

■ 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	2014年5月30日から2029年5月14日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 ピムコ・パミューダ・インカムファンドA クラスJ (JPY) ピムコ・パミューダ・インカムファンド (M) (米ドル建ての債券等に投資) マネー・マーケット・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■ 世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 ■ 運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。 ■ 原則として純資産総額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
組入制限	■ 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■ 年4回（原則として毎年2月、5月、8月、11月の12日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配を行います。 ■ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

# 三井住友・ピムコ・ストラテジック・ インカムファンド (為替ヘッジあり／3カ月決算型) 【運用報告書(全体版)】

第17作成期（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

第 33 期 / 第 34 期

第33期：決算日 2022年8月12日

第34期：決算日 2022年11月14日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

## 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1  
<https://www.smd-am.co.jp>

### ■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

### ■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

## 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

### ■ 最近10期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		公 社 比 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 込 金 騰 落	騰 落 率				
25期(2020年8月12日)	円 9,174	円 70	% 5.7	% 0.0	% 98.9	百万円 18,127	
26期(2020年11月12日)	9,309	50	2.0	0.0	98.5	18,429	
27期(2021年2月12日)	9,542	50	3.0	0.0	98.6	17,298	
28期(2021年5月12日)	9,452	50	△0.4	0.0	99.1	15,985	
29期(2021年8月12日)	9,477	30	0.6	0.0	98.9	15,258	
30期(2021年11月12日)	9,467	40	0.3	0.0	99.4	14,746	
31期(2022年2月14日)	9,208	50	△2.2	0.0	98.9	13,708	
32期(2022年5月12日)	8,466	80	△7.2	0.0	98.9	12,288	
33期(2022年8月12日)	8,383	120	0.4	0.0	98.6	11,516	
34期(2022年11月14日)	7,887	120	△4.5	0.0	98.8	10,855	

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		公 社 比 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率
		騰 落 率	騰 落 率			
第33期	(期 首) 2022年5月12日	円 8,466	% —	% 0.0	% 98.9	
	5 月 末	8,549	1.0	0.0	99.3	
	6 月 末	8,226	△2.8	0.0	99.4	
	7 月 末	8,434	△0.4	0.0	99.4	
	(期 末) 2022年8月12日	8,503	0.4	0.0	98.6	
第34期	(期 首) 2022年8月12日	8,383	—	0.0	98.6	
	8 月 末	8,260	△1.5	0.0	99.1	
	9 月 末	7,903	△5.7	0.0	99.1	
	10 月 末	7,927	△5.4	0.0	98.7	
	(期 末) 2022年11月14日	8,007	△4.5	0.0	98.8	

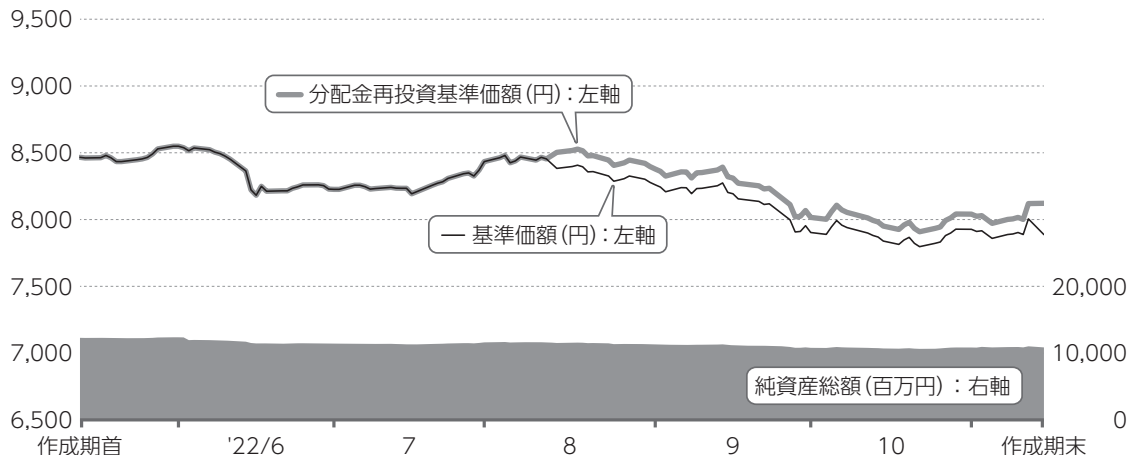
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

作成期首	8,466円
作成期末	7,887円 (当作成期既払分配金240円(税引前))
騰落率	-4.1% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### 基準価額の主な変動要因（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品などに投資しました。米ドル売り・円買いの為替取引による為替ヘッジを行いました。（米ドル以外の組入通貨については米ドルに対する当該通貨の影響を受けません。）

なお、運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託しています。

#### 上昇要因

- 債券利子収入を得たこと
- 売持ちとしていた英国債券の金利が上昇（価格は下落）したこと
- 一部の新興国関連資産が上昇したこと

#### 下落要因

- 米国の金利が上昇したこと
- スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大したこと
- 為替ヘッジコストがかかったこと

投資環境について（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

米国債券市場は下落しました。米国ハイイールド社債と新興国債券も下落しました。

## 債券市場

米国債券市場は、期初に米国の高いインフレ率の発表を受け、F R B（米連邦準備制度理事会）による急速な利上げ懸念から下落したものの、その後は景気後退懸念と利上げペースの減速期待が広がり上昇しました。し

かし、期の後半には良好な米国の経済指標や高いインフレ率を受け、F R Bによる大幅な利上げが継続するとの観測が再び強まったことから下落基調となりました。期を通じて、米国債券市場は下落となりました。

米国ハイイールド社債と新興国債券も、リスク回避の動きなどにより下落しました。

ポートフォリオについて（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

## 当ファンド

「ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラスJ（JPY）」および「マネー・マーケット・マザーファンド」に投資し、「ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラスJ（JPY）」の投資比率を高位に保ちました。

## ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラスJ（JPY）

### ●デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）

金利戦略については、世界的にインフレの上昇と利上げが進行し、急速に金利上昇が進む中、利回り面での妙味が高まった米国の中期年限を中心にリスク量を積み増し、米国ならびにポートフォリオ全体の金利リスク量を増加させました。一方、相対的に投資妙味に欠けると判断した日本などの金利リスクは売持ちとしました。

そのほか、変動利付債券を3～4割程度ポートフォリオに組入れることで、金利上昇に対する耐性を確保しました。

## ●債券セクター配分

セクター戦略については、景気後退リスクも意識される中、米国政府関連債や米国政府系モーゲージ証券といったリスクオフ（リスク回避）時に底堅い値動きが期待できる債券の組入れを増やしました。

社債については企業ファンダメンタルズ（業績、財務内容などの基礎的諸条件）の健全な発行体を選好して投資を行い、健全性の高い住宅市場の恩恵を受けやすい非政府系モーゲージ証券への投資を継続しました。

利回りが相対的に高い新興国債券については、南アフリカやメキシコなどへ投資を継続しました。

## マネー・マーケット・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

### ベンチマークとの差異について（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

### 分配金について（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第33期	第34期
当期分配金	120	120
（対基準価額比率）	(1.41%)	(1.50%)
当期の収益	48	48
当期の収益以外	71	71
翌期繰越分配対象額	460	389

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、左記の通りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。  
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

「ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラスJ（JPY）」を高位に組み入れます。

### ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（JPY）

当ファンドでは、リスク取得に過度に傾斜しない投資指針を通じ、市場が軟調となる局面において下値を抑制すると共に、確信度の高いボトムアップの投資アイデアに基づく魅力的な投資機会の発掘に取り組んでいます。また、質の良い高利回り資産を中心とす

る「攻め」の資産と、リスクオフ時にポートフォリオを安定化させる「守り」の資産のバランスを重視し、「良質なインカム」を着実に積み上げることで、引き続き元本の保全と安定的なインカムの提供を目指してまいります。

ロシアへのエクスポージャーについては、状況を精査しながら保有継続か売却かの検討を進めています。

### マネー・マーケット・マザーファンド

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	77円	0.941%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 期中の平均基準価額は8,212円です。
（投信会社）	(44)	(0.532)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(32)	(0.392)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.017)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保管費用）	(－)	(－)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	78	0.944	

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

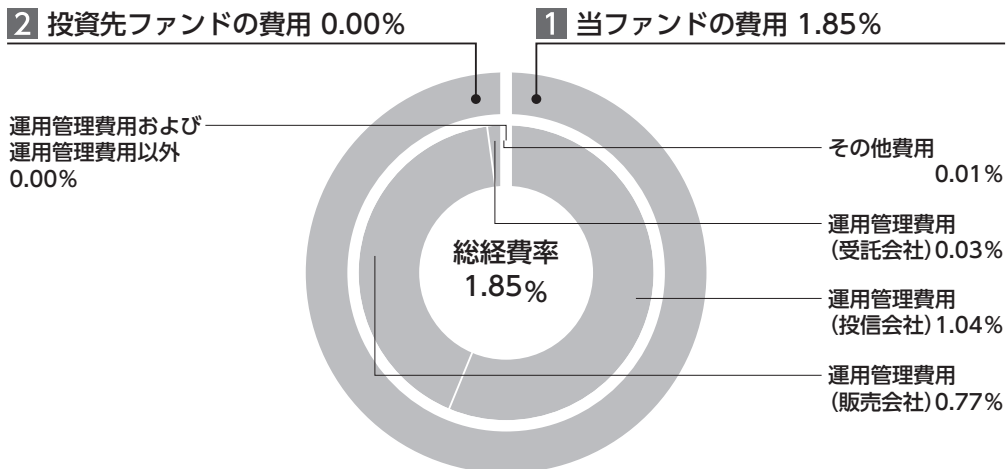
※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。





## 参考情報 総経費率（年率換算）



総経費率(1+2)	1.85%
1 当ファンドの費用の比率	1.85%
2 投資先ファンドの費用の比率	0.00%

※1の各費用は、前掲「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、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※2の投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンド、マネーファンドを除く))の運用管理費用は、当ファンドの運用委託報酬として負担していることから、原則として、開示すべき運用管理費用はありません。ただし、投資先ファンドには運用管理費用以外の費用(概算)がかかります。

※1と2の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.85%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

投資信託証券

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (JPY)	口	千円	口	千円
		—	—	97,511	829,686

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

■ 利害関係人との取引状況等（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
（2022年5月13日から2022年11月14日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細（2022年11月14日現在）

(1) 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

ファンド名	作成期首	作成期末		
	口数	口数	評価額	組入比率
	口	口	千円	%
ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (JPY)	1,420,081	1,322,570	10,722,074	98.8
合計	1,420,081	1,322,570	10,722,074	98.8

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 親投資信託残高

種類	作成期首	作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
マネー・マーケット・マザーファンド	4,909	4,909	4,905

※マネー・マーケット・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は76,632,575口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年11月14日現在)

項目	作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	10,722,074	96.8
マネー・マーケット・マザーファンド	4,905	0.0
コール・ローン等、その他	348,529	3.1
投資信託財産総額	11,075,510	100.0

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2022年8月12日)	(2022年11月14日)
	第33期末	第34期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>11,739,225,359円</b>	<b>11,075,510,200円</b>
コール・ローン等	375,662,456	348,529,944
投資信託受益証券(評価額)	11,358,656,164	10,722,074,990
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	4,906,739	4,905,266
<b>(B) 負 債</b>	<b>223,146,730</b>	<b>220,218,719</b>
未払収益分配金	164,857,593	165,159,066
未払解約金	3,590,878	2,315,045
未払信託報酬	54,531,994	52,582,882
その他未払費用	166,265	161,726
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>11,516,078,629</b>	<b>10,855,291,481</b>
元 本	13,738,132,795	13,763,255,564
次期繰越損益金	△ 2,222,054,166	△ 2,907,964,083
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>13,738,132,795口</b>	<b>13,763,255,564口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>8,383円</b>	<b>7,887円</b>

※当作成期における作成期首元本額14,515,795,489円、作成期中追加設定元本額320,305,504円、作成期中一部解約元本額1,072,845,429円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

## ■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第33期	第34期
		120円

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金(特別分配金)」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

## ■ 損益の状況

項 目	自2022年5月13日 至2022年8月12日	自2022年8月13日 至2022年11月14日
	第33期	第34期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>121,511,181円</b>	<b>118,921,309円</b>
受 取 配 当 金	121,523,190	118,946,459
受 取 利 息	1,377	612
支 払 利 息	△ 13,386	△ 25,762
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 16,275,559</b>	<b>△ 570,662,717</b>
売 買 益	10,297,083	8,267,814
売 買 損	△ 26,572,642	△ 578,930,531
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 54,702,299</b>	<b>△ 52,748,450</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>50,533,323</b>	<b>△ 504,489,858</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 1,821,465,307</b>	<b>△ 1,854,119,609</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 286,264,589</b>	<b>△ 384,195,550</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 677,616,577 )	( 634,751,040 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △ 963,881,166 )	( △ 1,018,946,590 )
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>△ 2,057,196,573</b>	<b>△ 2,742,805,017</b>
<b>(H) 収 益 分 配 金</b>	<b>△ 164,857,593</b>	<b>△ 165,159,066</b>
次期繰越損益金(G + H)	△ 2,222,054,166	△ 2,907,964,083
追加信託差損益金	△ 330,927,490	△ 483,175,106
( 配 当 等 相 当 額 )	( 632,953,677 )	( 535,771,500 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △ 963,881,167 )	( △ 1,018,946,606 )
繰 越 損 益 金	△ 1,891,126,676	△ 2,424,788,977

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するため要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は38,229,325円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第33期	第34期
(a) 経費控除後の配当等収益	66,815,610円	66,179,510円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0
(c) 収益調整金	677,616,578	634,751,056
(d) 分配準備積立金	53,379,082	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	797,811,270	700,930,566
1万口当たり当期分配対象額	580.73	509.28
(f) 分配金	164,857,593	165,159,066
1万口当たり分配金	120	120

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

## ■ 組入れ投資信託証券の内容

### 投資信託証券の概要

ファンド名	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（JPY）
形態	バミューダ籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。</li> <li>・原則として米ドル売り円買いの為替取引を行います。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・米ドル建て資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・デリバティブおよび外国為替予約取引の利用は、原則としてヘッジ目的および資産の効率的な運用に資することを目的とします。</li> <li>・低流動性資産への投資割合は、純資産総額の15%以内とします。</li> </ul>
配分方針	毎月、原則として利子収入および売買益から分配を行う方針です。
運用管理費用	ありません。
その他の費用	<p>ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。</p> <p>これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
申込手数料	ありません。
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
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

以下には、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（JPY）」をシェアクラスとして含む「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA」と「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA」が主要投資対象とする「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」の情報を委託会社において抜粋・要約して翻訳したものを記載しています。

(1)ピムコ・バミューダ・インカムファンドA

■ 損益計算書（2020年11月1日から2021年10月31日まで）

（単位：千米ドル）

投資収益	
受取利息（外国税控除後）	59
総収益	59
費用	
顧問費用 - W (USD)	171
管理手数料 - M (JPY助言)	308
管理手数料 - M (USD助言)	114
管理手数料 - P (JPY)	305
管理手数料 - T (JPY)	6,511
管理手数料 - U (USD)	592
管理手数料 - X (JPY)	36
管理事務代行費用 - W (USD)	53
販売手数料 - M (JPY助言)	267
販売手数料 - M (USD助言)	99
販売手数料 - P (JPY)	305
代行手数料- M (JPY助言)	20
代行手数料- M (USD助言)	8
支払利息	6
その他費用	1
総費用	8,796
投資純利益（損失）	(8,737)
実現純利益（損失）	
関連ファンドに対する投資	379,171
OTC金融デリバティブ商品	(518,405)
外国為替	(331)
実現純利益（損失）	(139,565)
未実現評価益（損）の純変動額	
有価証券に対する投資	(2)
関連ファンドに対する投資	518,884
OTC金融デリバティブ商品	(279,682)
外貨建資産および負債	(57)
未実現評価益の純変動額	239,143
純利益	99,578
運用の結果による純資産の純増加額	90,841

■ 投資明細表（2021年10月31日現在）

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>有価証券に対する投資 4.3%</b>		
短期証券 4.3%		
定期性預金 4.0%		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
0.005% due 11/01/2021	\$ 8,088	\$ 8,088
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
0.005% due 11/01/2021	708	708
<b>BNP Paribas Bank</b>		
0.005% due 11/01/2021	55,641	55,641
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
0.005% due 11/01/2021	33	33
<b>Citibank N.A.</b>		
0.005% due 11/01/2021	54,147	54,147
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
0.005% due 11/01/2021	22,743	22,743
<b>DnB Bank ASA</b>		
0.005% due 11/01/2021	381	381
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
0.005% due 11/01/2021	108,295	108,295
<b>National Australia Bank Ltd.</b>		
0.005% due 11/01/2021	2,679	2,679
<b>Royal Bank of Canada</b>		
0.005% due 11/01/2021	11,140	11,140
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
0.005% due 11/01/2021	213,939	213,939
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
0.005% due 11/01/2021	37,946	37,946
		<b>515,740</b>
<b>米国短期証券 0.1%</b>		
0.050% due 02/24/2022	2,400	2,400
0.050% due 03/31/2022	7,200	7,198
		<b>9,598</b>
<b>米国短期証券(CMB) 0.2%</b>		
0.045% due 01/04/2022	24,700	24,697
<b>短期証券合計 (原価 550,036米ドル)</b>		<b>550,035</b>
<b>有価証券に対する投資合計 (原価 550,036米ドル)</b>		<b>550,035</b>
	口数 (単位:千)	
<b>関連ファンドに対する投資 96.2%</b>		
<b>その他投資 96.2%</b>		
<b>PIMCO Bermuda Income Fund (M)</b> (原価 10,775,944米ドル)	793,189	12,389,610
<b>関連ファンドに対する投資合計 (原価 10,775,944米ドル)</b>		<b>12,389,610</b>
<b>投資合計 100.5%</b> (原価 11,325,980米ドル)		<b>\$ 12,939,645</b>
<b>金融デリバティブ商品 (1.5%)</b> (原価またはプレミアム(純額) 0米ドル)		<b>(192,496)</b>
<b>その他の資産および負債 (純額) 1.0%</b>		<b>128,450</b>
<b>純資産 100.0%</b>		<b>\$ 12,875,599</b>

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書(2020年11月1日から2021年10月31日まで)

(単位：千米ドル)

投資収益	
受取利息(外国税控除後)	350,782
受取配当金(外国税控除後)	743
総収益	351,525
費用	
支払利息	138
雑費用	1
総費用	139
投資純利益(損失)	351,386
実現純利益(損失)	
有価証券に対する投資	73,734
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	91,472
OTC金融デリバティブ商品	58,029
外国為替	21,105
実現純利益(損失)	244,340
未実現評価益(損)の純変動額	
有価証券に対する投資	383,009
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	(39,664)
OTC金融デリバティブ商品	(9,312)
外貨建資産および負債	(5,601)
未実現評価益(損)の純変動額	328,432
純利益(損失)	572,772
運用の結果による純資産の純増加額	924,158
* 外国源泉課税	351



三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

■ 投資明細表(2021年10月31日現在)

有価証券に対する投資 118.5%		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	LifePoint Health, Inc.		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	債券等 27.1%	
銀行貸付債権 4.8%				3,837% due 11/16/2025	\$	1,038	\$	1,037	銀行および金融 10.7%
<b>AAdvantage Loyalty IP Ltd.</b>				<b>Lumen Technologies, Inc.</b>		2,353	2,329	<b>AGFC Capital Trust I</b>	
5,500% due 04/20/2028	\$	7,103	\$	2,337% due 03/15/2027				1.874% due 01/15/2067	\$
<b>Air Canada</b>		4,800	4,856	<b>Marriott Ownership Resorts, Inc.</b>		1,133	1,114	<b>AIB Group PLC</b>	EUR
4,250% due 08/11/2028				1,837% due 08/29/2025				2.875% due 05/30/2031	EUR
<b>Altea France S.A.</b>		4,669	4,660	<b>Mauser Packaging Solutions Holding Co.</b>		373	364	4.263% due 04/10/2025	\$
4,125% due 08/14/2026				3,337% due 04/03/2024				6.250% due 06/23/2025	EUR
<b>Aramark Intermediate HoldCo Corp.</b>		833	911	<b>Nielsen Finance LLC</b>		275	275	<b>Ally Financial, Inc.</b>	
1,837% due 03/11/2025				2,086% due 10/04/2023				8.000% due 11/01/2031	\$
<b>Avantor Funding, Inc.</b>		126	126	<b>Nouryon Finance BV</b>		3,466	3,445	<b>Alpha Bank S.A.</b>	EUR
2,500% due 11/21/2024				2,839% due 10/01/2025				2,500% due 02/05/2023	EUR
<b>Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC</b>		7,056	7,004	<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>		6,752	6,701	<b>Army Hawaii Family Housing Trust Certificates</b>	
2,250% due 02/12/2027				2,375% due 01/03/2022				0.490% due 06/15/2050	\$
<b>Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV</b>		396	395	<b>Paraxel International Corp.</b>		1,943	1,942	<b>Aroundtown S.A.</b>	
1,882% due 06/01/2024		2,269	2,255	<b>PetSmart Inc.</b>		2,693	2,700	5.375% due 03/21/2029	11,300
<b>Azalea TopCo, Inc.</b>		1,164	1,163	<b>PetSmart LLC</b>		796	782	<b>Atrium European Real Estate Ltd.</b>	EUR
3,587-3.629% due 07/24/2026		673	672	4,500% due 02/11/2028		3,680	3,680	3,000% due 09/11/2025	EUR
<b>Bausch Health Cos., Inc.</b>		2,315	2,315	<b>Pug LLC</b>				3.625% due 10/17/2022	350
2,837% due 11/27/2025				3,587% due 02/12/2027				<b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>	
3,087% due 06/02/2025		14,482	14,430	<b>Scientific Games International, Inc.</b>		1,171	1,157	2,528% due 11/18/2027	\$
<b>Boeing Co.</b>		9,837	9,860	2,837% due 08/14/2024				<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>	EUR
1,366% due 02/07/2022				<b>Sequa Mezzanine Holdings LLC</b>		678	678	1.875% due 01/09/2026	EUR
<b>Caesars Resort Collection LLC</b>		8,009	8,010	0,000-11.750% due 04/28/2024		7,750	7,391	2.625% due 04/28/2025	400
2,837% due 12/23/2024				7,750% due 11/28/2023		10,000% due 07/23/2025	18,867	3.625% due 09/24/2024	700
3,587% due 07/21/2025		197	196	<b>Serta Simmons Bedding LLC</b>		180	128	4,000% due 07/10/2022	200
<b>Camelot U.S. Acquisition 1 Co.</b>		12,685	12,685	4,500% due 11/08/2023		3,670	4,121	<b>Banco Bradesco S.A.</b>	\$
3,087% due 10/30/2026		22,626	22,605	<b>Sigma Holdco BV</b>				2,850% due 01/27/2023	4,714
<b>Carnival Corp.</b>	EUR	8,009	8,010	3,500% due 07/02/2025	EUR			<b>Banco BTG Pactual S.A.</b>	4,400
3,750% due 06/30/2025				<b>Sinclair Television Group, Inc.</b>		1,171	1,157	4,500% due 01/10/2025	4,400
3,750% due 06/30/2025		18,461	18,581	2,590% due 09/30/2026	\$			<b>Banco de Credito del Peru</b>	
4,000% due 10/18/2028		5,443	5,411	<b>SkyMiles IP Ltd.</b>		700	746	4,650% due 09/17/2024	PEN
<b>Cengage Learning, Inc.</b>		16,461	16,581	4,750% due 10/20/2027				<b>Banco Espirito Santo S.A.</b>	EUR
5,750% due 06/29/2026		1,840	1,840	<b>Sotera Health Holdings LLC</b>		3,362	3,354	2,625% due 05/08/2049	3,100
<b>Charter Communications Operating LLC</b>		3,820	3,874	3,250% due 12/11/2026		3,397	3,366	<b>Banco Santander S.A.</b>	EUR
1,840% due 02/01/2027				<b>SS&amp;C Technologies Holdings, Inc.</b>		1,837% due 04/16/2025		4,750% due 03/19/2025	4,200
<b>Commscope, Inc.</b>		2,801	2,802	<b>Sunshine Luxembourg VII Sarl</b>		4,061	4,062	<b>Bank of Ireland Group PLC</b>	7,500% due 05/19/2025
3,337% due 04/06/2026				4,500% due 10/01/2026				<b>Bank of Nova Scotia</b>	\$
<b>Cornerstone Building Brands, Inc.</b>		1,773	1,774	6,000% due 03/09/2023		35,487	35,513	4,900% due 06/04/2025	1,681
3,750% due 04/12/2028		7,500	7,514	<b>TransDigm, Inc.</b>		299	297	<b>Barclays Bank PLC</b>	5,281
<b>Dell International LLC</b>		16,422	16,360	2,337% due 08/22/2024		2,294	2,270	<b>Barclays Bank PLC</b>	GBP
2,000% due 09/19/2025				2,337% due 05/30/2025		10,130	10,016	3,250% due 02/12/2027	13,583
<b>DIRECTV Financing LLC</b>		1,460	1,444	2,337% due 12/09/2025				4,375% due 03/15/2028	3,400
5,750% due 07/22/2027				<b>U.S. Renal Care, Inc.</b>		2,173	2,164	4,972% due 05/16/2029	2,600
<b>Envision Healthcare Corp.</b>		27	27	5,125% due 06/26/2026		1,300	1,302	5,875% due 09/15/2024	GBP
3,837% due 10/10/2025				<b>Uber Technologies, Inc.</b>		3,587% due 04/04/2025	9,948	6,125% due 12/15/2025	7,700
<b>Forest City Enterprises LP</b>		4,729	4,717	3,587% due 02/25/2027		7,264	7,372	6,375% due 12/15/2025	GBP
3,587% due 12/08/2025				<b>United Airlines, Inc.</b>				7,125% due 06/15/2025	5,200
<b>Golden Nugget, Inc.</b>		1,711	1,715	4,500% due 04/21/2028		46,017	46,021	7,250% due 03/15/2023	16,760
3,250% due 10/04/2023				<b>Univision Communications, Inc.</b>				7,750% due 09/15/2022	\$
<b>GreenSky Holdings LLC</b>		9,745	9,682	3,750% due 03/15/2024				7,875% due 03/15/2023	1,200
3,375% due 03/31/2025				<b>Westmoreland Coal Co.</b>		756	227	7,875% due 09/15/2022	GBP
<b>Hertz Corp.</b>		9,377	9,387	15,000% due 03/15/2029		45,000	44,962	8,000% due 06/15/2024	\$
4,000% due 06/30/2028				<b>WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL</b>				<b>BGC Partners, Inc.</b>	1,464
<b>Hilton Worldwide Finance LLC</b>		132,910	132,103	2,504% due 02/09/2022				4,375% due 12/15/2025	1,700
1,839% due 06/22/2026				<b>Windstream Services II LLC</b>		1,116	1,122	<b>BDC Aviation Ltd.</b>	1,900
<b>Icon PLC</b>		23,345	23,601	7,250% due 09/21/2027				1.257% due 09/28/2023	1,907
3,000% due 07/03/2028				<b>Wyndham Hotels &amp; Resorts, Inc.</b>		2,425	2,410	<b>CA Immobilien Anlagen AG</b>	EUR
<b>iHeartCommunications, Inc.</b>		10,100	10,247	1,837% due 05/30/2025				1,000% due 10/27/2025	3,800
3,087% due 05/01/2026				<b>Zayo Group Holdings, Inc.</b>		9,264	9,133	<b>CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan</b>	EUR
<b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>		3,641	3,642	3,087% due 03/09/2027				0,800% due 10/12/2029	13,300
3,600-5.750% due 10/13/2022				<b>銀行貸付債権合計</b>		<b>611,550</b>		<b>European Core Fund</b>	15,125
8,000% due 11/27/2023		578	272	<b>原簿 603,943米ドル</b>				<b>CIFI Holdings Group Co. Ltd.</b>	\$
8,625% due 01/02/2024		261	157					4,450% due 08/17/2026	300
<b>Iqvia, Inc.</b>								<b>CIT Bank N.A.</b>	2,800
1,837% due 01/17/2025								2,969% due 09/27/2025	2,888
<b>Lealand Finance Co. BV</b>									
1,087-3.00% due 06/30/2025									
3,087% due 06/30/2024									



三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust</b>			<b>Ford Foundation</b>			5,500 due 06/01/2050	\$ 2,100	\$ 2,817
3,350 due 10/15/2029	\$ 389	\$ 399	2,415 due 06/01/2050	\$ 1,285	\$ 1,262	<b>Marriott International, Inc.</b>		
<b>American Airlines, Inc.</b>			2,815 due 06/01/2070	2,070	2,113	4,625 due 06/15/2030	516	588
5,750 due 04/20/2029	2,712	2,922	<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>			<b>Marriott Ownership Resorts, Inc.</b>		
<b>Arcenic Corp.</b>			0.177% due 11/15/2023	EUR 200	230	6,125 due 09/15/2025	650	683
6,000 due 05/15/2025	1,017	1,065	1.198% due 08/03/2022	\$ 200	200	<b>Massachusetts Institute of Technology</b>		
<b>Atlanta SpA</b>			1.360% due 02/15/2023	600	601	4,678% due 07/01/2114	65	98
1,875 due 02/12/2028	EUR 10,200	12,236	1.744% due 07/19/2024	EUR 10,300	12,128	5,800 due 07/01/2111	103	185
<b>Boeing Co.</b>			2.330% due 11/25/2025	2,950	3,531	<b>Melco Resorts Finance Ltd.</b>		
3,600 due 05/01/2034	\$ 100	105	2.386% due 02/17/2026	1,000	1,200	4,875 due 06/06/2025	400	396
5,040 due 05/01/2027	6,299	7,155	2.700% due 08/10/2026	\$ 1,600	1,600	5.375% due 12/04/2029	5,200	5,122
5,150 due 05/01/2030	9,825	11,468	2.979% due 08/03/2022	5,600	5,650	<b>Memorial Sloan-Kettering Cancer Center</b>		
5,705 due 05/01/2040	15,535	19,971	3.021% due 03/06/2024	EUR 9,400	11,372	2,955 due 01/01/2050	1,700	1,756
5,805 due 05/01/2050	12,129	16,651	3.087% due 01/09/2023	\$ 11,400	11,610	<b>MGM China Holdings Ltd.</b>		
5,930 due 05/01/2060	18,195	25,389	3.096% due 05/04/2023	4,900	4,986	5,250 due 06/18/2025	4,500	4,456
<b>Bombardier, Inc.</b>			3.250% due 09/15/2025	EUR 29,099	35,994	<b>Micron Technology, Inc.</b>		
7,500 due 12/01/2024	6,008	6,263	3.264% due 01/07/2022	\$ 4,920	4,932	4,663% due 02/15/2030	3,365	3,845
7,500 due 03/15/2025	274	282	3.330% due 03/28/2022	800	806	5.327% due 02/06/2029	2,532	2,990
7,875 due 04/15/2027	6,256	6,512	3.350% due 11/01/2022	12,100	12,299	<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>		
<b>British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust</b>			3.370% due 11/17/2023	600	617	0.566% due 12/15/2030	494	466
3,300 due 12/15/2032	95	98	3.375% due 11/13/2025	4,100	4,218	6.013% due 12/15/2028	GBP 923	1,376
<b>Broadcom, Inc.</b>			3.550% due 10/07/2022	8,555	8,694	<b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>		
2,450 due 02/15/2031	10,500	10,165	3.684% due 09/08/2024	1,500	1,554	1.012% due 01/13/2022	\$ 200	200
2,600 due 02/15/2033	300	289	3.810% due 01/09/2024	5,700	5,907	<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b>		
3,137 due 11/15/2035	8,450	8,314	3.815% due 11/02/2027	2,800	2,701	2.652% due 03/17/2026	EUR 13,100	16,275
3,187 due 11/15/2036	1,183	1,164	4.063% due 11/01/2024	2,200	2,310	3.522% due 09/17/2025	\$ 8,300	8,735
3,419% due 04/15/2033	1,667	1,723	4.125% due 08/17/2027	700	744	4.345% due 07/17/2027	\$ 8,700	9,440
3,469% due 04/15/2034	8,892	8,355	4.140% due 02/15/2023	5,700	5,861	4.810% due 09/17/2030	450	500
4,110% due 09/15/2028	13,065	14,741	4.250% due 09/20/2022	4,200	4,301	<b>NMG Holding Co., Inc.</b>		
4,150% due 11/15/2030	12,521	13,773	4.389% due 01/08/2026	2,600	2,785	7,125% due 04/01/2026	11,900	12,513
4,300% due 11/15/2032	12,473	13,900	4.535% due 03/06/2025	GBP 18,765	27,140	<b>Oracle Corp.</b>		
<b>Caesars Entertainment, Inc.</b>			4.542% due 08/01/2026	\$ 1,400	1,509	3,850 due 04/01/2060	1,835	1,920
8,250 due 07/01/2025	17,006	17,909	4.687% due 06/09/2025	1,100	1,177	4,000 due 07/15/2046	514	556
<b>Caesars Resort Collection LLC</b>			5.125% due 06/16/2025	4,100	4,454	<b>Ortho Clinical Diagnostics, Inc.</b>		
5,750 due 07/01/2025	2,700	2,840	5.584% due 03/18/2024	2,700	2,913	7,250 due 02/01/2028	934	996
<b>Carnival Corp.</b>			5.596% due 01/07/2022	7,400	7,463	7,375 due 06/01/2025	382	402
4,000 due 08/01/2028	14,100	14,118	<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>			<b>PeaceHealth Obligated Group</b>		
<b>Centene Corp.</b>			6.500% due 10/01/2025	7,563	7,792	3,218% due 11/15/2050	3,100	3,304
4,250 due 12/15/2027	1,462	1,533	<b>Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b>			<b>PetSmart, Inc.</b>		
4,625 due 12/15/2029	1,880	2,030	1.875% due 03/31/2028	EUR 9,788	11,733	4,750 due 02/15/2028	2,800	2,881
<b>Citrix Systems, Inc.</b>			<b>General Electric Co.</b>			<b>QVC, Inc.</b>		
3,300 due 03/01/2030	1,586	1,610	6.875% due 01/10/2039	\$ 12	18	5,900 due 03/15/2043	5,293	5,511
<b>Clear Channel International BV</b>			<b>Greene King Finance PLC</b>			<b>Roadster Finance DAC</b>		
6,625 due 08/01/2025	4,250	4,432	1.870% due 12/15/2034	GBP 4,156	4,813	2.375% due 12/08/2027	EUR 1,000	1,223
<b>Community Health Systems, Inc.</b>			3.593% due 03/15/2035	2,125	3,061	<b>Rolls-Royce PLC</b>		
4,750 due 02/15/2031	30,800	30,640	4.064% due 03/15/2035	611	907	3.375% due 06/18/2026	GBP 448	619
5,625 due 03/15/2027	37,147	38,919	5.106% due 03/15/2034	149	233	4,625 due 02/18/2026	EUR 9,538	12,285
6,000 due 01/15/2029	5,830	6,143	<b>Hilton Domestic Operating Co., Inc.</b>			5,750 due 10/15/2027	GBP 7,289	11,145
6,625 due 02/15/2025	28,950	30,144	3.625% due 02/15/2032	\$ 6,800	6,448	5,750% due 10/15/2027	\$ 1,168	1,294
8,000 due 03/15/2026	11,418	12,080	4,000% due 05/01/2031	1,100	1,107	<b>Royal Caribbean Cruises Ltd.</b>		
<b>CoStar Group, Inc.</b>			<b>IHO Verwaltungs GmbH</b>			9,125 due 06/15/2023	2,800	3,044
2,800 due 07/15/2030	2,000	2,028	3.625% due 05/15/2025	EUR 2,700	3,175	10,875 due 06/01/2023	7,622	8,537
<b>CVS Pass-Through Trust</b>			6,000% due 05/15/2027	\$ 3,520	3,656	11,500% due 06/01/2025	7,300	8,317
5,773% due 01/10/2033	148	177	6,375% due 05/15/2029	2,159	2,337	<b>Russian Railways Via RZD Capital PLC</b>		
7,507% due 01/10/2032	602	751	<b>IMCO NV</b>			7,467% due 03/25/2031	GBP 6,300	11,514
<b>CVS Pass-Through Trust Series 2009</b>			2,500% due 03/26/2025	EUR 1,500	1,823	<b>Sabine Pass Liquefaction LLC</b>		
8,353% due 07/10/2031	602	775	<b>Imperial Brands Finance PLC</b>			4,500% due 05/15/2030	\$ 5,613	6,399
<b>Delta Air Lines, Inc.</b>			3,500% due 07/26/2026	\$ 2,400	2,549	<b>Sands China Ltd.</b>		
3,625 due 03/15/2022	920	927	<b>Indian Railway Finance Corp. Ltd.</b>			2,850 due 03/08/2029	2,500	2,349
4,750 due 10/20/2028	100	111	3,249% due 02/13/2030	1,900	1,921	3,250% due 08/08/2031	2,200	2,065
7,000 due 05/01/2025	8,926	10,419	<b>InterContinental Hotels Group PLC</b>			3,800% due 01/08/2026	2,800	2,821
<b>Enable Midstream Partners LP</b>			3,375% due 10/08/2028	GBP 5,500	7,953	4,375% due 06/18/2030	2,700	2,765
4,950 due 05/15/2028	424	474	<b>IOVIA, Inc.</b>			5,125% due 08/08/2025	4,500	4,789
<b>Energy Transfer LP</b>			2,875% due 09/15/2025	EUR 400	467	5,400% due 08/08/2028	5,200	5,624
5,875% due 03/01/2022	450	452	<b>JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust</b>			<b>Six Flags Theme Parks, Inc.</b>		
<b>Exela Intermediate LLC</b>			4,000% due 11/15/2032	\$ 7,061	7,773	7,000% due 07/01/2025	921	980
10,000% due 07/15/2023	880	738	<b>Kraft Heinz Foods Co.</b>			<b>Surgery Center Holdings, Inc.</b>		
<b>Expedia Group, Inc.</b>			3,875% due 05/15/2027	5,522	6,066	10,000% due 04/15/2027	400	430
4,625 due 08/01/2027	3,700	4,144	4,250% due 03/01/2031	4,662	5,495	<b>Syngenta Finance NV</b>		
6,250 due 05/01/2025	2,939	3,358				3,375% due 04/16/2026	EUR 25,000	31,414

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
4.441% due 04/24/2023	\$ 5,300	5,521	<b>Charter Communications Operating LLC</b>			3.300% due 03/15/2027	\$ 3,838	\$ 3,946
4.892% due 04/24/2025	800	867	3.900% due 06/01/2052	\$ 10,000	\$ 10,133	3.300% due 12/01/2047	14,666	15,024
5.182% due 04/24/2028	1,800	2,013	3.950% due 06/30/2062	3,500	3,433	3.300% due 08/01/2040	1,542	1,457
<b>Tenet Healthcare Corp.</b>			4.400% due 12/01/2061	9,500	10,102	3.400% due 08/15/2024	6,570	6,803
4.625% due 07/15/2024	69	70	4.800% due 03/01/2050	3,818	4,345	3.450% due 07/01/2025	12,102	12,620
<b>Teva Pharmaceutical Finance Co. BV</b>			<b>China Resources Gas Group Ltd.</b>			3.500% due 06/15/2025	8,068	8,455
3.650% due 11/10/2021	900	901	4.500% due 04/05/2022	400	406	3.500% due 08/01/2050	7,200	6,854
<b>Teva Pharmaceutical Finance IV BV</b>			<b>Constellation Oil Services Holding</b>			3.750% due 02/15/2024	10,188	10,180
3.650% due 11/10/2021	418	419	<b>S.A. 10.000%</b> due 11/09/2024	951	277	3.750% due 07/01/2028	13,613	14,214
<b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV</b>			<b>Corning, Inc.</b>			3.750% due 08/15/2042	418	397
1.250% due 03/31/2023	EUR 1,800	2,078	5.450% due 11/15/2079	1,291	1,736	3.850% due 11/15/2023	1,830	1,896
3.250% due 04/15/2022	12,900	15,004	<b>DIRECTV Holdings LLC</b>			3.950% due 12/01/2047	1,900	1,879
6.000% due 01/31/2025	2,700	3,364	5.875% due 08/15/2027	6,000	6,227	4.000% due 12/01/2046	3,144	3,129
<b>Times Square Hotel Trust</b>			<b>FirstEnergy Corp.</b>			4.250% due 08/01/2023	3,735	3,891
8.528% due 08/01/2026	\$ 1,296	1,393	3.400% due 03/01/2050	300	298	4.250% due 03/15/2046	5,219	5,316
<b>Travel + Leisure Co.</b>			<b>Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.</b>			4.300% due 03/15/2045	2,800	2,838
4.250% due 03/01/2022	115	115	4.375% due 09/19/2022	11,935	12,285	4.450% due 04/15/2042	4,333	4,419
6.000% due 04/01/2027	1,464	1,594	6.000% due 11/27/2023	28,785	31,395	4.500% due 07/01/2040	39,210	40,863
<b>Triumph Group, Inc.</b>			<b>Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.</b>			4.500% due 12/15/2041	743	745
6.250% due 09/15/2024	1,541	1,541	2.250% due 11/22/2024	EUR 100	120	4.550% due 07/01/2030	49,585	54,066
<b>U.S. Renal Care, Inc.</b>			2.948% due 01/24/2024	450	548	4.600% due 06/15/2043	1,794	1,839
10.625% due 07/15/2027	1,282	1,331	4.950% due 03/23/2027	\$ 1,800	1,983	4.650% due 08/01/2028	100	109
<b>Uber Technologies, Inc.</b>			4.950% due 02/06/2028	1,000	1,102	4.750% due 02/15/2044	2,707	2,803
4.500% due 08/15/2029	3,365	3,383	5.150% due 02/11/2026	5,700	6,274	4.950% due 07/01/2050	29,590	28,758
7.500% due 05/15/2025	571	609	6.510% due 03/07/2022	6,638	6,770	<b>Petrobras Global Finance BV</b>		
<b>United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust</b>			7.288% due 08/16/2037	500	676	6.250% due 12/14/2026	GBP 6,234	9,528
5.875% due 10/15/2027	18,969	21,261	8.625% due 04/28/2034	2,372	3,420	6.625% due 01/16/2034	2,900	4,494
<b>United Airlines, Inc.</b>			<b>Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC</b>			<b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>		
4.375% due 04/15/2026	1,200	1,243	1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	36,674	5.375% due 04/12/2027	\$ 11,932	626
<b>Vale Overseas Ltd.</b>			2.950% due 04/15/2025	5,000	6,128	5.500% due 04/12/2037	10,372	545
3.750% due 07/08/2030	2,200	2,241	2.950% due 01/27/2029	\$ 23,200	22,716	6.000% due 05/16/2024	8,283	435
6.250% due 08/10/2026	3,616	4,198	<b>Helmerich &amp; Payne, Inc.</b>			6.000% due 11/15/2026	13,183	692
6.875% due 11/21/2036	1,207	1,580	2.900% due 09/29/2031	9,500	9,467	9.000% due 11/17/2021	400	21
6.875% due 11/10/2039	951	1,255	<b>iHeartCommunications, Inc.</b>			9.750% due 05/17/2035	4,730	248
<b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>			4.750% due 01/15/2028	60,140	60,596	<b>Petroleos Mexicanos</b>		
3.875% due 08/15/2029	3,800	3,668	6.375% due 05/01/2026	9,272	9,655	2.750% due 04/21/2027	EUR 1,200	1,303
4.125% due 08/15/2031	3,500	3,627	8.375% due 05/01/2027	8,256	8,803	5.350% due 02/12/2028	\$ 880	880
<b>VOC Escrow Ltd.</b>			<b>Intelsat Connect Finance S.A.</b>			5.950% due 01/28/2031	23,330	22,999
5.000% due 02/15/2028	1,100	1,093	9.500% due 02/15/2023	3,960	997	6.490% due 01/23/2027	6,170	6,567
<b>Western Midstream Operating LP</b>			<b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>			6.500% due 03/13/2027	9,282	9,807
2.222% due 01/13/2023	1,048	1,040	5.500% due 08/01/2023	12,486	6,290	6.500% due 01/23/2029	21,284	22,207
<b>Wynn Las Vegas LLC</b>			8.000% due 02/15/2024	7,115	7,284	6.750% due 09/21/2047	390	346
5.250% due 05/15/2027	1,700	1,726	8.500% due 10/15/2024	57,550	29,710	6.840% due 01/23/2030	31,836	33,346
<b>Wynn Macau Ltd.</b>			9.750% due 07/15/2025	29,732	14,978	6.950% due 01/28/2060	7,790	6,925
5.125% due 12/15/2029	2,800	2,528	<b>Intelsat Luxembourg S.A.</b>			7.690% due 01/23/2050	2,430	2,326
5.500% due 01/15/2026	6,500	6,122	7.750% due 06/01/2049	20,642	310	<b>Prosus NV</b>		
5.500% due 10/01/2027	1,000	933	<b>Level 3 Financing, Inc.</b>			1.985% due 07/13/2033	EUR 5,600	6,273
5.625% due 08/26/2028	1,198	1,120	3.875% due 11/15/2029	2,218	2,332	3.061% due 07/13/2031	\$ 12,400	12,046
		<b>957,893</b>	<b>Lumen Technologies, Inc.</b>			<b>Qatar Petroleum</b>		
<b>公共事業 8.8%</b>			4.000% due 02/15/2027	1,238	1,246	3.125% due 07/12/2041	2,450	2,478
<b>Aker BP ASA 3.750%</b>			<b>Netflix, Inc.</b>			<b>Rio Oil Finance Trust Series 2014-1</b>		
due 01/15/2030	1,300	1,390	3.625% due 05/15/2027	EUR 3,900	5,196	9.250% due 07/09/2024	1,763	1,927
<b>Altice Financing S.A.</b>			3.625% due 06/15/2030	18,776	26,021	<b>Rio Oil Finance Trust Series 2014-3</b>		
2.250% due 01/15/2025	EUR 1,340	1,498	3.875% due 11/15/2029	8,217	11,512	9.750% due 01/09/2027	656	768
3.000% due 01/15/2028	2,700	2,971	4.625% due 05/15/2029	7,800	11,051	<b>Rio Oil Finance Trust Series 2018-1</b>		
4.250% due 08/15/2029	3,510	3,993	4.875% due 06/15/2030	\$ 3,100	3,646	8.200% due 04/09/2028	2,588	2,962
5.750% due 08/15/2029	\$ 12,389	12,203	5.375% due 11/15/2029	980	1,183	<b>Southern California Edison Co.</b>		
<b>Altice France S.A.</b>			<b>Noble Finance Co.</b>			4.875% due 03/01/2049	346	436
8.125% due 02/01/2027	2,744	2,953	11.000% due 02/15/2028	2,086	2,318	<b>Sprint Communications, Inc.</b>		
<b>AT&amp;T, Inc.</b>			<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>			6.000% due 11/15/2022	3,934	4,132
2.250% due 02/01/2032	1,475	1,420	6.720% due 12/01/2022	106	105	<b>Sprint Corp.</b>		
3.100% due 02/01/2043	12,371	11,966	<b>Oi Movel S.A.</b>			7.125% due 06/15/2024	7,766	8,785
3.300% due 02/01/2052	13,551	13,322	8.750% due 07/30/2026	33,044	34,300	7.625% due 02/15/2025	1,000	1,164
3.500% due 06/01/2041	14,644	15,028	<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>			7.625% due 03/01/2026	839	1,078
3.500% due 02/01/2061	13,084	12,776	2.100% due 08/01/2027	1,910	1,854	7.875% due 09/15/2023	25,749	28,581
3.650% due 06/01/2051	13,724	14,296	2.500% due 02/01/2031	2,800	2,486	<b>Sprint Spectrum Co. LLC</b>		
3.850% due 06/01/2060	10,556	11,162	2.950% due 03/01/2026	8,630	8,829	4.738% due 03/20/2025	4,200	4,436
<b>CCO Holdings LLC</b>			3.000% due 06/15/2028	11,288	11,383	5.152% due 03/20/2028	3,163	3,574
4.500% due 09/15/2030	1,549	1,579	3.150% due 01/01/2026	15,753	16,227			
			3.250% due 06/15/2023	8,640	8,821			

三井住友・ピコモ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>State Grid Overseas Investment BVI Ltd.</b>								
2.750% due 05/04/2022	\$ 1,700	\$ 1,716						
<b>Systems Energy Resources, Inc.</b>								
2.140% due 12/09/2025	6,100	6,245						
<b>Tencent Holdings Ltd.</b>								
3.680% due 04/22/2041	6,100	6,380						
<b>T-Mobile USA, Inc.</b>								
2.250% due 02/15/2026	6,600	6,641						
3.375% due 04/15/2029	7,400	7,613						
3.500% due 04/15/2031	7,400	7,668						
<b>Topaz Solar Farms LLC</b>								
4.875% due 09/30/2039	5,791	6,545						
5.750% due 09/30/2039	8,164	9,927						
<b>Transocean Guardian Ltd.</b>								
5.875% due 01/15/2024	202	198						
<b>Transocean Phoenix 2 Ltd.</b>								
7.750% due 10/15/2024	1,050	1,069						
<b>Transocean Proteus Ltd.</b>								
6.250% due 12/01/2024	30	30						
<b>Transocean, Inc.</b>								
7.250% due 11/01/2025	2,585	2,146						
7.500% due 01/15/2026	1,783	1,438						
8.000% due 02/01/2027	3,062	2,343						
<b>United Group BV</b>								
3.125% due 02/15/2026	EUR 1,842	2,055						
4.875% due 07/01/2024	565	662						
<b>Univision Communications, Inc.</b>								
5.125% due 02/15/2025	\$ 14,429	14,663						
6.625% due 06/01/2027	2,048	2,218						
9.500% due 05/01/2025	1,646	1,784						
<b>Valaris Ltd.</b>								
8.250% due 04/30/2028	519	541						
<b>Verizon Communications, Inc.</b>								
3.400% due 03/22/2041	6,750	7,090						
<b>Viasat, Inc.</b>								
5.625% due 09/15/2025	3,363	3,416						
6.500% due 07/15/2028	3,300	3,469						
<b>Windstream Escrow LLC</b>								
7.750% due 08/15/2028	11,607	12,292						
<b>Zayo Group Holdings, Inc.</b>								
4.000% due 03/01/2027 6.125% due 03/01/2028	4,942	4,806						
	1,762	1,722						
	<b>1,119,848</b>							
<b>社債券等合計</b>	<b>3,436,987</b>							
(原価 3,364,296米ドル)								
<b>国債</b>								
0.3%								
<b>CBL &amp; Associates HoldCo II LLC</b>								
7.000% due 11/15/2028	82	82						
<b>Multiplan Corp.</b>								
6.000% due 10/15/2027	5,700	4,552						
<b>Nationwide Building Society</b>								
10.250% due 09/20/2166	GBP 7,405	19,792						
<b>Stichting AK Rabobank Certificaten</b>								
19.436% due 01/01/0001	EUR 2,946	4,744						
<b>転換社債型新株予約権付社債券等合計</b>		<b>29,170</b>						
(原価 25,232米ドル)								
<b>地方債等 0.6%</b>								
<b>Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010</b>								
6.630% due 02/01/2035	\$ 655	811						
6.725% due 04/01/2035	310	384						
7.350% due 07/01/2035	545	693						
<b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003</b>								
5.100% due 06/01/2033	1,110	1,179						
<b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015</b>								
7.750% due 01/01/2042	130	148						
<b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017</b>								
7.045% due 01/01/2029	315	360						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2001</b>								
5.125% due 07/01/2031	\$ 17,360	\$ 17,143						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006</b>								
5.000% due 07/01/2031	420	409						
5.250% due 07/01/2023	500	496						
5.250% due 07/01/2026	1,000	990						
5.250% due 07/01/2049	610	601						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007</b>								
5.000% due 07/01/2027	700	691						
5.000% due 07/01/2028	75	74						
5.250% due 07/01/2032	400	396						
5.250% due 07/01/2034	400	398						
5.250% due 07/01/2037	410	407						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008</b>								
5.000% due 07/01/2023	300	294						
5.125% due 07/01/2028	130	127						
5.500% due 07/01/2032	10,780	10,605						
5.700% due 07/01/2023	685	657						
6.000% due 07/01/2038	4,070	4,065						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009</b>								
5.750% due 07/01/2038	550	534						
6.000% due 07/01/2039	215	210						
6.500% due 07/01/2037	400	402						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011</b>								
5.375% due 07/01/2030	685	664						
5.750% due 07/01/2041	1,900	1,850						
6.500% due 07/01/2040	120	120						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012</b>								
5.000% due 07/01/2023	1,010	929						
5.000% due 07/01/2041	3,660	3,262						
5.125% due 07/01/2037	800	734						
5.500% due 07/01/2026	1,900	1,774						
5.500% due 07/01/2039	4,215	3,941						
<b>Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014</b>								
8.000% due 07/01/2035	13,450	11,870						
<b>Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021</b>								
2.246% due 06/01/2029	1,600	1,602						
3.000% due 06/01/2046	800	822						
<b>Puerto Rico, Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010</b>								
6.050% due 07/01/2032	800	769						
6.125% due 07/01/2040	3,000	2,914						
<b>Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016</b>								
0.838% due 09/25/2056	783	784						
<b>Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017</b>								
0.838% due 01/25/2057	7,213	7,194						
<b>Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014</b>								
8.250% due 07/01/2024	400	403						
<b>地方債等合計</b>		<b>81,706</b>						
(原価 32,299米ドル)								
<b>米国政府機関債 23.3%</b>								
<b>Fannie Mae</b>								
2.500% due 10/01/2022	34	36						
3.000% due 07/01/2023	23	24						
3.000% due 11/01/2025	40	42						
3.000% due 12/01/2025	\$ 30	\$ 31						
3.000% due 10/01/2026	28	29						
3.000% due 01/01/2027	289	303						
3.000% due 02/01/2027	1,772	1,857						
3.000% due 01/01/2034	96	101						
3.000% due 01/01/2035	66	70						
3.000% due 06/01/2035	253	267						
3.000% due 07/01/2035	1,871	1,967						
3.000% due 09/01/2035	533	558						
3.000% due 09/01/2049	238	254						
3.000% due 03/01/2050	23,295	24,555						
3.500% due 08/01/2042	27	29						
3.500% due 09/01/2047	242	257						
3.500% due 03/01/2048	77	81						
3.500% due 05/01/2049	107	113						
3.500% due 06/01/2049	1	1						
3.500% due 07/01/2049	33	35						
3.500% due 08/01/2049	45	47						
3.500% due 10/01/2049	14	15						
3.500% due 12/01/2049	3	3						
3.500% due 01/01/2050	21	22						
3.500% due 02/01/2050	31	32						
3.500% due 03/01/2050	220	233						
3.500% due 05/01/2050	1,653	1,743						
3.500% due 06/01/2050	430	455						
3.500% due 07/01/2050	1,163	1,217						
3.500% due 10/01/2050	238	251						
3.500% due 12/01/2050	197	209						
3.500% due 01/01/2051	10,499	11,078						
3.500% due 04/01/2051	1,000	1,060						
4.000% due 07/01/2040	9	9						
4.000% due 12/01/2041	65	69						
4.000% due 07/01/2042	77	81						
4.000% due 08/01/2042	24	25						
4.000% due 09/01/2042	101	109						
4.000% due 11/01/2045	129	140						
4.000% due 03/01/2047	49	53						
4.000% due 04/01/2								

# 三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジあり / 3 カ月決算型)

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
6.000% due 08/01/2031	\$ 25	\$ 25	<b>Ginnie Mae</b>			2.625% due 02/15/2029	\$ 5,000	\$ 5,402
6.000% due 06/01/2032	1	2	4.000% due 06/20/2041	\$ 2	\$ 2	2.750% due 08/15/2047	2,830	3,291
6.000% due 09/01/2039	388	427	4.000% due 04/20/2047	2,442	2,617	3.000% due 08/15/2048	155	189
6.000% due 10/01/2047	8	9	4.000% due 05/20/2047	43,961	47,062	3.000% due 02/15/2049	77	94
6.111% due 05/25/2048	2,815	632	4.000% due 06/20/2047	20,833	22,322	3.125% due 05/15/2048	180	225
6.500% due 01/01/2037	3	4	4.000% due 07/20/2047	18,616	19,977	<b>U.S. Treasury Notes</b>		
6.500% due 10/01/2037	5	5	4.000% due 02/20/2048	13,086	14,042	1.125% due 02/29/2028	318,900	313,936
7.000% due 09/01/2031	32	32	4.000% due 05/20/2049	47,040	50,125	1.125% due 02/15/2031	773	746
7.000% due 05/01/2037	1	1	4.000% due 02/20/2050	574	609	1.625% due 02/15/2026	2,200	2,250
7.500% due 09/01/2032	7	7	4.000% due 07/20/2050	263	279	2.000% due 02/15/2025	11,021	11,437
			4.000% due 08/20/2050	41	44	2.000% due 08/15/2025	1,400	1,453
<b>Fannie Mae, TBA</b>			4.000% due 09/20/2050	3,099	3,294	2.000% due 11/15/2026	800	831
2.000% due 12/01/2036	6,600	6,762	4.000% due 10/20/2050	99,793	106,077	2.250% due 11/15/2024	12,300	12,848
2.000% due 12/01/2051	55,100	54,989	4.500% due 01/20/2040	82	88	2.250% due 02/15/2027	28,000	29,447
2.500% due 12/01/2036	3,000	3,116	4.500% due 03/20/2040	8	8			
2.500% due 01/01/2052	72,800	74,545	5.000% due 08/20/2030	219	239	<b>米国財務省証券合計</b>		<b>1,158,496</b>
3.000% due 01/01/2052	26,900	27,997	5.000% due 05/20/2040	363	395	<b>(原価 1,093,770米ドル)</b>		
3.500% due 12/01/2051	744,350	786,336	5.000% due 11/20/2040	19	20	<b>モーニングスター証券 31.5%</b>		
4.000% due 12/01/2051	113,500	121,536	5.000% due 04/20/2041	7	8	<b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>		
			5.500% due 05/20/2038	8	8	1.034% due 07/25/2035	9,806	9,811
<b>Freddie Mac</b>			5.500% due 06/20/2038	70	78	1.784% due 07/25/2035	715	718
3.000% due 01/01/2026	792	831	5.500% due 07/20/2038	77	84	<b>ACE Securities Corporate Home Equity Loan Trust</b>		
3.000% due 09/01/2026	2,282	2,406	5.500% due 08/20/2038	378	423	0.244% due 08/25/2036	5,423	5,330
3.000% due 10/01/2026	39	41	5.500% due 09/20/2038	77	87	0.884% due 01/25/2035	988	982
3.000% due 11/01/2026	10	11	5.500% due 10/20/2038	16	18	0.914% due 02/25/2034	5,384	5,415
3.000% due 06/01/2034	142	149	5.500% due 01/20/2039	11	12	0.989% due 08/25/2035	5,023	5,035
3.000% due 07/01/2034	767	807	5.500% due 02/20/2039	44	49	<b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>		
3.000% due 08/01/2035	32	33	5.500% due 09/20/2039	58	65	1.039% due 08/25/2035	4,257	4,243
3.000% due 11/01/2046	80	85	5.500% due 10/20/2039	11	12	<b>AFC Home Equity Loan Trust</b>		
3.000% due 12/01/2047	2,548	2,668	5.500% due 11/20/2039	317	355	0.899% due 06/25/2029	1,875	1,500
3.000% due 03/01/2048	145	152	5.500% due 12/20/2039	26	28	<b>Alternative Loan Trust</b>		
3.500% due 10/01/2039	187	199	5.500% due 01/20/2040	200	220	0.276% due 09/20/2046	1,069	986
3.500% due 10/01/2047	2,916	3,097	5.500% due 06/20/2040	274	317	0.429% due 01/25/2037	2	121
3.500% due 12/01/2047	946	1,006	5.500% due 07/20/2040	502	552	0.449% due 07/25/2036	7,262	7,179
3.500% due 03/01/2048	3,619	3,839	<b>Ginnie Mae, TBA</b>			0.469% due 08/25/2046	10,715	9,957
3.500% due 04/01/2048	1,555	1,654	2.000% due 12/01/2051	19,000	19,199	0.489% due 05/25/2036	14,309	13,330
3.500% due 10/01/2048	1,488	1,573	2.500% due 11/01/2051	5,400	5,551	0.506% due 03/20/2046	6,753	5,755
3.500% due 12/01/2048	3,458	3,664	2.500% due 12/01/2051	83,000	85,154	0.589% due 12/25/2046	17,880	17,504
3.500% due 03/01/2049	2,256	2,382	3.000% due 11/01/2051	7,740	8,038	0.629% due 07/25/2036	22,397	20,997
3.500% due 05/01/2049	129	136	3.000% due 12/01/2052	492,260	510,566	0.689% due 01/25/2036	2,512	2,447
3.500% due 06/01/2049	1	1	4.000% due 11/01/2051	65,423	69,341	0.726% due 12/20/2035	6,616	6,356
3.500% due 07/01/2049	1	1	4.000% due 12/01/2051	696,135	737,713	1.437% due 08/25/2035	481	436
3.500% due 10/01/2049	278	294	<b>米国政府機関債合計</b>		<b>2,954,394</b>	2.248% due 09/25/2034	1,126	1,106
3.500% due 12/01/2049	35	37	<b>(原価 2,953,245米ドル)</b>			3.070% due 08/25/2035	523	511
3.500% due 01/01/2050	51	53	<b>米国財務省証券 0.1%</b>			5.500% due 08/25/2035	5,688	5,441
3.500% due 02/01/2050	1,819	1,919	<b>Treasury Inflation Protected Securities</b>			5.500% due 08/25/2036	66	67
3.500% due 04/01/2050	203	214	0.125% due 10/15/2024	45,743	49,163	5.500% due 02/25/2036	17	13
3.500% due 05/01/2050	100	105	0.125% due 07/15/2030	60,498	67,371	6.000% due 07/25/2037	26,922	18,113
3.500% due 07/01/2050	1,521	1,607	0.250% due 07/15/2029	166,422	186,534	7.000% due 10/25/2037	31,416	15,978
3.500% due 09/01/2050	17	18	0.250% due 02/15/2050	25,325	29,563	<b>Ameriquest Mortgage Securities Trust</b>		
3.500% due 05/01/2051	93	100	0.375% due 01/15/2027	5,259	5,835	0.599% due 04/25/2036	4,473	4,460
4.000% due 09/01/2033	1	1	0.375% due 07/15/2027	1,409	1,576	0.704% due 03/25/2036	27,500	27,108
4.000% due 04/01/2047	451	487	0.625% due 02/15/2043	2,618	3,188	<b>Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>		
4.000% due 05/01/2047	441	476	0.750% due 07/15/2028	102,114	117,490	1.157% due 09/25/2032	264	274
4.000% due 08/01/2047	876	944	0.750% due 02/15/2042	6,174	7,683	1.844% due 10/25/2034	9,913	10,095
4.000% due 08/01/2048	1,013	1,086	0.750% due 02/15/2045	20,098	25,285	<b>Argent Mortgage Loan Trust</b>		
4.000% due 09/01/2048	411	440	0.875% due 01/15/2029	56,416	65,535	0.569% due 05/25/2035	22,537	21,476
4.000% due 12/01/2048	15,327	16,564	0.875% due 02/15/2047	24,252	31,929	<b>Argent Securities Trust</b>		
4.000% due 02/01/2049	5,758	6,223	1.000% due 02/15/2046	10,622	14,170	0.449% due 04/25/2036	8,096	3,596
4.000% due 03/01/2049	440	475	1.000% due 02/15/2048	23,075	31,465	<b>Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>		
5.000% due 06/01/2034	177	191	1.000% due 02/15/2049	67,730	93,461	0.854% due 10/25/2035	36,400	35,859
5.000% due 08/01/2035	44	46	1.375% due 02/15/2044	3,052	4,264	2.789% due 09/25/2033	1,288	1,296
5.000% due 01/01/2037	3	4	2.125% due 02/15/2040	3,164	4,783	<b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>		
5.000% due 01/01/2038	2	2	2.125% due 02/15/2041	1,749	2,679	0.749% due 03/25/2035	16,991	16,964
5.500% due 01/01/2035	573	607	<b>U.S. Treasury Bonds</b>			0.824% due 06/25/2035	10,728	10,697
5.500% due 05/01/2037	2	3	2.250% due 08/15/2046	100	106			
5.500% due 06/01/2037	209	222	2.375% due 05/15/2029	32,200	34,267			
5.750% due 05/01/2037	223	251						
6.000% due 07/01/2037	46	50						
6.460% due 06/15/2042	40	8						

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust</b>			<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>			<b>CWABS Asset-Backed Certificates Trust</b>		
0.554% due 05/25/2036	\$ 37,857	\$ 39,141	0.369% due 12/25/2036	\$ 3,767	\$ 3,724	0.329% due 03/25/2037	\$ 33,000	\$ 32,081
<b>Atrium Hotel Portfolio Trust</b>			0.479% due 01/25/2037	645	648	0.329% due 03/25/2047	26,535	25,070
1.520% due 06/15/2035	18,395	18,343	0.689% due 03/25/2037	5,700	5,699	0.349% due 09/25/2046	5,600	5,392
<b>Bank of America Alternative Loan Trust</b>			0.909% due 09/25/2037	17,435	15,931	0.809% due 05/25/2036	2,106	1,730
4.310% due 04/25/2022	71	70	1.561% due 08/25/2036	16,176	7,397	1.214% due 12/25/2034	530	532
6.000% due 07/25/2046	1,859	1,808	2.824% due 08/25/2036	5,347	5,477	1.664% due 03/25/2035	5,500	5,621
<b>Bank of America Funding Trust</b>			2.995% due 07/25/2037	3,249	3,153	5.633% due 06/25/2035	8,644	8,945
2.160% due 11/20/2034	367	393	3.000% due 11/25/2038	98	98	<b>CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust</b>		
2.408% due 06/20/2036	5,461	5,524	7.250% due 05/25/2036	10,356	7,171	0.340% due 03/15/2030	1,005	997
3.191% due 02/20/2035	1,635	1,710	<b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>			<b>Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust</b>		
3.413% due 01/20/2047	116	113	1.124% due 05/25/2035	6,300	6,283	0.409% due 03/25/2037	10,515	6,490
<b>Bayview Opportunity Master Fund Iva Trust</b>			<b>Commercial Mortgage Trust</b>			0.419% due 08/25/2037	24,960	21,548
3.475% due 08/28/2034	1,296	1,306	0.176% due 04/10/2047	33,000	139	0.589% due 09/25/2047	14,982	14,267
<b>BCAP LLC Trust</b>			<b>Conseco Finance Corp.</b>			<b>Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust</b>		
0.483% due 07/26/2036	15	15	6.870% due 04/01/2030	276	277	2.716% due 10/25/2035	9,954	9,966
5.876% due 04/26/2037	3,224	2,280	6.920% due 12/01/2030	1,621	1,751	<b>Deutsche Mortgage &amp; Asset Receiving Corp.</b>		
6.000% due 04/26/2036	5,434	3,966	7.500% due 03/01/2030	49,985	27,302	0.806% due 11/27/2036	2,263	2,254
<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>			7.600% due 04/15/2028	5,067	1,671	<b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage Loan Trust</b>		
3.031% due 11/25/2034	222	224	<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b>			0.270% due 10/19/2036	8,652	7,796
<b>Bear Stearns Alternative-A Trust</b>			0.229% due 06/25/2035	1,851	1,797	0.680% due 10/19/2045	1,248	1,281
0.429% due 04/25/2037	7,174	7,061	0.229% due 06/25/2037	15,865	15,211	0.740% due 09/19/2045	5,927	4,519
0.509% due 11/25/2046	9,417	9,307	0.229% due 07/25/2037	10,725	10,573	<b>Dragon Finance BV</b>		
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust</b>			0.239% due 04/25/2047	2,361	2,352	1.074% due 07/13/2023	GBP 88	119
0.329% due 02/25/2037	4,140	6,911	0.249% due 05/25/2037	2,275	2,273	<b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>		
0.489% due 05/25/2036	9,370	3,758	0.269% due 11/25/2047	6,595	7,005	1.189% due 05/25/2037	\$ 1,369	1,373
0.629% due 04/25/2036	7,329	7,304	0.309% due 08/25/2037	25,800	24,586	<b>EMC Mortgage Loan Trust</b>		
0.689% due 02/25/2036	4,146	4,143	0.319% due 05/25/2037	14,583	14,181	1.139% due 04/25/2042	8,542	8,589
0.734% due 12/25/2035	2,531	2,533	0.319% due 10/25/2047	13,709	13,621	<b>Encore Credit Receivables Trust</b>		
1.109% due 06/25/2034	5,452	5,453	0.339% due 02/25/2036	1,500	1,478	1.019% due 11/25/2035	6,510	6,532
1.139% due 11/25/2035	3,537	3,515	0.509% due 01/25/2045	3,128	3,117	<b>Eurosil-UK PLC</b>		
1.139% due 08/25/2037	19,530	18,956	0.569% due 05/25/2036	10,003	9,041	0.837% due 09/13/2045	GBP 4,867	6,528
1.169% due 12/25/2035	9,268	7,971	0.588% due 08/26/2033	261	258	1.017% due 06/13/2045	9,559	13,106
6.511% due 05/25/2036	9,370	719	0.689% due 06/25/2036	3,874	3,856	<b>FBR Securitization Trust</b>		
<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>			0.749% due 04/25/2036	3,433	3,436	0.764% due 10/25/2035	\$ 20,968	19,248
2.114% due 06/25/2035	924	955	0.789% due 03/25/2036	1,745	1,673	0.769% due 10/25/2035	3,391	3,393
5.500% due 11/25/2033	4,915	5,134	1.184% due 06/25/2035	7,000	7,038	0.854% due 09/25/2035	7,500	7,455
<b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>			<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>			<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>		
0.289% due 02/25/2037	6,265	6,056	2.463% due 06/25/2034	1	1	0.399% due 11/25/2036	59,328	54,834
<b>BHP Trust</b>			2.685% due 11/25/2034	9	9	0.409% due 04/25/2036	4,604	4,533
2.658% due 08/15/2036	27,720	27,646	2.971% due 10/20/2035	5,359	5,309	0.779% due 01/25/2036	10,000	9,756
<b>Business Loan Express Business Loan Trust</b>			3.041% due 11/25/2037	5,011	4,990	0.794% due 05/25/2036	3,142	3,140
0.379% due 09/25/2038	1,084	1,048	3.379% due 03/25/2037	5,776	5,817	0.944% due 04/25/2035	4,301	4,289
0.639% due 09/25/2038	525	477	5.500% due 11/25/2035	6,558	4,966	<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>		
1.189% due 09/25/2038	38	35	6.000% due 07/25/2036	20,665	15,160	0.589% due 05/25/2035	1,502	1,002
<b>BX Trust</b>			6.000% due 11/25/2037	4,613	3,453	4.911% due 05/25/2035	1,502	209
1.726% due 10/15/2036	16,400	16,363	<b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>			<b>Fremont Home Loan Trust</b>		
1.975% due 10/15/2036	18,000	17,963	2.039% due 01/25/2033	1,359	1,374	0.369% due 02/25/2037	8,324	6,902
1.977% due 10/15/2036	6,000	5,949	<b>Credit Suisse Mortgage Capital</b>			1.109% due 01/25/2035	6,483	6,488
<b>Canterbury Finance No.1 PLC</b>			0.256% due 11/27/2036	11,400	13,684	<b>Glen Securities Finance DAC</b>		
1.400% due 05/16/2056	GBP 25,377	35,053	3.000% due 01/29/2036	814	823	0.000% due 10/28/2038	EUR 12,700	14,692
<b>CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage</b>			3.000% due 06/27/2037	2,932	2,987	<b>GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.</b>		
6.040% due 01/25/2039	\$ 827	799	6.113% due 10/26/2036	167	164	5.456% due 03/10/2051	\$ 12,120	13,416
<b>Centex Home Equity Loan Trust</b>			<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>			<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>		
0.734% due 03/25/2035	5,418	5,421	0.000% due 01/25/2058	25	25	0.649% due 11/25/2045	54	44
<b>CGMS Commercial Mortgage Trust</b>			0.000% due 04/25/2058	1	1	<b>Grifonos Finance No.1 PLC</b>		
1.190% due 07/15/2030	5,016	5,000	1.090% due 07/15/2032	5,200	5,188	0.000% due 08/28/2039	EUR 748	850
<b>Chase Mortgage Finance Trust</b>			1.340% due 07/15/2032	4,000	3,971	<b>GS Mortgage Securities Corporation Trust</b>		
2.993% due 12/25/2035	4,468	4,313	1.540% due 07/15/2032	2,400	2,371	2.230% due 06/15/2038	\$ 27,488	27,475
<b>ChaseFlex Trust</b>			2.868% due 06/01/2050	58,503	59,906	3.419% due 10/10/2032	3,300	3,363
0.389% due 07/25/2037	1,072	1,006	3.622% due 06/25/2050	46,826	42,650	4.591% due 10/10/2032	8,215	8,181
<b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b>			3.623% due 01/25/2058	21,877	20,906	<b>GSAA Home Equity Trust</b>		
0.449% due 03/25/2035	343	356	3.648% due 04/25/2058	38,825	40,235	6.500% due 11/25/2037	20	12
<b>CIT Mortgage Loan Trust</b>			<b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b>			<b>GSAMP Trust</b>		
1.439% due 10/25/2037	8,710	8,790	6.980% due 03/25/2046	4,266	4,258	0.229% due 03/25/2047	4,369	4,217
<b>Citigroup Commercial Mortgage Trust</b>			<b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization Trust</b>			0.249% due 01/25/2037	19,186	14,222
0.269% due 03/10/2047	25,400	177	0.389% due 07/25/2036	704	704	0.409% due 05/25/2046	390	389
2.441% due 02/15/2039	8,790	8,811			0.609% due 08/25/2036	16,307	16,150	
2.500% due 02/15/2039	9,766	9,725			0.734% due 11/25/2035	7,323	7,074	



三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
<b>GSMSC Resecuritized Trust</b>			0.494% due 05/25/2036	\$ 12,851	\$ 12,733	<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>		
0.266% due 09/26/2036	\$ 4,534	\$ 3,512	<b>JPMorgan Mortgage Trust</b>			0.780% due 11/15/2052	\$ 134,258	\$ 5,066
7.218% due 04/26/2037	44,351	16,986	0.389% due 10/25/2035	4,867	4,073	<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>		
<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>			2.667% due 01/25/2037	525	472	1.740% due 08/15/2033	3,154	3,131
0.389% due 03/25/2037	8,057	1,355	<b>JPMorgan Resecuritized Trust</b>			2.428% due 04/05/2042	13,500	13,756
6.611% due 03/25/2037	8,057	1,866	3.064% due 02/26/2037	2,750	2,703	<b>Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust</b>		
<b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>			<b>Kentmere No.2 PLC</b>			0.629% due 02/25/2036	18,203	19,413
0.320% due 12/19/2036	1,013	1,017	0.000% due 01/28/2042	GBP 9,500	7,203	<b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>		
0.640% due 02/19/2036	11,678	9,287	0.850% due 01/28/2042	67,365	92,579	0.599% due 02/25/2036	14,415	13,961
0.720% due 08/19/2045	8,539	7,666	0.870% due 01/28/2042	2,439	2,589	<b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>		
<b>Hawaii Hotel Trust</b>			1.450% due 01/28/2042	5,693	7,806	0.549% due 07/25/2036	11,004	6,029
1.740% due 05/15/2038	2,000	2,000	1.800% due 01/28/2042	4,066	5,563	<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>		
2.250% due 05/15/2038	Hawksmoor 12,500	12,475	2.250% due 01/28/2042	2,439	3,330	2.817% due 11/25/2037	1,460	1,255
<b>Mortgages</b>			3.050% due 01/28/2042	1,626	2,197	6.000% due 12/25/2035	525	296
1.100% due 05/25/2053	GBP 60,806	83,396	5.050% due 01/28/2042	3,252	4,087	<b>Morgan Stanley Reremic Trust</b>		
<b>Home Equity Asset Trust</b>			<b>Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC</b>			0.406% due 11/26/2036	7,011	6,625
0.569% due 10/25/2036	\$ 23,475	16,962	0.000% due 06/15/2045	EUR 4,059	4,490	<b>Mortgage Loan Trust</b>		
<b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>			<b>Legacy Mortgage Asset Trust</b>			5.370% due 03/25/2034	3,310	3,430
0.229% due 11/25/2036	15,074	14,361	0.000% due 09/25/2059	\$ 709,719	3,602	<b>Natis Commercial Mortgage Securities Trust</b>		
0.329% due 04/25/2037	14,677	11,791	0.000% due 09/25/2059	18,390	9,772	0.840% due 02/15/2033	7,885	7,884
0.449% due 06/25/2036	3,059	2,977	0.791% due 09/25/2059	18,352	16,041	1.190% due 02/15/2033	8,285	8,247
1.079% due 08/25/2035	5,750	5,744	1.835% due 01/28/2070	67,698	68,368	2.140% due 02/15/2033	3,600	3,575
<b>HPLY Trust</b>			3.000% due 06/25/2059	226	227	3.790% due 11/15/2032	1,400	1,409
2.440% due 11/15/2036	22,109	21,997	3.000% due 09/25/2059	139,923	144,660	3.821% due 02/15/2039	2,900	3,193
<b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>			3.438% due 05/25/2059	69	69	<b>New York Mortgage Trust</b>		
0.339% due 05/25/2037	7,197	7,113	4.057% due 09/25/2059	111,258	112,682	0.629% due 04/25/2035	938	965
<b>Impac CMB Trust</b>			<b>Lehman XS Trust</b>			<b>Newgate Funding PLC</b>		
0.769% due 01/25/2035	11,518	11,797	0.289% due 02/25/2037	14,995	14,928	0.230% due 12/15/2050	GBP 20,498	27,121
<b>Impac Secured Assets Corp.</b>			0.469% due 09/25/2036	7,053	6,443	<b>Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</b>		
0.649% due 03/25/2036	12,210	10,904	0.469% due 12/25/2036	11,461	10,590	5.034% due 05/25/2035	\$ 3,342	2,158
<b>Impac Secured Assets Trust</b>			0.609% due 02/25/2047	25,310	24,932	<b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>		
0.469% due 01/25/2037	2,794	2,658	0.939% due 10/25/2037	22,155	21,525	0.854% due 05/25/2035	7,400	7,380
<b>IMT Trust</b>			6.500% due 06/25/2046	5,473	5,489	5.745% due 10/25/2036	22,529	8,055
0.790% due 06/15/2034	1,690	1,691	<b>Liberty</b>			<b>Nomura Resecuritized Trust</b>		
1.040% due 06/15/2034	1,267	1,267	1.260% due 10/10/2049	AUD 3,799	2,861	1.161% due 03/28/2037	6,759	6,190
1.190% due 06/15/2034	775	775	<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>			<b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>		
<b>IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust</b>			0.469% due 02/25/2036	\$ 5,840	5,380	0.289% due 09/25/2037	25,129	24,790
6.500% due 10/25/2037	9,152	6,900	0.469% due 03/25/2046	35,411	17,044	0.409% due 05/25/2036	8,825	8,748
<b>IndyMac INSC Mortgage Loan Trust</b>			<b>Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust</b>			0.409% due 10/25/2036	5,886	4,836
2.893% due 06/25/2037	9,778	7,970	3.339% due 03/25/2032	1,567	1,566	0.809% due 10/25/2035	2,145	2,149
<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b>			<b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>			<b>Option One Mortgage Loan Trust</b>		
0.269% due 02/25/2037	25,839	26,028	2.206% due 04/25/2034	1	1	0.189% due 02/25/2037	5,356	3,293
0.469% due 10/25/2036	5,659	3,110	<b>Mastr Asset-Backed Securities Trust</b>			0.209% due 03/25/2037	11,015	10,780
2.856% due 07/25/2037	22,349	22,501	0.309% due 11/25/2036	28	21	0.229% due 03/25/2037	37,541	36,212
2.950% due 03/25/2036	4,919	4,352	0.459% due 01/25/2036	7,500	7,314	<b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>		
3.098% due 04/25/2037	8,089	7,815	1.239% due 08/25/2037	13,649	13,431	0.824% due 09/25/2035	4,510	4,514
3.143% due 04/25/2037	16,308	16,690	<b>Mastr Specialized Loan Trust</b>			0.869% due 09/25/2035	25,075	24,722
3.216% due 11/25/2036	13,860	11,155	0.809% due 02/25/2036	5,336	4,637	<b>People's Financial Real Estate Mortgage Securities Trust</b>		
<b>IXIS Real Estate Capital Trust</b>			<b>MBRT</b>			0.249% due 09/25/2036	27,128	7,534
0.854% due 12/25/2035	3,888	3,912	1.490% due 11/15/2036	6,435	6,428	<b>Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust</b>		
<b>Jefferies Resecuritized Trust</b>			<b>Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust</b>			0.399% due 11/25/2036	14,837	13,361
5.198% due 06/25/2047	627	576	1.089% due 10/25/2037	4,857	4,890	3.695% due 07/25/2035	9,601	9,098
<b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>			1.589% due 10/25/2037	17,772	18,118	<b>Precise Mortgage Funding PLC</b>		
0.649% due 04/25/2047	2,227	2,224	<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>			0.000% due 12/12/2055	GBP 0	1,464
2.796% due 03/25/2036	374	334	0.229% due 05/25/2037	21,464	14,308	<b>PRET LLC</b>		
5.730% due 03/25/2036	114	118	0.809% due 07/25/2034	5,120	4,960	1.843% due 09/25/2051	\$ 50,417	50,198
<b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>			0.884% due 09/25/2035	1,806	1,807	<b>Quest Trust</b>		
0.940% due 12/15/2036	3,700	3,702	1.169% due 10/25/2035	1,309	1,313	1.514% due 03/25/2035	5,550	5,572
1.190% due 10/15/2032	8,134	8,104	1.847% due 02/25/2033	12	12	<b>RAAC Trust</b>		
1.490% due 10/15/2032	7,200	7,158	<b>Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust</b>			0.794% due 02/25/2036	9,049	8,724
2.230% due 10/15/2032	11,000	10,922	0.339% due 07/25/2036	5,889	5,309	0.839% due 06/25/2047	21,323	19,969
5.337% due 05/15/2047	227	210	0.389% due 07/25/2036	48,361	25,174	<b>RBSC Mortgage Loan Trust</b>		
<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.</b>			0.569% due 06/25/2036	23,462	21,929	6.000% due 01/25/2037	2	2
0.449% due 03/25/2036	5,201	5,196	0.589% due 07/25/2036	48,124	25,581	<b>RBSSP Resecuritized Trust</b>		
<b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>			0.629% due 03/25/2036	5,822	5,778	0.585% due 04/26/2037	32	32
0.339% due 07/25/2036	1,662	1,664	0.794% due 07/25/2035	263	272	<b>Real Estate Asset Liquidity Trust</b>		
0.359% due 08/25/2036	8,600	8,264	0.824% due 07/25/2035	6,912	6,907	2.419% due 06/12/2054	CAD 7,512	6,134
0.359% due 06/25/2037	34,806	33,587	1.089% due 03/25/2033	91	90			
0.369% due 06/25/2037	22,826	20,976	1.089% due 07/25/2037	625	626			



三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジあり / 3 カ月決算型)

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	
<b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>						<b>Cavendish Square Funding PLC</b>			
0.809% due 11/25/2034	\$ 57	\$ 56		EUR 5	\$ 5	0.307% due 02/11/2055	EUR 8	\$ 9	
1.089% due 09/25/2037	43	41		170,916	197,912	<b>FAB CBO BV</b>			
5.612% due 04/25/2037	10,124	4,316		0.689% due 03/24/2059	22,011	25,461	0.473% due 08/20/2080	106	113
5.675% due 06/25/2037	3,910	1,586		1.239% due 03/24/2059	17,746	20,499	<b>Gateway Casinos &amp; Entertainment Ltd.</b>		
				1.839% due 03/24/2059	14,202	16,369	5.000% due 03/12/2038	CAD 8,695	6,741
<b>Residential Accredited Securities Corporation Trust</b>				3.089% due 03/24/2059	8,521	9,790	<b>Goodgreen</b>		
0.239% due 01/25/2037	1,887	1,880		4.439% due 03/24/2059	4,256	4,887	3.930% due 10/15/2053	\$ 5,834	6,133
0.249% due 11/25/2036	156	254		5.439% due 03/24/2059	4,256	4,891	<b>Harley Marine Financing LLC</b>		
0.309% due 02/25/2037	14,000	13,614		6.500% due 03/24/2059	6,568	6,459	5.682% due 05/15/2043	5,263	5,118
0.386% due 01/25/2037	35,802	29,833		<b>Sutherland Commercial Mortgage Loans</b>			<b>Humboldt Americas LLC</b>		
0.584% due 04/25/2036	12,438	12,450		3.192% due 05/25/2037	\$ 353	352	0.000% due 07/31/2022	COP62,570,000	14,850
1.064% due 09/25/2035	7,400	7,404		<b>Taurus UK DAC</b>			7.078% due 11/30/2021	CLP23,414,122	27,378
1.664% due 04/25/2034	1,333	1,348		1.175% due 06/22/2029	GBP 5,472	7,514	<b>Jubilee CLO BV</b>		
<b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>				<b>Terwin Mortgage Trust</b>			0.293% due 07/12/2028	EUR 815	944
0.689% due 02/25/2036	3,551	3,533		1.469% due 09/25/2035	\$ 2,943	2,952	<b>KKR CLO 18 Ltd.</b>		
0.764% due 11/25/2035	13,000	12,945		<b>Trinidad Mortgage Securities PLC</b>			1.062% due 07/18/2030	\$ 1,900	1,900
0.769% due 12/25/2035	12,528	12,079		1.006% due 01/24/2059	GBP 8,897	12,222	<b>LP Credit Card Asset-Backed Securities Master Trust</b>		
0.839% due 09/25/2035	12,591	12,562		<b>Truman Capital Mortgage Loan Trust</b>			1.638% due 08/20/2024	\$ 3,857	3,857
<b>RESIMAC Bastille Trust</b>				0.349% due 03/25/2036	\$ 1,407	1,401	<b>Mackay Shields Euro CLO-2 DAC</b>		
1.005% due 09/05/2057	3,329	3,329		<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>			1.550% due 08/15/2033	EUR 8,150	9,438
<b>Saxon Asset Securities Trust</b>				0.808% due 01/25/2045	502	493	<b>METAL LLC</b>		
0.884% due 03/25/2035	597	596		<b>Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC</b>			4.581% due 10/15/2042	\$ 12,209	11,064
1.839% due 12/25/2037	4,071	4,071		0.000% due 12/21/2049	GBP 0	584	<b>MMCoPS Funding XVII Ltd.</b>		
<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>				1.000% due 12/21/2049	34,240	47,117	0.470% due 12/01/2035	545	526
0.629% due 03/25/2036	5,909	5,713		1.700% due 12/21/2049	4,921	6,781	<b>National Collegiate Student Loan Trust</b>		
0.914% due 10/25/2035	10,136	10,047		2.200% due 12/21/2049	2,460	3,392	0.464% due 10/25/2033	7,216	7,132
1.139% due 03/25/2035	8,849	8,858		2.700% due 12/21/2049	1,406	1,937	<b>Navient Private Education Loan Trust</b>		
<b>Sequoia Mortgage Trust</b>				3.200% due 12/21/2049	1,406	1,931	2.240% due 12/15/2045	4,025	4,137
0.486% due 05/20/2035	1,665	1,727		6.670% due 12/21/2049	0	962	<b>Navient Private Education Refi Loan Trust</b>		
0.606% due 06/20/2034	31	31		<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates</b>			0.990% due 11/15/2068	1,950	1,967
<b>Sestante Finance Srl</b>				<b>WMALT Trust</b>			<b>Netnet Student Loan Trust</b>		
0.000% due 07/23/2046	EUR 10,331	11,034		0.937% due 10/25/2046	\$ 12,208	10,273	0.889% due 09/25/2065	3,582	3,581
<b>SG Mortgage Securities Trust</b>				5.500% due 11/25/2035	69	71	<b>OCP CLO Ltd.</b>		
0.449% due 02/25/2036	\$ 5,071	3,379		<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>			0.945% due 10/26/2027	4,759	4,769
<b>Shamrock Residential DAC</b>				0.359% due 07/25/2036	2,296	2,294	<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>		
0.291% due 12/24/2059	EUR 14,026	16,279		0.509% due 03/25/2037	1,184	1,148	1.150% due 01/15/2030	EUR 8,612	9,992
<b>Soundview Home Loan Trust</b>				<b>Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b>			<b>Pents CLO 2 BV</b>		
0.329% due 07/25/2036	\$ 24,020	23,015		0.689% due 04/25/2034	4,740	4,677	0.790% due 08/04/2028	7,335	8,495
0.399% due 06/25/2036	42,490	43,131		<b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>			<b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b>		
0.509% due 06/25/2036	5,089	5,206		2.537% due 10/25/2036	199	196	1.030% due 12/20/2031	12,800	14,852
1.064% due 03/25/2036	8,102	7,820		<b>WFRBS Commercial Mortgage Trust</b>			<b>Sapphire Aviation Finance</b>		
<b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b>				0.415% due 03/15/2047	8,800	93	4.250% due 03/15/2040	\$ 21,585	21,224
0.164% due 12/25/2035	1,306	1,308		<b>モーゲージ証券合計</b>		<b>4,000,995</b>	<b>Saranac CLO III Ltd.</b>		
<b>SREIT Trust</b>				<b>原簿 3,920,255米ドル</b>			1.725% due 06/22/2030	26,970	26,984
1.545% due 10/15/2038	24,605	24,667					<b>Sound Point CLO XV Ltd.</b>		
1.893% due 10/15/2038	20,425	20,476					1.024% due 01/23/2029	2,100	2,101
<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>							<b>Springleaf Funding Trust</b>		
0.409% due 10/25/2035	5,478	5,492					2.680% due 07/15/2030	2,557	2,560
1.064% due 08/25/2035	11,959	11,795					<b>Taberna Preferred Funding I Ltd.</b>		
1.487% due 05/25/2035	68	58					0.603% due 07/05/2035	4,182	3,785
2.631% due 06/25/2037	2,785	2,775					<b>Telos CLO Ltd.</b>		
2.821% due 07/25/2035	2,425	1,532					1.072% due 04/17/2028	4,785	4,791
<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>							<b>Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.</b>		
0.239% due 06/25/2036	9,492	9,384					4.212% due 05/17/2032	524	522
0.809% due 04/25/2035	6,857	6,865					<b>TICP CLO II-2 Ltd.</b>		
0.889% due 02/25/2034	19,365	19,335					0.972% due 04/20/2028	19,371	19,396
1.289% due 12/25/2034	4,684	4,696					<b>Tropic CDO V Ltd.</b>		
<b>Structured Asset Mortgage Investments II Trust</b>							0.444% due 07/15/2036	11,082	10,251
0.509% due 09/25/2047	24,315	27,209					<b>TruPS Financials Note Securitization Ltd.</b>		
0.755% due 04/19/2035	2,064	2,127					1.302% due 03/30/2039	21,491	20,739
<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>							1.692% due 09/20/2039	4,667	4,538
0.740% due 09/19/2032	25	25					<b>Venture XVII CLO Ltd.</b>		
<b>Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust</b>							1.004% due 04/15/2027	28,714	28,742
0.219% due 05/25/2036	7,869	7,783					<b>Venture XXI CLO Ltd.</b>		
0.339% due 05/25/2036	4,347	3,581					1.004% due 07/15/2027	1,126	1,127
0.349% due 04/25/2036	351	351							
0.399% due 07/25/2036	22,610	22,384							
0.589% due 04/25/2031	8,945	8,890							
1.019% due 11/25/2035	19,865	19,909							



三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジあり／3カ月決算型）

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
0.005% due 11/01/2021	\$ 52	52
<b>HSBC Bank PLC</b>		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 1,984	2,296
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
0.005% due 11/01/2021	\$ 14,910	\$ 14,910
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 1,181,321	10,360
<b>National Australia Bank Ltd.</b>		
0.005% due 11/01/2021	\$ 369	369
<b>Royal Bank of Canada</b>		
0.005% due 11/01/2021	CAD 1,534	1,534
0.005% due 11/01/2021	CAD 327	264
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 1,261	1,459
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 5	0
0.005% due 11/01/2021	\$ 29,455	29,455
0.005% due 11/01/2021	GBP 81	111
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 3,962	4,585
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 141,497	1,241
0.005% due 11/01/2021	\$ 5,224	5,224
0.005% due 11/01/2021	GBP 1,325	1,817
		<b>103,817</b>
<b>アルゼンチン短期証券 0.1%</b>		
(39.915%) due 02/28/2022	ARS 781,991	4,853
40.179% due 11/30/2021	2,934,810	13,826
		<b>18,679</b>
<b>米国短期証券 2.4%</b>		
0.053% due 04/14/2022	\$ 5,800	5,799
0.055% due 04/07/2022	292,800	292,733
		<b>298,532</b>
<b>米国短期証券(CMB) 6.1%</b>		
0.035% due 01/25/2022	218,100	218,073
0.042% due 01/11/2022	194,600	194,580
0.050% due 02/01/2022	356,500	356,450
0.057% due 02/08/2022	6,100	6,099
		<b>775,202</b>
<b>短期証券合計</b>		<b>1,329,557</b>
(原価 1,331,327米ドル)		
<b>有価証券に対する投資合計 118.5%</b>	\$ 15,042,273	
(原価 14,877,410米ドル)		
<b>金融デリバティブ商品 0.0%</b>		(4,695)
(原価またはプレミアム 純額) (20,275米ドル)		
<b>その他資産および負債 純額 (18.5%)</b>		<b>(2,346,715)</b>
<b>純資産 100.0%</b>	\$	<b>12,690,863</b>

# マネー・マーケット・マザーファンド

第11期 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2011年5月31日)
運用方針	主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		公社債 組入比率	純資産 総額
		期中 騰落率		
	円	%	%	百万円
7期 (2018年3月1日)	10,025	△0.1	76.9	90
8期 (2019年3月1日)	10,019	△0.1	74.1	89
9期 (2020年3月2日)	10,013	△0.1	80.6	77
10期 (2021年3月1日)	10,002	△0.1	75.9	76
11期 (2022年3月1日)	9,994	△0.1	76.0	76

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

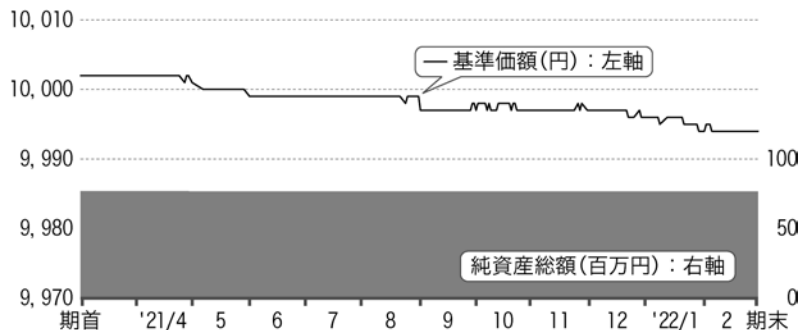
年月日	基準価額		公社債 組入比率
		騰落率	
(期首) 2021年3月1日	円	%	%
3月末	10,002	-	75.9
4月末	10,002	0.0	75.8
5月末	10,001	△0.0	75.9
6月末	9,999	△0.0	76.1
7月末	9,999	△0.0	76.0
8月末	9,999	△0.0	75.9
9月末	9,997	△0.0	76.0
10月末	9,997	△0.0	76.0
11月末	9,997	△0.0	76.0
12月末	9,996	△0.1	76.1
2022年1月末	9,994	△0.1	76.0
2月末	9,994	△0.1	76.0
(期末) 2022年3月1日	9,994	△0.1	76.0

※騰落率は期首比です。

## 1 運用経過

### ▶ 基準価額等の推移について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

#### 基準価額等の推移



期首	10,002円
期末	9,994円
騰落率	-0.1%

### ▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

#### 下落要因

・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

---

▶ 投資環境について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

---

短期金利は小幅上昇しました。

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、発行額の増減などにより上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案し、短期国債の買入れ額を調整したことから、期を通じて概ねレンジ推移となりました。

---

▶ ポートフォリオについて (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

---

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

---

▶ ベンチマークとの差異について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

---

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

## 2 今後の運用方針

2%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン（金融機関同士のごく短期の資金の貸借）翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナス圏での推移を想定します。

残存0年から1年3ヵ月までの公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	1円 (1)	0.005% (0.005)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	1	0.005	

期中の平均基準価額は9,998円です。

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	特殊債券	千円 58,518	千円 — (58,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※( )内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 58	百万円 15	% 25.9	百万円 —	百万円 —	% —

利害関係人とは、投資信託およ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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、S M B C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2022年3月1日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除く金融債券)	58,000 (58,000)	58,193 (58,193)	76.0 (76.0)	— (—)	— (—)	— (—)	76.0 (76.0)
合 計	58,000 (58,000)	58,193 (58,193)	76.0 (76.0)	— (—)	— (—)	— (—)	76.0 (76.0)

※( )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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除く金融債券)	159 政保道路機構	0.9000	14,000	14,005	2022/03/18
	163 政保道路機構	0.9010	15,000	15,033	2022/05/31
	40政保地方公共団	0.8190	15,000	15,068	2022/09/16
	180 政保道路機構	0.7340	14,000	14,085	2022/12/28
	小 計	—	58,000	58,193	—
	合 計	—	58,000	58,193	—

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年3月1日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 58,193	% 76.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,392	24.0
投 資 信 託 財 産 総 額	76,586	100.0



## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月1日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	76,586,115円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,301,901
公 社 債 ( 評 価 額 )	58,193,302
未 収 利 息	90,912
(B) 負 債	263
そ の 他 未 払 費 用	263
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	76,585,852
元 本	76,632,575
次 期 繰 越 損 益 金	△ 46,723
(D) 受 益 権 総 口 数	76,632,575口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	9,994円

※当期における期首元本額76,752,334円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額119,759円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

高成長インド・中型株式ファンド	17,711,132円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)	7,742,960円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)	1,337,053円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型)	4,909,194円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型)	1,456,790円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし)	14,208,735円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ)	1,237,272円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	369,177円
アジア好利回りリート・ファンド(年1回決算型)	997円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし/年2回決算型)	1,187,376円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ/年2回決算型)	389,132円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド(為替ヘッジあり)	289,352円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド(為替ヘッジなし)	419,066円
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	4,140,881円
グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジなし)	11,065,647円
グローイング・フロンティア株式ファンド	2,185,185円
高成長インド・中型株式ファンド(年1回決算型)	7,882,655円

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

## ■ お知らせ

### <約款変更について>

該当事項はございません。

## ■ 損益の状況

(自2021年3月2日 至2022年3月1日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	542,668円
受 取 利 息	555,652
支 払 利 息	△ 12,984
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 603,028
売	△ 603,028
買	△ 603,028
(C) そ の 他 費 用 等	△ 3,836
(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )	△ 64,196
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,437
(F) 解 約 差 損 益 金	36
(G) 合 計 ( D + E + F )	△ 46,723
次 期 繰 越 損 益 金 ( G )	△ 46,723

※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。

※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。