

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年4月27日

【発行者名】 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.
(Mitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg)
S.A.)

【代表者の役職氏名】 デプティ・マネージング・ディレクター 弘田 嘉信

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 1150、
アーロン通り 287 - 289番
(287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健
同 青山 正幸

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・
セレクション
(Emerging Bond Fund Currency Selection)
- 米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ
(USD (BRL-hedged) Portfolio)
- 豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ
(AUD (BRL-hedged) Portfolio)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資信託受益証券の金額】
- 米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ受益証券:
100億アメリカ合衆国ドル(約1兆1,205億円)を上限とする。
- 豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ受益証券:
110億オーストラリア・ドル(約9,336億円)を上限とする。

(注1) 各サブ・ファンドは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各サブ・ファンドの参照通貨は以下の通りである。
米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ: アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)
豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ: オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)

(注2) 米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行(現株式会社三菱UFJ銀行)の対顧客電信売買相場の仲値である、1米ドル=112.05円および1豪ドル=84.87円による。以下同じ。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成30年１月31日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、「第二部 ファンド情報」の「第１ ファンドの状況」の「５ 運用状況」および「第３ ファンドの経理状況」ならびに「第三部 特別情報」の「第１ 管理会社の概況」の「１ 管理会社の概況」、「２ 事業の内容及び営業の概況」および「５ その他」を新たな情報により訂正および追加するため、また、「表紙」、「第一部 証券情報」の「（３）発行（売出）価額の総額」、「第二部 ファンド情報」の「第１ ファンドの状況」の「１ ファンドの性格、（３）ファンドの仕組み」、「２ 投資方針、（３）運用体制」、「３ 投資リスク、（２）リスクに対する管理体制および（３）リスクに関する参考情報」、「４ 手数料等及び税金、（５）課税上の取扱い」、「５ 運用状況、（２）投資資産」、「第３ ファンドの経理状況」、「第三部 特別情報」の「第１ 管理会社の概況」の「１ 管理会社の概況」、「３ 管理会社の経理状況」および「第２ その他の関係法人の概況」の「１ 名称、資本金の額及び事業の内容」を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

２【訂正の内容】

（１）半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容＊と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 第15 ファンド情報 ファンドの状況 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第31 ファンドの経理状況 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 第11 特別情報 管理会社の概況 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
5 その他	(4) 訴訟事件その他の重要事項		(3) その他	追加

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（「５ 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション（Emerging Bond Fund Currency Selection）（以下「ファンド」という。）のサブ・ファンドである米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ（USD（BRL-hedged）Portfolio）および豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ（AUD（BRL-hedged）Portfolio）の運用状況は以下のとおりである。

（１）投資状況（資産別および地域別の投資状況）（2018年２月末日現在）

＜米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン	34,356,020.42	99.79
現金・その他の資産 （負債控除後）		73,587.51	0.21
合計（純資産総額）		34,429,607.93 （約3,697百万円）	100.00

（注１）投資比率とは、各サブ・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（注２）各サブ・ファンドは、それぞれ異なる通貨を参照通貨としており、異なる定めがない限り、金額表示は参照通貨で行う。各サブ・ファンドの参照通貨は以下の通りである。

米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ：アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）

豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ：オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）

（注３）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2018年２月28日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行（現株式会社三菱ＵＦＪ銀行）の対顧客電信売買相場の仲値である、１米ドル＝107.37円および１豪ドル＝83.66円による。以下同じ。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

＜豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ＞

資産の種類	地域名	時価合計（豪ドル）	投資比率（％）
外国投資信託	ケイマン	9,726,407.67	99.93
現金・その他の資産 （負債控除後）		6,559.49	0.07
合計（純資産総額）		9,732,967.16 （約814百万円）	100.00

（２）運用実績

純資産の推移

2018年２月末日までの１年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

<米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2017年３月末日	39,901,510.28	4,284,225	29.52	3,170
４月末日	40,105,614.21	4,306,140	29.59	3,177
５月末日	38,984,836.23	4,185,802	29.00	3,114
６月末日	37,536,472.90	4,030,291	28.14	3,021
７月末日	39,594,979.02	4,251,313	29.88	3,208
８月末日	40,619,805.89	4,361,349	29.89	3,209
９月末日	40,765,226.20	4,376,962	29.50	3,167
10月末日	39,381,235.93	4,228,363	28.50	3,060
11月末日	38,638,320.76	4,148,597	28.17	3,025
12月末日	37,778,858.75	4,056,316	27.73	2,977
2018年１月末日	36,972,221.93	3,969,707	28.67	3,078
２月末日	34,429,607.93	3,696,707	27.18	2,918

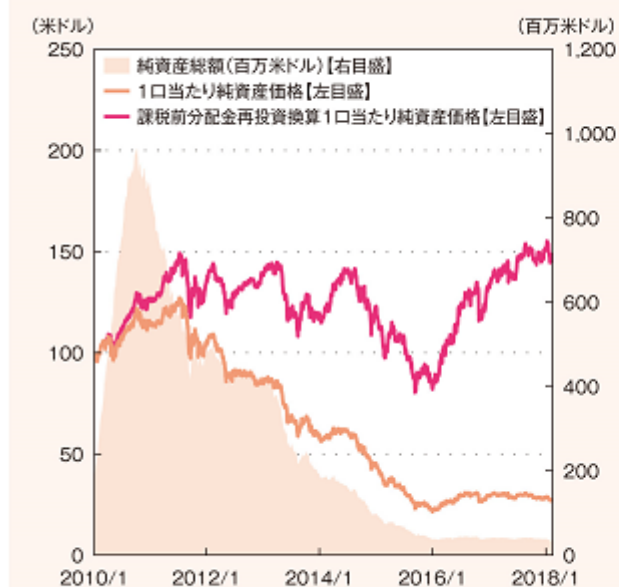
<豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

	純資産総額		１口当たり純資産価格	
	豪ドル	千円	豪ドル	円
2017年３月末日	12,430,174.26	1,039,908	38.76	3,243
４月末日	12,667,425.17	1,059,757	39.74	3,325
５月末日	12,269,590.56	1,026,474	39.01	3,264
６月末日	11,435,967.00	956,733	36.71	3,071
７月末日	11,477,706.76	960,225	37.37	3,126
８月末日	11,218,852.76	938,569	37.58	3,144
９月末日	11,116,696.20	930,023	37.47	3,135
10月末日	10,751,584.52	899,478	36.90	3,087
11月末日	10,664,775.86	892,215	36.91	3,088
12月末日	10,044,457.72	840,319	35.31	2,954
2018年１月末日	9,935,633.16	831,215	35.04	2,931
２月末日	9,732,967.16	814,260	34.48	2,885

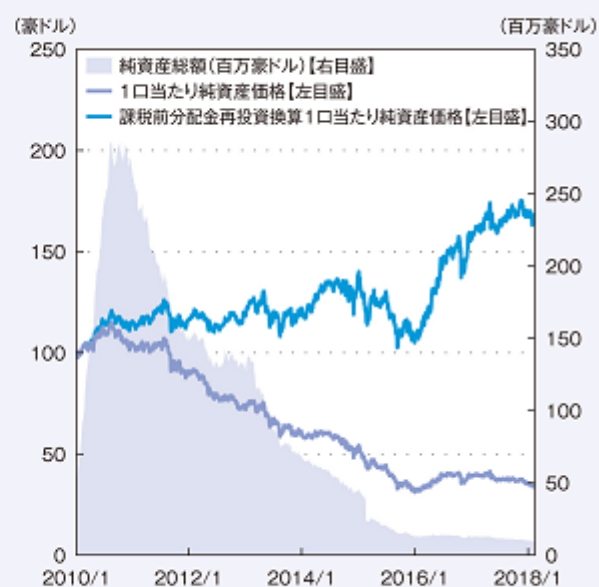
（注）上記に記載された各月末日の数値は、評価および買戻目的のため計算されたものである。そのため、各会計年度末の純資産総額および１口当たり純資産価格は、財務書類中の数値とは一致しないことがある。

< 参考情報 >

米ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ



豪ドル(ブラジルリアル・ヘッジ)ポートフォリオ



● 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、各サブ・ファンドの公表されている1口当たり純資産価格に各収益分配金(課税前)をその分配を行う日に全額再投資したと仮定して算出したものであり、公表されている1口当たり純資産価格とは異なります。以下同じです。

分配の推移

2018年２月末日までの１年間の１口当たりの分配の額は、以下のとおりである。

<米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	米ドル	円
2017年３月１日～2018年２月末日	4.80	515

<豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

計算期間	１口当たり分配金	
	豪ドル	円
2017年３月１日～2018年２月末日	6.60	552

<参考情報>

米ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ		豪ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ	
単位：米ドル		単位：豪ドル	
第4計算期間 (2012年8月1日～2013年7月31日)	18.05	第4計算期間 (2012年8月1日～2013年7月31日)	15.95
第5計算期間 (2013年8月1日～2014年7月31日)	15.60	第5計算期間 (2013年8月1日～2014年7月31日)	13.80
第6計算期間 (2014年8月1日～2015年7月31日)	15.00	第6計算期間 (2014年8月1日～2015年7月31日)	13.45
第7計算期間 (2015年8月1日～2016年7月31日)	6.00	第7計算期間 (2015年8月1日～2016年7月31日)	7.60
第8計算期間 (2016年8月1日～2017年7月31日)	4.80	第8計算期間 (2016年8月1日～2017年7月31日)	6.60
2017年10月	0.40	2017年10月	0.55
2017年11月	0.40	2017年11月	0.55
2017年12月	0.40	2017年12月	0.55
2018年 1月	0.40	2018年 1月	0.55
2018年 2月	0.40	2018年 2月	0.55
直近1年間累計	4.80	直近1年間累計	6.60
設定来累計	101.81	設定来累計	97.39

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

● 分配金は1口当たり(税引前)の金額です。

収益率の推移

<米ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

計算期間	収益率(注)
2017年3月1日～2018年2月末日	6.07%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格(当該期間中の分配金の合計額を加えた額)

b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<豪ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ>

計算期間	収益率(注)
2017年3月1日～2018年2月末日	4.26%

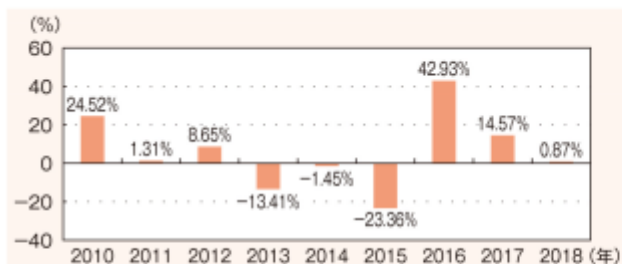
(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 上記期間末の1口当たり純資産価格(当該期間中の分配金の合計額を加えた額)

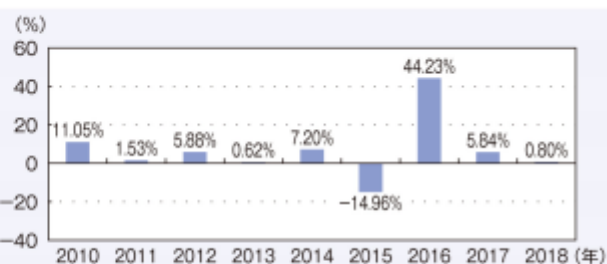
b = 上記期間の直前の日の1口当たり純資産価格

<参考情報>

米ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ



豪ドル(ブラジルレアル・ヘッジ)ポートフォリオ



- 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$
a = 各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格
b = 当該各暦年の直前の各暦年末現在の課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格
(ただし2010年の場合、当初募集価格である100米ドルまたは100豪ドル)
- 2010年は設定日から年末までの、2018年は2月28日までの収益率を表示しています。
- サブ・ファンドにベンチマークはありません。

２ 販売及び買戻しの実績

2018年２月末日までの１年間における販売および買戻しの実績ならびに2018年２月末日現在の発行済口数は次のとおりである。

<米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
172,805 (172,805)	258,326 (258,326)	1,266,642 (1,266,642)

<豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ>

販売口数	買戻口数	発行済口数
2,455 (2,455)	43,228 (43,228)	282,242 (282,242)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

[次へ](#)

３ ファンドの経理状況

- a．サブ・ファンドの日本文の中間財務書類は、米国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c．サブ・ファンドの原文の中間財務書類は米ドルおよび豪ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行（現株式会社三菱ＵＦＪ銀行）の2018年2月28日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝107.37円、1豪ドル＝83.66円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

[次へ](#)

(１) 資産及び負債の状況

貸借対照表

エマージング・ボンド・ファンド 米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ

	2018年 1 月31日現在	
	米ドル	千円
資産		
現金		
銀行預金 - 基準通貨	193,498.16	20,776
有価証券（取得原価）		
投資信託（取得原価）	49,286,254.06	5,291,865
未実現評価損益		
未実現時価評価損益	(12,420,599.63)	(1,333,600)
未収収益		
未収預金利息	33.33	4
投資売却未収金		
投資売却未収金	1,460,000.00	156,760
資産合計：	38,519,185.92	4,135,805
負債		
資本証券		
受益証券買戻未払金	1,478,385.08	158,734
未払費用		
未払監査費用	11,660.32	1,252
未払保管報酬	4,044.98	434
未払報告書作成費用	2,615.06	281
未払投資運用報酬	11,268.67	1,210
未払受託報酬	856.45	92
未払副投資顧問報酬	19,543.57	2,098
未払代行協会員報酬	1,616.53	174
未払販売報酬	16,164.38	1,736
未払副管理報酬	808.95	87
負債合計：	1,546,963.99	166,098
資本		
サブ・ファンド受益証券		
発行済サブ・ファンド受益証券（額面価額）	128,942,100.00	13,844,513
受益証券額面超過額	105,681,906.94	11,347,066
分配金支払額		
分配金支払額	(401,048,292.14)	(43,060,555)
利益剰余金		
利益剰余金	201,795,031.67	21,666,733
当期純利益	1,601,475.46	171,950
資本合計：	36,972,221.93	3,969,707
負債および資本合計	38,519,185.92	4,135,805
純資産価額合計	36,972,221.93	3,969,707
発行済受益証券総数	1,289,421.00000口	
受益証券 1 口当たり純資産価格合計	28.67	3,078円

貸借対照表

エマージング・ボンド・ファンド 豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

	2018年 1 月31日現在	
	豪ドル	千円
資産		
現金		
銀行預金 - 基準通貨	50,961.87	4,263
有価証券（取得原価）		
投資信託（取得原価）	12,895,265.70	1,078,818
未実現評価損益		
未実現時価評価損益	(2,979,723.36)	(249,284)
未収収益		
未収預金利息	10.46	1
投資売却未収金		
投資売却未収金	4,000.00	335
資産合計：	9,970,514.67	834,133
負債		
資本証券		
受益証券買戻未払金	3,182.40	266
未払費用		
未払監査費用	13,275.44	1,111
未払保管報酬	1,078.21	90
未払報告書作成費用	3,189.91	267
未払投資運用報酬	2,960.70	248
未払受託報酬	1,018.42	85
未払副投資顧問報酬	5,137.77	430
未払代行協会員報酬	438.46	37
未払販売報酬	4,384.65	367
未払副管理報酬	215.55	18
負債合計：	34,881.51	2,918
資本		
サブ・ファンド受益証券		
発行済サブ・ファンド受益証券（額面価額）	28,356,300.00	2,372,288
受益証券額面超過額	70,662,583.24	5,911,632
分配金支払額		
分配金支払額	(127,262,843.50)	(10,646,809)
利益剰余金		
利益剰余金	37,884,490.76	3,169,416
当期純利益	295,102.66	24,688
資本合計：	9,935,633.16	831,215
負債および資本合計	9,970,514.67	834,133
純資産価額合計	9,935,633.16	831,215
発行済受益証券総数	283,563.000000口	
受益証券 1 口当たり純資産価格合計	35.04	2,931円

損益計算書

エマージング・ボンド・ファンド 米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

	2017年8月1日から 2018年1月31日までの期間	
	米ドル	千円
収益		
実現損益		
為替取引に係る実現損失	(16.51)	(2)
市場に係る実現損失	(2,807,738.70)	(301,467)
受取利息		
預金受取利息	620.31	67
受取配当金		
受取配当金	2,554,363.38	274,262
未実現評価損益		
未実現時価評価損益	2,209,497.20	237,234
収益合計：	1,956,725.68	210,094
費用		
費用 - 報酬		
監査費用	12,469.32	1,339
保管報酬	24,919.42	2,676
報告書作成費用	1,095.59	118
弁護士費用	1,680.19	180
投資運用報酬	67,780.63	7,278
受託報酬	5,041.60	541
経費	7,697.71	827
副投資顧問報酬	117,619.07	12,629
代行協会員報酬	9,967.79	1,070
販売報酬	99,677.25	10,702
C I M A 関連年次費用	2,317.79	249
副管理報酬	4,983.86	535
費用合計：	355,250.22	38,143
投資純利益	1,601,475.46	171,950

損益計算書

エマージング・ボンド・ファンド 豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ

2017年8月1日から
2018年1月31日までの期間

豪ドル 千円

		豪ドル	千円
収益			
実現損益			
為替取引に係る実現利益	5.09	0	
為替取引に係る実現損失	(106.38)	(9)	
市場に係る実現損失	(547,766.34)	(45,826)	
為替に係る実現利益	3.02	0	
為替に係る実現損失	(0.78)	(0)	
受取利息			
預金受取利息	251.99	21	
受取配当金			
受取配当金	695,839.67	58,214	
未実現評価損益			
未実現時価評価損益	269,709.82	22,564	
収益合計：		417,936.09	34,965
費用			
費用 - 報酬			
監査費用	14,437.63	1,208	
保管報酬	6,798.34	569	
報告書作成費用	1,471.75	123	
弁護士費用	469.95	39	
投資運用報酬	18,491.63	1,547	
受託報酬	6,387.62	534	
経費	8,473.97	709	
副投資顧問報酬	32,088.53	2,685	
代行協会員報酬	2,719.43	228	
販売報酬	27,193.64	2,275	
C I M A 関連年次費用	2,941.37	246	
副管理報酬	1,359.57	114	
費用合計：		122,833.43	10,276
投資純利益		295,102.66	24,688

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

保有有価証券残高明細

エマージング・ボンド・ファンド 米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ

シェアクラス・種類別 2018年１月31日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット・ クラス	取得原価 （表示通貨）（注１）	取得原価 （基準通貨）（注２） （米ドル）	基準価格 ／ 換算レート	価額 （表示通貨）	価額 （基準通貨） （米ドル）	未実現損益		
									市場 （米ドル）	通貨 （米ドル）	合計 （米ドル）
未割当のクラス											
現金											
193,498.16000	現金	2018年 1 月31日		193,498.16	193,498.16	1.000000000 1.000000000	193,498.16	193,498.16	0.00	0.00	0.00
ファンド											
7,158,379.50000	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラスD （ ブラジルレアル） SCYM0033 844004	2010年 1 月21日		49,286,254.06	49,286,254.06	5.150000000 1.000000000	36,865,654.43	36,865,654.43	(12,420,599.63)	0.00	(12,420,599.63)
7,351,877.66000	未割当のクラス合計			49,479,752.22	49,479,752.22		37,059,152.59	37,059,152.59	(12,420,599.63)	0.00	(12,420,599.63)
7,351,877.66000	ポートフォリオ合計			49,479,752.22	49,479,752.22		37,059,152.59	37,059,152.59	(12,420,599.63)	0.00	(12,420,599.63)

選別、分類されたまたはタックスロットの時価および未実現損益の価格をサブ・ファンドの時価および未実現損益の価格と比較した場合、四捨五入による差が生じる場合がある。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。本ポートフォリオの表示通貨は米ドルです。

（注２）基準通貨とは、ポートフォリオ計理上の基準通貨をいいます。本ポートフォリオの基準通貨は米ドルです。

保有有価証券残高明細

エマージング・ボンド・ファンド 豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ

シェアクラス・種類別 2018年 1 月31日現在

口数 / 金額	種類	取引日	サブ ユニット・ クラス	取得原価 （表示通貨）（注 1）	取得原価 （基準通貨）（注 2） （豪ドル）	基準価格 ／換算レート	価額 （表示通貨）	価額 （基準通貨） （豪ドル）	未実現損益		
									市場 （豪ドル）	通貨 （豪ドル）	合計 （豪ドル）
未割当のクラス											
現金											
50,961.87000	現金	2018年 1 月31日		50,961.87	50,961.87	1.000000000 1.000000000	50,961.87	50,961.87	0.00	0.00	0.00
ファンド											
1,727,446.40000	ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド B クラス A （ブラジルレアル） SCYM0032 844008	2010年 1 月21日		12,895,265.70	12,895,265.70	5.740000000 1.000000000	9,915,542.34	9,915,542.34	(2,979,723.36)	0.00	(2,979,723.36)
1,778,408.27000	未割当のクラス合計			12,946,227.57	12,946,227.57		9,966,504.21	9,966,504.21	(2,979,723.36)	0.00	(2,979,723.36)
1,778,408.27000	ポートフォリオ合計			12,946,227.57	12,946,227.57		9,966,504.21	9,966,504.21	(2,979,723.36)	0.00	(2,979,723.36)

選別、分類されたまたはタックスロットの時価および未実現損益の価格をサブ・ファンドの時価および未実現損益の価格と比較した場合、四捨五入による差が生じる場合がある。

（注１）表示通貨とは、投資対象の表示通貨をいいます。本ポートフォリオの表示通貨は豪ドルまたは米ドルです。

（注２）基準通貨とは、ポートフォリオ計理上の基準通貨をいいます。本ポートフォリオの基準通貨は豪ドルです。

[次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは、ピムコ・ケイマン・トラストのサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢを通じてピムコ・ケイマン・トラストの別のサブ・ファンドであるピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）に投資します。資産負債計算書の資産の部に計上された投資有価証券は、ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢの受益証券です。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）の状況は次の通りです。

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）の状況

同投資信託は、ケイマンの法律に基づき設立された外国投資信託です。同投資信託の資産負債計算書および投資有価証券明細表は、ピムコジャパンリミテッドより入手した中間財務書類の原文を管理会社が抜粋したものが翻訳されております。

[次へ](#)

資産負債計算書（未監査）

2017年 8 月31日現在

	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）	
	千米ドル （受益証券１口当 りの金額を除く）	百万円 （受益証券１口当 りの金額を除く）
資産：		
投資、時価評価額		
投資有価証券*	1,164,268	125,007
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	100	11
店頭取引	1,501	161
取引相手への預け金	6,179	663
外貨、時価評価額	87	9
投資売却未収金	4,222	453
ファンド受益証券販売未収金	371	40
未収利息および／または未収配当金	17,097	1,836
	<u>1,193,825</u>	<u>128,181</u>
負債：		
借入金およびその他の金融取引		
逆現先取引契約に係る未払金	535	57
金融デリバティブ商品		
取引所取引または中央清算	31	3
店頭取引	3,484	374
投資購入未払金	3,875	416
未払利息	3	0
取引相手からの預り金	380	41
ファンド受益証券買戻未払金	1,252	134
未払税金	8,094	869
	<u>17,654</u>	<u>1,896</u>
純資産	<u>1,176,171</u>	<u>126,285</u>
投資有価証券原価	<u>1,124,152</u>	<u>120,700</u>
保有外貨原価	<u>80</u>	<u>9</u>
金融デリバティブ商品の原価純額またはプレミアム純額	<u>(1,350)</u>	<u>(145)</u>
*次の現先取引契約を含む：	<u>60,600</u>	<u>6,507</u>

ピムコ ケイマン

エマージング ボンド ファンド（Ｍ）

	千米ドル	百万円
	（受益証券１口当たりの金額を除く）	（受益証券１口当たりの金額を除く）

純資産：	<u>1,176,171</u>	<u>126,285</u>
発行済受益証券口数：	<u>82,039千口</u>	
発行済受益証券１口当たり純資産価格および買戻価格： （機能通貨による表示）	<u>14.34米ドル</u>	<u>1,540円</u>

千未満の数値は四捨五入により残高が０と表示されることがある。

[次へ](#)

投資有価証券明細表（未監査）

ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド（Ｍ）

（2017年8月31日現在）

	額面金額 （単位：千）	時価 （単位：千）		額面金額 （単位：千）	時価 （単位：千）
INVESTMENTS IN SECURITIES 99.0%			Centrais Eletricas Brasileiras S.A.		
ANGOLA 0.1%			6.875% due 07/30/2019	\$ 9,985	\$ 10,671
SOVEREIGN ISSUES 0.1%					
Angolan Government International Bond			Petrobras Global Finance BV		
9.500% due 11/12/2025	\$ 1,300	\$ 1,402	4.875% due 03/17/2020	664	681
Total Angola (Cost \$1,201)		1,402	5.375% due 01/27/2021	4,275	4,432
			5.625% due 05/20/2043	3,400	2,995
ARGENTINA 5.9%			5.750% due 01/20/2020	4,242	4,471
SOVEREIGN ISSUES 5.9%			6.250% due 03/17/2024	6,500	6,905
Argentina Government International Bond			6.750% due 01/27/2041	1,400	1,387
3.875% due 01/15/2022	EUR 1,200	1,446	6.850% due 06/05/2115	4,400	4,151
5.000% due 01/15/2027	3,800	4,437	6.875% due 01/20/2040	8,150	8,170
6.625% due 07/06/2028	\$ 1,200	1,258	7.250% due 03/17/2044	700	724
6.875% due 04/22/2021	10,500	11,433	7.375% due 01/17/2027	800	886
7.125% due 07/06/2036	1,800	1,891			85,078
7.125% due 06/28/2117	4,250	4,203			
7.500% due 04/22/2026	13,050	14,623	SOVEREIGN ISSUES 2.5%		
7.625% due 04/22/2046	2,300	2,524	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social		
7.820% due 12/31/2033	EUR 4,541	6,000	4.125% due 09/15/2017	EUR 700	834
8.280% due 12/31/2033	\$ 1,823	2,119	6.500% due 06/10/2019	\$ 2,328	2,488
8.750% due 05/07/2024	2,700	3,193			
			Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais		
Provincia de Buenos Aires			5.333% due 02/15/2028	26,000	26,325
5.375% due 01/20/2023	EUR 2,800	3,394			29,647
			Total Brazil (Cost \$107,715)		114,725
Provincia de Entre Rios Argentina					
8.750% due 02/08/2025	\$ 4,250	4,453	CAMEROON 0.1%		
			SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Provincia de la Rioja			Republic of Cameroon International Bond		
9.750% due 02/24/2025	4,000	4,212	9.500% due 11/19/2025	700	828
			Total Cameroon (Cost \$797)		828
Provincia de Neuquen Argentina					
7.500% due 04/27/2025	3,650	3,769	CAYMAN ISLANDS 0.4%		
Total Argentina (Cost \$64,770)		68,955	CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
			Interoceanica IV Finance Ltd.		
AZERBAIJAN 1.0%			0.000% due 11/30/2018	34	33
CORPORATE BONDS & NOTES 0.7%			0.000% due 11/30/2025	907	766
Southern Gas Corridor CJSC					
6.875% due 03/24/2026	3,500	3,923	Interoceanica V Finance Ltd.		
			0.000% due 05/15/2030	6,400	4,232
State Oil Company of the Azerbaijan Republic			Total Cayman Islands (Cost \$4,175)		5,031
4.750% due 03/13/2023	5,040	5,078			
		9,001	CHILE 1.8%		
			CORPORATE BONDS & NOTES 1.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%			Corp. Nacional del Cobre de Chile		
Republic of Azerbaijan International Bond			3.625% due 08/01/2027	200	204
4.750% due 03/18/2024	3,100	3,226	4.250% due 07/17/2042	12,500	12,730
Total Azerbaijan (Cost \$11,557)		12,227	4.500% due 08/01/2047	500	516
			4.875% due 11/04/2044	6,800	7,489
BRAZIL 9.8%					20,939
CORPORATE BONDS & NOTES 7.3%					
Banco do Brasil S.A.			SOVEREIGN ISSUES 0.0%		
6.000% due 01/22/2020	20,420	21,849	Chile Government International Bond		
			3.625% due 10/30/2042	150	152
Banco do Nordeste do Brasil S.A.			3.860% due 06/21/2047	500	520
4.375% due 05/03/2019	8,200	8,364			672
			Total Chile (Cost \$20,214)		21,611
Caixa Economica Federal					
4.500% due 10/03/2018	9,200	9,392			

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
CHINA 0.4%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
China Construction Bank Corp.		
3.875% due 05/13/2025	\$ 900	\$ 920
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.		
3.125% due 07/27/2021	400	403
4.200% due 07/27/2026	200	208
Rongshi International Finance Ltd.		
2.875% due 05/04/2022	1,700	1,718
3.625% due 05/04/2027	1,700	1,754
Total China (Cost \$4,883)		<u>5,003</u>
COLOMBIA 2.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%		
Ecopetrol S.A.		
5.875% due 05/28/2045	8,400	8,206
7.375% due 09/18/2043	2,400	2,708
		<u>10,914</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
Colombia Government International Bond		
6.125% due 01/18/2041	3,800	4,517
7.375% due 09/18/2037	9,150	12,170
		<u>16,687</u>
Total Colombia (Cost \$25,347)		<u>27,601</u>
COSTA RICA 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Costa Rica Government International Bond		
4.375% due 04/30/2025	650	632
5.625% due 04/30/2043	10,600	9,686
Total Costa Rica (Cost \$10,578)		<u>10,318</u>
CROATIA 0.2%		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Croatia Government International Bond		
6.000% due 01/26/2024	2,000	2,284
Total Croatia (Cost \$2,277)		<u>2,284</u>
DOMINICAN REPUBLIC 2.3%		
SOVEREIGN ISSUES 2.3%		
Dominican Republic Government International Bond		
5.500% due 01/27/2025	3,600	3,825
5.950% due 01/25/2027	13,300	14,464
6.850% due 01/27/2045	2,400	2,706
6.875% due 01/29/2026	4,700	5,417
9.040% due 01/23/2018	55	56
Total Dominican Republic (Cost \$25,075)		<u>26,468</u>
ECUADOR 2.0%		
SOVEREIGN ISSUES 2.0%		
Ecuador Government International Bond		
8.750% due 06/02/2023	2,500	2,553
9.625% due 06/02/2027	2,100	2,202
9.650% due 12/13/2026	8,200	8,641
10.750% due 03/28/2022	9,400	10,340
Total Ecuador (Cost \$22,335)		<u>23,736</u>
EGYPT 2.0%		
SOVEREIGN ISSUES 2.0%		
Egypt Government International Bond		
6.125% due 01/31/2022	9,900	10,326
7.500% due 01/31/2027	6,900	7,616
8.500% due 01/31/2047	5,000	5,609
Total Egypt (Cost \$22,508)		<u>23,551</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
EL SALVADOR 1.4%		
SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
El Salvador Government International Bond		
6.375% due 01/18/2027	\$ 1,500	\$ 1,451
7.625% due 02/01/2041	9,130	9,039
7.650% due 06/15/2035	1,100	1,103
8.250% due 04/10/2032	4,690	4,959
Total El Salvador (Cost \$19,479)		<u>16,552</u>
ETHIOPIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Ethiopia International Bond		
6.625% due 12/11/2024	4,400	4,512
Total Ethiopia (Cost \$4,390)		<u>4,512</u>
GABON 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Gabon Government International Bond		
6.375% due 12/12/2024	9,002	8,898
Total Gabon (Cost \$8,826)		<u>8,898</u>
GHANA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Republic of Ghana International Bond		
8.125% due 01/18/2026	1,500	1,595
9.250% due 09/15/2022	3,500	3,900
Total Ghana (Cost \$5,288)		<u>5,495</u>
GUATEMALA 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Guatemala Government Bond		
4.875% due 02/13/2028	2,000	2,075
5.750% due 06/06/2022	7,990	8,769
Total Guatemala (Cost \$9,952)		<u>10,844</u>
HONG KONG 0.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Nexen Energy ULC		
6.400% due 05/15/2037	2,460	3,212
7.500% due 07/30/2039	1,440	2,131
Total Hong Kong (Cost \$4,668)		<u>5,343</u>
INDONESIA 4.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 2.7%		
Majapahit Holding BV		
7.750% due 01/20/2020	540	606
Pelabuhan Indonesia III Persero PT		
4.875% due 10/01/2024	3,400	3,657
Pertamina Persero PT		
4.875% due 05/03/2022	4,900	5,275
5.250% due 05/23/2021	2,900	3,153
6.000% due 05/03/2042	6,805	7,594
Perusahaan Listrik Negara PT		
4.125% due 05/15/2027	2,300	2,325
5.250% due 10/24/2042	9,000	9,327
		<u>31,937</u>
SOVEREIGN ISSUES 1.9%		
Indonesia Government International Bond		
5.125% due 01/15/2045	1,100	1,211
5.250% due 01/08/2047	6,600	7,465
6.750% due 01/15/2044	6,250	8,329

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia		
3.875% due 04/06/2024	\$ 2,400	\$ 2,464
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III		
3.400% due 03/29/2022	2,400	2,451
		21,920
Total Indonesia (Cost \$49,343)		53,857
IRAQ 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Iraq International Bond		
6.752% due 03/09/2023	4,200	4,284
Total Iraq (Cost \$4,200)		4,284
IRELAND 0.9%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%		
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC		
3.035% due 02/21/2018	EUR 2,300	2,767
6.025% due 07/05/2022	\$ 6,900	7,398
6.902% due 07/09/2020	500	542
Total Ireland (Cost \$10,003)		10,707
IVORY COAST 0.9%		
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
Ivory Coast Government International Bond		
5.125% due 06/15/2025	EUR 4,600	5,685
5.375% due 07/23/2024	\$ 654	660
5.750% due 12/31/2032	142	141
6.125% due 06/15/2033	1,600	1,600
6.375% due 03/03/2028	2,800	2,926
Total Ivory Coast (Cost \$10,343)		11,012
JAMAICA 0.7%		
SOVEREIGN ISSUES 0.7%		
Jamaica Government International Bond		
6.750% due 04/28/2028	3,800	4,422
7.875% due 07/28/2045	3,000	3,683
Total Jamaica (Cost \$6,798)		8,105
KAZAKHSTAN 4.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.4%		
Kazakhstan Temir Zholy National Co. JSC		
6.375% due 10/06/2020	14,300	15,497
KazMunayGas National Co. JSC		
6.375% due 04/09/2021	14,000	15,435
7.000% due 05/05/2020	12,986	14,286
Samruk-Energy JSC		
3.750% due 12/20/2017	6,000	5,999
		51,217
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Kazakhstan Government International Bond		
4.875% due 10/14/2044	1,600	1,662
6.500% due 07/21/2045	2,000	2,476
		4,138
Total Kazakhstan (Cost \$51,215)		55,355
LITHUANIA 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Lithuania Government International Bond		
5.125% due 09/14/2017	250	250
7.375% due 02/11/2020	3,400	3,827
Total Lithuania (Cost \$4,039)		4,077

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
LUXEMBOURG 4.5%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.5%		
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.		
4.375% due 09/19/2022	\$ 10,100	\$ 10,291
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.		
5.999% due 01/23/2021	2,400	2,592
6.510% due 03/07/2022	1,000	1,110
7.288% due 08/16/2037	6,810	8,242
8.625% due 04/28/2034	1,800	2,454
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
5.180% due 06/28/2019	22,800	23,800
5.500% due 02/26/2024	3,700	3,796
6.125% due 02/07/2022	500	547
Total Luxembourg (Cost \$49,589)		52,832
MALAYSIA 0.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%		
Petronas Capital Ltd.		
4.500% due 03/18/2045	100	111
7.875% due 05/22/2022	2,800	3,471
Total Malaysia (Cost \$3,153)		3,582
MEXICO 5.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 4.1%		
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC		
3.800% due 08/11/2026	1,500	1,504
Comision Federal de Electricidad		
5.750% due 02/14/2042	5,775	6,064
6.125% due 06/16/2045	3,500	3,850
Petroleos Mexicanos		
2.750% due 04/21/2027	EUR 3,700	4,095
5.500% due 06/27/2044	\$ 5,000	4,717
6.500% due 03/13/2027	2,900	3,248
6.500% due 06/02/2041	4,035	4,273
6.625% due 06/15/2035	2,150	2,354
6.625% due 06/15/2038	9,800	10,518
6.750% due 09/21/2047	2,000	2,143
8.625% due 02/01/2022	4,580	5,498
		48,264
SOVEREIGN ISSUES 1.0%		
Mexico Government International Bond		
4.000% due 03/15/2115	EUR 2,400	2,668
5.750% due 10/12/2110	\$ 8,300	9,014
		11,682
Total Mexico (Cost \$57,391)		59,946
MONGOLIA 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Mongolia Government International Bond		
5.125% due 12/05/2022	7,655	7,427
Total Mongolia (Cost \$7,649)		7,427
MOROCCO 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Morocco Government International Bond		
5.500% due 12/11/2042	700	797
Total Morocco (Cost \$708)		797

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
NAMIBIA 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Namibia International Bond		
5.250% due 10/29/2025	\$ 1,000	\$ 1,027
Total Namibia (Cost \$992)		<u>1,027</u>
NETHERLANDS 0.8%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV		
6.950% due 07/10/2042	5,730	6,409
MDC-GMTN BV		
3.000% due 04/19/2024	2,700	2,690
Total Netherlands (Cost \$9,459)		<u>9,099</u>
NIGERIA 1.4%		
SOVEREIGN ISSUES 1.4%		
Nigeria Government International Bond		
5.125% due 07/12/2018	700	713
5.625% due 06/27/2022	7,700	7,840
6.750% due 01/28/2021	200	215
7.875% due 02/16/2032	6,600	7,373
Total Nigeria (Cost \$15,221)		<u>16,141</u>
OMAN 1.2%		
SOVEREIGN ISSUES 1.2%		
Oman Government International Bond		
4.750% due 06/15/2026	2,400	2,401
5.375% due 03/08/2027	8,500	8,868
6.500% due 03/08/2047	3,000	3,144
Total Oman (Cost \$13,859)		<u>14,413</u>
PANAMA 2.2%		
SOVEREIGN ISSUES 2.2%		
Panama Government International Bond		
4.300% due 04/29/2053	10,000	10,350
4.500% due 05/15/2047	3,000	3,225
8.125% due 04/28/2034	4,400	6,017
9.375% due 01/16/2023	4,500	5,782
Total Panama (Cost \$23,039)		<u>25,374</u>
PARAGUAY 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Paraguay Government International Bond		
4.625% due 01/25/2023	500	530
4.700% due 03/27/2027	2,700	2,855
6.100% due 08/11/2044	4,800	5,520
Total Paraguay (Cost \$8,011)		<u>8,905</u>
PERU 2.6%		
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Corp. Financiera de Desarrollo S.A.		
4.750% due 02/08/2022	800	860
Fondo MIVIVIENDA S.A.		
3.500% due 01/31/2023	10,400	10,665
Peru Government International Bond		
3.750% due 03/01/2030	EUR 2,100	2,940
6.550% due 03/14/2037	\$ 2,505	3,413
8.750% due 11/21/2033	8,208	12,969
Total Peru (Cost \$28,469)		<u>30,847</u>
PHILIPPINES 1.0%		
CORPORATE BONDS & NOTES 1.0%		
Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.		
7.390% due 12/02/2024	8,950	11,548
Total Philippines (Cost \$10,584)		<u>11,548</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
POLAND 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Poland Government International Bond		
3.250% due 04/06/2026	\$ 4,700	\$ 4,866
Total Poland (Cost \$4,669)		<u>4,866</u>
QATAR 0.6%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%		
Qatar Government International Bond		
4.500% due 01/20/2022	4,800	5,127
SoQ Sukuk A QSC		
2.099% due 01/18/2018	2,400	2,401
Total Qatar (Cost \$7,470)		<u>7,528</u>
ROMANIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Romania Government International Bond		
2.750% due 10/29/2025	EUR 2,200	2,828
2.875% due 05/26/2028	1,700	2,110
Total Romania (Cost \$4,365)		<u>4,938</u>
RUSSIA 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
SCF Capital Designated Activity Co.		
5.375% due 06/16/2023	\$ 2,400	2,499
Total Russia (Cost \$2,400)		<u>2,499</u>
SENEGAL 0.1%		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%		
Senegal Government International Bond		
6.250% due 05/23/2033	1,700	1,754
Total Senegal (Cost \$1,700)		<u>1,754</u>
SERBIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Serbia International Bond		
4.875% due 02/25/2020	4,100	4,314
Total Serbia (Cost \$4,233)		<u>4,314</u>
SLOVENIA 0.4%		
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Slovenia Government International Bond		
5.250% due 02/18/2024	4,250	4,911
Total Slovenia (Cost \$4,718)		<u>4,911</u>
SOUTH AFRICA 1.7%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.8%		
Eskom Holdings SOC Ltd.		
6.750% due 08/06/2023	9,600	10,071
SOVEREIGN ISSUES 0.9%		
South Africa Government International Bond		
4.300% due 10/12/2028	7,000	6,755
4.665% due 01/17/2024	500	518
4.875% due 04/14/2026	1,300	1,337
5.375% due 07/24/2044	1,600	1,605
Total South Africa (Cost \$20,416)		<u>20,286</u>
SPAIN 0.3%		
SOVEREIGN ISSUES 0.3%		
Autonomous Community of Catalonia		
4.900% due 09/15/2021	EUR 3,100	3,867
Total Spain (Cost \$3,549)		<u>3,867</u>

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
SRI LANKA 3.1%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
National Savings Bank		
5.150% due 09/10/2019	\$ 5,400	\$ 5,528
SOVEREIGN ISSUES 2.6%		
Sri Lanka Government International Bond		
5.125% due 04/11/2019	400	412
5.750% due 01/18/2022	1,000	1,059
6.000% due 01/14/2019	200	208
6.200% due 05/11/2027	4,700	4,951
6.250% due 10/04/2020	13,200	14,160
6.250% due 07/27/2021	8,315	8,972
6.825% due 07/18/2026	900	990
		30,752
Total Sri Lanka (Cost \$34,348)		36,280
SUPRANATIONAL 0.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Africa Finance Corp.		
4.375% due 04/29/2020	1,400	1,452
Banque Ouest Africaine de Developpement		
5.000% due 07/27/2027	2,900	3,000
Republic of Ghana International Bond		
10.750% due 10/14/2030	3,400	4,413
Total Supranational (Cost \$8,328)		8,865
TANZANIA 0.5%		
SOVEREIGN ISSUES 0.5%		
Tanzania Government International Bond		
7.421% due 03/09/2020	5,333	5,613
Total Tanzania (Cost \$5,381)		5,613
TRINIDAD AND TOBAGO 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.4%		
Petroleum Co. of Trinidad & Tobago Ltd.		
6.000% due 05/08/2022	4,467	4,467
SOVEREIGN ISSUES 0.2%		
Trinidad & Tobago Government International Bond		
4.500% due 08/04/2026	2,400	2,448
Total Trinidad and Tobago (Cost \$6,866)		6,915
TUNISIA 1.1%		
SOVEREIGN ISSUES 1.1%		
Banque Centrale de Tunisie International Bond		
3.280% due 08/09/2027	/ 1,700,000	12,592
5.625% due 02/17/2024	EUR 700	861
Total Tunisia (Cost \$16,256)		13,453
TURKEY 2.1%		
SOVEREIGN ISSUES 2.1%		
Export Credit Bank of Turkey		
5.375% due 10/24/2023	\$ 2,600	2,704
Turkey Government International Bond		
5.750% due 05/11/2047	4,600	4,740
6.000% due 03/25/2027	800	878
6.750% due 05/30/2040	7,400	8,550
6.875% due 03/17/2036	500	582
7.250% due 03/05/2038	6,100	7,411
Total Turkey (Cost \$23,595)		24,865

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
UKRAINE 5.1%		
SOVEREIGN ISSUES 5.1%		
Ukraine Government International Bond		
7.750% due 09/01/2019	\$ 25,950	\$ 27,078
7.750% due 09/01/2020	11,000	11,494
7.750% due 09/01/2021	10,600	11,076
7.750% due 09/01/2022	700	730
7.750% due 09/01/2023	600	624
7.750% due 09/01/2024	3,900	4,027
7.750% due 09/01/2027	4,800	4,917
Total Ukraine (Cost \$56,869)		59,946
UNITED ARAB EMIRATES 0.2%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
Dolphin Energy Ltd.		
5.500% due 12/15/2021	400	442
DP World Ltd.		
6.850% due 07/02/2037	1,820	2,260
Total United Arab Emirates (Cost \$2,416)		2,702
UNITED KINGDOM 0.6%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC		
9.375% due 03/10/2023	2,231	2,344
SOVEREIGN ISSUES 0.4%		
Ukreximbank Via Biz Finance PLC		
9.625% due 04/27/2022	4,350	4,599
Total United Kingdom (Cost \$6,767)		6,943
UNITED STATES 0.3%		
U.S. GOVERNMENT AGENCIES 0.3%		
Federal Home Loan Bank		
4.125% due 12/13/2019	3,485	3,694
Total United States (Cost \$3,576)		3,694
URUGUAY 3.0%		
SOVEREIGN ISSUES 3.0%		
Uruguay Government International Bond		
5.100% due 06/18/2050	6,700	7,085
7.625% due 03/21/2036	10,890	15,328
7.875% due 01/15/2033	9,240	13,005
Total Uruguay (Cost \$31,628)		35,418
VENEZUELA 1.3%		
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		
Petroleos de Venezuela S.A.		
5.500% due 04/12/2037	20,990	6,376
8.500% due 11/02/2017 (c)	173	157
		6,533
SOVEREIGN ISSUES 0.8%		
Venezuela Government International Bond		
7.000% due 03/31/2038	10,900	3,788
7.650% due 04/21/2025	12,050	4,278
7.750% due 10/13/2019	260	115
9.375% due 01/13/2034	1,330	509
11.950% due 08/05/2031	500	207
		8,897
Total Venezuela (Cost \$31,457)		15,430

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
ZAMBIA 0.6%			ARGENTINA TREASURY BILLS 1.8%		
SOVEREIGN ISSUES 0.6%			2.810% due 03/16/2018	\$ 4,200	\$ 4,140
Zambia Government International Bond			2.850% due 11/10/2017	3,200	3,184
8.970% due 07/30/2027	\$ 6,500	\$ 7,184	2.858% due 10/27/2017	3,700	3,686
Total Zambia (Cost \$7,055)		<u>7,184</u>	2.899% due 10/13/2017	7,800	7,778
			3.351% due 09/15/2017	1,700	<u>1,699</u>
SHORT-TERM INSTRUMENTS 8.3%					<u>20,487</u>
REPURCHASE AGREEMENTS (b) 5.2%		<u>60,600</u>	MEXICO TREASURY BILLS 1.2%		
			6.900% due 01/04/2018 (a)	MXN 2,656,000	<u>14,539</u>
TIME DEPOSITS 0.1%			Total Short-Term Instruments		<u>97,278</u>
ANZ National Bank			(Cost \$95,990)		
0.670% due 09/01/2017	79	79	Total Investments in Securities 99.0%		
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.			(Cost \$1,124,152)	\$ 1,164,268	
(0.230%) due 09/01/2017	/ 296	3	Financial Derivative Instruments (d)(f) (0.2%)		(1,914)
Brown Brothers Harriman & Co.			(Cost or Premiums, net \$(1,350))		
0.050% due 09/01/2017	GBP 1	1	Other Assets and Liabilities, net 1.2%		<u>13,817</u>
0.670% due 09/01/2017	\$ 1	1			
Citibank N.A.			Net Assets 100.0%		<u>\$ 1,176,171</u>
0.050% due 09/01/2017	GBP 15	19			
0.670% due 09/01/2017	\$ 263	263			
DBS Bank Ltd.					
0.670% due 09/01/2017	486	486			
Deutsche Bank AG					
0.670% due 09/01/2017	304	304			
DnB NORBank ASA					
0.670% due 09/01/2017	167	167			
HSBC Bank					
0.050% due 09/01/2017	GBP 1	2			
JPMorgan Chase & Co.					
0.670% due 09/01/2017	\$ 318	318			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.					
(0.230%) due 09/01/2017	/ 13	0			
Wells Fargo Bank					
0.670% due 09/01/2017	\$ 9	9			
6.068% due 09/01/2017	ZAR 5	<u>0</u>			
		<u>1,652</u>			

[次へ](#)

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) Coupon represents a weighted average rate.

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(b) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	元本金額	担保	受入担保 (時価評価額)	現先取引 (時価評価額)	現先取引に 係る未収金 ⁽¹⁾
SAL	1.220%	08/31/2017	09/01/2017	\$ 60,600	U.S. Treasury Notes 1.875% due 08/31/2024	\$ (61,924)	\$ 60,600	\$ 60,602
Total Repurchase Agreements						\$ (61,924)	\$ 60,600	\$ 60,602

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入額 ⁽²⁾	逆現先取引に係る未払金
NOM	(16.000%)	08/25/2017	09/01/2017	\$ (537)	\$ (535)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (535)

⁽²⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended August 31, 2017 was \$1,017 at a weighted average interest rate of (1.915%).

Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	逆現先取引の契約満期までの残存期間				合計
	翌日物および 継続	30日まで	31日から90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (535)	\$ 0	\$ 0	\$ (535)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (535)	\$ 0	\$ 0	\$ (535)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/(received) as of August 31, 2017:

(c) Securities with an aggregate market value of \$621 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of August 31, 2017.

取引相手	現先取引 に係る未収金	逆現先取引 に係る未払金	買戻し条件付 売買取引に係る 未払金	空売り に係る未払金	借入金および その他の 金融取引合計	差入／ (受入)担保	エクスポ ージャー 純額 (3)
Global/Master Repurchase Agreement							
NOM	\$ 0	\$ (535)	\$ 0	\$ 0	\$ (535)	\$ 621	\$ 86
SAL	60,602	0	0	0	60,602	(61,924)	(1,322)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 60,602	\$ (535)	\$ 0	\$ 0			

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

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

PURCHASED OPTIONS:

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

銘柄	行使価格	行使期限	契約数	取得原価	時価
Put - 90-Day Eurodollar March Futures	\$ 98.250	03/19/2018	630	\$ 55	\$ 16
Total Purchased Options				\$ 55	\$ 16

WRITTEN OPTIONS:

銘柄	行使価格	行使期限	契約数	プレミアム (受取額)	時価
Call - 90-Day Eurodollar March Futures	\$ 98.750	03/19/2018	630	\$ (67)	\$ (31)
Total Written Options				\$ (67)	\$ (31)

OPTIONS ON EXCHANGE-TRADED FUTURES CONTRACTS

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現 評価益	変動証拠金	
					資産	負債
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2017	94	\$ 94	\$ 0	\$ 0
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2017	151	54	26	0
Total Futures Contracts				\$ 148	\$ 26	\$ 0

SWAP AGREEMENTS:

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	時価	未実現 評価益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2027	\$ 24,600	\$ (1,280)	\$ 855	\$ 58	\$ 0
Total Swap Agreements					\$ (1,280)	\$ 855	\$ 58	\$ 0

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of August 31, 2017:

(e) Cash of \$3,208 has been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of August 31, 2017. See Note 8, Master Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	時価	未収変動証拠金			時価	未払変動証拠金		
	買建 オプション	先物	スワップ 契約	合計	売建 オプション	先物	スワップ 契約	合計
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 16	\$ 26	\$ 58	\$ 100	\$ (31)	\$ 0	\$ 0	\$ (31)

(f) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価益 / (損)	
				資産	負債
CBK	09/2017	\$ 94	EUR 80	\$ 1	\$ 0
CBK	09/2017	1,047	JPY 115,600	4	0
GLM	09/2017	EUR 2,436	\$ 2,855	0	(42)
GLM	09/2017	\$ 1,999	EUR 1,693	13	0
GLM	01/2018	MXN 265,600	\$ 12,970	0	(1,648)
JPM	09/2017	EUR 464	549	0	(3)
JPM	09/2017	\$ 43,889	EUR 36,391	0	(624)
JPM	10/2017	EUR 36,391	\$ 43,958	628	0
MSB	09/2017	35,264	41,413	0	(512)
SCX	09/2017	\$ 12,504	JPY 1,356,739	0	(177)
SCX	10/2017	JPY 1,356,739	\$ 12,522	178	0
TOR	09/2017	1,472,339	13,260	0	(118)
Total Forward Foreign Currency Contracts				\$ 824	\$ (3,124)

WRITTEN OPTIONS:

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

取引相手	銘柄	行使価格	行使期限	想定元本	プレミアム (受取額)	時価
SOG	Call - OTC Euro versus U.S. dollar	\$ 1.200	09/07/2017	EUR 1,900	\$ (9)	\$ (5)
Total Written Options					\$ (9)	\$ (5)

TRANSACTIONS IN WRITTEN CALL AND PUT OPTIONS FOR THE PERIOD ENDED AUGUST 31, 2017

	契約数	ユーロ建て 想定元本	プレミアム
Balance at 02/28/2017	0 EUR	0 \$	0
Sales	662	1,900	(83)
Closing Buys	0	0	0
Expirations	(32)	0	7
Exercised	0	0	0
Balance at 08/31/2017	630 EUR	1,900 \$	(76)

SWAP AGREEMENTS:

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

取引相手	参照債券	固定金利 の（支払）	満期日	2017年8月 31日時点の インプライド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額	未実現評価 （損）	スワップ契約 （時価評価額）	
								資産	負債
CBK	Turkey Government International Bond	(1.000%)	09/20/2020	0.991%	\$ 1,300	\$ 113	\$ (116)	\$ 0	\$ (3)
GST	Turkey Government International Bond	(1.000%)	09/20/2020	0.991%	1,300	112	(115)	0	(3)
						\$ 225	\$ (231)	\$ 0	\$ (6)

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽²⁾

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2017年8月 31日時点の インプライド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額 / （受取額）	未実現評価益 / （損）	スワップ契約 （時価評価額）	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.641%	\$ 3,000	\$ (94)	\$ 114	\$ 20	\$ 0
BOA	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2020	0.955%	1,000	(124)	127	3	0
BPS	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2018	0.263%	1,000	8	0	8	0
BPS	Philippines Government International Bond	1.000%	06/20/2021	0.473%	7,500	11	150	161	0
BRC	Egypt Government International Bond	1.000%	06/20/2018	1.987%	3,700	(16)	(6)	0	(22)
BRC	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.919%	500	(2)	5	3	0
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2021	1.534%	4,000	(285)	206	0	(79)
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2022	1.694%	1,900	(89)	33	0	(56)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.376%	900	(9)	18	9	0
CBK	Nigeria Government International Bond	1.000%	08/20/2018	2.267%	1,000	(9)	(2)	0	(11)
CBK	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.919%	6,800	(13)	52	39	0
DUB	Malaysia Government International Bond	1.000%	03/20/2020	0.386%	2,000	(17)	52	35	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2018	0.376%	5,700	(47)	105	58	0
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2019	0.416%	2,100	10	16	26	0
GST	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2020	0.955%	3,800	(471)	484	13	0

取引相手	参照債券	固定金利 の受取	満期日	2017年8月 31日時点の インプライ ド・クレ ジット・ス プレッド ⁽³⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現評価益/ (損)	スワップ契約 (時価評価額)	
								資産	負債
HUS	South Africa Government International Bond	1.000%	03/20/2023	1.952%	\$ 3,800	\$ (393)	\$ 216	\$ 0	\$(177)
JPM	Philippines Government International Bond	1.000%	06/20/2021	0.473%	12,500	18	251	269	0
NGF	Qatar Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.919%	2,600	(23)	38	15	0
NGF	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2021	1.534%	200	(13)	9	0	(4)
SCX	Nigeria Government International Bond	5.000%	09/20/2017	2.134%	1,500	4	14	18	0
						\$ (1,554)	\$ 1,882	\$ 677	\$(349)
Total Swap Agreements						\$ (1,329)	\$ 1,651	\$ 677	\$(355)

- (1) If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (2) If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- (3) Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- (4) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of OTC financial derivative instruments and collateral pledged/(received) as of August 31, 2017:

(g) Cash of \$2,971 has been pledged as collateral for financial derivative instruments as governed by International Swaps and Derivatives Association, Inc. master agreements as of August 31, 2017.

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバティブの時価純額	差入／ (受入)担保	エクスポージャー純額 ⁽⁵⁾
	先渡為替 契約	買建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計	先渡為替 契約	売建 オプション	スワップ 契約	店頭取引 合計			
BOA	\$ 0	\$ 0	\$ 23	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 23	\$ 0	\$ 23
BPS	0	0	169	169	0	0	0	0	169	0	169
BRC	0	0	3	3	0	0	(157)	(157)	(154)	191	37
CBK	5	0	48	53	0	0	(14)	(14)	39	0	39
DUB	0	0	35	35	0	0	0	0	35	0	35
GLM	13	0	0	13	(1,690)	0	0	(1,690)	(1,677)	1,610	(67)
GST	0	0	97	97	0	0	(3)	(3)	94	0	94
HUS	0	0	0	0	0	0	(177)	(177)	(177)	270	93
JPM	628	0	269	897	(627)	0	0	(627)	270	(380)	(110)
MSB	0	0	0	0	(512)	0	0	(512)	(512)	620	108
NGF	0	0	15	15	0	0	(4)	(4)	11	0	11
SCX	178	0	18	196	(177)	0	0	(177)	19	0	19
SOG	0	0	0	0	0	(5)	0	(5)	(5)	0	(5)
TOR	0	0	0	0	(118)	0	0	(118)	(118)	280	162
Total Over the Counter	\$ 824	\$ 0	\$ 677	\$ 1,501	\$ (3,124)	\$ (5)	\$ (355)	\$ (3,484)			

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

FAIR VALUE OF FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS

The following is a summary of the fair valuation of the Fund's derivative instruments categorized by risk exposure:

Fair Values of Financial Derivative Instruments on the Statement of Assets and Liabilities as of August 31, 2017:

	Derivatives not accounted for as hedging instruments					
	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Financial Derivative Instruments - Assets						
Exchange-traded or centrally cleared						
Purchased Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 16	\$ 16
Futures	0	0	0	0	26	26
Swap Agreements	0	0	0	0	58	58
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 100	\$ 100
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 824	\$ 0	\$ 824
Swap Agreements	0	677	0	0	0	677
	\$ 0	\$ 677	\$ 0	\$ 824	\$ 0	\$ 1,501
	\$ 0	\$ 677	\$ 0	\$ 824	\$ 100	\$ 1,601

Derivatives not accounted for as hedging instruments

	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Financial Derivative Instruments - Liabilities						
Exchange-traded or centrally cleared						
Written Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$(31)	\$(31)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$(3,124)	\$ 0	\$(3,124)
Written Options	0	0	0	(5)	0	(5)
Swap Agreements	0	(355)	0	0	0	(355)
	\$ 0	\$(355)	\$ 0	\$(3,129)	\$ 0	\$(3,484)
	\$ 0	\$(355)	\$ 0	\$(3,129)	\$(31)	\$(3,515)

The Effect of Financial Derivative Instruments on the Statement of Operations for the period ended August 31, 2017:

Derivatives not accounted for as hedging instruments

	Commodity Contracts	Credit Contracts	Equity Contracts	Foreign Currency Contracts	Interest Rate Contracts	Total
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Written Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 7	7
Futures	0	0	0	0	514	514
Swap Agreements	0	0	0	0	61	61
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 582	582
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$(4,087)	\$ 0	\$(4,087)
Written Options	0	0	0	0	0	0
Swap Agreements	0	1,854	0	0	0	1,854
	\$ 0	\$ 1,854	\$ 0	\$(4,087)	\$ 0	\$(2,233)
	\$ 0	\$ 1,854	\$ 0	\$(4,087)	\$ 582	\$(1,651)
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Purchased Options	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$(39)	\$(39)
Written Options	0	0	0	0	36	36
Futures	0	0	0	0	(527)	(527)
Swap Agreements	0	0	0	0	698	698
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 168	168
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$(2,320)	\$ 0	\$(2,320)
Written Options	0	0	0	4	0	4
Swap Agreements	0	(798)	0	0	0	(798)
	\$ 0	\$(798)	\$ 0	\$(2,316)	\$ 0	\$(3,114)
	\$ 0	\$(798)	\$ 0	\$(2,316)	\$ 168	\$(2,946)

FAIR VALUE MEASUREMENTS

The following is a summary of the fair valuations according to the inputs used as of August 31, 2017 in valuing the Fund's assets and liabilities:

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2017
Investments in Securities, at Value				
Angola				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 1,402	\$ 0	\$ 1,402
Argentina				
Sovereign Issues	0	68,955	0	68,955
Azerbaijan				
Corporate Bonds & Notes	0	9,001	0	9,001
Sovereign Issues	0	3,226	0	3,226
Brazil				
Corporate Bonds & Notes	0	85,078	0	85,078
Sovereign Issues	0	29,647	0	29,647
Cameroon				
Sovereign Issues	0	828	0	828
Cayman Islands				
Corporate Bonds & Notes	0	5,031	0	5,031
Chile				
Corporate Bonds & Notes	0	20,939	0	20,939
Sovereign Issues	0	672	0	672
China				
Corporate Bonds & Notes	0	5,003	0	5,003
Colombia				
Corporate Bonds & Notes	0	10,914	0	10,914
Sovereign Issues	0	16,687	0	16,687
Costa Rica				
Sovereign Issues	0	10,318	0	10,318
Croatia				
Sovereign Issues	0	2,284	0	2,284
Dominican Republic				
Sovereign Issues	0	26,468	0	26,468
Ecuador				
Sovereign Issues	0	23,736	0	23,736
Egypt				
Sovereign Issues	0	23,551	0	23,551
El Salvador				
Sovereign Issues	0	16,552	0	16,552
Ethiopia				
Sovereign Issues	0	4,512	0	4,512

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2017
Investments in Securities, at Value				
Gabon				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 8,898	\$ 0	\$ 8,898
Ghana				
Sovereign Issues	0	5,495	0	5,495
Guatemala				
Sovereign Issues	0	10,844	0	10,844
Hong Kong				
Corporate Bonds & Notes	0	5,343	0	5,343
Indonesia				
Corporate Bonds & Notes	0	31,937	0	31,937
Sovereign Issues	0	21,920	0	21,920
Iraq				
Sovereign Issues	0	4,284	0	4,284
Ireland				
Corporate Bonds & Notes	0	10,707	0	10,707
Ivory Coast				
Sovereign Issues	0	11,012	0	11,012
Jamaica				
Sovereign Issues	0	8,105	0	8,105
Kazakhstan				
Corporate Bonds & Notes	0	51,217	0	51,217
Sovereign Issues	0	4,138	0	4,138
Lithuania				
Sovereign Issues	0	4,077	0	4,077
Luxembourg				
Corporate Bonds & Notes	0	52,832	0	52,832
Malaysia				
Corporate Bonds & Notes	0	3,582	0	3,582
Mexico				
Corporate Bonds & Notes	0	48,264	0	48,264
Sovereign Issues	0	11,682	0	11,682
Mongolia				
Sovereign Issues	0	7,427	0	7,427
Morocco				
Sovereign Issues	0	797	0	797
Namibia				
Sovereign Issues	0	1,027	0	1,027

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2017
Investments in Securities, at Value				
Netherlands				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 9,099	\$ 0	\$ 9,099
Nigeria				
Sovereign Issues	0	16,141	0	16,141
Oman				
Sovereign Issues	0	14,413	0	14,413
Panama				
Sovereign Issues	0	25,374	0	25,374
Paraguay				
Sovereign Issues	0	8,905	0	8,905
Peru				
Sovereign Issues	0	30,847	0	30,847
Philippines				
Corporate Bonds & Notes	0	11,548	0	11,548
Poland				
Sovereign Issues	0	4,866	0	4,866
Qatar				
Sovereign Issues	0	7,528	0	7,528
Romania				
Sovereign Issues	0	4,938	0	4,938
Russia				
Corporate Bonds & Notes	0	2,499	0	2,499
Senegal				
Sovereign Issues	0	1,754	0	1,754
Serbia				
Sovereign Issues	0	4,314	0	4,314
Slovenia				
Sovereign Issues	0	4,911	0	4,911
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	0	10,071	0	10,071
Sovereign Issues	0	10,215	0	10,215
Spain				
Sovereign Issues	0	3,867	0	3,867
Sri Lanka				
Corporate Bonds & Notes	0	5,528	0	5,528
Sovereign Issues	0	30,752	0	30,752
Supranational				
Sovereign Issues	0	8,865	0	8,865
Tanzania				
Sovereign Issues	0	5,613	0	5,613

Category and Sub-category	Level 1	Level 2	Level 3	Fair Value at 08/31/2017
Investments in Securities, at Value				
Trinidad and Tobago				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 4,467	\$ 0	\$ 4,467
Sovereign Issues	0	2,448	0	2,448
Tunisia				
Sovereign Issues	0	13,453	0	13,453
Turkey				
Sovereign Issues	0	24,865	0	24,865
Ukraine				
Sovereign Issues	0	59,946	0	59,946
United Arab Emirates				
Corporate Bonds & Notes	0	2,702	0	2,702
United Kingdom				
Corporate Bonds & Notes	0	2,344	0	2,344
Sovereign Issues	0	4,599	0	4,599
United States				
U.S. Government Agencies	0	3,694	0	3,694
Uruguay				
Sovereign Issues	0	35,418	0	35,418
Venezuela				
Corporate Bonds & Notes	0	6,533	0	6,533
Sovereign Issues	0	8,897	0	8,897
Zambia				
Sovereign Issues	0	7,184	0	7,184
Short-Term Instruments	0	97,278	0	97,278
Total Investments	\$ 0	\$ 1,164,268	\$ 0	\$ 1,164,268
Financial Derivative Instruments - Assets				
Exchange-traded or centrally cleared	42	58	0	100
Over the counter	0	1,501	0	1,501
	\$ 42	\$ 1,559	\$ 0	\$ 1,601
Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Exchange-traded or centrally cleared	(31)	0	0	(31)
Over the counter	0	(3,484)	0	(3,484)
	\$ (31)	\$ (3,484)	\$ 0	\$ (3,515)
Totals	\$ 11	\$ 1,162,343	\$ 0	\$ 1,162,354

There were no significant transfers between Levels 1, 2, or 3 during the period ended August 31, 2017.

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額(2018年2月末日現在)

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル(約201億円)

発行済株式総数 5,051,655株

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命をただちに解除することができる。(a) 管理会社が清算される場合、(b) 管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、(c) 受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、(d) 決議が総会において投票を行った受益者の4分の3以上の多数により承認された場合、または(e) 発行済受益証券の価値の4分の3を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合。管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不適切な行為、詐欺または重過失の場合を除き、信託証書に基づく職務の遂行について、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、() ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは() 管理会社の行為に関係し、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が実際に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費(弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。)、判決および和解において支払われる金額(ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。)を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、信託証書に基づく職務の遂行について、かかる行為が故意の不適切な行為、詐欺または重過失を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、2018年1月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産価格の合計(通貨別)
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	64	6,079,665,743.93米ドル

(3) その他

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はない。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所を下線または傍線で示します。

表紙

< 訂正前 >

(前略)

代表者の役職氏名 マネージング・ディレクター 鈴木 惣太

(中略)

(注 2) 米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、1 米ドル = 112.05円および 1 豪ドル = 84.87円による。以下同じ。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

代表者の役職氏名 デプティ・マネージング・ディレクター 弘田 嘉信

(中略)

(注 2) 米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行 (現株式会社三菱ＵＦＪ銀行) の対顧客電信売買相場の仲値である、1 米ドル = 112.05円および 1 豪ドル = 84.87円による。以下同じ。

(後略)

第一部 証券情報

(3) 発行 (売出) 価額の総額

< 訂正前 >

(前略)

(注 2) 別途定める場合を除き、米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、
2017年11月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客
電信売買相場の仲値である、1 米ドル = 112.05円および 1 豪
ドル = 84.87円による。以下同じ。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

(注 2) 別途定める場合を除き、米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、
2017年11月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行 (現株式
会社三菱ＵＦＪ銀行) の対顧客電信売買相場の仲値である、
1 米ドル = 112.05円および 1 豪ドル = 84.87円による。以下同
じ。

(後略)

第二部 ファンド情報

第１ ファンドの状況

１ ファンドの性格

（３）ファンドの仕組み

管理会社の概況

< 訂正前 >

（前略）

（ ）資本金の額（2017年11月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約210億円）

発行済株式総数 5,051,655株（一株37.04米ドルの記名式額面株式）

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

（注）米ドルの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信相場の仲値である、
1米ドル＝112.05円による。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（ ）資本金の額（2018年２月末日現在）

払込済資本金の額 187,117,965.90米ドル（約201億円）

発行済株式総数 5,051,655株（一株37.04米ドルの記名式額面株式）

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

ただし、上記資本金の増減については、定款の規定に基づく株主総会の決議を要する。

（注）米ドルの円貨換算は、2018年２月28日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行（現株式会社三菱ＵＦＪ銀行）の
対顧客電信相場の仲値である、1米ドル＝107.37円による。

（後略）

２ 投資方針

（３）運用体制

< 訂正前 >

（イ）サブ・ファンドの運用体制

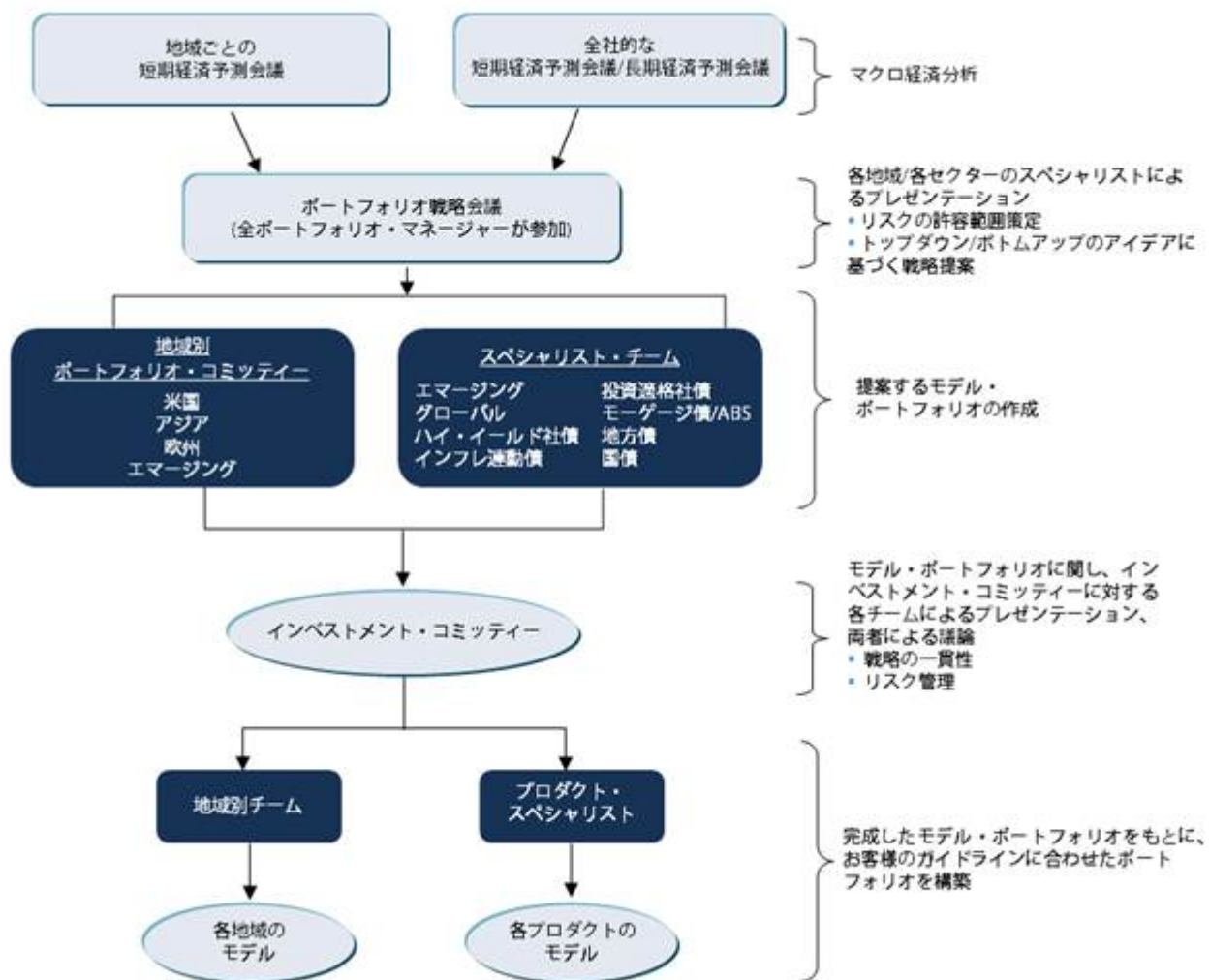
副投資運用会社の運用体制

（中略）

上記運用体制は、2017年12月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

(ロ) 投資先ファンドの運用体制

運用プロセス

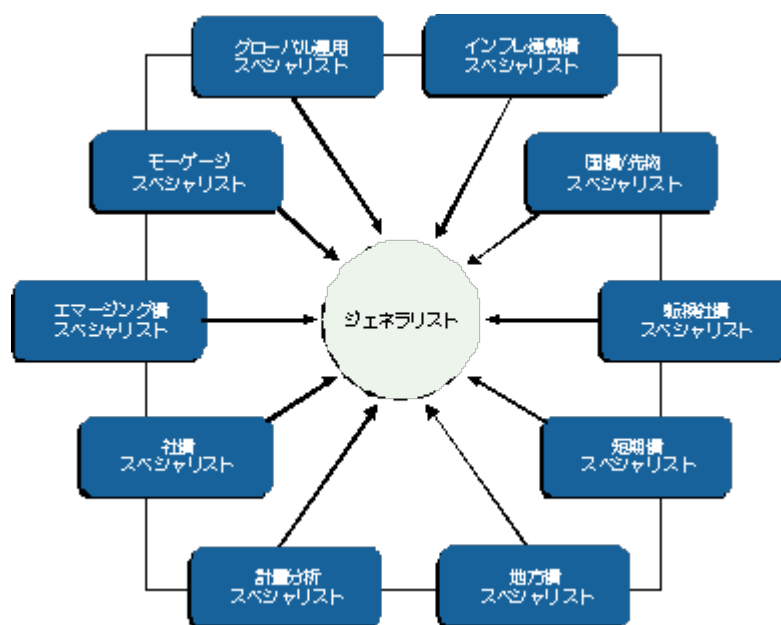


(2017年12月末日現在)

(中略)

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



(2017年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

（イ）サブ・ファンドの運用体制

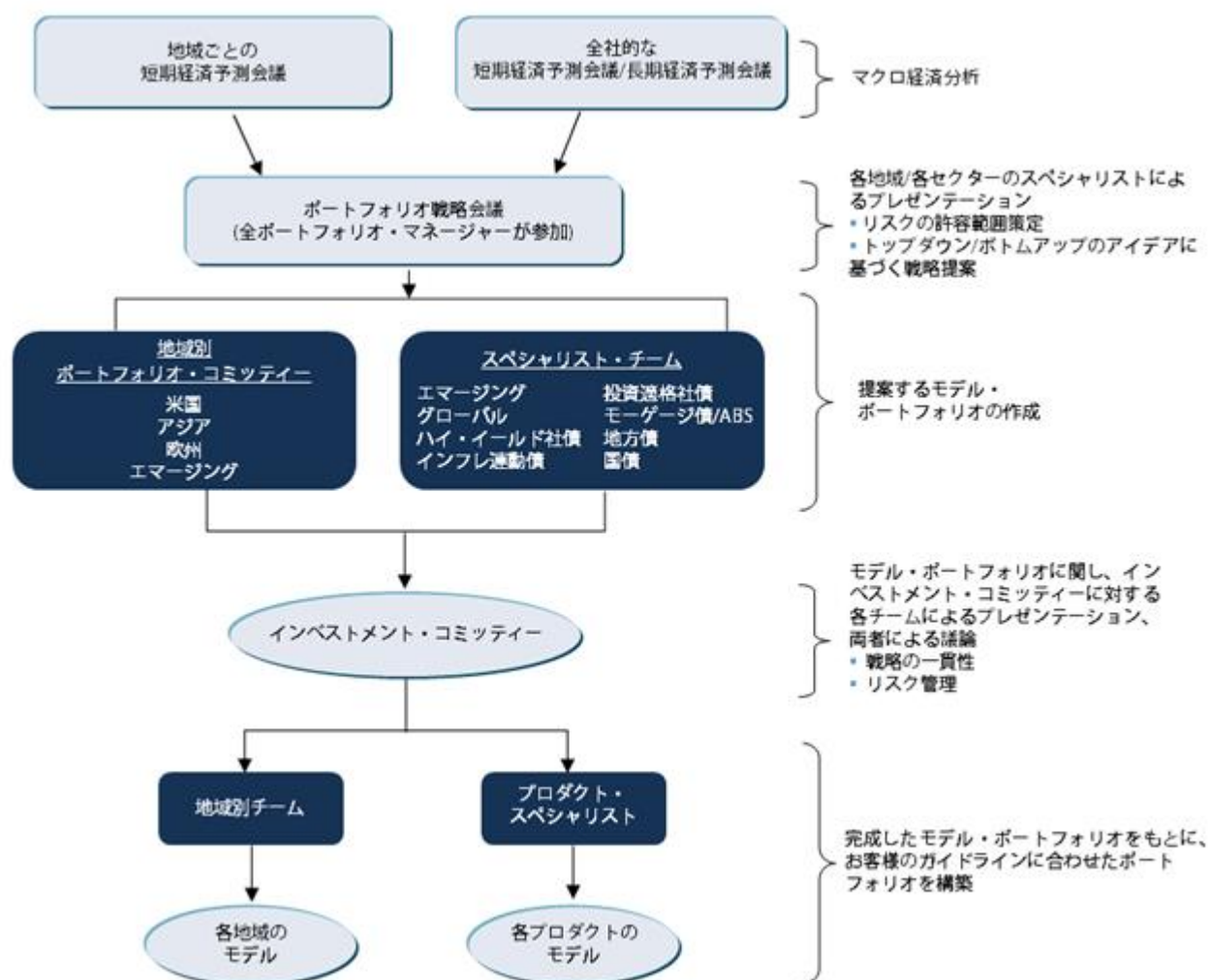
副投資運用会社の運用体制

（中略）

上記運用体制は、2018年2月末日現在のものであり、今後変更する場合がある。

（ロ）投資先ファンドの運用体制

運用プロセス

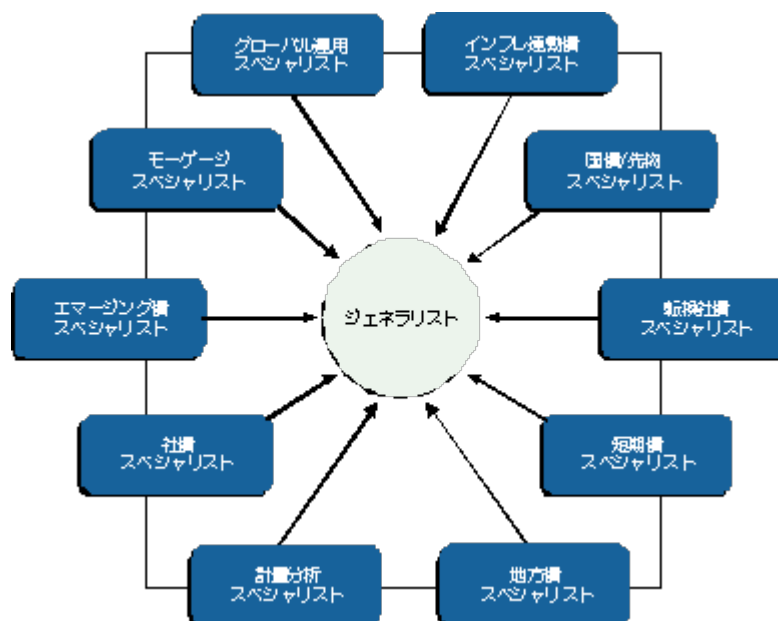


（2018年2月末日現在）

（中略）

運用体制

- ジェネラリストと各債券セクターのスペシャリスト・チームによる運用体制
- トップダウン戦略に加え、スペシャリスト・チームからのボトムアップ戦略を融合させることによりポートフォリオの安定化を図ります。



（2018年2月末日現在）

（後略）

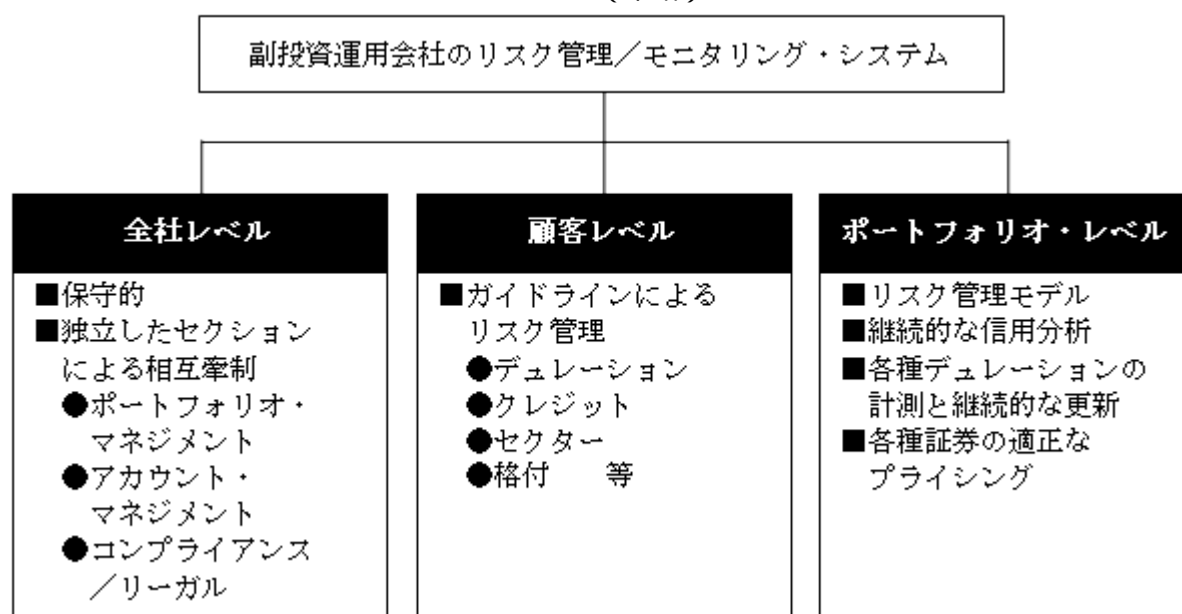
3 投資リスク

（2）リスクに対する管理体制

<訂正前>

（イ）サブ・ファンドのリスク管理体制

（中略）



（2017年12月末日現在）

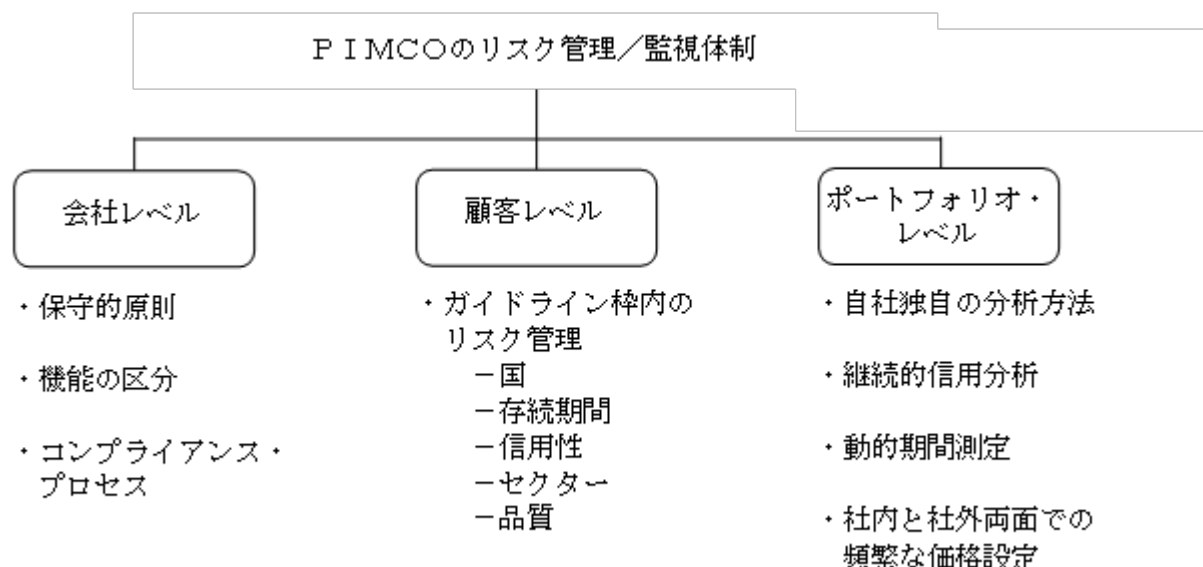
（中略）

（ロ）投資先ファンドのリスク管理体制

PIMCOのリスク管理は、ポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、インベストメント・オペレーションズおよびコンプライアンスの4つの業務分野に及んでいる。各々

は、ポートフォリオ・リスクとコンプライアンスが適正に監視され、管理されていることを目指して個別でありながら、ある程度重複する責務を負っている。

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



PIMCOのインベストメント・コミッティーが多岐にわたるポートフォリオ・リスクを監視する。

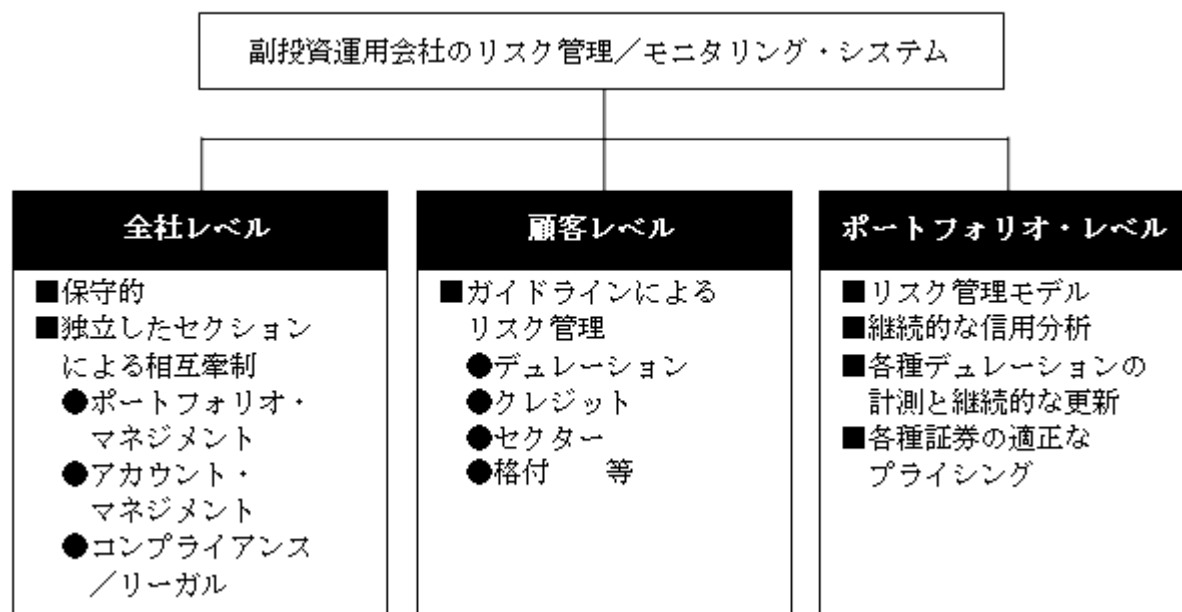
(2017年12月末日現在)

(後略)

<訂正後>

(イ) サブ・ファンドのリスク管理体制

(中略)



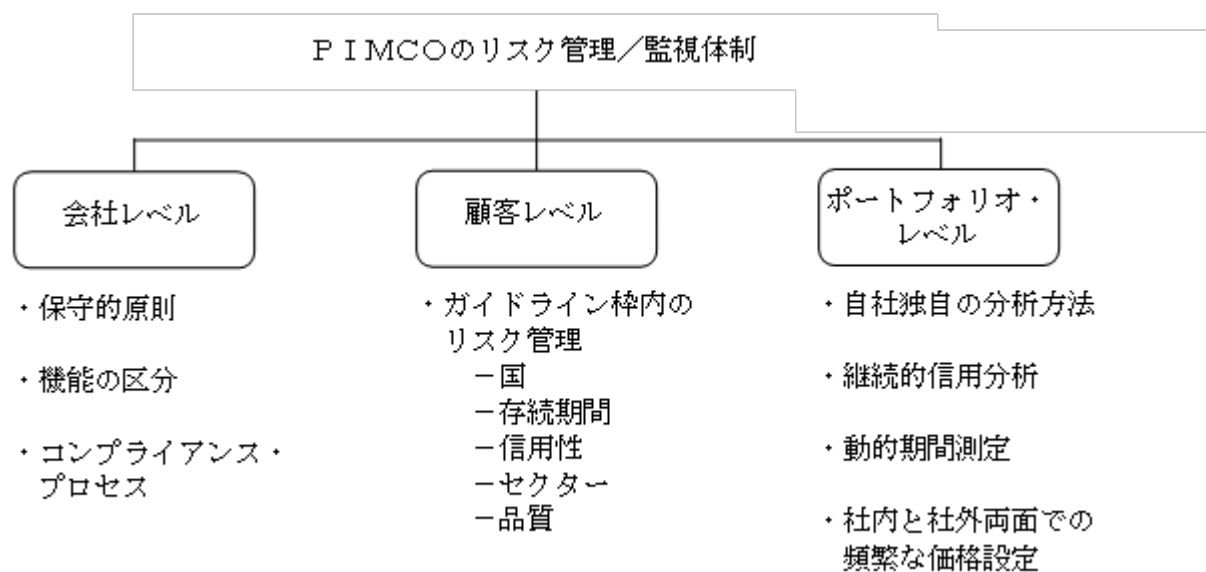
(2018年2月末日現在)

(中略)

(ロ) 投資先ファンドのリスク管理体制

PIMCOのリスク管理は、ポートフォリオ・マネジメント、アカウント・マネジメント、インベストメント・オペレーションズおよびコンプライアンスの4つの業務分野に及んでいる。各々は、ポートフォリオ・リスクとコンプライアンスが適正に監視され、管理されていることを目指して個別でありながら、ある程度重複する責務を負っている。

各レベルで監視管理されるポートフォリオ・リスク



PIMCOのインベストメント・コミッティーが多岐にわたるポートフォリオ・リスクを監視する。

(2018年2月末日現在)

(後略)

(3) リスクに関する参考情報

<訂正前>

(前略)

※課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にサブ・ファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

※サブ・ファンドの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。

※代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。

※サブ・ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。

※サブ・ファンドの課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※サブ・ファンドの年間騰落率は、各受益証券の参照通貨建てで計算されており、円貨に換算されておりません。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

※サブ・ファンドは代表的な資産クラスのすべてに投資するものではありません。

●各資産クラスの指数

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・ラッセル先進国(除く日本)大型株インデックス

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグ/EFFAS債券・インデックス・ジャパン・ガバメント・オール(1年超)

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債・・・FTSE新興国市場国債インデックス(円ベース)

(注)ラッセル先進国(除く日本)大型株インデックスおよびS&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(関東証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、関東証券取引所が有しています。なお、サブ・ファンドは、関東証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、関東証券取引所は、サブ・ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ラッセル・インデックスに関連する登録商標、トレードマーク、サービスマークおよび著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利は、ラッセル・インベストメントに帰属します。インデックスは資産運用管理の対象とはなりません。またインデックス自体は直接的に投資の対象となるものではありません。

FTSE世界国債インデックスおよび**FTSE新興国市場国債インデックス**はFTSE Fixed Income LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスです。

(後略)

<訂正後>

(前略)

※課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にサブ・ファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

※サブ・ファンドの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。

※代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。

※サブ・ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。

※サブ・ファンドの課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※サブ・ファンドの年間騰落率は、各受益証券の参照通貨建てで計算されており、円貨に換算されておりません。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

※サブ・ファンドは代表的な資産クラスのすべてに投資するものではありません。

●各資産クラスの指数

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・ラッセル先進国(除く日本)大型株インデックス

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・BBGバークレイズE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債・・・FTSE新興国市場国債インデックス(円ベース)

(注)ラッセル先進国(除く日本)大型株インデックスおよびS&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(関東証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、関東証券取引所が有しています。なお、サブ・ファンドは、関東証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、関東証券取引所は、サブ・ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ラッセル・インデックスに関連する登録商標、トレードマーク、サービスマークおよび著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利は、ラッセル・インベストメントに帰属します。インデックスは資産運用管理の対象とはなりません。またインデックス自体は直接的に投資の対象となるものではありません。

FTSE世界国債インデックスおよび**FTSE新興国市場国債インデックス**はFTSE Fixed Income LLCにより算出および公表されている債券インデックスです。

(後略)

4 手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

（Ａ）日本

2017年12月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

（Ａ）日本

2018年 3 月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

（後略）

5 運用状況

（２）投資資産

< 訂正前 >

投資有価証券の主要銘柄（2017年11月末日現在）

< 米ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ >

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢ クラス Ｄ（ＢＲＬ）	ケイマン 諸島	投資信託	<u>7,718,216.71</u>	<u>6.93</u>	<u>53,512,811.43</u>	<u>5.00</u>	<u>38,591,083.55</u>	<u>99.88</u>

< 豪ドル（ブラジルリアル・ヘッジ）ポートフォリオ >

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（豪ドル）		時価（豪ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ピムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドＢ クラス Ａ（ＢＲＬ）	ケイマン 諸島	投資信託	<u>1,794,391.47</u>	<u>7.50</u>	<u>13,452,636.54</u>	<u>5.95</u>	<u>10,676,629.25</u>	<u>100.11</u>

< 参考情報 >

〔ご参考〕ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド(M)の組入上位銘柄

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	SBERBANK (SB CAP SA) UNSEC REGS	5.180%	2019/06/28	2.08%
2	BANCO DO BRASIL (CAYMAN) SR UNSEC REGS	6.000%	2020/01/22	1.91%
3	BRAZIL MINAS SPE REGS	5.333%	2028/02/15	1.86%
4	URUGUAY (REP OF) GLBL UNSEC	7.625%	2036/03/21	1.36%
5	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO SR UNSEC REGS	6.375%	2021/04/09	1.35%
6	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.950%	2027/01/25	1.22%
7	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO REGS	7.000%	2020/05/05	1.21%
8	URUGUAY (REP OF) BD PIK	7.875%	2033/01/15	1.16%
9	PERU (REP OF) GLBL SR UNSECURED	8.750%	2033/11/21	1.14%
10	REPUBLIC OF SRI LANKA	6.250%	2020/10/04	1.13%

- 組入比率は、債券評価額の比率を小数第3位を四捨五入して表示しています。
- 現金同等資産(米国短期国債等)を除いて表示しています。

投資不動産物件（2017年11月末日現在）

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの（2017年11月末日現在）

該当事項なし。

< 訂正後 >

投資有価証券の主要銘柄（2018年 2 月末日現在）

< 米ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ >

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（米ドル）		時価（米ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドB クラスD（BRL）	ケイマン諸島	投資信託	6,982,930.98	6.87	47,967,571.77	4.92	34,356,020.42	99.79

< 豪ドル（ブラジルレアル・ヘッジ）ポートフォリオ >

順位	銘柄	地域	種類	口数（口）	取得価格（豪ドル）		時価（豪ドル）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	ビムコ ケイマン エマージング ボンド ファンドB クラスA（BRL）	ケイマン諸島	投資信託	1,706,387.31	7.45	12,709,850.23	5.70	9,726,407.67	99.93

< 参考情報 >

〔ご参考〕ヒムコ ケイマン エマージング ボンド ファンド(M)の組入上位銘柄

順位	組入上位銘柄	クーポン	償還日	組入比率
1	SBERBANK (SB CAP SA) UNSEC REGS	5.180%	2019/06/28	2.02%
2	BANCO DO BRASIL (CAYMAN) SR UNSEC REGS	6.000%	2020/01/22	2.00%
3	OMAN GOV INTERNTL BOND REGS	5.625%	2028/01/17	1.50%
4	ARGENTINA GOVT	7.820%	2033/12/31	1.47%
5	URUGUAY (REP OF) GLBL UNSEC	7.625%	2036/03/21	1.41%
6	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO SR UNSEC REGS	6.375%	2021/04/09	1.40%
7	EGYPT GOVT SR UNSEC REGS	5.577%	2023/02/21	1.29%
8	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO REGS	7.000%	2020/05/05	1.27%
9	DOMINICAN REPUBLIC REGS	5.950%	2027/01/25	1.27%
10	REPUBLIC OF NIGERIA REGS	6.500%	2027/11/28	1.19%

● 組入比率は、債券評価額の比率を小数第3位を四捨五入して表示しています。

● 現金同等資産(米国短期国債等)を除いて表示しています。

投資不動産物件（2018年2月末日現在）

該当事項なし。

その他投資資産の主要なもの（2018年2月末日現在）

該当事項なし。

第3 ファンドの経理状況

< 訂正前 >

（前略）

d．ファンドの原文の財務書類は米ドルおよび豪ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の2017年11月30日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝112.05円、1豪ドル＝84.87円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

d．ファンドの原文の財務書類は米ドルおよび豪ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円への換算には、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行（現株式会社三菱ＵＦＪ銀行）の2017年11月30日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝112.05円、1豪ドル＝84.87円）で換算された円換算額が併記されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。

（後略）

第三部 特別情報

第1 管理会社の概況

1 管理会社の概況

<訂正前>

(前略)

(2) 会社の機構

(中略)

取締役会は、管理会社の目的を達成するのに必要または有用なすべての行為をなす広汎な権限を有する。

(3) 役員および従業員の状況

(2017年11月末日現在)

氏名	役職名	略歴	
鈴木 惣太	マネージング・ディレクター	1989年4月 2017年4月	三菱信託銀行株式会社(現三菱UFJ信託銀行株式会社)入行 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.入社
弘田 嘉信	デプティ・マネージング・ディレクター	1993年4月 2016年10月	三菱信託銀行株式会社(現三菱UFJ信託銀行株式会社)入行 ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.入社

<訂正後>

(前略)

(2) 会社の機構

(中略)

取締役会は、管理会社の目的を達成するのに必要または有用なすべての行為をなす広汎な権限を有する。

3 管理会社の経理状況

<訂正前>

(前略)

c. 管理会社の原文の財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2017年11月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=112.05円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(後略)

<訂正後>

(前略)

c. 管理会社の原文の財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2017年11月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行(現株式会社三菱UFJ銀行)の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=112.05円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(後略)

第2 その他の関係法人の概況

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(2) MUFGルクスマネジメントカンパニーS.A. (MUFG Lux Management Company S.A.) (「副管理会社」)

(イ) 資本金の額

<訂正前>

2017年11月末日現在、7,375,000ユーロ(約9億7,947万円)

(注) ユーロの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である、1ユーロ=132.81円による。

<訂正後>

2017年11月末日現在、7,375,000ユーロ(約9億7,947万円)

(注) ユーロの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行(現株式会社三菱UFJ銀行)の対顧客電信売買相場の仲値である、1ユーロ=132.81円による。

(4) ミツビシ・UFJ・アセット・マネジメント(UK)リミテッド(Mitsubishi UFJ Asset Management (UK) Ltd.) (「投資運用会社」)

(イ) 資本金の額

<訂正前>

2017年11月末日現在、2,000,000英ポンド(約3億66万円)

(注) 英ポンドの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である1英ポンド=150.33円による。

<訂正後>

2017年11月末日現在、2,000,000英ポンド(約3億66万円)

(注) 英ポンドの円貨換算は、2017年11月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行(現株式会社三菱UFJ銀行)の対顧客電信売買相場の仲値である1英ポンド=150.33円による。