

ピムコ・バミューダ・トラストII
PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム
米ドルクラス/ユーロクラス/円クラス
バミューダ籍/オープン・エンド契約型外国投資信託

運用報告書（償還報告書）（全体版）

作成対象期間 第8期(2022年11月1日～2023年10月16日)

受益者の皆様へ

平素より格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、ピムコ・バミューダ・トラストII-PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム（以下「ファンド」といいます。）は、2023年10月16日付で繰上償還されました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。これまでファンドをご愛顧頂き、誠にありがとうございました。

ファンドの仕組みは次のとおりです。

ファンド形態	バミューダ籍/オープン・エンド契約型外国投資信託
信託期間	ファンドは、有価証券報告書「ファンドの解散」に記載する一定の状況下で早期に終了しない限り、信託証書の日付（2003年12月1日）から100年間。なお、ファンドは、2023年10月16日付で繰上償還されました。
運用方針	ファンドの投資目的は、主として、米ドル建てのモーゲージ債（住宅ローン担保証券）およびその派生商品に幅広く投資を行い、短期金利を上回るリターンの獲得を目指すことです。
主要投資対象	米ドル建てのモーゲージ債（住宅ローン担保証券）およびその派生商品を実質的な主要投資対象とします。
運用方法	ファンドは、通常の場合において、その総資産の65%以上を、様々な満期を有するモーゲージ関連債券または当該証券に関連するデリバティブに分散されたポートフォリオに投資することにより投資目的の実現を図ります。
主な投資制限	●米ドル建て証券以外には投資しないものとします。 ●新興国債券にはファンドの総資産の5%を超えて投資しないものとします。 ●流動性の低い証券にはファンドの純資産の15%を超えて投資しないものとします。 ●モーゲージ派生商品にはファンドの総資産の5%を超えて投資しないものとします。
分配方針	当面、分配は行いません。ただし、将来、分配を行うことも可能です。

■管理会社
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

■代行協会員
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

I. ファンドの設定から前期までの運用の経過

第1期（2015年10月29日～2016年10月31日）

当期の政府系モーゲージ債市場は上昇しました。期の前半を中心に米国債金利の低下が進んだことに加え、米国内の住宅市場が期を通じて堅調に推移したことや、住宅ローンの繰上返済およびモーゲージ債の期限前償還が引き続き穏やかな水準で推移したことがプラス要因となりました。

当期の米ドルクラスの騰落率は+2.4%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+0.4%）を2.0%上回りました。

当期のユーロクラスの騰落率は+0.7%の上昇となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.3%）を1.0%上回りました。

当期の円クラスの騰落率は+1.2%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（0.0%）を1.2%上回りました。

第2期（2016年11月1日～2017年10月31日）

当期は、米国内の住宅市場が堅調に推移したことがプラス材料となった一方で、米国債金利が上昇を続けたことなどがマイナスとなり、政府系モーゲージ債市場の価格は軟調となりました。ただし、期を通じてみると利子収入がプラスとなり、政府系モーゲージ債は上昇しました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.2%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+1.0%）を0.8%下回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.9%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.4%）を1.5%下回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.3%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（0.0%）を1.3%下回りました。

第3期（2017年11月1日～2018年10月31日）

当期の政府系モーゲージ債市場は下落しました。米国内の住宅市場が堅調に推移したことや利子収入を得たことはプラス材料となった一方で、米国債金利が上昇を続けたことなどがマイナスとなりました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.1%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+1.8%）を0.7%下回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.4%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.4%）を1.0%下回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.2%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.1%）を1.1%下回りました。

第4期（2018年11月1日～2019年10月31日）

当期の政府系モーゲージ債市場は上昇しました。利子収入を得たことに加え、米国債金利が低下傾向であったことや、米国内の住宅市場が堅調に推移したことがプラスに寄与しました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は2.3%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+2.4%）を0.1%下回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.6%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.4%）を0.2%下回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.5%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.1%）を0.4%下回りました。

第5期（2019年11月1日～2020年10月末）

当期の政府系モーゲージ債市場は上昇しました。利子収入を得たことに加え、米国債金利が低下したこと、さらにFRBによる同債券の無期限買い支えなどがプラスに寄与しました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は2.1%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+0.9%）を1.2%上回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.6%の上昇となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.5%）を1.1%上回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.8%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.1%）を0.9%上回りました。

第6期（2020年11月1日～2021年10月31日）

当期の政府系モーゲージ債市場は下落しました。利子収入を得たことがプラスに寄与した一方、米国債金利が上昇したことや、期末にかけてFRBによるテーパリング開始が確実視されたことなどがマイナスに寄与しました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.5%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+0.1%）を下回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.3%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.6%）を下回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.8%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.1%）を下回りました。

第7期（2021年11月1日～2022年10月31日）

当期の政府系モーゲージ債市場は下落しました。利子収入を得たことがプラスに寄与した一方、米国債金利の上昇に加えて、FRBによる資産買入が終了し、その後バランスシートの縮小が進められたことなどがマイナスに寄与しました。

当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は2.9%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+1.1%）を下回りました。

当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は4.4%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（-0.4%）を下回りました。

当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は4.2%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（0.0%）を下回りました。

II. 運用の経過および運用状況の推移等

(1) 当期の運用経過

■当期の受益証券1口当たり純資産価格等の推移

<米ドルクラス>

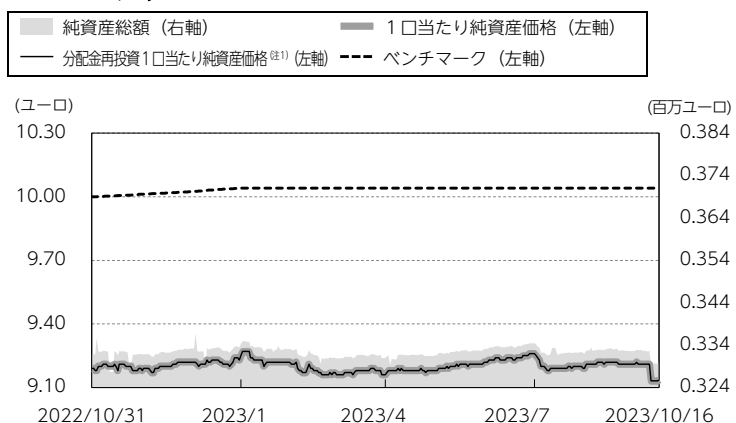


1口当たり純資産価格	
第7期末	10.47米ドル
第8期末	10.63米ドル
(1口当たり分配金額)	(0米ドル)
騰落率	1.53%

1口当たり純資産価格の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 保有している債券から利子収入を得たこと ■ 保有していたモーゲージ債が小幅に上昇したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 米国債金利が上昇したこと

<ユーロクラス>

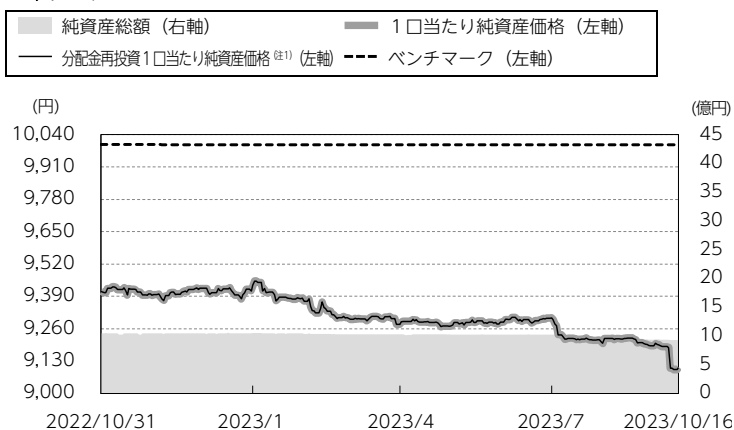


1口当たり純資産価格	
第7期末	9.19ユーロ
第8期末	9.14ユーロ
(1口当たり分配金額)	(0ユーロ)
騰落率	-0.54%

1口当たり純資産価格の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 保有している債券から利子収入を得たこと ■ 保有していたモーゲージ債が小幅に上昇したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 為替取引コストがマイナスに寄与したこと ■ 米国債金利が上昇したこと

<円クラス>



1口当たり純資産価格	
第7期末	9,410円
第8期末	9,106円
(1口当たり分配金額)	(0円)
騰落率	-3.23%

1口当たり純資産価格の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 保有している債券から利子収入を得たこと ■ 保有していたモーゲージ債が小幅に上昇したこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ■ 為替取引コストがマイナスに寄与したこと ■ 米国債金利が上昇したこと

(注1) 分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引き前の分配金をファンドへ再投資したとみなして算出したもので、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。ただし、ファンドは当期において、分配を行っていないため、分配金再投資1口当たり純資産価格の値は1口当たり純資産価格の値と同じです。

(注2) ベンチマークは、第7期末の受益証券1口当たり純資産価格を起点として計算しています。

(注3) ファンドにおいて、分配金の再投資は行っていません。

(注4) ファンドのベンチマークは、米ドルクラスについてはICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックス、ユーロクラスについてはICE BofA ESTR オーバーナイトレートインデックス、円クラスについてはICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックスです。(ベンチマークは2021年10月28日までユーロクラスについて「1か月物ユーロLIBORインデックス」、円クラスについて「1か月物日本円LIBORインデックス」でしたが、2021年10月29日から「ICE BofA ESTR オーバーナイトレートインデックス」、「ICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックス」にそれぞれ変更され、また2023年3月30日まで米ドルクラスについて「1か月物米ドルLIBORインデックス」でしたが、2023年3月31日から「ICE BofA SOFR オーバーナイトレートインデックス」に変更されました。)以下同じです。

(注5) 騰落率は、税引き前の分配金を再投資したものとみなして計算しています。なお、ファンドに分配金の支払実績はありません。以下同じです。

■分配金について

該当事項はありません。

■投資環境について

【米国債金利の動向】

- ・当期の米国債金利は、FRBによる利上げの継続や、米景気の底堅さなどを背景に上昇しました。

【政府系モーゲージ債市場の動向】

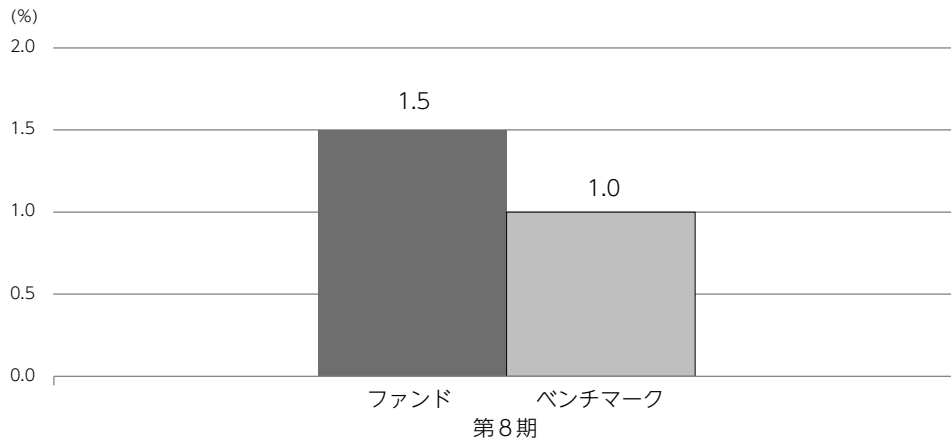
- ・当期の政府系モーゲージ債市場は小幅に上昇しました。利子収入を得たことがプラスに寄与した一方、米国債金利が上昇したことや、破綻した米地銀が保有していたモーゲージ債の売却が実施されたことなどがマイナスに寄与しました。

■ポートフォリオについて

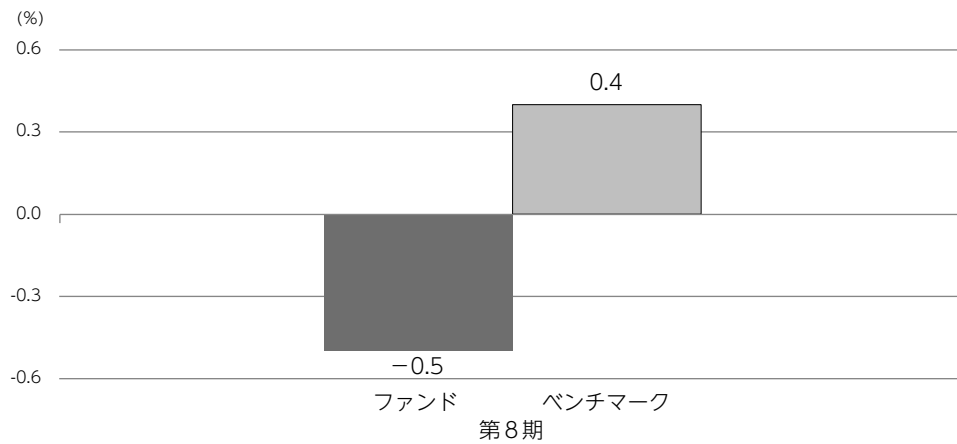
- ・主要投資対象である高格付け（原則としてA格相当以上）の政府系モーゲージ債（住宅ローン担保証券）を概ね高位に組みました。

■ベンチマークとの差異について

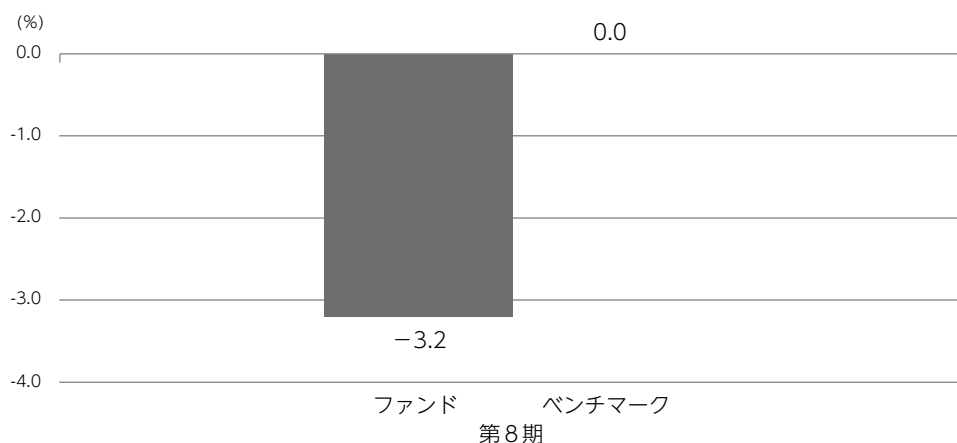
<米ドルクラス>



<ユーロクラス>



<円クラス>



ファンドとベンチマークの騰落率の差異の状況および要因について

- ・当期の米ドルクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は1.5%の上昇となり、ベンチマークであるICE BofA SFR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+1.0%）を0.5%上回りました。
- ・当期のユーロクラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は0.5%の下落となり、ベンチマークであるICEBofA ESTR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（+0.4%）を0.9%下回りました。
- ・当期の円クラスの騰落率（税引前分配金再投資後）は3.2%の下落となり、ベンチマークであるICE BofA TNAR オーバーナイトレートインデックスの騰落率（0.0%）を3.2%下回りました。

プラス要因	■モーゲージ債の銘柄選択効果など
マイナス要因	■報酬がかかったこと

■投資の対象とする有価証券の主な銘柄

該当事項はありません。

■今後の運用方針

ファンドは、2023年10月16日付で償還されました。

(2) 費用の明細

項目	項目の概要					
	政策金利*					
	0.5%未満	0.5%以上～ 1.5%未満	1.5%以上～ 2.5%未満	2.5%以上～ 3.5%未満	3.5%以上	
管理報酬**	0.30%	0.325%	0.35%	0.40%	0.45%	投資顧問、管理事務および第三者への業務の提供および提供の手配などの業務の対価
販売報酬	0.25%	0.275%	0.30%	0.35%	0.40%	受益証券の販売、販売促進、募集、および買戻しに関する業務の対価
代行協会員報酬	0.05%					受益証券1口当たり純資産価格の公表および法令規則により作成を要する文書の配布等、ならびにこれらに付随する業務の対価
その他の費用 (当期)	1.1%					支払利息、その他の費用

(注) 各報酬については、目論見書に定められている料率（各クラスの純資産総額に対して、各クラスの政策金利*に連動する報酬率（年率））を記載しています。「その他の費用（当期）」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、当期のその他の費用の金額をファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

* 各クラスについて、以下を参照します。

米ドルクラス：フェデラル・ファンド金利（誘導目標）

ユーロクラス：欧州中央銀行発表政策金利

円クラス：日本銀行無担保コール翌日物金利（誘導目標）

（上記の参考指標が有効ではない場合には、管理会社が適切とみなす参考指標を用いる場合があります。）

** ファンドに関する情報や資料を提供する等のサービス支援業務に対する受託報酬、その他管理事務代行報酬、保管報酬、名義書換事務報酬等については、管理会社が管理報酬から支払います。

Ⅲ. 運用実績

(1) 純資産の推移

下記会計年度末および第8会計年度中における各月末の純資産の推移は次のとおりです。

<米ドルクラス>

	純 資 産 総 額		一口当たりの純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
第1会計年度末 (2016年10月末日)	10,934,662.85	1,634,841	10.24	1,531
第2会計年度末 (2017年10月末日)	5,552,622.63	830,173	10.26	1,534
第3会計年度末 (2018年10月末日)	2,339,399.12	349,764	10.37	1,550
第4会計年度末 (2019年10月末日)	2,415,551.77	361,149	10.61	1,586
第5会計年度末 (2020年10月末日)	8,653,726.26	1,293,819	10.83	1,619
第6会計年度末 (2021年10月末日)	14,075,963.78	2,104,497	10.78	1,612
第7会計年度末 (2022年10月末日)	18,728,482.45	2,800,095	10.47	1,565
第8会計年度末 (2023年10月16日)	1,130,704.28	169,052	10.63	1,589
2022年11月末日	18,767,629.76	2,805,948	10.49	1,568
12月末日	18,711,929.28	2,797,621	10.56	1,579
2023年1月末日	2,492,514.03	372,656	10.61	1,586
2月末日	2,488,002.04	371,981	10.59	1,583
3月末日	2,086,461.13	311,947	10.55	1,577
4月末日	2,089,285.54	312,369	10.56	1,579
5月末日	2,097,337.42	313,573	10.60	1,585
6月末日	1,319,408.66	197,265	10.67	1,595
7月末日	1,326,555.87	198,333	10.73	1,604
8月末日	1,135,237.16	169,729	10.67	1,595
9月末日	1,138,782.89	170,259	10.70	1,600
10月16日	1,130,704.28	169,052	10.63	1,589

(注1) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、別段の記載のない限り、2023年10月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売相場場の仲値（1米ドル=149.51円および1ユーロ=158.66円）によります。以下同じです。

(注2) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入または切捨の処理がしてあります。従って、合計の数字が一致しない場合があります。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ります。従って、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ります。

(注3) 会計年度末の純資産総額が各日における取引すべてを反映した数字であるのに対し、各月末の純資産総額は各日の米国東部標準時午後7時時点で算出された数字です。以下同じです。

(注4) ファンドは、2015年10月29日から運用を開始しており、第1会計年度は当該運用開始日から2016年10月末日までの期間をいいます。

<ユーロクラス>

	純 資 産 総 額		一口当たりの純資産価格	
	ユーロ	千円	ユーロ	円
第1会計年度末 (2016年10月末日)	537,432.16	85,269	10.07	1,598
第2会計年度末 (2017年10月末日)	385,970.32	61,238	9.88	1,568
第3会計年度末 (2018年10月末日)	380,374.47	60,350	9.74	1,545
第4会計年度末 (2019年10月末日)	377,871.29	59,953	9.68	1,536
第5会計年度末 (2020年10月末日)	351,651.56	55,793	9.74	1,545
第6会計年度末 (2021年10月末日)	347,235.10	55,092	9.61	1,525
第7会計年度末 (2022年10月末日)	331,896.46	52,659	9.19	1,458
第8会計年度末 (2023年10月16日)	330,006.68	52,359	9.14	1,450
2022年11月末日	331,932.55	52,664	9.19	1,458
12月末日	333,160.67	52,859	9.22	1,463
2023年1月末日	334,189.56	53,023	9.25	1,468
2月末日	333,059.55	52,843	9.22	1,463
3月末日	330,907.85	52,502	9.16	1,453
4月末日	330,933.97	52,506	9.16	1,453
5月末日	331,512.70	52,598	9.18	1,456
6月末日	333,076.30	52,846	9.22	1,463
7月末日	334,437.48	53,062	9.26	1,469
8月末日	331,980.64	52,672	9.19	1,458
9月末日	332,570.83	52,766	9.21	1,461
10月16日	330,006.68	52,359	9.14	1,450

<円クラス>

	純 資 産 総 額	一口当たりの純資産価格
	円	円
第1会計年度末 (2016年10月末日)	13,973,514,725	10,118
第2会計年度末 (2017年10月末日)	7,233,859,229	9,989
第3会計年度末 (2018年10月末日)	3,099,529,665	9,871
第4会計年度末 (2019年10月末日)	2,386,586,502	9,824
第5会計年度末 (2020年10月末日)	1,376,161,185	9,901
第6会計年度末 (2021年10月末日)	1,263,677,229	9,818
第7会計年度末 (2022年10月末日)	1,044,380,678	9,410
第8会計年度末 (2023年10月16日)	927,429,327	9,106
2022年11月末日	1,043,356,771	9,401
12月末日	1,045,807,545	9,423
2023年1月末日	1,047,082,966	9,434
2月末日	1,041,327,667	9,382
3月末日	1,032,013,045	9,298
4月末日	1,029,725,663	9,278
5月末日	1,024,435,018	9,271
6月末日	1,026,225,434	9,287
7月末日	1,028,053,509	9,304
8月末日	937,199,306	9,201
9月末日	936,218,946	9,192
10月16日	927,429,327	9,106

(2) 分配の推移

該当事項はありません。

IV. ファンドの経理状況

- a. PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム¹の2022年11月1日から2023年10月16日（償還日）までの日本文の財務書類は、アメリカ合衆国（ファンドの設定国：バーミューダ諸島）における諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の財務書類を翻訳したものである。
- b. ファンドの財務書類は、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. ファンドの原文の財務書類は米ドルおよびユーロで表示されている。日本文の財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円による金額は、株式会社三菱UFJ銀行の2023年10月31日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=149.51円、1ユーロ=158.66円）で換算されている。なお、百万円未満の金額は四捨五入されている。

PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム
資産・負債計算書

2023年10月16日現在

(未監査)

	(千米ドル、一口当たり 金額を除く)	(百万円、一口当たり 金額を除く)
資 産：		
金融デリバティブ商品		
店頭取引金融デリバティブ商品	1	0
現金	7,685	1,149
外国通貨、時価	2	0
投資有価証券売却未収金	2	0
未収利息および未収分配金	9	1
	7,699	1,151
負 債：		
未払管理報酬	1	0
未払代行協会員報酬	0	0
未払販売報酬	1	0
その他の負債	21	3
	23	3
純 資 産	7,676	1,148
保有外国通貨にかかる取得原価	2	0
純 資 産：		
ユーロクラス	348	52
円クラス	6,197	927
米ドルクラス	1,131	169
発行済受益証券口数：		
ユーロクラス	36 千口	
円クラス	102 千口	
米ドルクラス	106 千口	
発行済受益証券一口当たりの純資産価格 および買戻価格：		
ユーロクラス		
(機能通貨による)	9.64 米ドル	1,441 円
(純資産価額通貨による)	9.14 ユーロ	1,450 円
円クラス		
(機能通貨による)	60.85 米ドル	9,098 円
(純資産価額通貨による)	9,106 円	
米ドルクラス		
(機能通貨による)	10.63 米ドル	1,589 円

ゼロ残高は、千単位未満に四捨五入された実際値を反映していることがある。

PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム
運用計算書

2022年11月1日から2023年10月16日（償還日）までの期間
（未監査）

	(千米ドル)	(百万円)
投資収益：		
利息（外国税控除後）*	332	50
収益合計	332	50
費用：		
管理報酬—ユーロクラス	1	0
管理報酬—円クラス	21	3
管理報酬—米ドルクラス	24	4
販売報酬—ユーロクラス	1	0
販売報酬—円クラス	18	3
販売報酬—米ドルクラス	21	3
代行協会員報酬—ユーロクラス	0	0
代行協会員報酬—円クラス	3	0
代行協会員報酬—米ドルクラス	3	0
支払利息	5	1
その他の費用	80	12
費用合計	177	26
純投資収益（費用）	155	23
実現純利益（損失）：		
投資有価証券	(2,850)	(426)
上場金融デリバティブ商品または 集中清算の対象となる金融デリバティブ商品	364	54
店頭取引金融デリバティブ商品	(492)	(74)
外国通貨	(31)	(5)
実現純利益（損失）	(3,009)	(450)
未実現利益（損失）純変動額：		
投資有価証券	3,018	451
上場金融デリバティブ商品または 集中清算の対象となる金融デリバティブ商品	(294)	(44)
店頭取引金融デリバティブ商品	145	22
未実現（損失）純変動額	2,869	429
純利益（損失）	(140)	(21)
運用の結果による純資産の純増加（減少）額	15	2
*外国税	—	—

ゼロ残高は、千単位未満に四捨五入された実際値を反映していることがある。

V. 投資信託財産運用総括表

(米ドルクラス)

信託期間	投資信託当初払込日	2015年10月29日		投資信託終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年10月16日		資産総額	— (注)
区分	投資信託当初払込時	投資信託契約終了時	差引増減	負債総額	— (注)
				純資産総額	1,130,704.28米ドル
受益権口数	45,026.260口	106,409.512口	61,383.252口	受益権口数	106,409.512口
元本額	450,262.59米ドル	1,130,704.28米ドル	680,441.69米ドル	1口当たり償還金	10.63米ドル
各会計年度の状況					
計算期	期首純資産総額 (米ドル)	期末純資産総額 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (米ドル)	1口当たり分配金	
				金額 (米ドル)	分配率 (%)
第1期	450,262.59	10,934,662.85	10.24	—	—
第2期	10,934,662.85	5,552,622.63	10.26	—	—
第3期	5,552,622.63	2,339,399.12	10.37	—	—
第4期	2,339,399.12	2,415,551.77	10.61	—	—
第5期	2,415,551.77	8,653,726.26	10.83	—	—
第6期	8,653,726.26	14,075,963.78	10.78	—	—
第7期	14,075,963.78	18,728,482.45	10.47	—	—
第8期	18,728,482.45	1,130,704.28	10.63	—	—

(注) 各クラスの資産総額および負債総額は算出されていない。ファンド全体の資産総額は7,699,040.44米ドル、ファンド全体の負債総額は22,665.95米ドルでした。

(ユーロクラス)

信託期間	投資信託当初払込日	2015年10月29日		投資信託終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年10月16日		資産総額	— (注)
区分	投資信託当初払込時	投資信託契約終了時	差引増減	負債総額	— (注)
				純資産総額	330,006.68ユーロ
受益権口数	24,414.000口	36,121.519口	11,707.519口	受益権口数	36,121.519口
元本額	244,140.00ユーロ	330,006.68ユーロ	85,867ユーロ	1口当たり償還金	9.14ユーロ
各会計年度の状況					
計算期	期首純資産総額 (ユーロ)	期末純資産総額 (ユーロ)	1口当たり 純資産価格 (ユーロ)	1口当たり分配金	
				金額 (ユーロ)	分配率 (%)
第1期	244,140.00	537,432.16	10.07	—	—
第2期	537,432.16	385,970.32	9.88	—	—
第3期	385,970.32	380,374.47	9.74	—	—
第4期	380,374.47	377,871.29	9.68	—	—
第5期	377,871.29	351,651.56	9.74	—	—
第6期	351,651.56	347,235.10	9.61	—	—
第7期	347,235.10	331,896.46	9.19	—	—
第8期	331,896.46	330,006.68	9.14	—	—

(注) 各クラスの資産総額および負債総額は算出されていない。ファンド全体の資産総額は7,699,040.44米ドル、ファンド全体の負債総額は22,665.95米ドルでした。

(円クラス)

信託期間	投資信託当初払込日	2015年10月29日		投資信託終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年10月16日		資産総額	— (注)
区分	投資信託当初払込時	投資信託契約終了時	差引増減	負債総額	— (注)
				純資産総額	927,429,327円
受益権口数	87,414,000口	101,853,436口	14,439,436口	受益権口数	101,853,436口
元本額	874,140,000円	927,429,327円	53,289,327円	1口当たり償還金	9,106円
各会計年度の状況					
計算期	期首純資産総額 (円)	期末純資産総額 (円)	1口当たり 純資産価格 (円)	1口当たり分配金	
				金額 (円)	分配率 (%)
第1期	874,140,000	13,973,514,725	10,118	—	—
第2期	13,973,514,725	7,233,859,229	9,989	—	—
第3期	7,233,859,229	3,099,529,665	9,871	—	—
第4期	3,099,529,665	2,386,586,502	9,824	—	—
第5期	2,386,586,502	1,376,161,185	9,901	—	—
第6期	1,376,161,185	1,263,677,229	9,818	—	—
第7期	1,263,677,229	1,044,380,678	9,410	—	—
第8期	1,044,380,678	927,429,327	9,106	—	—

(注) 各クラスの資産総額および負債総額は算出されていない。ファンド全体の資産総額は7,699,040.44米ドル、ファンド全体の負債総額は22,665.95米ドルでした。

VI. お知らせ

ファンドは、2023年10月16日付で償還されました。