および負債		0
当期末実現評価損益		1,020
当期実現および未実現評価損益		3,348
運用の結果による純資産の増減額	\$	3,349

(単位:千 1口単位を除く)

期末純資産総額		
J (JPY)	\$	27,884
期末現在発行済受益証券数		
J (JPY)		406
期末1口当たり純資産価格		
J (JPY)	\$	68.65

※PIMCO パミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)の期末純資産額は96,465千米ドル

組入資産の明細

2021年6月30日

額面金額(単位:千) 評価額(単位:千)

投資有価証券 3.1%		
短期金融商品 3.1%		
コマーシャル・ペーパー 1.1%		
Federal Home Loan Bank		
0.014% due 08/06/2021 (a)	\$ 300	\$ 300
定期預金 0.9%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	51	51
Bank of Nova Scotia		
0.005% due 07/01/2021	2	2
Citibank N.A.		
0.005% due 07/01/2021	27	27
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	54	54
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 07/01/2021	54	54
National Australia Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	19	19
Royal Bank of Canada		
0.005% due 07/01/2021	1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.005% due 07/01/2021	47	47
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	3	3
		<u>258</u>
米国財務省短期証券 1.1%		
0.023% due 08/03/2021 (a)	300	300
短期金融商品合計		<u>858</u>
(取得原価\$858)		
投資有価証券合計		<u>858</u>
(取得原価\$858)		
	口数(単位:千)	
関連投資 98.4%		
その他の投資会社 98.4%		
PIMCOバリュエーションUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド(M)		
(取得原価\$23,630)	1,652	27,430
関連投資合計		<u>27,430</u>
(取得原価\$23,630)		
投資合計 101.5%		\$ 28,288
(取得原価\$24,488)		
金融デリバティブ商品 (1.5%)		(406)
(取得原価またはプレミアム\$0)		
その他の資産および負債 0.0%		2
純資産 100.0%		\$ 27,884

(a)クーポンは最終利回りである。

2021年6月30日現在

◎店頭金融デリバティブ商品

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益					
				資産	負債				
BPS	07/2021	JPY	3,918	\$	35	\$	0	\$	0

●J (JPY)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益					
				資産	負債				
BOA	07/2021	JPY	3,120	\$	28	\$	0	\$	0
BPS	07/2021		1,077,646		9,709		0		0
BPS	07/2021	\$	8,380	JPY	916,527		0		(123)
BPS	08/2021		9,712		1,077,646		0		0
BRC	07/2021	JPY	1,077,646	\$	9,709		0		0
BRC	07/2021	\$	9,218	JPY	1,008,179		0		(135)
BRC	08/2021		9,712		1,077,646		0		0
GLM	07/2021		35		3,880		0		0
HUS	07/2021		676		74,220		0		(7)
MYI	07/2021	JPY	1,018	\$	9		0		0
NAB	07/2021		889,367		8,013		0		0
NAB	08/2021	\$	8,015	JPY	889,367		0		0
SCX	07/2021	JPY	9,826	\$	88		0		0
SCX	07/2021	\$	8,380	JPY	916,527		0		(122)
UAG	07/2021		1,533		168,025		0		(19)
						\$	0	\$	(406)
外国為替先渡し契約合計						\$	0	\$	(406)

PIMCO USハイ・イールド・ストラテジー・ファンドB

(単位:千 1口単位を除く)

運用計算書

2021年6月30日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:	
受取利息	\$ 6
収益合計	6
費用:	
支払利息	0
費用合計	0
純投資損益	6
当期実現損益:	
投資有価証券	1
関連投資	6,727
店頭金融デリバティブ商品	7,878
外貨通貨	(12)
当期実現損益	14,594
当期末実現評価損益:	
投資有価証券	0
関連投資	3,563
店頭金融デリバティブ商品	3,390
外貨建資産および負債	1
当期末実現評価損益	6,954
当期実現および未実現評価損益	21,548
運用の結果による純資産の増減額	\$ 21,554

期末純資産総額

J (AUD)	\$ 8,043
J (BRL)	35,193
J (MXN)	29,624
J (NZD)	3,827
J (ZAR)	1,515

期末現在発行済受益証券数

J (AUD)	106
J (BRL)	1,457
J (MXN)	650
J (NZD)	57
J (ZAR)	40

期末1口当たり純資産価格

J (AUD)	\$ 76.16
J (BRL)	24.15
J (MXN)	45.57
J (NZD)	67.62
J (ZAR)	38.30

※PIMCO バミューダUSハイ・イールド・ストラテジー・ファンド (M)の期末純資産額は96,465千米ドル

2021年6月30日現在

◎店頭金融デリバティブ商品

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益			
						資産	負債		
BPS	07/2021	JPY	7,743	\$	70	\$	0	\$	(1)
BPS	07/2021	\$	89	JPY	9,803		0		0
HUS	07/2021		73		8,092		0		0
HUS	07/2021		5		532		0		0
						\$	0	\$	(1)

●J (AUD)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益			
						資産	負債		
BOA	07/2021	AUD	3,567	\$	2,686	\$	8	\$	0
BOA	07/2021	\$	2,736	AUD	3,541		0		(78)
BOA	08/2021		2,686		3,567		0		(8)
BPS	07/2021		2,037		2,621		0		(69)
CBK	07/2021		22		29		0		(1)
HUS	07/2021	AUD	11	\$	8		0		0
HUS	07/2021	\$	82	AUD	110		0		0
MYI	07/2021	AUD	1,513	\$	1,145		9		0
MYI	07/2021	\$	5	AUD	6		0		0
MYI	08/2021		1,145		1,513		0		(9)
SCX	07/2021	AUD	3,060	\$	2,297		0		0
SCX	08/2021	\$	2,297	AUD	3,060		0		0
TOR	07/2021		690		892		0		(21)
UAG	07/2021	AUD	2,477	\$	1,879		20		0
UAG	07/2021	\$	2,744	AUD	3,540		0		(86)
UAG	08/2021		1,818		2,396		0		(19)
						\$	37	\$	(291)

●J (BRL)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益			
						資産	負債		
BOA	07/2021	BRL	61,253	\$	12,241	\$	37	\$	(3)
BOA	07/2021	\$	11,538	BRL	61,253		669		0
BPS	07/2021	BRL	62	\$	12		0		0
BPS	07/2021	\$	12	BRL	62		0		0
BPS	08/2021	BRL	342	\$	69		1		0
CBK	07/2021		59,703		11,868		0		(30)
CBK	07/2021	\$	11,935	BRL	59,703		0		(37)
CBK	08/2021	BRL	353	\$	71		1		0
CBK	08/2021	\$	11,674	BRL	58,906		26		0
GLM	07/2021	BRL	59,741	\$	11,862		0		(44)
GLM	07/2021	\$	11,943	BRL	59,741		0		(37)
GLM	08/2021		11,659		58,906		41		0
HUS	07/2021	BRL	352	\$	66		0		(4)
HUS	07/2021	\$	70	BRL	352		0		0
MYI	07/2021	BRL	61,535	\$	12,270		9		(2)
MYI	07/2021	\$	11,497	BRL	61,535		766		0
MYI	08/2021		11,563		58,173		0		(9)
SCX	08/2021		445		2,242		0		0
SSB	07/2021	BRL	61,865	\$	12,368		39		0
SSB	07/2021	\$	11,667	BRL	61,865		663		(1)
SSB	08/2021	BRL	613	\$	123		1		0
UAG	07/2021		4,645		899		0		(27)
UAG	07/2021	\$	929	BRL	4,645		0		(3)
UAG	08/2021	BRL	779	\$	157		2		0
						\$	2,255	\$	(197)

●J (MXN)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益						
				資産	負債					
BOA	07/2021	MXN	195,377	\$	9,848	\$	35	\$	0	
BOA	07/2021	\$	9,909	MXN	197,697		20		0	
BOA	08/2021		9,808		195,377		0		(34)	
BPS	07/2021	MXN	191,265	\$	9,441		0		(165)	
BPS	07/2021	\$	20	MXN	397		0		0	
BPS	08/2021		9,406		191,265		161		0	
GLM	07/2021	MXN	539	\$	27		0		0	
GLM	08/2021		5,219		256		0		(5)	
HUS	07/2021		2,698		135		1		(1)	
HUS	07/2021	\$	366	MXN	7,297		0		0	
JPM	07/2021	MXN	697	\$	35		0		0	
RYL	07/2021		437		22		0		0	
RYL	08/2021	\$	60	MXN	1,187		0		0	
SCX	07/2021		9,862		197,240		45		0	
SSB	07/2021	MXN	1,579	\$	77		0		(2)	
SSB	08/2021		1,108		56		0		0	
UAG	07/2021		200,042		10,084		37		0	
UAG	07/2021	\$	10,018	MXN	200,211		38		0	
UAG	08/2021		9,841		195,955		0		(39)	
							\$	337	\$	(246)

●J (NZD)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益						
				資産	負債					
BPS	07/2021	NZD	1,826	\$	1,278	\$	2	\$	0	
BPS	07/2021	\$	12	NZD	16		1		0	
BPS	08/2021		1,278		1,826		0		(2)	
GLM	07/2021	NZD	2,059	\$	1,439		1		(1)	
GLM	08/2021	\$	1,334	NZD	1,911		1		0	
HUS	07/2021	NZD	23	\$	17		0		0	
HUS	07/2021	\$	39	NZD	56		0		0	
JPM	07/2021	NZD	1,655	\$	1,156		0		0	
JPM	07/2021	\$	1,397	NZD	1,914		0		(59)	
JPM	08/2021		1,152		1,649		0		0	
MYI	07/2021		1,401		1,931		0		(52)	
SCX	07/2021	NZD	173	\$	122		1		0	
SCX	07/2021	\$	1,367	NZD	1,892		0		(45)	
UAG	07/2021	NZD	17	\$	12		0		0	
							\$	6	\$	(159)

●J (ZAR)クラス外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益						
				資産	負債					
BOA	07/2021	\$	4	ZAR	56	\$	0	\$	0	
BOA	07/2021	ZAR	7,211	\$	503		0		(2)	
BOA	08/2021	\$	501	ZAR	7,211		2		0	
BPS	07/2021		510		7,023		0		(19)	
BPS	07/2021	ZAR	7,168	\$	501		0		(1)	
BPS	08/2021	\$	499	ZAR	7,168		1		0	
CBK	07/2021		513		7,112		0		(15)	
CBK	07/2021	ZAR	6,833	\$	477		0		(1)	
CBK	08/2021	\$	475	ZAR	6,833		1		0	
HUS	07/2021		22		319		0		0	
IND	07/2021		3		43		0		0	
IND	07/2021	ZAR	144	\$	10		0		0	
SCX	07/2021	\$	503	ZAR	6,979		0		(15)	
SSB	07/2021		10		143		0		0	
							\$	4	\$	(53)
外国為替先渡し契約合計							\$	2,639	\$	(947)

PIMCO バミューダ US ハイ・イールド・ストラテジー・ファンド (M)

組入資産の明細

2021年6月30日

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
投資有価証券 98.5%					
バンクローン 7.9%					
Alice France S.A.					
4.155% due 08/14/2026	\$	975	\$	975	
Caesars Resort Collection LLC					
2.854% due 12/23/2024		124		123	
4.604% due 07/21/2025		124		125	
Commscope, Inc.					
3.354% due 04/06/2026		246		245	
Cornerstone Building Brands, Inc.					
3.750% due 04/12/2028		394		394	
Flex Acquisition Co., Inc.					
3.452% due 06/29/2025		246		244	
Getty Images, Inc.					
4.625% due 02/19/2026		555		555	
iHeartCommunications, Inc.					
3.104% due 05/01/2026		719		714	
IRB Holding Corp.					
4.250% due 12/15/2027		398		398	
MPH Acquisition Holdings LLC					
3.750% due 06/07/2023		669		668	
Nouryon Finance BV					
2.843-5.000% due 10/01/2025		692		687	
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.					
3.089% due 06/30/2025		386		386	
Parexel International Corp.					
2.854% due 09/27/2024		435		433	
TransDigm, Inc.					
2.354% due 12/09/2025		598		590	
U.S. Renal Care, Inc.					
5.125% due 06/26/2026		761		766	
Zayo Group Holdings, Inc.					
3.104% due 03/09/2027		365		362	
バンクローン合計					
(取得原価\$7,578)				7,665	
社債・約束手形 87.7%					
銀行・金融 12.2%					
Barclays PLC					
6.125% due 12/15/2025 (b)(c)		200		222	
Burford Capital Global Finance LLC					
6.250% due 04/15/2028		200		210	
Credit Acceptance Corp.					
5.125% due 12/31/2024		170		177	
Credit Suisse Group AG					
7.250% due 09/12/2025 (b)(c)		300		339	
CTR Partnership LP					
3.875% due 06/30/2028		75		77	
Deutsche Bank AG					
3.729% due 01/14/2032		400		407	
Fairstone Financial, Inc.					
7.875% due 07/15/2024		775		811	
Freedom Mortgage Corp.					
8.125% due 11/15/2024		850		882	
goeasy Ltd.					
4.375% due 05/01/2026		50		51	
5.375% due 12/01/2024		150		155	
HAT Holdings I LLC					
3.375% due 06/15/2026		325		328	
3.750% due 09/15/2030		20		20	
Howard Hughes Corp.					
4.375% due 02/01/2031		100		100	
5.375% due 08/01/2028		200		213	
Intesa Sanpaolo SpA					
5.017% due 06/26/2024		550		599	
Ladder Capital Finance Holdings LLLP					
4.250% due 02/01/2027		100		100	
LPL Holdings, Inc.					
4.000% due 03/15/2029		200		201	
MGM Growth Properties Operating Partnership LP					
4.500% due 01/15/2028		225		238	
4.625% due 06/15/2025		130		139	
5.625% due 05/01/2024		400		434	
Midcap Financial Issuer Trust					
6.500% due 05/01/2028		200		209	
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.					
5.500% due 08/15/2028		160		162	
6.000% due 01/15/2027		150		156	
Natwest Group PLC					
6.000% due 12/29/2025 (b)(c)		270		302	
Navient Corp.					
7.250% due 09/25/2023		100		111	
NMI Holdings, Inc.					
7.375% due 06/01/2025		90		103	
OneMain Finance Corp.					
6.125% due 03/15/2024		350		377	
6.625% due 01/15/2028		600		690	
8.875% due 06/01/2025		100		111	
Oxford Finance LLC					
6.375% due 12/15/2022		425		430	
Park Intermediate Holdings LLC					
4.875% due 05/15/2029		100		103	
5.875% due 10/01/2028		50		53	
7.500% due 06/01/2025		150		163	
PennyMac Financial Services, Inc.					
4.250% due 02/15/2029		125		121	
5.375% due 10/15/2025		80		84	
PRA Group, Inc.					
7.375% due 09/01/2025		230		248	
Provident Funding Associates LP					
6.375% due 06/15/2025		125		127	
Quicken Loans LLC					
3.875% due 03/01/2031		210		212	
Radian Group, Inc.					
4.875% due 03/15/2027		325		354	
RHP Hotel Properties LP					
4.750% due 10/15/2027		370		381	
RLJ Lodging Trust LP					
3.750% due 07/01/2026		100		101	

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Societe Generale S.A.			ATS Automation Tooling Systems, Inc.		
7.375% due 10/04/2023 (b)(c)	300	328	4.125% due 12/15/2028	100	103
UniCredit SpA			Avantor Funding, Inc.		
5.459% due 06/30/2035	200	218	4.625% due 07/15/2028	310	328
VICI Properties LP			Axalta Coating Systems LLC		
3.750% due 02/15/2027	180	184	4.750% due 06/15/2027	150	158
4.125% due 08/15/2030	200	206	B&G Foods, Inc.		
4.250% due 12/01/2026	500	521	5.250% due 09/15/2027	340	355
		11,758	Banjay Entertainment SASU		
			5.375% due 03/01/2025	300	311
工業 51.2%			Bausch Health Americas, Inc.		
Acadia Healthcare Co., Inc.			8.500% due 01/31/2027	1,100	1,198
5.000% due 04/15/2029	50	52	Bausch Health Cos., Inc.		
5.500% due 07/01/2028	180	193	4.875% due 06/01/2028	200	205
AdaptHealth LLC			Beacon Roofing Supply, Inc.		
4.625% due 08/01/2029	25	25	4.125% due 05/15/2029	75	75
6.125% due 08/01/2028	140	149	Berry Global, Inc.		
Adient U.S. LLC			5.625% due 07/15/2027	80	85
9.000% due 04/15/2025	100	110	Bloomin' Brands, Inc.		
Advantage Sales & Marketing, Inc.			5.125% due 04/15/2029	125	129
6.500% due 11/15/2028	280	296	Blue Racer Midstream LLC		
AECOM			6.625% due 07/15/2026	425	446
5.125% due 03/15/2027	125	140	Bombardier, Inc.		
Albertsons Cos., Inc.			7.500% due 12/01/2024	600	628
4.625% due 01/15/2027	210	220	Boyd Gaming Corp.		
4.875% due 02/15/2030	150	160	4.750% due 06/15/2031	150	156
5.875% due 02/15/2028	40	43	Boyne USA, Inc.		
Allied Universal Holdco LLC			4.750% due 05/15/2029	75	78
6.625% due 07/15/2026	330	350	Brink's Co.		
Allison Transmission, Inc.			5.500% due 07/15/2025	80	85
3.750% due 01/30/2031	125	123	Buckeye Partners LP		
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust			4.125% due 03/01/2025	190	198
3.700% due 10/01/2026	212	216	4.500% due 03/01/2028	130	134
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust			BWX Technologies, Inc.		
3.375% due 05/01/2027	88	87	4.125% due 06/30/2028	170	174
American Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust			Caesars Entertainment, Inc.		
3.575% due 01/15/2028	79	80	6.250% due 07/01/2025	95	101
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through			Caesars Resort Collection LLC		
3.350% due 10/15/2029	147	149	5.750% due 07/01/2025	95	100
American Airlines, Inc.			Camelot Finance S.A.		
5.750% due 04/20/2029	50	54	4.500% due 11/01/2026	50	52
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.			Cargo Aircraft Management, Inc.		
3.875% due 11/15/2029	150	149	4.750% due 02/01/2028	110	113
4.000% due 01/15/2028	40	41	Carnival Corp.		
AMN Healthcare, Inc.			7.625% due 03/01/2026	225	245
4.000% due 04/15/2029	25	25	Cascades, Inc.		
Amsted Industries, Inc.			5.125% due 01/15/2026	105	112
4.625% due 05/15/2030	50	51	5.375% due 01/15/2028	105	111
5.625% due 07/01/2027	40	42	Central Garden & Pet Co.		
ANGI Group LLC			4.125% due 10/15/2030	75	77
3.875% due 08/15/2028	160	159	CF Industries, Inc.		
Antero Midstream Partners LP			4.950% due 06/01/2043	200	237
5.375% due 06/15/2029	150	157	Cheniere Energy Partners LP		
7.875% due 05/15/2026	100	112	5.625% due 10/01/2026	650	676
Arconic Corp.			Cheniere Energy, Inc.		
6.000% due 05/15/2025	100	107	4.625% due 10/15/2028	150	158
Ardagh Packaging Finance PLC			Chephlapharm Arzneimittel GmbH		
5.250% due 08/15/2027	200	204	5.500% due 01/15/2028	200	205
Asbury Automotive Group, Inc.			Churchill Downs, Inc.		
4.500% due 03/01/2028	42	43	5.500% due 04/01/2027	250	261

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Cinemark USA, Inc.			Garda World Security Corp.		
5.875% due 03/15/2026	125	131	4.625% due 02/15/2027	120	121
Clarios Global LP			Gartner, Inc.		
6.250% due 05/15/2026	172	183	4.500% due 07/01/2028	110	116
Clarivate Science Holdings Corp.			Genesis Energy LP		
3.875% due 06/30/2028	200	202	6.500% due 10/01/2025	100	101
Clear Channel International BV			8.000% due 01/15/2027	150	158
6.625% due 08/01/2025	200	211	GFL Environmental, Inc.		
Clearwater Paper Corp.			3.500% due 09/01/2028	75	75
5.375% due 02/01/2025	100	107	5.125% due 12/15/2026	160	170
Core & Main Holdings LP			Go Daddy Operating Co. LLC		
8.625% due 09/15/2024 (d)	150	154	3.500% due 03/01/2029	200	199
Coty, Inc.			Graphic Packaging International LLC		
5.000% due 04/15/2026	250	254	3.500% due 03/01/2029	210	208
Crestwood Midstream Partners LP			Great Lakes Dredge & Dock Corp.		
6.000% due 02/01/2029	200	210	5.250% due 06/01/2029	75	77
DaVita, Inc.			Griffon Corp.		
3.750% due 02/15/2031	230	221	5.750% due 03/01/2028	310	330
4.625% due 06/01/2030	170	175	GYP Holdings III Corp.		
DCP Midstream Operating LP			4.625% due 05/01/2029	75	76
5.125% due 05/15/2029	200	221	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.		
5.375% due 07/15/2025	320	357	5.750% due 01/20/2026	100	107
5.625% due 07/15/2027	110	125	Hilton Domestic Operating Co., Inc.		
Dell, Inc.			3.625% due 02/15/2032	650	643
6.500% due 04/15/2038	100	128	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC		
DT Midstream, Inc.			4.875% due 07/01/2031	150	150
4.125% due 06/15/2029	210	213	5.000% due 06/01/2029	50	51
4.375% due 06/15/2031	210	215	Hilton Grand Vacations Borrower LLC		
Dun & Bradstreet Corp.			6.125% due 12/01/2024	500	526
6.875% due 08/15/2026	120	128	IHO Verwaltungs GmbH		
Edgewell Personal Care Co.			6.000% due 05/15/2027 (d)	400	420
5.500% due 06/01/2028	110	117	Imola Merger Corp.		
Elanco Animal Health, Inc.			4.750% due 05/15/2029	150	155
5.900% due 08/28/2028	100	117	Ingevity Corp.		
Energizer Holdings, Inc.			3.875% due 11/01/2028	125	124
4.750% due 06/15/2028	150	154	Installed Building Products, Inc.		
EnLink Midstream Partners LP			5.750% due 02/01/2028	80	85
4.150% due 06/01/2025	225	236	Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.		
5.600% due 04/01/2044	225	205	6.000% due 09/15/2028	230	240
EQM Midstream Partners LP			International Game Technology PLC		
4.125% due 12/01/2026	100	103	5.250% due 01/15/2029	230	247
4.500% due 01/15/2029	340	346	IQVIA, Inc.		
4.750% due 01/15/2031	165	170	5.000% due 05/15/2027	225	236
6.000% due 07/01/2025	130	142	J2 Global, Inc.		
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.			4.625% due 10/15/2030	100	104
4.500% due 09/15/2027	170	185	Jaguar Holding Co. II		
Ford Motor Credit Co. LLC			4.625% due 06/15/2025	90	95
3.096% due 05/04/2023	500	511	5.000% due 06/15/2028	60	65
3.375% due 11/13/2025	400	415	Jaguar Land Rover Automotive PLC		
4.000% due 11/13/2030	600	629	5.875% due 01/15/2028	200	211
4.134% due 08/04/2025	200	214	7.750% due 10/15/2025	200	220
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			JELD-WEN, Inc.		
6.500% due 10/01/2025	1,050	1,092	4.875% due 12/15/2027	250	260
Freeport-McMoRan, Inc.			Kaiser Aluminum Corp.		
5.450% due 03/15/2043	200	245	4.500% due 06/01/2031	50	51
Gap, Inc.			4.625% due 03/01/2028	110	114
8.625% due 05/15/2025	110	121	KAR Auction Services, Inc.		
8.875% due 05/15/2027	120	139	5.125% due 06/01/2025	50	51

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Korn Ferry			Owens & Minor, Inc.		
4.625% due 12/15/2027	140	146	4.500% due 03/31/2029	100	103
Kraft Heinz Foods Co.			Performance Food Group, Inc.		
5.000% due 06/04/2042	600	734	5.500% due 10/15/2027	140	147
5.200% due 07/15/2045	700	871	PetSmart, Inc.		
Kronos Acquisition Holdings, Inc.			4.750% due 02/15/2028	250	260
5.000% due 12/31/2026	200	203	Picasso Finance Sub, Inc.		
L Brands, Inc.			6.125% due 06/15/2025	128	136
6.625% due 10/01/2030	375	435	PM General Purchaser LLC		
LABL Escrow Issuer LLC			9.500% due 10/01/2028	150	158
6.750% due 07/15/2026	125	134	Post Holdings, Inc.		
Lamar Media Corp.			4.625% due 04/15/2030	450	458
3.750% due 02/15/2028	100	102	Presidio Holdings, Inc.		
Legends Hospitality Holding Co. LLC			4.875% due 02/01/2027	90	93
5.000% due 02/01/2026	225	235	Prestige Brands, Inc.		
Live Nation Entertainment, Inc.			5.125% due 01/15/2028	80	85
3.750% due 01/15/2028	200	201	Prime Healthcare Services, Inc.		
4.750% due 10/15/2027	90	93	7.250% due 11/01/2025	180	195
6.500% due 05/15/2027	100	111	Prime Security Services Borrower LLC		
LSF9 Atlantis Holdings LLC			3.375% due 08/31/2027	130	126
7.750% due 02/15/2026	75	78	5.250% due 04/15/2024	300	322
Marriott Ownership Resorts, Inc.			5.750% due 04/15/2026	275	305
4.500% due 06/15/2029	75	76	Rackspace Technology Global, Inc.		
4.750% due 01/15/2028	150	154	5.375% due 12/01/2028	25	26
6.125% due 09/15/2025	100	107	Rattler Midstream LP		
Masonite International Corp.			5.625% due 07/15/2025	60	63
5.750% due 09/15/2026	875	908	RBS Global, Inc.		
Mattel, Inc.			4.875% due 12/15/2025	335	343
6.200% due 10/01/2040	50	62	Resolute Forest Products, Inc.		
Melco Resorts Finance Ltd.			4.875% due 03/01/2026	75	78
5.625% due 07/17/2027	625	654	Rolls-Royce PLC		
MGM China Holdings Ltd.			5.750% due 10/15/2027	200	221
5.875% due 05/15/2026	375	394	Royal Caribbean Cruises Ltd.		
Murphy Oil USA, Inc.			5.500% due 04/01/2028	350	367
4.750% due 09/15/2029	100	105	9.125% due 06/15/2023	120	132
NCL Corp. Ltd.			RP Escrow Issuer LLC		
5.875% due 03/15/2026	325	341	5.250% due 12/15/2025	150	157
NCR Corp.			Sabre GLBL, Inc.		
5.000% due 10/01/2028	220	228	7.375% due 09/01/2025	230	250
5.250% due 10/01/2030	200	208	Seagate HDD Cayman		
New Red Finance, Inc.			3.375% due 07/15/2031	300	290
3.875% due 01/15/2028	100	101	Sealed Air Corp.		
4.000% due 10/15/2030	350	339	4.000% due 12/01/2027	50	53
5.750% due 04/15/2025	200	212	Select Medical Corp.		
Newell Brands, Inc.			6.250% due 08/15/2026	240	256
4.875% due 06/01/2025	110	122	Sensata Technologies BV		
Nielsen Finance LLC			5.625% due 11/01/2024	250	279
4.750% due 07/15/2031	325	326	Shift4 Payments LLC		
Northriver Midstream Finance LP			4.625% due 11/01/2026	75	78
5.625% due 02/15/2026	125	130	Sigma Holdco BV		
Novelis Corp.			7.875% due 05/15/2026	300	308
4.750% due 01/30/2030	300	315	Simmons Foods, Inc.		
NuStar Logistics LP			4.625% due 03/01/2029	75	76
6.000% due 06/01/2026	250	272	Spectrum Brands, Inc.		
Organon & Co.			5.500% due 07/15/2030	100	108
4.125% due 04/30/2028	400	408	Spirit AeroSystems, Inc.		
5.125% due 04/30/2031	200	206	7.500% due 04/15/2025	200	214
Outfront Media Capital LLC			Square, Inc.		
5.000% due 08/15/2027	475	493	3.500% due 06/01/2031	125	126

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
SRS Distribution, Inc.			Western Midstream Operating LP		
4.625% due 07/01/2028	75	77	4.650% due 07/01/2026	300	321
Standard Industries, Inc.			5.450% due 04/01/2044	100	108
3.375% due 01/15/2031	440	422	WMG Acquisition Corp.		
4.375% due 07/15/2030	160	165	3.000% due 02/15/2031	50	47
5.000% due 02/15/2027	500	518	WR Grace & Co.-Conn		
Staples, Inc.			4.875% due 06/15/2027	130	138
7.500% due 04/15/2026	300	311	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.		
Station Casinos LLC			4.375% due 08/15/2028	100	104
4.500% due 02/15/2028	230	234	Wynn Las Vegas LLC		
Suburban Propane Partners LP			5.500% due 03/01/2025	400	432
5.000% due 06/01/2031	100	103	Wynn Macau Ltd.		
Tallgrass Energy Partners LP			5.500% due 10/01/2027	650	678
6.000% due 12/31/2030	400	417	Yum! Brands, Inc.		
Targa Resources Partners LP			6.875% due 11/15/2037	100	125
6.500% due 07/15/2027	155	168			49,373
6.875% due 01/15/2029	255	288			
TEGNA, Inc.					
4.625% due 03/15/2028	40	42	公益事業 24.3%		
4.750% due 03/15/2026	250	267	Altice Financing S.A.		
Tenet Healthcare Corp.			5.000% due 01/15/2028	600	590
4.250% due 06/01/2029	175	177	Altice France S.A.		
6.125% due 10/01/2028	450	481	5.125% due 01/15/2029	200	201
TransDigm, Inc.			AMC Networks, Inc.		
4.625% due 01/15/2029	400	401	4.250% due 02/15/2029	75	76
Travel + Leisure Co.			4.750% due 08/01/2025	300	309
4.625% due 03/01/2030	30	31	Antero Resources Corp.		
6.000% due 04/01/2027	275	303	5.375% due 03/01/2030	25	26
6.600% due 10/01/2025	325	366	Apache Corp.		
TreeHouse Foods, Inc.			4.625% due 11/15/2025	140	152
4.000% due 09/01/2028	170	169	4.875% due 11/15/2027	160	174
TripAdvisor, Inc.			Arches Buyer, Inc.		
7.000% due 07/15/2025	100	108	4.250% due 06/01/2028	250	248
Triumph Group, Inc.			Archrock Partners LP		
7.750% due 08/15/2025	300	309	6.250% due 04/01/2028	200	209
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust			Ascent Resources Utica Holdings LLC		
2.900% due 05/01/2028	48	48	8.250% due 12/31/2028	150	165
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			Atlantica Sustainable Infrastructure PLC		
5.875% due 10/15/2027	143	159	4.125% due 06/15/2028	25	26
United Airlines, Inc.			Block Communications, Inc.		
4.625% due 04/15/2029	50	52	4.875% due 03/01/2028	100	102
US Foods, Inc.			Cable One, Inc.		
4.750% due 02/15/2029	325	332	4.000% due 11/15/2030	220	221
Valvoline, Inc.			Cablevision Lightpath LLC		
3.625% due 06/15/2031	125	125	3.875% due 09/15/2027	225	223
4.250% due 02/15/2030	40	41	Calpine Corp.		
Veritas U.S., Inc.			4.500% due 02/15/2028	100	102
7.500% due 09/01/2025	110	115	5.000% due 02/01/2031	180	179
Vertical U.S. Newco, Inc.			CCO Holdings LLC		
5.250% due 07/15/2027	200	211	4.500% due 08/15/2030	130	136
Viking Cruises Ltd.			4.750% due 03/01/2030	290	307
13.000% due 05/15/2025	240	283	5.375% due 06/01/2029	800	875
WESCO Distribution, Inc.			Chesapeake Energy Corp.		
7.125% due 06/15/2025	100	108	5.875% due 02/01/2029	75	81
7.250% due 06/15/2028	250	279	Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.		
			5.125% due 08/15/2027	100	103

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)		額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Clearway Energy Operating LLC			Ohio Edison Co.		
3.750% due 02/15/2031	100	100	6.875% due 07/15/2036	375	533
4.750% due 03/15/2028	60	63	Parkland Corp.		
CNX Resources Corp.			5.875% due 07/15/2027	225	241
6.000% due 01/15/2029	125	135	Pattern Energy Operations LP		
Colgate Energy Partners III LLC			4.500% due 08/15/2028	70	73
5.875% due 07/01/2029	150	156	PBF Holding Co. LLC		
CommScope Technologies LLC			9.250% due 05/15/2025	100	101
5.000% due 03/15/2027	300	308	PDC Energy, Inc.		
Comstock Resources, Inc.			6.125% due 09/15/2024	100	103
5.875% due 01/15/2030	200	204	Precision Drilling Corp.		
Connect Finco SARL			6.875% due 01/15/2029	100	103
6.750% due 10/01/2026	250	265	Range Resources Corp.		
Consolidated Communications, Inc.			9.250% due 02/01/2026	200	221
5.000% due 10/01/2028	150	152	Scrapps Escrow II, Inc.		
CrownRock LP			5.375% due 01/15/2031	175	175
5.625% due 10/15/2025	100	104	Scrapps Escrow, Inc.		
CSC Holdings LLC			5.875% due 07/15/2027	175	181
5.250% due 06/01/2024	475	515	Sirius XM Radio, Inc.		
5.750% due 01/15/2030	400	416	4.125% due 07/01/2030	70	71
Diamond Sports Group LLC			SM Energy Co.		
5.375% due 08/15/2026	50	32	6.500% due 07/15/2028	100	103
6.625% due 08/15/2027	750	369	Southwestern Energy Co.		
Endeavor Energy Resources LP			4.100% due 03/15/2022	500	505
5.750% due 01/30/2028	90	96	Sprint Capital Corp.		
6.625% due 07/15/2025	130	139	8.750% due 03/15/2032	500	761
EQT Corp.			Switch Ltd.		
3.125% due 05/15/2026	350	359	3.750% due 09/15/2028	80	81
Frontier Communications Holdings LLC			Talen Energy Supply LLC		
5.000% due 05/01/2028	175	181	7.250% due 05/15/2027	450	420
5.875% due 10/15/2027	125	134	Telecom Italia Capital S.A.		
6.750% due 05/01/2029	125	133	6.375% due 11/15/2033	300	359
iHeartCommunications, Inc.			Telesat Canada		
4.750% due 01/15/2028	200	206	6.500% due 10/15/2027	130	124
Indigo Natural Resources LLC			TerraForm Power Operating LLC		
5.375% due 02/01/2029	125	131	4.750% due 01/15/2030	230	236
Level 3 Financing, Inc.			T-Mobile USA, Inc.		
3.625% due 01/15/2029	60	58	3.500% due 04/15/2031	450	466
3.750% due 07/15/2029	250	243	Transocean Pontus Ltd.		
LogMeIn, Inc.			6.125% due 08/01/2025	157	159
5.500% due 09/01/2027	160	166	Transocean Proteus Ltd.		
Lumen Technologies, Inc.			6.250% due 12/01/2024	55	56
7.500% due 04/01/2024	500	562	Univision Communications, Inc.		
MEG Energy Corp.			5.125% due 02/15/2025	500	512
5.875% due 02/01/2029	25	26	6.625% due 06/01/2027	140	152
7.125% due 02/01/2027	240	256	UPC Holding BV		
Netflix, Inc.			5.500% due 01/15/2028	200	210
5.875% due 11/15/2028	500	614	Viasat, Inc.		
Nexstar Broadcasting, Inc.			5.625% due 09/15/2025	500	511
4.750% due 11/01/2028	75	77	Viper Energy Partners LP		
Nokia OYJ			5.375% due 11/01/2027	90	94
4.375% due 06/12/2027	800	886	Virgin Media Secured Finance PLC		
Occidental Petroleum Corp.			5.500% due 05/15/2029	750	807
1.606% due 08/15/2022	930	926	Vistra Operations Co. LLC		
4.400% due 04/15/2046	700	673	5.000% due 07/31/2027	325	334
6.125% due 01/01/2031	150	177	Zayo Group Holdings, Inc.		
6.625% due 09/01/2030	400	481	4.000% due 03/01/2027	760	756
8.000% due 07/15/2025	250	300	Ziggo Bond Co. BV		
8.875% due 07/15/2030	70	94	5.125% due 02/28/2030	300	308

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
Ziggo BV		
4.875% due 01/15/2030	200	205
5.500% due 01/15/2027	225	234
		23,437
社債・約束手形合計		84,568
(取得原価\$80,450)		
米国財務省債務証券 0.5%		
U.S. Treasury Bonds		
2.875% due 05/15/2043	400	460
米国財務省債務証券合計		460
(取得原価\$436)		
	株数	
普通株式 0.4%		
Groupe Novasep SAS	139,800	444
普通株式合計		444
(取得原価\$766)		
	額面金額(単位:千)	
短期金融商品 2.0%		
定期預金 0.2%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	\$ 42	42
Bank of Nova Scotia		
0.005% due 07/01/2021	2	2
Citibank N.A.		
0.005% due 07/01/2021	22	22
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	44	44
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 07/01/2021	44	44

	額面金額(単位:千)	評価額(単位:千)
National Australia Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	16	16
Royal Bank of Canada		
0.005% due 07/01/2021	1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.005% due 07/01/2021	39	39
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.005% due 07/01/2021	3	3
		213
米国財務省短期証券 1.8%		
0.043% due 08/26/2021 (e)	1,700	1,700
短期金融商品合計		1,913
(取得原価\$1,913)		
投資有価証券合計 (a) 98.5%	\$	95,050
(取得原価\$91,143)		
金融デリバティブ商品 (0.0%)		(4)
(取得原価またはプレミアム\$0)		
その他の資産および負債 1.5%		1,419
純資産 100.0%	\$	96,465

(a) 2021年6月30日現在の投資合計の地域別配分は、米国に純資産の77.4%、カナダに純資産の5.2%、その他諸国に合計で15.9%になっている。

(b) 偶発転換証券

(c) 無期限。日付は、該当する場合、次回の契約上の償還日である。

(d) 現物払いの有価証券

(e) クーボンは最終利回りである。

●制限付証券

2021年6月30日現在

発行体	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	単位:千	
						純資産に占める 市場価格の割合	
Deutsche Bank AG	3.729%	01/14/2032	01/21/2021	\$ 401	\$ 407	0.42%	
Groupe Novasep SAS	N/A	N/A	03/15/2012	766	444	0.46%	
Occidental Petroleum Corp.	6.125%	01/01/2031	12/08/2020	150	177	0.19%	
制限付証券合計				\$ 1,317	\$ 1,028	1.07%	

◎借入およびその他の金融取引

2021年6月30日現在

●リバース・レポ取引

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入額	単位:千	
					リバース・レポ取引に係る未払金	
JML	(1.000%)	04/28/2021	07/14/2021	\$ (312)	\$	(312)
リバース・レポ取引合計				\$	\$	(312)

●担保付借入として会計処理される取引

単位:千

	残存期間				合計
	翌日物および継続	30日以下	31-90日	90日超	
リバース・レポ取引					
Non-U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (312)	\$ 0	\$ 0	\$ (312)
リバース・レポ取引合計	\$ 0	\$ (312)	\$ 0	\$ 0	\$ (312)
借入合計	\$ 0	\$ (312)	\$ 0	\$ 0	\$ (312)
リバース・レポ取引に係る未払金					\$ (312)

◎上場金融デリバティブ商品

2021年6月30日現在

●先物契約

単位:千

銘柄	種類	決算月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金		
					資産	負債	
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2023	77	\$ 144	\$ 1	\$ 0	\$ 0
先物契約合計				\$ 144	\$ 1	\$ 0	\$ 0

●スワップ契約

クレジット・デフォルト・スワップ(クレジット・インデックス) — 売り

単位:千

インデックス/トランシェ	受取 固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
						資産	負債	
CDX.HY-34 Index	5.000%	06/20/2025	\$ 3,220	\$ 323	\$ 327	\$ 0	\$ (8)	
CDX.HY-35 Index	5.000%	12/20/2025	600	62	8	0	0	
CDX.HY-36 Index	5.000%	06/20/2026	3,700	385	49	2	0	
				\$ 770	\$ 384	\$ 2	\$ (8)	

金利スワップ

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
支払	3-Month USD-LIBOR	0.250%	08/22/2024	\$ 10,000	\$ (87)	\$ (74)	\$ 2	\$ 0	
受取	3-Month USD-LIBOR	0.360%	08/22/2024	5,000	47	51	0	(1)	
					\$ (40)	\$ (23)	\$ 2	\$ (1)	
スワップ契約合計					\$ 730	\$ 361	\$ 4	\$ (9)	

運用計算書

2021年6月30日に終了した期間

(金額単位:千米ドル)

収益:	
受取利息(外国税額控除後)*	\$ 5,476
雑収入	0
収益合計	5,476
費用:	
支払利息	0
費用合計	0
純投資損益	5,476
当期実現損益:	
投資有価証券(外国税額控除後)	1,967
上場金融デリバティブ商品	258
店頭金融デリバティブ商品	0
外貨通貨	0
当期実現損益	2,225
当期末実現評価損益:	
投資有価証券(外国税額控除後)	6,276
上場金融デリバティブ商品	619
店頭金融デリバティブ商品	0
外貨建資産および負債	19
当期末実現評価損益	6,914
当期実現および未実現評価損益	9,139
運用の結果による純資産の増減額	\$ 14,615
*外国税	\$ 4

野村マネーポートフォリオ マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2021年7月12日）

作成対象期間（2020年7月14日～2021年7月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。 外貨建て資産への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	中率			
9期(2017年7月11日)	円 10,065		% △0.0	% 60.8	% -	百万円 140
10期(2018年7月11日)	10,062		△0.0	34.5	-	145
11期(2019年7月11日)	10,058		△0.0	57.9	-	124
12期(2020年7月13日)	10,055		△0.0	62.0	-	37
13期(2021年7月12日)	10,048		△0.1	55.0	-	1,836

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

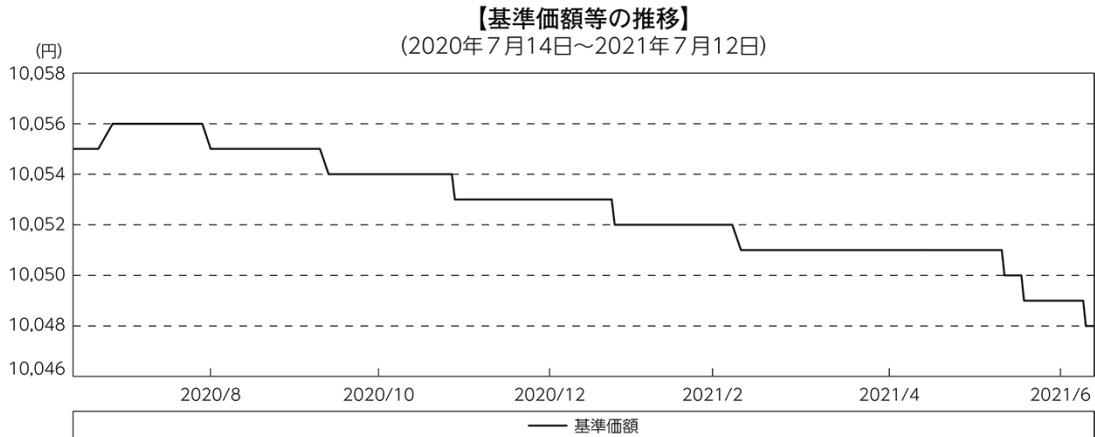
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年7月13日	円 10,055		% -	% 62.0	% -
7月末	10,056		0.0	59.3	-
8月末	10,055		0.0	59.4	-
9月末	10,055		0.0	60.5	-
10月末	10,054		△0.0	59.4	-
11月末	10,053		△0.0	59.4	-
12月末	10,053		△0.0	59.9	-
2021年1月末	10,052		△0.0	59.4	-
2月末	10,052		△0.0	59.9	-
3月末	10,051		△0.0	54.5	-
4月末	10,051		△0.0	53.0	-
5月末	10,051		△0.0	53.0	-
6月末	10,049		△0.1	55.3	-
(期末) 2021年7月12日	10,048		△0.1	55.0	-

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

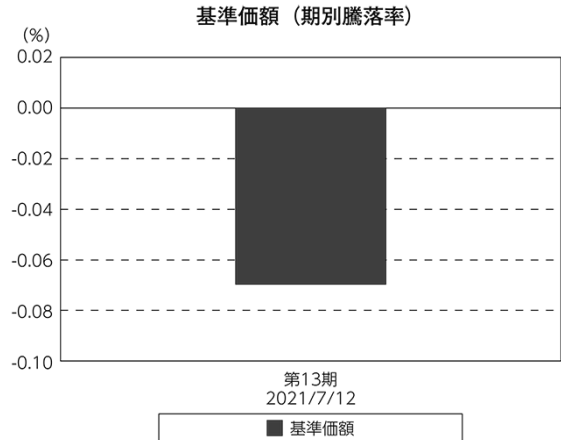
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年7月14日～2021年7月12日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年7月14日～2021年7月12日)

公社債

		買付額	売付額
国	国債証券	千円 27,894,011	千円 26,859,905 (44,000)
内	特殊債券	20,090	— (23,000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月14日～2021年7月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	64	22	34.4	—	—	—

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年7月12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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	990,000 (990,000)	990,000 (990,000)	53.9 (53.9)	— (—)	53.9 (53.9)	— (—)	— (—)
特殊債券 (除く金融債)	20,000 (20,000)	20,050 (20,050)	1.1 (1.1)	— (—)	— (—)	— (—)	1.1 (1.1)
合 計	1,010,000 (1,010,000)	1,010,050 (1,010,050)	55.0 (55.0)	— (—)	53.9 (53.9)	— (—)	1.1 (1.1)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	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	
国債バスケット(変動利付・利付・国庫短期証券)※	—	990,000	990,000	—
小 計		990,000	990,000	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第2回	0.502	20,000	20,050	2021/12/24
小 計		20,000	20,050	
合 計		1,010,000	1,010,050	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

*※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2021年7月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 1,010,050	% 55.0
コール・ローン等、その他	826,070	45.0
投資信託財産総額	1,836,120	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年7月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,836,120,051
コール・ローン等	751,858,701
公社債(評価額)	1,010,050,750
未収利息	28,600
差入委託証拠金	74,182,000
(B) 負債	523
未払利息	523
(C) 純資産総額(A-B)	1,836,119,528
元本	1,827,284,353
次期繰越損益金	8,835,175
(D) 受益権総口数	1,827,284,353口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,048円

(注) 期首元本額は36,951,839円、期中追加設定元本額は3,584,838,527円、期中一部解約元本額は1,794,506,013円、1口当たり純資産額は1.0048円です。

○損益の状況 (2020年7月14日～2021年7月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 73,315
受取利息	△ 40,529
支払利息	△ 32,786
(B) 有価証券売買損益	△ 69,009
売買損	△ 69,009
(C) 当期損益金(A+B)	△ 142,324
(D) 前期繰越損益金	205,013
(E) 追加信託差損益金	17,566,473
(F) 解約差損益金	△ 8,793,987
(G) 計(C+D+E+F)	8,835,175
次期繰越損益金(G)	8,835,175

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

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

* 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
マルチアセット投信(全天候型)2106(適格機関投資家専用)	1,791,223,007
財形給付金ファンド	29,672,244
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	1,003,293
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	998,495
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	997,887
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	997,001
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	997,000
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)毎月分配型	996,337
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	100,755
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	99,927
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	99,898
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,985
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)年2回決算型	9,978

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,978
NEXT FUNDS ChinaAMC・中国株式・上証50連動型上場投信	9,938
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Eコース	9,937
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Fコース	9,937
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド(為替ヘッジあり)	9,936
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,935
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,935
野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド(為替ヘッジなし)	4,974
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Cコース	994
野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Dコース	994

○お知らせ

該当事項はございません。