

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

第19作成期 (2023年5月13日から2023年11月13日まで)

第 37 期 / 第 38 期

第37期：決算日 2023年8月14日

第38期：決算日 2023年11月13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。

■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・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD) ピムコ・バミューダ・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。 ■外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 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（為替ヘッジなし／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 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 | |
| 29期(2021年8月12日) | 9,657 | 40 | 2.5 | 0.0 | 98.5 | 4,508 | |
| 30期(2021年11月12日) | 9,958 | 40 | 3.5 | 0.0 | 98.9 | 4,543 | |
| 31期(2022年2月14日) | 9,860 | 50 | △0.5 | 0.0 | 95.3 | 4,339 | |
| 32期(2022年5月12日) | 10,000 | 310 | 4.6 | 0.0 | 95.9 | 3,925 | |
| 33期(2022年8月12日) | 10,006 | 280 | 2.9 | 0.0 | 95.3 | 3,471 | |
| 34期(2022年11月14日) | 9,984 | 160 | 1.4 | 0.0 | 94.5 | 3,425 | |
| 35期(2023年2月13日) | 9,544 | 150 | △2.9 | 0.0 | 97.7 | 3,395 | |
| 36期(2023年5月12日) | 9,720 | 120 | 3.1 | 0.0 | 96.6 | 4,307 | |
| 37期(2023年8月14日) | 10,008 | 510 | 8.2 | 0.0 | 97.8 | 4,371 | |
| 38期(2023年11月13日) | 10,007 | 350 | 3.5 | 0.0 | 96.1 | 4,572 | |

※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 | 率 | | | |
| 第37期 | (期 首) 2023年5月12日 | 円 | % | | % | % |
| | 5 月末 | 9,720 | — | 0.0 | 96.6 | |
| | 6 月末 | 9,973 | 2.6 | 0.0 | 99.1 | |
| | 7 月末 | 10,445 | 7.5 | 0.0 | 98.8 | |
| | (期 末) 2023年8月14日 | 10,284 | 5.8 | 0.0 | 99.2 | |
| 第38期 | (期 首) 2023年8月14日 | 10,518 | 8.2 | 0.0 | 97.8 | |
| | 8 月末 | 10,008 | — | 0.0 | 97.8 | |
| | 9 月末 | 10,108 | 1.0 | 0.0 | 98.9 | |
| | 10 月末 | 10,206 | 2.0 | 0.0 | 99.2 | |
| | (期 末) 2023年11月13日 | 10,039 | 0.3 | 0.0 | 92.8 | |
| | | 10,357 | 3.5 | 0.0 | 96.1 | |

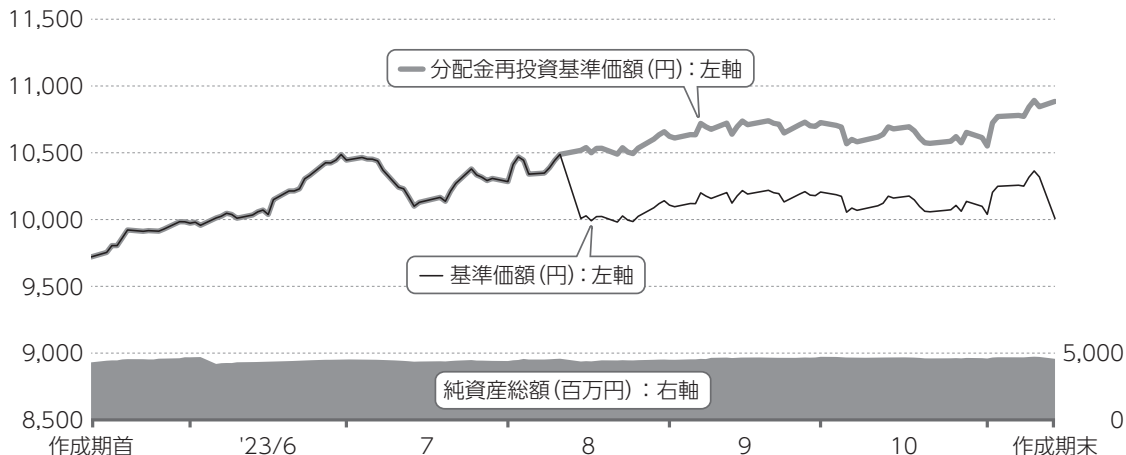
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは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（2023年5月13日から2023年11月13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 | 9,720円 |
| 作成期末 | 10,007円 (当作成期既払分配金860円(税引前)) |
| 騰落率 | +12.0% (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（2023年5月13日から2023年11月13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。外貨建資産については、対円での為替ヘッジは行っていません。

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
- スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと
- 米ドル高・円安となったこと

下落要因

- 米国の金利が上昇（債券価格は下落）したこと

投資環境について（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

米国債券市場は下落しました。新興国債券も下落しましたが、米国ハイイールド社債は上昇しました。為替市場では、米ドル高・円安となりました。

債券市場

米国債券市場は、期初より雇用関連指標やGDP（国内総生産）など米経済の堅調さを示す指標の発表が相次いだことや、これを受けてFRB（米連邦準備制度理事会）が追加的な利上げや金融引き締めを長期化を示唆したことにより下落基調となりました。11月に入ると雇用統計やCPI（消費者物価指数）の落ち着きを受けて上昇に転じましたが、期を通じては、米国債券市場は下落しました。新興国債券も下落しましたが、米国ハイイールド社債はスプレッドの縮小がプラス要因となり、上昇しました。

為替市場

為替市場では、米ドル高・円安となりました。米国において堅調な経済指標の発表が相次いだことからFRBによる金融引き締めの長期化観測が広がった一方で、日銀が金融緩和を維持したことから、日米の金利差拡大などが意識され米ドル高・円安が進行しました。

ポートフォリオについて（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

当ファンド

期初より「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ(USD)」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(USD)」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(USD)

●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、保有するリスク性資産の価格変動の影響を和らげる適切な金利リスク量を見極め、市場環境に応じて機動的に調整しました。期間においては、金融引き締め長期化観測などを背景とした米国の金利上昇に合わせて同国の金利リスクを積み増しました。一方、金融緩和政策の修正の可能性などから日本の金利リスクは売持ちとしました。

●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ポートフォリオの安定性を高めました。また、長年にわたる住宅価格の上昇から恩恵を受ける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等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（2023年5月13日から2023年11月13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（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第37期 | 第38期 |
|-----------|---------|---------|
| 当期分配金 | 510 | 350 |
| （対基準価額比率） | （4.85%） | （3.38%） |
| 当期の収益 | 427 | 341 |
| 当期の収益以外 | 82 | 8 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,008 | 1,000 |

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(USD)」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(USD)

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いきます。

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（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 95円 | 0.934% | 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10,158円です。 |
| （投信会社） | (54) | (0.528) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (40) | (0.389) | 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） | (2) | (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 | 95 | 0.937 | |

※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。

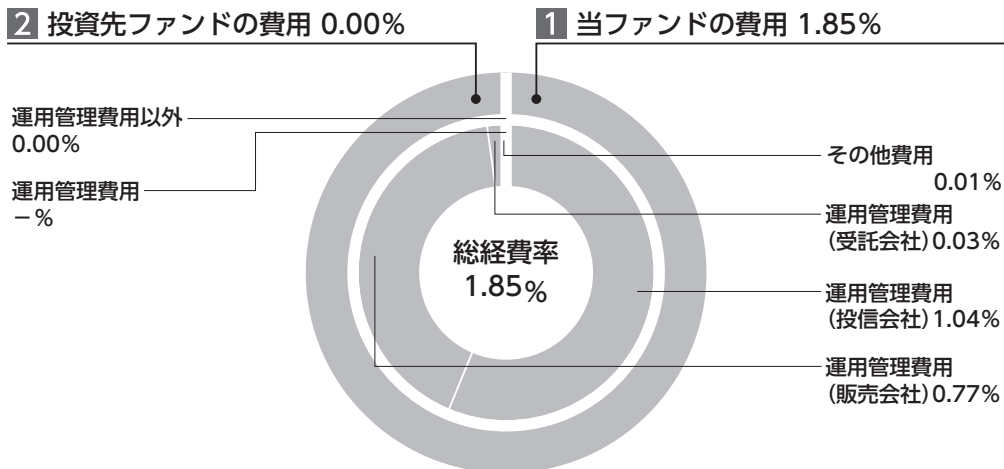
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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 | 投資先ファンドの運用管理費用の比率 | -% |
| 2 | 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 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(マザーファンドを除く))の費用は、シェアクラスの経費率です。運用管理費用と運用管理費用以外の費用を、目論見書に記載している料率にもとづき区別しています。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。ただし、投資先ファンドでの運用管理費用は、当ファンドの運用委託報酬の中から負担しているため、開示すべき運用管理費用はありません。
- ※**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（2023年5月13日から2023年11月13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 (USD) | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | | 85,652 | 960,938 | 102,660 | 1,154,969 |

※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（2023年5月13日から2023年11月13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

（2023年5月13日から2023年11月13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（2023年11月13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 (USD) | 387,562 | 370,554 | 4,391,806 | 96.1 |
| 合計 | 387,562 | 370,554 | 4,391,806 | 96.1 |

※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 | 1,456 | 1,456 | 1,454 |

※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

(2023年11月13日現在)

| 項目 | 作成期末 | |
|-------------------|-----------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 4,391,806 | 92.3 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 1,454 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 362,837 | 7.6 |
| 投資信託財産総額 | 4,756,098 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | (2023年8月14日) (2023年11月13日) | |
|-------------------------|----------------------------|-----------------------|
| | 第37期末 | 第38期末 |
| (A) 資 産 | 4,615,847,613円 | 4,756,098,543円 |
| コール・ローン等 | 338,078,950 | 362,837,639 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 4,276,313,622 | 4,391,806,008 |
| マネー・マーケット・マザーファンド(評価額) | 1,455,041 | 1,454,896 |
| (B) 負 債 | 244,054,336 | 183,703,706 |
| 未払収益分配金 | 222,787,370 | 159,921,542 |
| 未払解約金 | 1,018 | 2,530,292 |
| 未払信託報酬 | 21,191,531 | 21,185,722 |
| その他未払費用 | 74,417 | 66,150 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 4,371,793,277 | 4,572,394,837 |
| 元 本 | 4,368,379,819 | 4,569,186,934 |
| 次期繰越損益金 | 3,413,458 | 3,207,903 |
| (D) 受益権総口数 | 4,368,379,819口 | 4,569,186,934口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,008円 | 10,007円 |

※当作成期における作成期首元本額4,431,368,607円、作成期中追加設定元本額965,052,987円、作成期中一部解約元本額827,234,660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37期 | 第38期 |
|----------------|------|------|
| | | 510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2023年5月13日 至2023年8月14日 | | 自2023年8月15日 至2023年11月13日 | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------------|-----------------------------|------|
| | 第37期 | 第38期 | 第37期 | 第38期 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 60,869,853円 | 61,872,575円 | | |
| 受 取 配 当 金 | 60,883,267 | 61,882,773 | | |
| 受 取 利 息 | 1,083 | 1,531 | | |
| 支 払 利 息 | △ 14,497 | △ 11,729 | | |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 291,199,189 | 115,362,519 | | |
| 売 買 益 | 308,015,368 | 117,321,373 | | |
| 売 買 損 | △ 16,816,179 | △ 1,958,854 | | |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 21,268,680 | △ 21,254,389 | | |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 330,800,362 | 155,980,705 | | |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 16,082,678 | 120,645,534 | | |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 120,682,212 | △ 113,496,794 | | |
| (配 当 等 相 当 額) | (316,307,202) | (340,589,575) | | |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 436,989,414) | (△ 454,086,369) | | |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 226,200,828 | 163,129,445 | | |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 222,787,370 | △ 159,921,542 | | |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G + H) | 3,413,458 | 3,207,903 | | |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 120,682,212 | △ 113,496,794 | | |
| (配 当 等 相 当 額) | (316,307,236) | (340,589,589) | | |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 436,989,448) | (△ 454,086,383) | | |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 124,095,670 | 116,704,697 | | |

※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15,180,918円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 第37期 | 第38期 |
|----------------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 57,194,431円 | 54,454,332円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 129,432,629 | 101,526,373 |
| (c) 収益調整金 | 316,307,236 | 340,589,589 |
| (d) 分配準備積立金 | 160,255,980 | 120,645,534 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 663,190,276 | 617,215,828 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 1,518.16 | 1,350.82 |
| (f) 分配金 | 222,787,370 | 159,921,542 |
| 1万口当たり分配金 | 510 | 350 |

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（USD） |
| 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"> ●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。 ●原則として対円で為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ●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。 ●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。 ●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。 |
| 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（USD）」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（2021年11月1日から2022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） | 3,963 |
| 総収益 | 3,963 |
| 費用 | |
| 顧問費用 - W (USD) | 188 |
| 管理手数料 - M (JPY助言) | 547 |
| 管理手数料 - M (USD助言) | 332 |
| 管理手数料 - P (JPY) | 241 |
| 管理手数料 - R (USD) | 93 |
| 管理手数料 - T (JPY) | 5,769 |
| 管理手数料 - U (USD) | 83 |
| 管理手数料 - U2 (USD) | 214 |
| 管理手数料 - X (JPY) | 30 |
| 管理事務代行費用 - R (USD) | 29 |
| 管理事務代行費用 - W (USD) | 58 |
| 販売手数料 - M (JPY助言) | 474 |
| 販売手数料 - M (USD助言) | 288 |
| 販売手数料 - P (JPY) | 241 |
| 代行手数料 - M (JPY助言) | 37 |
| 代行手数料 - M (USD助言) | 22 |
| 支払利息 | 133 |
| その他費用 | 12 |
| 総費用 | 8,791 |
| 投資純損益 | (4,828) |
| 実現純損益 | |
| 関連ファンドに対する投資 | 440,185 |
| OTC金融デリバティブ商品 | (2,074,947) |
| 外国為替 | (2,481) |
| 実現純損益 | (1,637,243) |
| 未実現損益の純変動額 | |
| 有価証券に対する投資 | (1) |
| 関連ファンドに対する投資 | (1,752,599) |
| OTC金融デリバティブ商品 | (4,806) |
| 外貨建資産および負債 | (100) |
| 未実現損益の純変動額 | (1,757,506) |
| 純損益 | (3,394,749) |
| 運用の結果による純資産の純増減額 | (3,399,577) |

■ 投資明細表（2022年10月31日現在）

| | 額面金額 (単位:千) | 時価 (単位:千) |
|---|----------------|---------------------|
| 有価証券に対する投資 4.7% | | |
| 短期証券 4.7% | | |
| 定期性預金 4.7% | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 72,714 | \$ 72,714 |
| Bank of Nova Scotia | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 5,987 | 5,987 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 39 | 39 |
| Citibank N.A. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 60,870 | 60,870 |
| DBS Bank Ltd. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 37,928 | 37,928 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 81,160 | 81,160 |
| Royal Bank of Canada | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 80,362 | 80,362 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 61,645 | 61,645 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 62,794 | 62,794 |
| | | 463,499 |
| 米国短期証券 0.0% | | |
| 2.552% due 11/10/2022 | 2,825 | 2,823 |
| 米国短期証券(CMB) 0.0% | | |
| 3.278% due 01/10/2023 | 1,720 | 1,707 |
| 短期証券合計 | | 468,029 |
| (原価 \$468,031) | | |
| 有価証券に対する投資合計 | | 468,029 |
| (原価 \$468,031) | | |
| | 口数 (単位:千) | |
| 関連ファンドに対する投資 95.8% | | |
| その他投資 95.8% | | |
| PIMCO Bermuda Income Fund (M) | | |
| (原価 \$9,636,026) | 682,263 | 9,497,093 |
| 関連ファンドに対する投資合計 | | 9,497,093 |
| (原価 \$9,636,026) | | |
| 投資合計 100.5% | | \$ 9,965,122 |
| (原価 \$10,104,057) | | |
| 金融デリバティブ商品 (2.0%) | | (197,302) |
| (原価またはプレミアム(純額) \$0) | | |
| その他の資産および負債 (純額) 1.5% | | 148,384 |
| 純資産 100.0% | | \$ 9,916,204 |

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書（2021年11月1日から2022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） | 445,562 |
| 受取配当金（外国税控除後） | 868 |
| 雑収入 | 11 |
| 総収益 | <u>446,441</u> |
| 費用 | |
| 支払利息 | 417 |
| その他費用 | 0 |
| 総費用 | <u>417</u> |
| 投資純損益 | <u>446,024</u> |
| 実現純損益 | |
| 有価証券に対する投資 | (531,587) |
| 市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引 | 193,654 |
| OTC金融デリバティブ商品 | 271,858 |
| 外国為替 | (3,334) |
| 実現純損益 | <u>(69,409)</u> |
| 未実現損益の純変動額 | |
| 有価証券に対する投資 | (1,632,829) |
| 市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引 | 53,628 |
| OTC金融デリバティブ商品 | (146,457) |
| 外貨建資産および負債 | 15,202 |
| 未実現損益の純変動額 | <u>(1,710,456)</u> |
| 純損益 | <u>(1,779,865)</u> |
| 運用の結果による純資産の純増減額 | <u>(1,333,841)</u> |
| * 外国源泉課税 | 391 |

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

■ 投資明細表 (2022年10月31日現在)

| | 額面金額 (単位: 千) | 時価 (単位: 千) | | 額面金額 (単位: 千) | 時価 (単位: 千) | | 額面金額 (単位: 千) | 時価 (単位: 千) |
|--|-----------------|---------------|--|-----------------|---------------|--|-----------------|---------------|
| 有価証券に対する投資 127.5% | | | | | | | | |
| 銀行貸付債権 6.0% | | | | | | | | |
| Advantage Loyalty IP Ltd. | | | | | | | | |
| 8.993% due 04/20/2028 | \$ 10,503 | \$ 10,419 | | | | | | |
| Air Canada | | | | | | | | |
| 6.421% due 08/11/2028 | 1,435 | 1,404 | | | | | | |
| AmSurg LLC | | | | | | | | |
| 1.000% due 04/29/2027 (b) | 2,415 | 2,376 | | | | | | |
| 12.119% due 04/29/2027 | 13,285 | 13,069 | | | | | | |
| 15.744% due 04/28/2028 | 34,672 | 31,378 | | | | | | |
| Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC | | | | | | | | |
| 4.989% due 02/12/2027 | 6,984 | 6,827 | | | | | | |
| Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV | | | | | | | | |
| 5.424% due 06/01/2024 | 391 | 387 | | | | | | |
| Azalea TopCo, Inc. | | | | | | | | |
| 7.254% due 07/24/2026 | 827 | 774 | | | | | | |
| Caesars Resort Collection LLC | | | | | | | | |
| 6.504% due 12/23/2024 | 13,214 | 13,089 | | | | | | |
| 7.254% due 07/21/2025 | 4,578 | 4,544 | | | | | | |
| Carnival Corp. | | | | | | | | |
| 3.975% due 06/30/2025 | EUR 11,380 | 10,746 | | | | | | |
| 5.877% due 06/30/2025 | \$ 24,287 | 22,861 | | | | | | |
| 6.127% due 10/18/2028 | 7,949 | 7,311 | | | | | | |
| Cengage Learning, Inc. | | | | | | | | |
| 7.814% due 07/14/2026 | 18,276 | 16,228 | | | | | | |
| Charter Communications Operating LLC | | | | | | | | |
| 5.510% due 02/01/2027 | 5,387 | 5,302 | | | | | | |
| Coherent Corp. | | | | | | | | |
| 5.878% due 07/02/2029 | 4,777 | 4,663 | | | | | | |
| Comscope, Inc. | | | | | | | | |
| 7.004% due 04/08/2026 | 3,880 | 3,710 | | | | | | |
| DIRECTV Financing LLC | | | | | | | | |
| 8.754% due 08/02/2027 | 7,881 | 7,530 | | | | | | |
| Hilton Worldwide Finance LLC | | | | | | | | |
| 5.336% due 06/22/2026 | 9,745 | 9,588 | | | | | | |
| HeartCommunications, Inc. | | | | | | | | |
| 6.754% due 05/01/2026 | 132,910 | 125,863 | | | | | | |
| Instant Brands Holdings, Inc. | | | | | | | | |
| 7.076% due 04/12/2028 | \$ 2,663 | 1,819 | | | | | | |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | | | | | | |
| 7.445% due 02/01/2029 | 18,343 | 17,724 | | | | | | |
| Iqvia, Inc. | | | | | | | | |
| 3.193% due 03/07/2024 | EUR 3,900 | 3,821 | | | | | | |
| Lealand Finance Co. BV | | | | | | | | |
| 3.000-4.754% due 06/30/2025 | \$ 594 | 318 | | | | | | |
| 6.754% due 06/28/2024 | 261 | 170 | | | | | | |
| LifePoint Health, Inc. | | | | | | | | |
| 8.165% due 11/16/2025 | 1,038 | 922 | | | | | | |
| 6.004% due 03/15/2027 | 1,158 | 1,081 | | | | | | |
| Mariotti Ownership Resorts, Inc. | | | | | | | | |
| 5.504% due 08/29/2025 | 456 | 442 | | | | | | |
| PetSmart LLC | | | | | | | | |
| 7.500% due 02/11/2028 | 2,666 | 2,572 | | | | | | |
| Poseidon Bidco | | | | | | | | |
| 6.443% due 07/14/2028 | EUR 39,600 | 37,182 | | | | | | |
| Pug LLC | | | | | | | | |
| 7.254% due 02/12/2027 | \$ 788 | 680 | | | | | | |
| Redstone HoldCo 2 LP | | | | | | | | |
| 9.108% due 04/27/2028 | 3,000 | 2,170 | | | | | | |
| Sequa Mezzanine Holdings LLC | | | | | | | | |
| 9.760% due 11/28/2023 | 4,900 | 4,900 | | | | | | |
| Serta Simmons Bedding LLC | | | | | | | | |
| 7.743-7.827% due 11/08/2023 | 188 | 20 | | | | | | |
| Sigma Holdco BV | | | | | | | | |
| 3.738% due 07/02/2025 | EUR 3,670 | 3,053 | | | | | | |
| SkyMiles IP Ltd. | | | | | | | | |
| 7.993% due 10/20/2027 | \$ 15,150 | 15,311 | | | | | | |
| Softbank vision Fund II | | | | | | | | |
| 5.000% due 12/21/2025 | \$ 42,246 | \$ 40,493 | | | | | | |
| Sotera Health Holdings LLC | | | | | | | | |
| 7.165% due 12/11/2026 | 3,362 | 3,068 | | | | | | |
| SS&C Technologies Holdings, Inc. | | | | | | | | |
| 5.504% due 04/16/2025 | 3,247 | 3,187 | | | | | | |
| Sunshine Luxembourg VII Sarl | | | | | | | | |
| 7.424% due 10/01/2026 | 4,021 | 3,836 | | | | | | |
| Syniverse Holdings LLC | | | | | | | | |
| 10.553% due 05/13/2027 | 23,288 | 20,039 | | | | | | |
| TransDigm, Inc. | | | | | | | | |
| 5.924% due 08/22/2024 | 792 | 781 | | | | | | |
| 5.924% due 05/30/2025 | 2,271 | 2,223 | | | | | | |
| 5.924% due 12/09/2025 | 26,146 | 25,576 | | | | | | |
| U.S. Renal Care, Inc. | | | | | | | | |
| 8.813-9.313% due 06/26/2026 | 3,750 | 2,349 | | | | | | |
| Uber Technologies, Inc. | | | | | | | | |
| 6.570% due 04/04/2025 | 5,546 | 5,507 | | | | | | |
| 6.570% due 02/25/2027 | 9,843 | 9,806 | | | | | | |
| United Airlines, Inc. | | | | | | | | |
| 8.108% due 04/21/2028 | 6,802 | 6,658 | | | | | | |
| Univision Communications, Inc. | | | | | | | | |
| 6.504% due 03/15/2024 | 7,074 | 7,052 | | | | | | |
| Westmoreland Coal Co. | | | | | | | | |
| 15.000% due 03/15/2029 | 839 | 598 | | | | | | |
| WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL | | | | | | | | |
| 6.768% due 02/09/2023 (I) | 40,918 | 40,899 | | | | | | |
| Windstream Services II LLC | | | | | | | | |
| 10.004% due 09/21/2027 | 8,104 | 7,309 | | | | | | |
| Zayo Group Holdings, Inc. | | | | | | | | |
| 6.754% due 03/09/2027 | 9,264 | 7,548 | | | | | | |
| 銀行貸付債権合計 | | | | | | | | |
| (原簿 \$607,045) | | | | | 577,183 | | | |
| 社債証券等 21.1% | | | | | | | | |
| 銀行預り付金融 7.4% | | | | | | | | |
| AGFC Capital Trust I | | | | | | | | |
| 5.829% due 01/15/2067 | 2,200 | 1,185 | | | | | | |
| AIB Group PLC | | | | | | | | |
| 4.263% due 04/10/2025 | 1,960 | 1,870 | | | | | | |
| Armor Holdco, Inc. | | | | | | | | |
| 8.500% due 11/15/2029 | 200 | 149 | | | | | | |
| Army Hawaii Family Housing Trust Certificates | | | | | | | | |
| 3.812% due 06/15/2050 | 8,100 | 5,534 | | | | | | |
| Aroundtown S.A. | | | | | | | | |
| 5.375% due 03/21/2029 | 11,300 | 8,731 | | | | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | | | | | |
| 2.528% due 11/18/2027 | 47,992 | 36,669 | | | | | | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | | | | | |
| 1.875% due 01/09/2026 | EUR 5,000 | 4,231 | | | | | | |
| 2.625% due 04/28/2025 | 1,000 | 883 | | | | | | |
| 3.625% due 09/24/2024 | 700 | 650 | | | | | | |
| 5.375% due 01/18/2028 | 800 | 590 | | | | | | |
| 8.000% due 01/22/2030 | 4,937 | 3,683 | | | | | | |
| 8.500% due 09/10/2030 | 100 | 75 | | | | | | |
| Banco Bradesco S.A. | | | | | | | | |
| 2.850% due 01/27/2023 | \$ 2,100 | 2,089 | | | | | | |
| Banco BTG Pactual S.A. | | | | | | | | |
| 4.500% due 01/10/2025 | 1,200 | 1,148 | | | | | | |
| Banco de Credito del Peru S.A. | | | | | | | | |
| 4.650% due 09/17/2024 | PEN 16,400 | 3,833 | | | | | | |
| Banco Espirito Santo S.A. | | | | | | | | |
| 2.625% due 05/08/2049 (c) | EUR 3,100 | 444 | | | | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | | | | | | | | |
| 7.500% due 05/19/2025 (d)(e) | 12,003 | 11,597 | | | | | | |
| Bank of Nova Scotia | | | | | | | | |
| 4.900% due 06/04/2025 (d)(e) | \$ 1,124 | 1,044 | | | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | | | | | |
| 7.625% due 11/21/2022 (d) | \$ 5,281 | \$ 5,274 | | | | | | |
| Barclays PLC | | | | | | | | |
| 4.972% due 05/16/2029 | 2,600 | 2,305 | | | | | | |
| 5.875% due 09/15/2024 (d)(e) | GBP 4,000 | 4,042 | | | | | | |
| 6.125% due 12/15/2025 (d)(e) | \$ 7,700 | 6,689 | | | | | | |
| 6.375% due 12/15/2025 (d)(e) | GBP 2,150 | 2,197 | | | | | | |
| 7.125% due 06/15/2025 (d)(e) | 5,000 | 5,301 | | | | | | |
| 7.250% due 03/15/2023 (d)(e) | 16,760 | 19,193 | | | | | | |
| 7.750% due 09/15/2023 (d)(e) | \$ 14,570 | 13,750 | | | | | | |
| 8.000% due 06/15/2024 (d)(e) | 9,600 | 9,057 | | | | | | |
| BGC Partners, Inc. | | | | | | | | |
| 3.750% due 10/01/2024 | 1,464 | 1,392 | | | | | | |
| 4.375% due 12/15/2025 | 1,400 | 1,300 | | | | | | |
| CA Immobilien Anlagen AG | | | | | | | | |
| 1.000% due 10/27/2025 | EUR 3,400 | 2,841 | | | | | | |
| CIFI Holdings Group Co. Ltd. (c) | | | | | | | | |
| 4.375% due 04/12/2027 | \$ 300 | 21 | | | | | | |
| 4.450% due 08/17/2026 | 500 | 37 | | | | | | |
| 5.950% due 10/20/2025 | 200 | 15 | | | | | | |
| 6.000% due 07/16/2025 | 200 | 15 | | | | | | |
| 6.450% due 11/07/2024 | 600 | 53 | | | | | | |
| Corestate Capital Holding S.A. | | | | | | | | |
| 3.500% due 04/15/2023 | EUR 39,300 | 7,244 | | | | | | |
| Corsair International Ltd. | | | | | | | | |
| 5.473% due 01/28/2027 | 10,000 | 9,463 | | | | | | |
| 5.823% due 01/28/2029 | 4,100 | 3,840 | | | | | | |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. | | | | | | | | |
| 2.700% due 07/12/2026 | \$ 2,100 | 194 | | | | | | |

三井住友・ピコモ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／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) |
|---|----------------|--------------|-----------------------|----------------|--------------|---|----------------|--------------|
| Melco Resorts Finance Ltd. | | | | | | | | |
| 4.875% due 06/06/2025 | \$ 400 | \$ 286 | 5.500% due 01/15/2026 | \$ 6,500 | \$ 4,517 | 3.250% due 06/15/2023 | \$ 8,640 | \$ 8,506 |
| 5.375% due 12/04/2029 | 5,200 | 2,915 | 5.500% due 10/01/2027 | 1,000 | 647 | 3.250% due 06/01/2031 | 3,800 | 2,962 |
| MGM China Holdings Ltd. | | | 5.625% due 08/26/2028 | 1,198 | 734 | 3.300% due 03/15/2027 | 3,838 | 3,311 |
| 5.250% due 06/18/2025 | 4,500 | 3,586 | | | | 3.300% due 12/01/2027 | 14,666 | 12,450 |
| Micron Technology, Inc. | | | | | | 3.300% due 08/01/2040 | 1,542 | 1,004 |
| 4.063% due 02/15/2030 | 3,365 | 3,007 | | | | 3.400% due 08/15/2024 | 6,570 | 6,251 |
| 5.327% due 02/06/2029 | 1,333 | 1,237 | | | | 3.450% due 07/01/2025 | 12,102 | 11,254 |
| Mitchells & Butlers Finance PLC | | | | | | 3.500% due 08/01/2050 | 4,660 | 2,851 |
| 3.743% due 12/15/2030 | 495 | 403 | | | | 3.750% due 02/15/2024 | 10,188 | 9,882 |
| 6.013% due 12/15/2028 | GBP 874 | 933 | | | | 3.750% due 07/01/2028 | 13,613 | 11,630 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | | | | | | 3.750% due 08/15/2042 | 418 | 266 |
| 3.522% due 09/17/2025 | \$ 8,300 | 7,368 | | | | 3.850% due 11/15/2023 | 1,830 | 1,789 |
| 4.345% due 09/17/2027 | 8,700 | 7,338 | | | | 3.950% due 12/01/2047 | 2,500 | 1,617 |
| 4.810% due 09/17/2030 | 2,250 | 1,799 | | | | 4.000% due 12/01/2046 | 3,144 | 2,005 |
| NMG Holding Co., Inc. | | | | | | 4.200% due 03/01/2029 | 9,900 | 8,600 |
| 7.125% due 04/01/2026 | 11,900 | 11,333 | | | | 4.250% due 08/01/2023 | 3,735 | 3,698 |
| Oracle Corp. | | | | | | 4.250% due 03/15/2046 | 5,219 | 3,483 |
| 3.850% due 04/01/2060 | 1,835 | 1,112 | | | | 4.300% due 03/15/2045 | 3,000 | 2,026 |
| PeaceHealth Obligated Group | | | | | | 4.400% due 03/01/2032 | 7,300 | 6,119 |
| 3.218% due 11/15/2050 | 3,100 | 1,918 | | | | 4.450% due 04/15/2042 | 4,333 | 3,062 |
| QVC, Inc. | | | | | | 4.500% due 07/01/2040 | 39,210 | 29,308 |
| 5.950% due 03/15/2043 | 5,293 | 3,240 | | | | 4.500% due 12/15/2041 | 743 | 507 |
| Roadster Finance DAC | | | | | | 4.550% due 07/01/2030 | 50,195 | 44,022 |
| 2.375% due 12/08/2027 | EUR 1,000 | 843 | | | | 4.600% due 06/15/2043 | 1,794 | 1,289 |
| Rolls-Royce PLC | | | | | | 4.650% due 08/01/2028 | 100 | 88 |
| 4.625% due 02/16/2026 | 13,860 | 13,124 | | | | 4.750% due 02/15/2044 | 2,707 | 1,958 |
| 5.750% due 10/15/2027 | GBP 8,199 | 8,159 | | | | 4.950% due 07/01/2050 | 25,950 | 19,397 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | | | | 5.250% due 03/01/2052 | 7,300 | 5,630 |
| 11.500% due 06/01/2025 | \$ 7,300 | 7,871 | | | | Petrobras Global Finance BV | | |
| Russian Railways Via RZD Capital PLC | | | | | | 6.250% due 12/14/2024 | GBP 6,234 | 6,833 |
| 7.487% due 03/25/2031 | GBP 6,300 | 2,539 | | | | 6.625% due 01/16/2034 | 2,900 | 2,801 |
| Sands China Ltd. | | | | | | Petroleos de Venezuela S.A. (c) | | |
| 3.350% due 03/08/2029 | \$ 2,500 | 1,679 | | | | 5.375% due 04/12/2027 | \$ 11,932 | 283 |
| 3.750% due 08/08/2031 | 2,200 | 1,445 | | | | 5.500% due 04/12/2037 | 10,372 | 236 |
| 4.300% due 01/08/2026 | 3,000 | 2,462 | | | | 6.000% due 05/16/2024 | 6,283 | 217 |
| 4.875% due 06/18/2030 | 2,700 | 1,930 | | | | 6.000% due 11/15/2026 | 13,183 | 300 |
| 5.625% due 08/08/2025 | 4,500 | 3,984 | | | | 9.000% due 11/17/2022 | 4,700 | 9 |
| 5.900% due 08/08/2028 | 5,500 | 4,381 | | | | 9.750% due 05/17/2035 | 400 | 112 |
| Studio City Co. Ltd. | | | | | | Petroleos Mexicanos | | |
| 7.000% due 02/15/2027 | 2,700 | 2,148 | | | | 2.750% due 04/21/2027 | EUR 1,200 | 883 |
| Syngenta Finance NV | | | | | | 5.950% due 01/28/2031 | \$ 22,485 | 16,245 |
| 3.375% due 04/16/2026 | EUR 11,100 | 10,051 | | | | 6.700% due 02/16/2032 | 79,356 | 60,145 |
| 4.441% due 04/24/2023 | \$ 5,300 | 5,257 | | | | 6.950% due 01/28/2060 | 6,116 | 3,681 |
| 4.892% due 04/24/2025 | 800 | 766 | | | | 7.690% due 01/23/2050 | 1,570 | 1,026 |
| Times Square Hotel Trust | | | | | | PG&E Wildfire Recovery Funding LLC | | |
| 6.528% due 08/01/2026 | 1,070 | 1,054 | | | | 4.263% due 06/01/2036 | 3,600 | 3,245 |
| Triumph Group, Inc. | | | | | | 4.377% due 06/01/2039 | 3,990 | 3,479 |
| 6.250% due 09/15/2024 | 1,541 | 1,427 | | | | 4.451% due 12/01/2047 | 20,700 | 17,233 |
| U.S. Renal Care, Inc. | | | | | | 4.674% due 12/01/2051 | 3,600 | 3,086 |
| 10.625% due 07/15/2027 | 1,282 | 519 | | | | Prosus NV | | |
| Uber Technologies, Inc. | | | | | | 1.985% due 07/13/2033 (n) | EUR 5,600 | 3,340 |
| 4.500% due 08/15/2029 | 2,865 | 2,461 | | | | 2.085% due 01/19/2030 | 4,200 | 2,934 |
| 7.500% due 05/15/2025 | 571 | 572 | | | | 3.061% due 07/13/2031 | \$ 11,900 | 8,004 |
| United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust | | | | | | 4.193% due 01/19/2032 | 5,600 | 3,989 |
| 2.700% due 05/01/2032 | 1,365 | 1,086 | | | | 4.987% due 01/19/2052 | 4,700 | 2,925 |
| United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust | | | | | | Rio Oil Finance Trust Series 2014-1 | | |
| 5.875% due 10/15/2027 | 24,502 | 23,679 | | | | 9.250% due 07/09/2024 | 1,184 | 1,199 |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | | | | Rio Oil Finance Trust Series 2014-3 | | |
| 3.875% due 08/15/2029 | 3,600 | 3,097 | | | | 9.500% due 01/09/2027 | 554 | 573 |
| 3.875% due 11/01/2033 | 15,900 | 12,790 | | | | Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 | | |
| 4.125% due 08/15/2031 | 3,500 | 2,993 | | | | 8.200% due 04/09/2028 | 2,383 | 2,398 |
| VOC Escrow Ltd. | | | | | | Southern California Edison Co. | | |
| 5.000% due 02/15/2028 | 1,100 | 908 | | | | 4.875% due 03/01/2049 | 346 | 279 |
| Westera Midstream Operating LP | | | | | | Sprint Capital Corp. | | |
| 5.041% due 01/13/2023 | 1,048 | 1,043 | | | | 8.750% due 03/15/2032 | 2,200 | 2,585 |
| Wynn Las Vegas LLC | | | | | | Sprint Communications LLC | | |
| 5.250% due 05/15/2027 | 1,800 | 1,569 | | | | 6.000% due 11/15/2022 | 3,934 | 3,940 |
| Wynn Macau Ltd. | | | | | | | | |
| 5.125% due 12/15/2029 | 2,800 | 1,701 | | | | | | |

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／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) |
|---|----------------|------------------|---------------------------|----------------|---------------|----------------------------|----------------|--------------|
| Sprint Corp. | | | 6.125% due 07/01/2040 | \$ 3,000 | \$ 2,265 | Fannie Mae, TBA (h) | | |
| 7.125% due 06/15/2024 | \$ 8,766 | \$ 8,874 | 地方債等合計 | | 14,509 | 2.500% due 11/01/2052 | \$ 47,000 | \$ 38,482 |
| 7.625% due 02/15/2025 | 1,100 | 1,132 | (原簿 \$14,672) | | | 2.500% due 12/01/2052 | 99,000 | 81,061 |
| 7.625% due 03/01/2026 | 839 | 877 | 深国政府機関債 28.5% | | | 3.000% due 12/01/2052 | 243,350 | 206,886 |
| 7.875% due 09/15/2023 | 46,749 | 47,578 | Fannie Mae | | | 3.500% due 12/01/2052 | 862,411 | 757,936 |
| Sprint Spectrum Co. LLC | | | 2.614% due 05/25/2048 (g) | \$ 2,241 | 281 | 4.000% due 11/01/2052 | 55,000 | 50,006 |
| 4.738% due 03/20/2025 | 2,425 | 2,392 | 3.000% due 04/01/2037 | 667 | 615 | 4.000% due 12/01/2052 | 107,150 | 97,375 |
| 5.152% due 03/20/2028 | 2,758 | 2,685 | 3.000% due 09/01/2049 | 194 | 167 | 4.500% due 12/01/2052 | 36,200 | 33,940 |
| System Energy Resources, Inc. | | | 3.000% due 03/01/2050 | 18,419 | 15,817 | Freddie Mac | | |
| 2.140% due 12/09/2025 | 6,100 | 5,475 | 3.000% due 10/01/2051 | 1,378 | 1,174 | 3.000% due 05/01/2037 | 1,902 | 1,753 |
| T-Mobile USA, Inc. | | | 3.000% due 12/01/2051 | 210 | 179 | 3.000% due 11/01/2046 | 63 | 54 |
| 3.375% due 04/15/2029 | 5,983 | 5,188 | 3.000% due 02/01/2052 | 10,966 | 9,361 | 3.000% due 12/01/2047 | 1,956 | 1,692 |
| 3.500% due 04/15/2031 | 3,000 | 2,527 | 3.000% due 03/01/2052 | 25,128 | 21,428 | 3.000% due 03/01/2048 | 111 | 96 |
| Topaz Solar Farms LLC | | | 3.000% due 04/01/2052 | 27,202 | 23,152 | 3.000% due 04/01/2052 | 154 | 132 |
| 4.875% due 09/30/2039 | 5,450 | 4,610 | 3.000% due 05/01/2052 | 3,554 | 3,030 | 3.000% due 07/01/2052 | 164 | 140 |
| 5.750% due 09/30/2039 | 7,731 | 7,363 | 3.000% due 06/01/2052 | 9,382 | 8,001 | 3.138% due 06/15/2042 (g) | 33 | 4 |
| Transocean Phoenix 2 Ltd. | | | 3.000% due 07/01/2052 | 7,483 | 6,393 | 3.500% due 10/01/2039 | 122 | 110 |
| 7.750% due 10/15/2024 | 840 | 836 | 3.000% due 08/01/2052 | 3,667 | 3,126 | 3.500% due 10/01/2047 | 2,126 | 1,914 |
| Transocean, Inc. | | | 3.500% due 08/01/2042 | 20 | 18 | 3.500% due 12/01/2047 | 724 | 651 |
| 7.500% due 01/15/2026 | 1,228 | 1,040 | 3.500% due 09/01/2047 | 182 | 165 | 3.500% due 03/01/2048 | 2,588 | 2,325 |
| 8.000% due 02/01/2027 | 2,983 | 2,423 | 3.500% due 03/01/2048 | 56 | 50 | 3.500% due 04/01/2048 | 933 | 840 |
| United Group BV | | | 3.500% due 04/01/2051 | 729 | 653 | 3.500% due 10/01/2048 | 1,039 | 931 |
| 4.875% due 07/01/2024 | EUR 565 | 535 | 4.000% due 07/01/2040 | 7 | 6 | 3.500% due 12/01/2048 | 2,503 | 2,251 |
| Valaris Ltd. | | | 4.000% due 12/01/2041 | 55 | 50 | 3.500% due 03/01/2049 | 1,595 | 1,427 |
| 8.250% due 04/30/2028 | \$ 2,483 | 2,446 | 4.000% due 07/01/2042 | 75 | 67 | 3.500% due 05/01/2051 | 85 | 73 |
| Viatsat, Inc. | | | 4.000% due 08/01/2042 | 8 | 7 | 4.000% due 09/01/2033 | 1 | 1 |
| 5.625% due 09/15/2025 | 3,363 | 3,109 | 4.000% due 09/01/2042 | 98 | 89 | 4.000% due 04/01/2047 | 328 | 307 |
| 6.500% due 07/15/2028 | 2,700 | 2,261 | 4.000% due 11/01/2045 | 98 | 92 | 4.000% due 05/01/2047 | 319 | 298 |
| Windstream Escrow LLC | | | 4.000% due 03/01/2047 | 31 | 29 | 4.000% due 08/01/2047 | 570 | 532 |
| 7.750% due 08/15/2028 | 11,607 | 10,076 | 4.000% due 04/01/2047 | 242 | 227 | 4.000% due 08/01/2048 | 673 | 624 |
| | | 777,725 | 4.000% due 08/01/2047 | 4,110 | 3,834 | 4.000% due 09/01/2048 | 276 | 255 |
| 社債券等合計 | | 2,020,932 | 4.000% due 10/01/2047 | 257 | 239 | 4.000% due 12/01/2048 | 10,622 | 9,840 |
| (原簿 \$2,522,029) | | | 4.000% due 12/01/2047 | 82 | 76 | 4.000% due 01/01/2049 | 4,039 | 3,742 |
| 国債社債券等 0.4% | | | 4.000% due 01/01/2048 | 52 | 48 | 4.000% due 03/01/2049 | 315 | 292 |
| Multiplan Corp. | | | 4.000% due 02/01/2048 | 586 | 546 | 5.000% due 06/01/2034 | 75 | 75 |
| 6.000% due 10/15/2027 | 5,700 | 3,933 | 4.000% due 07/01/2048 | 6,869 | 6,338 | 5.000% due 08/01/2035 | 42 | 41 |
| Nationwide Building Society | | | 4.000% due 08/01/2048 | 4,053 | 3,744 | 5.000% due 01/01/2037 | 3 | 3 |
| 10.250% due 06/20/2166 | GBP 7,405 | 9,571 | 4.000% due 09/01/2048 | 1,153 | 1,075 | 5.000% due 01/01/2038 | 1 | 1 |
| Stichting AK Rabobank Certificaten | | | 4.500% due 05/01/2033 | 15 | 14 | 5.000% due 01/01/2035 | 273 | 271 |
| 6.500% due 03/29/2170 (e) | EUR 30,963 | 28,971 | 4.500% due 05/01/2035 | 6 | 6 | 5.000% due 05/01/2037 | 2 | 2 |
| 転換社債券 | | 42,475 | 4.500% due 02/01/2038 | 1 | 1 | 5.000% due 06/01/2037 | 205 | 203 |
| (原簿 \$67,887) | | | 4.500% due 01/01/2041 | 177 | 164 | 5.750% due 05/01/2037 | 186 | 166 |
| 地方債等 0.2% | | | 4.750% due 06/01/2033 | 172 | 163 | 6.000% due 07/01/2037 | 44 | 44 |
| Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010 | | | 5.000% due 10/01/2035 | 64 | 63 | Ginnie Mae | | |
| 6.630% due 02/01/2035 | \$ 655 | 654 | 5.000% due 12/01/2035 | 148 | 142 | 4.000% due 06/20/2041 | 2 | 1 |
| 6.725% due 04/01/2035 | 310 | 310 | 5.000% due 10/01/2036 | 6 | 6 | 4.000% due 04/20/2047 | 1,622 | 1,520 |
| 7.350% due 07/01/2035 | 506 | 519 | 5.000% due 05/01/2039 | 2 | 2 | 4.000% due 05/20/2047 | 30,018 | 28,145 |
| Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015 | | | 5.000% due 11/01/2039 | 7 | 7 | 4.000% due 06/20/2047 | 14,337 | 13,442 |
| 7.750% due 01/01/2042 | 130 | 131 | 5.500% due 07/01/2033 | 23 | 23 | 4.000% due 07/20/2047 | 12,474 | 11,696 |
| Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017 | | | 5.500% due 06/01/2035 | 699 | 682 | 4.000% due 02/20/2048 | 8,496 | 7,981 |
| 7.045% due 01/01/2029 | 275 | 274 | 5.500% due 04/01/2036 | 1 | 1 | 4.000% due 05/20/2049 | 29,604 | 27,562 |
| Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2021 | | | 5.500% due 11/01/2036 | 2 | 2 | 4.000% due 02/20/2050 | 360 | 337 |
| 4.000% due 07/01/2037 | 2,082 | 1,661 | 5.500% due 01/01/2037 | 11 | 11 | 4.000% due 07/20/2050 | 179 | 166 |
| Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022 | | | 5.500% due 09/01/2037 | 5 | 4 | 4.000% due 08/20/2050 | 27 | 25 |
| 0.000% due 11/01/2043 | 13,426 | 6,142 | 5.500% due 02/01/2038 | 3 | 3 | 4.000% due 09/20/2050 | 2,159 | 2,009 |
| Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. | | | 5.500% due 04/01/2038 | 13 | 13 | 4.000% due 10/20/2050 | 67,643 | 62,916 |
| Revenue Bonds, Series 2021 | | | 6.000% due 08/01/2031 | 22 | 21 | 4.500% due 01/20/2040 | 79 | 76 |
| 2.246% due 06/01/2029 | 1,600 | 1,305 | 6.000% due 06/01/2032 | 1 | 1 | 4.500% due 03/20/2040 | 8 | 7 |
| 3.000% due 06/01/2046 | 710 | 644 | 6.000% due 09/01/2039 | 373 | 368 | 5.000% due 08/20/2030 | 191 | 188 |
| Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (c) | | | 6.000% due 10/01/2047 | 8 | 8 | 5.000% due 05/20/2040 | 276 | 270 |
| 6.050% due 07/01/2032 | 800 | 604 | 6.500% due 01/01/2037 | 2 | 2 | 5.000% due 04/20/2041 | 7 | 7 |
| | | | 6.500% due 10/01/2037 | 3 | 3 | 5.500% due 05/20/2038 | 7 | 7 |
| | | | 7.000% due 09/01/2031 | 30 | 30 | 5.500% due 06/20/2038 | 40 | 40 |
| | | | 7.000% due 05/01/2037 | 1 | 1 | 5.500% due 07/20/2038 | 35 | 34 |
| | | | | | | 5.500% due 08/20/2038 | 279 | 280 |
| | | | | | | 5.500% due 09/20/2038 | 75 | 75 |
| | | | | | | 5.500% due 10/20/2038 | 15 | 15 |

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／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) |
|--|------------------|--------------|--|-------------------|--------------|---|----------------|--------------|
| 5,500% due 01/20/2039 | \$ 11 | \$ 10 | 米国財務省証券合計 | \$ 952,776 | | 5,468% due 04/26/2036 | \$ 4,966 | \$ 2,780 |
| 5,500% due 02/20/2039 | 43 | 43 | ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust | | | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | |
| 5,500% due 09/20/2039 | 54 | 54 | 4.631% due 07/25/2035 | \$ 9,806 | 9,553 | 3.889% due 11/25/2034 | 194 | 186 |
| 5,500% due 10/20/2039 | 9 | 9 | 5.281% due 07/25/2035 (c) | 715 | 600 | Bear Stearns Alternative-A Trust | | |
| 5,500% due 11/20/2039 | 220 | 220 | ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust | | | 3.926% due 04/25/2037 | 6,239 | 5,395 |
| 5,500% due 12/20/2039 | 25 | 24 | 3.741% due 08/25/2036 | 3,949 | 3,723 | 4.006% due 11/25/2046 | 7,446 | 5,656 |
| 5,500% due 01/20/2040 | 194 | 190 | 4.381% due 01/25/2035 | 927 | 834 | Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust | | |
| 5,500% due 06/20/2040 | 245 | 252 | 4.411% due 02/25/2034 | 3,077 | 3,003 | 3.014% due 05/25/2036 (g) | 8,798 | 274 |
| 5,500% due 07/20/2040 | 486 | 478 | 4.486% due 08/25/2035 | 4,857 | 4,707 | 3.826% due 02/25/2037 | 7,228 | 5,322 |
| Ginnie Mae, TBA (h) | | | Adjustable Rate Mortgage Trust | | | 3.888% due 08/25/2047 | 6,300 | 5,936 |
| 2,000% due 11/01/2052 | 19,000 | 15,613 | 4.536% due 08/25/2035 | 3,475 | 3,179 | 3.986% due 05/25/2036 (c) | 8,798 | 3,108 |
| 2,500% due 11/01/2052 | 46,200 | 39,162 | AFC Home Equity Loan Trust | | | 4.126% due 04/25/2036 | 5,026 | 4,994 |
| 3,000% due 11/01/2052 | 133,220 | 116,451 | 4.396% due 06/25/2029 | 1,685 | 1,065 | 4.186% due 02/25/2036 (c) | 2,543 | 2,532 |
| 3,000% due 12/01/2052 | 366,280 | 318,878 | Alternative Loan Trust | | | 4.231% due 12/25/2035 | 713 | 711 |
| 3,500% due 11/01/2052 | 85,700 | 76,721 | 2.721% due 08/25/2035 (c) | 417 | 345 | 4.606% due 06/25/2034 | 4,740 | 4,589 |
| 4,000% due 11/01/2052 | 646,158 | 595,566 | 3.623% due 08/25/2035 (c) | 466 | 418 | 4.636% due 11/25/2035 (c) | 3,116 | 2,770 |
| 4,500% due 11/01/2052 | 4,000 | 3,792 | 3.679% due 09/20/2046 | 711 | 677 | 4.636% due 08/25/2037 | 16,968 | 15,068 |
| 米国政府機関債合計 | 2,732,876 | | 3.757% due 09/25/2034 | 992 | 896 | 4.666% due 12/25/2035 | 9,270 | 7,617 |
| 米国財務省証券 9.9% | | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | 5,500% due 11/25/2033 | 4,076 | 3,645 |
| Treasury Inflation Protected Securities (i) | | | 3.909% due 03/20/2046 | 5,629 | 4,413 | Bear Stearns Mortgage Funding Trust | | |
| 0.125% due 07/15/2024 | 64,736 | 63,127 | 3.926% due 07/25/2046 | 59 | 276 | 3.986% due 02/25/2037 (c) | 5,216 | 4,574 |
| 0.125% due 10/15/2024 | 37,979 | 36,871 | 3.946% due 07/25/2036 | 5,013 | 4,830 | Benchmark Mortgage Trust | | |
| 0.125% due 07/15/2030 | 52,802 | 47,150 | 3.986% due 08/25/2046 (c) | 9,125 | 7,337 | 3.509% due 09/15/2048 | 47,290 | 42,964 |
| 0.125% due 01/15/2031 | 1,934 | 1,714 | 3.988% due 05/25/2036 | 13,102 | 11,058 | 3.899% due 03/15/2062 | 9,775 | 7,396 |
| 0.125% due 07/15/2031 | 7,337 | 6,471 | 4.086% due 12/25/2046 | 14,983 | 12,123 | BHP Trust | | |
| 0.250% due 07/15/2029 | 142,835 | 130,385 | 4.126% due 07/25/2036 | 20,327 | 17,524 | 5.183% due 08/15/2036 | 10,500 | 9,864 |
| 0.250% due 02/15/2050 | 21,151 | 14,090 | 4.129% due 12/20/2035 | 5,472 | 4,796 | BHP Trust 2019-BXHP | | |
| 0.375% due 07/15/2023 | 77,080 | 76,440 | 4.186% due 01/25/2036 | 3,183 | 2,709 | 5.980% due 08/15/2036 | 33,656 | 31,477 |
| 0.375% due 01/15/2027 | 5,694 | 5,383 | 5,500% due 06/25/2035 | 4,775 | 3,851 | BSST Mortgage Trust | | |
| 0.375% due 07/15/2027 (p) | 1,526 | 1,441 | 5,500% due 08/25/2035 (c) | 54 | 46 | 6.226% due 02/15/2037 | 11,000 | 10,209 |
| 0.500% due 04/15/2024 | 26,903 | 26,344 | 5,500% due 02/25/2036 (c) | 15 | 10 | 6.876% due 02/15/2037 | 24,700 | 22,811 |
| 0.625% due 01/15/2024 | 20,195 | 19,866 | 6,000% due 07/25/2037 (c) | 24,656 | 13,144 | 7.876% due 02/15/2037 | 7,500 | 6,886 |
| 0.625% due 07/15/2032 | 87,868 | 80,541 | 7,000% due 10/25/2037 | 29,589 | 11,237 | BX Trust | | |
| 0.625% due 02/15/2043 | 2,834 | 2,238 | Ameriqwest Mortgage Securities Trust | | | 5,058% due 10/15/2036 | 16,400 | 15,169 |
| 0.750% due 07/15/2028 (p) | 33,456 | 31,853 | 4.096% due 04/25/2036 | 2,220 | 2,200 | 5.299% due 10/15/2036 | 7,150 | 6,647 |
| 0.750% due 02/15/2042 | 6,685 | 5,498 | 4.201% due 03/25/2036 | 27,500 | 24,984 | 5,307% due 10/15/2036 | 25,610 | 23,263 |
| 0.750% due 02/15/2045 | 18,237 | 14,515 | Ameriqwest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | 7.787% due 07/15/2034 | 6,800 | 6,551 |
| 0.875% due 01/15/2029 (p) | 61,077 | 58,186 | 4.058% due 09/25/2032 | 167 | 174 | Canterbury Finance No.1 PLC | | |
| 0.875% due 02/15/2047 | 21,349 | 17,173 | 5.341% due 10/25/2034 | 9,913 | 9,213 | 2.465% due 05/16/2056 | GBP | 16,366 |
| 1,000% due 02/15/2046 | 11,500 | 9,605 | Argent Mortgage Loan Trust | | | Capitalsource Real Estate Loan Trust | | |
| 1,000% due 02/15/2048 | 24,981 | 20,566 | 4.066% due 05/25/2035 | 20,545 | 18,224 | 4.559% due 01/20/2037 | \$ 11,122 | 10,055 |
| 1,000% due 02/15/2049 (p) | 63,333 | 52,238 | Argent Securities Trust | | | 4.659% due 01/20/2037 | 4,800 | 4,026 |
| 1.375% due 02/15/2044 | 3,304 | 3,014 | 3.946% due 04/25/2036 | 7,821 | 2,564 | 4.759% due 01/20/2037 | 2,700 | 1,781 |
| 2.125% due 02/15/2040 | 3,426 | 3,586 | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage | | |
| 2.125% due 02/15/2041 | 1,893 | 1,978 | 4.258% due 09/25/2033 | 3,275 | 3,148 | 6.040% due 01/25/2039 (c) | 657 | 600 |
| U.S. Treasury Bonds | | | 4.351% due 10/25/2035 | 36,400 | 31,894 | Centex Home Equity Loan Trust | | |
| 2.250% due 08/15/2046 | 100 | 68 | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | 4.231% due 03/25/2035 | 3,661 | 3,593 |
| 2.750% due 08/15/2047 | 2,830 | 2,124 | 3.806% due 10/25/2036 | 10,129 | 8,287 | Chase Mortgage Finance Trust | | |
| 3,000% due 08/15/2048 | 155 | 123 | 4.246% due 03/25/2035 | 13,129 | 12,529 | 3.067% due 12/25/2035 (c) | 4,087 | 3,494 |
| 3,000% due 02/15/2049 | 77 | 62 | 4.321% due 06/25/2035 | 7,965 | 7,605 | ChaseFlex Trust | | |
| 3.125% due 05/15/2048 | 180 | 146 | Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust | | | 3.886% due 07/25/2037 | 906 | 849 |
| U.S. Treasury Notes | | | 4.051% due 05/25/2036 (c) | 37,847 | 34,858 | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates | | |
| 1.625% due 02/15/2026 (p) | 2,200 | 2,013 | Atrium Hotel Portfolio Trust | | | 3.946% due 03/25/2035 | 275 | 261 |
| 2,000% due 02/15/2025 (p) | 11,021 | 10,430 | 4.842% due 06/15/2035 | 18,395 | 17,329 | CIT Mortgage Loan Trust | | |
| 2,000% due 08/15/2025 (p) | 1,400 | 1,310 | Austin Fairmont Hotel Trust | | | 4.936% due 10/25/2037 | 3,468 | 3,464 |
| 2,000% due 11/15/2026 (p) | 800 | 731 | 5.212% due 09/15/2032 | 3,000 | 2,839 | 5.086% due 10/25/2037 | 28,585 | 26,870 |
| 2,250% due 11/15/2024 (p) | 12,300 | 11,766 | Banc of America Alternative Loan Trust | | | Citigroup Commercial Mortgage Trust | | |
| 2,250% due 02/15/2027 (p) | 28,000 | 25,740 | 3.921% due 01/25/2023 | 58 | 48 | 0.283% due 03/10/2047 (g) | 25,400 | 85 |
| 2,375% due 05/15/2029 (p) | 32,200 | 28,832 | 6,000% due 07/25/2046 (c) | 1,531 | 1,265 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | |
| 2,625% due 02/15/2029 (p) | 5,000 | 4,555 | Banc of America Funding Trust | | | 3.244% due 08/25/2036 | 15,928 | 6,599 |
| 2,750% due 08/15/2032 | 150,100 | 134,340 | 2.765% due 06/20/2036 | 4,196 | 3,366 | 3.291% due 08/25/2036 | 4,085 | 3,865 |
| 2,875% due 05/15/2032 | 290 | 263 | 3.104% due 02/20/2035 | 1,345 | 1,158 | 3.643% due 07/25/2037 (c) | 2,752 | 2,387 |
| | | | 3.547% due 01/20/2047 (c) | 86 | 79 | 3.749% due 07/25/2036 | 10,148 | 5,769 |
| | | | BCAP LLC Trust | | | 3.866% due 12/25/2036 | 2,870 | 2,792 |
| | | | 4.578% due 04/26/2037 | 2,854 | 1,551 | 4.406% due 09/25/2037 | 13,629 | 11,184 |
| | | | | | | 7.250% due 05/25/2036 (c) | 9,326 | 4,866 |
| | | | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | |
| | | | | | | 4.621% due 05/25/2035 | 10,698 | 10,013 |

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／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) |
|--|----------------|--------------|--|----------------|--------------|--|----------------|--------------|
| Commercial Mortgage Trust | | | DBGS Mortgage Trust | | | GSR Mortgage Loan Trust | | |
| 0.177% due 04/10/2047 (g) | \$ 33,000 | \$ 71 | 6.063% due 10/15/2036 | \$ 15,000 | \$ 13,494 | 3.114% due 03/25/2037 (g) | \$ 7,645 | \$ 860 |
| 3.633% due 02/10/2037 | 10,000 | 8,866 | Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust | | | 3.886% due 03/25/2037 | 7,645 | 1,066 |
| 6.563% due 12/15/2038 | 8,575 | 8,021 | 3.906% due 03/25/2037 | 9,717 | 5,282 | HarborView Mortgage Loan Trust | | |
| Conseco Finance Corp. | | | 3.916% due 08/25/2037 (c) | 20,298 | 17,099 | 3.720% due 12/19/2036 (c) | 852 | 773 |
| 6.920% due 12/01/2030 | 1,202 | 1,209 | 4.086% due 09/25/2047 | 12,504 | 10,505 | 4.040% due 02/19/2036 | 10,220 | 6,832 |
| 7.500% due 03/01/2030 | 47,279 | 20,106 | Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | | | 4.120% due 08/19/2045 | 7,922 | 6,040 |
| 7.800% due 04/15/2026 | 4,963 | 1,468 | 3.344% due 10/25/2035 (c) | 9,297 | 8,166 | Hawaii Hotel Trust | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp. | | | 5.062% due 05/15/2038 | 2,000 | 1,885 |
| 4.076% due 08/26/2033 | 219 | 210 | 3.687% due 11/27/2036 | 1,560 | 1,538 | 5.572% due 05/15/2038 | 12,500 | 11,663 |
| 5.461% due 05/25/2035 (c) | 4,282 | 4,166 | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust | | | Home Equity Asset Trust | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | 3.670% due 10/19/2036 (c) | 7,566 | 6,370 | Home Equity due 10/25/2036 | 23,475 | 14,259 |
| 3.160% due 06/25/2034 | 1 | 1 | 4.080% due 10/19/2045 (c) | 524 | 540 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | |
| 3.411% due 03/25/2037 (c) | 3,708 | 3,175 | 4.140% due 09/19/2045 | 5,029 | 3,210 | 3.726% due 11/25/2036 | 12,718 | 11,271 |
| 3.573% due 10/20/2035 (c) | 4,532 | 4,091 | Dragon Finance BV | | | 3.826% due 04/25/2037 | 13,304 | 8,939 |
| 3.638% due 11/25/2034 | 8 | 7 | 3.425% due 07/13/2023 | GBP 42 | 47 | 3.946% due 06/25/2036 | 2,268 | 2,173 |
| 3.638% due 11/25/2037 | 4,686 | 4,243 | Ellington Loan Acquisition Trust | | | 4.576% due 08/25/2035 | 5,221 | 5,105 |
| 5.500% due 11/25/2035 (c) | 6,050 | 3,437 | 4.686% due 05/25/2037 | \$ 1,199 | 1,148 | HPLY Trust | | |
| 6.000% due 07/25/2036 | 17,730 | 10,084 | EMC Mortgage Loan Trust | | | 5.412% due 11/15/2036 | 4,675 | 4,393 |
| 6.000% due 11/25/2037 | 3,719 | 2,127 | 4.636% due 04/25/2042 (c) | 6,336 | 6,234 | 5.762% due 11/15/2036 | 26,212 | 24,505 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | Encore Credit Receivables Trust | | | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | |
| 6.036% due 01/25/2033 | 1,206 | 1,094 | 4.516% due 11/25/2035 | 6,510 | 6,069 | 3.961% due 05/25/2037 | 7,197 | 6,783 |
| Credit Suisse Mortgage Capital | | | Eurosaik-UK PLC | | | Impac CMB Trust | | |
| 3.000% due 01/29/2036 | 544 | 527 | 2.994% due 09/13/2045 | GBP 4,277 | 4,522 | 4.266% due 01/25/2035 | 8,673 | 8,121 |
| 3.000% due 06/27/2037 | 1,462 | 1,441 | 3.174% due 06/13/2045 | 7,502 | 8,576 | Impac Secured Assets Corp. | | |
| 3.254% due 11/27/2036 | 11,043 | 12,537 | Extended Stay America Trust | | | 4.146% due 03/25/2036 (c) | 9,496 | 7,723 |
| 8.810% due 10/26/2036 | 142 | 119 | 6.263% due 07/15/2038 | \$ 15,619 | 14,772 | Impac Secured Assets Trust | | |
| Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | FBR Securitization Trust | | | 3.966% due 01/25/2037 | 2,319 | 1,979 |
| 0.000% due 01/25/2058 | 22 | 22 | 4.261% due 10/25/2035 | 20,476 | 16,975 | IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust | | |
| 0.000% due 04/25/2058 (g) | 1 | 1 | 4.351% due 09/25/2035 | 7,500 | 7,210 | 6.500% due 10/25/2037 | 8,443 | 4,701 |
| 3.562% due 06/25/2050 | 45,723 | 38,011 | First Franklin Mortgage Loan Trust | | | IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust | | |
| 3.592% due 01/25/2058 | 19,089 | 15,473 | 3.896% due 11/25/2036 | 59,328 | 48,481 | 3.233% due 06/25/2037 (c) | 8,451 | 5,679 |
| 3.687% due 06/01/2050 | 43,560 | 43,645 | 3.906% due 04/25/2036 | 4,548 | 4,382 | IndyMac INDX Mortgage Loan Trust | | |
| 3.951% due 04/25/2058 | 30,646 | 28,823 | 4.276% due 01/25/2036 | 24,773 | 22,503 | 3.028% due 07/25/2037 | 19,688 | 16,877 |
| 4.162% due 07/15/2032 | 5,200 | 4,902 | 4.291% due 05/25/2036 | 991 | 987 | 3.067% due 03/25/2036 (c) | 4,133 | 3,166 |
| 4.412% due 07/15/2032 | 4,000 | 3,735 | 4.441% due 04/25/2035 | 3,265 | 3,094 | 3.119% due 04/25/2037 (c) | 6,885 | 5,810 |
| 4.612% due 07/15/2032 | 2,400 | 2,217 | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (c) | | | 3.244% due 04/25/2037 | 13,614 | 11,244 |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | 1.414% due 05/25/2035 (g) | 1,263 | 45 | 3.694% due 11/25/2036 (c) | 11,119 | 7,774 |
| 7.480% due 03/25/2046 | 4,266 | 3,425 | 4.086% due 05/25/2035 | 1,263 | 778 | 3.946% due 02/25/2037 (c) | 22,247 | 20,193 |
| CWABS Asset-Backed Certificates Trust | | | Fontainebleau Miami Beach Trust | | | 3.966% due 10/25/2036 | 5,035 | 2,338 |
| 3.726% due 06/25/2035 (c) | 1,577 | 1,411 | 3.963% due 12/10/2036 | 33,098 | 30,218 | INTOWN Mortgage Trust | | |
| 3.726% due 06/25/2037 | 13,597 | 12,372 | Fremont Home Loan Trust | | | 7.061% due 08/15/2039 | 11,495 | 11,212 |
| 3.726% due 07/25/2037 (c) | 5,642 | 5,521 | 3.866% due 02/25/2037 | 7,291 | 5,564 | IXIS Real Estate Capital Trust | | |
| 3.736% due 04/25/2047 (c) | 591 | 590 | 4.606% due 01/25/2035 | 6,493 | 5,493 | 4.351% due 12/25/2035 | 1,930 | 1,924 |
| 3.766% due 11/25/2047 | 3,747 | 4,091 | Glen Securities Finance DAC | | | Jefferies Resecuritization Trust | | |
| 3.806% due 08/25/2037 | 25,800 | 21,540 | 2.312% due 10/28/2038 | EUR 5,104 | 4,888 | 7.981% due 06/25/2047 (c) | 481 | 390 |
| 3.816% due 05/25/2037 (c) | 12,639 | 11,777 | 3.312% due 10/28/2038 | 3,828 | 3,609 | JPMorgan Alternative Loan Trust | | |
| 3.816% due 10/25/2047 | 8,007 | 7,871 | 4.112% due 10/28/2038 | 1,871 | 1,768 | 2.905% due 03/25/2036 (c) | 307 | 256 |
| 3.836% due 02/25/2036 | 1,176 | 1,118 | GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. | | | 4.146% due 04/25/2047 | 1,683 | 1,595 |
| 3.846% due 09/25/2046 | 5,600 | 5,278 | 5.456% due 03/10/2051 | \$ 11,955 | 10,197 | 5.730% due 03/25/2036 (c) | 72 | 69 |
| 4.006% due 01/25/2045 | 1,494 | 1,481 | GreenPoint Mortgage Funding Trust | | | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | |
| 4.066% due 05/25/2036 | 9,800 | 8,062 | 4.146% due 11/25/2045 | 52 | 39 | 4.262% due 12/15/2036 | 3,700 | 3,576 |
| 4.066% due 03/25/2037 | 29,856 | 27,748 | Grifonas Finance No.1 PLC | | | 5.337% due 05/15/2047 | 197 | 182 |
| 4.066% due 03/25/2047 (c) | 26,535 | 22,676 | 1.264% due 08/28/2039 | EUR 629 | 577 | 5.512% due 09/15/2029 | 1,740 | 1,621 |
| 4.090% due 12/25/2034 | 4 | 4 | GS Mortgage Securities Corporation Trust | | | 5.928% due 11/15/2038 | 16,193 | 14,801 |
| 4.111% due 06/25/2036 | 2,400 | 2,275 | 3.419% due 10/10/2032 | \$ 3,300 | 3,294 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | |
| 4.186% due 06/25/2036 | 1,830 | 1,811 | 4.591% due 10/10/2032 | 8,215 | 7,807 | 3.856% due 08/25/2036 | 8,600 | 7,760 |
| 4.246% due 04/25/2036 | 134 | 134 | GSA Home Equity Trust | | | 3.856% due 06/25/2037 | 34,606 | 32,426 |
| 4.286% due 03/25/2036 (c) | 1,655 | 1,471 | 6.500% due 11/25/2037 (c) | 20 | 9 | 3.866% due 06/25/2037 (c) | 22,826 | 19,350 |
| 4.666% due 05/25/2036 (c) | 2,182 | 1,588 | GSAMP Trust | | | 3.991% due 05/25/2036 | 9,836 | 9,490 |
| 4.681% due 06/25/2035 | 8,400 | 7,850 | 3.726% due 03/25/2047 | 3,737 | 3,381 | 4.021% due 05/25/2036 | 17,725 | 16,685 |
| 5.161% due 11/25/2034 | 6,720 | 6,632 | 3.746% due 01/25/2037 | 17,397 | 10,437 | JPMorgan Mortgage Trust (c) | | |
| 5.536% due 08/25/2035 | 3,000 | 2,806 | 3.906% due 05/25/2046 | 27 | 27 | 3.295% due 01/25/2037 | 438 | 357 |
| 5.633% due 06/25/2035 | 8,644 | 7,015 | 4.106% due 06/25/2036 | 12,650 | 12,077 | 3.866% due 10/25/2035 | 4,004 | 2,929 |
| CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust | | | 4.231% due 11/25/2035 (c) | 6,223 | 5,394 | JPMorgan Resecuritization Trust | | |
| 5.161% due 03/25/2035 | 5,500 | 5,295 | GSMSC Resecuritization Trust | | | 3.225% due 02/26/2037 | 2,174 | 1,987 |
| CWHD Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust | | | 3.264% due 09/26/2036 | 3,896 | 2,571 | Kentmere No.2 PLC | | |
| 3.662% due 03/15/2030 | 319 | 321 | 5.270% due 04/26/2037 | 44,351 | 12,702 | 0.000% due 01/28/2042 | GBP 9,500 | 3,409 |
| | | | | | | 0.870% due 01/28/2042 | 2,439 | 2,276 |

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジなし / 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) |
|---|-----------------|---------------|---|-----------------|---------------|--|-----------------|---------------|
| 2.985% due 01/28/2042 | GBP 54,421 | \$ 59,356 | 6.000% due 12/25/2035 (c) | \$ 481 | \$ 199 | 5.161% due 04/25/2034 | \$ 1,204 | \$ 1,078 |
| 3.585% due 01/28/2042 | 5,693 | 6,121 | Morgan Stanley Reremic Trust | | | Residential Asset Mortgage Products Trust | | |
| 3.935% due 01/28/2042 | 4,066 | 4,360 | 3.404% due 11/26/2036 | 6,042 | 5,270 | 3.936% due 10/25/2036 | 16,691 | 15,347 |
| 4.385% due 01/28/2042 | 2,439 | 2,609 | Mortgage Loan Trust | | | 4.186% due 02/25/2036 | 1,793 | 1,767 |
| 5.185% due 01/28/2042 | 1,626 | 1,741 | 5.370% due 03/25/2034 | 3,310 | 2,983 | 4.261% due 11/25/2035 | 10,786 | 10,472 |
| 7.185% due 01/28/2042 | 3,252 | 3,345 | Natixis Commercial Mortgage Securities Trust | | | 4.266% due 12/25/2035 | 10,537 | 9,485 |
| Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC | | | 3.790% due 11/15/2032 | 1,400 | 1,262 | 4.336% due 09/25/2035 | 8,801 | 8,560 |
| 1.900% due 06/15/2045 | EUR 3,120 | 2,944 | 3.821% due 02/15/2039 | 2,900 | 2,542 | RESIMAC Bastille Trust | | |
| Legacy Mortgage Asset Trust | | | 5.471% due 02/15/2033 | 3,204 | 3,189 | 4.073% due 09/05/2057 | 1,612 | 1,612 |
| 0.000% due 09/25/2059 (g) | \$ 621,026 | 3,092 | New York Mortgage Trust | | | Saxon Asset Securities Trust | | |
| 0.000% due 09/25/2059 | 18,314 | 5,964 | 4.126% due 04/25/2035 | 623 | 590 | 2.472% due 03/25/2035 (c) | 506 | 490 |
| 3.000% due 09/25/2059 | 107,358 | 100,159 | Newgate Funding PLC | | | 5.336% due 12/25/2037 | 3,000 | 2,779 |
| 4.040% due 09/25/2059 | 129,610 | 94,743 | 2.903% due 12/15/2050 | GBP 18,103 | 19,644 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | |
| 5.382% due 01/28/2070 | 33,490 | 33,407 | Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust | | | 4.126% due 03/25/2036 | 5,085 | 4,500 |
| Lehman XS Trust | | | 5.034% due 05/25/2035 (c) | \$ 2,890 | 1,462 | 4.411% due 10/25/2035 | 10,136 | 8,950 |
| 3.786% due 02/25/2037 (c) | 13,119 | 11,256 | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | 4.636% due 03/25/2035 | 6,663 | 6,391 |
| 3.966% due 09/25/2036 | 5,858 | 4,627 | 4.351% due 05/25/2035 | 7,329 | 7,116 | Sequoia Mortgage Trust | | |
| 3.966% due 12/25/2036 | 11,465 | 8,775 | 5.745% due 10/25/2036 (c) | 21,971 | 5,648 | 3.889% due 05/20/2035 | 1,334 | 1,144 |
| 4.106% due 02/25/2047 | 22,721 | 20,159 | Nomura Resecuritization Trust | | | 4.009% due 06/20/2034 | 26 | 23 |
| 5.286% due 10/25/2037 | 13,965 | 12,686 | 1.831% due 03/26/2037 | 5,987 | 5,348 | Sestante Finance Srl | | |
| 6.500% due 06/25/2046 | 4,809 | 3,783 | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | 1.722% due 07/23/2046 | EUR 9,116 | 8,373 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | 3.786% due 09/25/2037 | 18,680 | 17,949 | SFO Commercial Mortgage Trust | | |
| 3.966% due 02/25/2036 | 5,414 | 4,396 | 3.906% due 05/25/2036 | 5,904 | 5,727 | 5.812% due 05/15/2038 | \$ 885 | 792 |
| 3.966% due 03/25/2046 | 33,650 | 12,211 | 3.906% due 10/25/2036 | 5,502 | 3,076 | 6.312% due 05/15/2038 | 22,000 | 19,666 |
| Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust | | | 4.306% due 10/25/2035 | 1,341 | 1,319 | SG Mortgage Securities Trust | | |
| 6.836% due 03/25/2032 | 861 | 862 | NYO Commercial Mortgage Trust | | | 3.946% due 02/25/2036 | 4,822 | 2,792 |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | 5.408% due 11/15/2038 | 30,000 | 27,559 | 4.046% due 07/25/2036 | 8,218 | 1,900 |
| 2.691% due 04/25/2034 | 1 | 1 | 5.958% due 11/15/2038 | 14,400 | 12,906 | Shmrock Residential DAC | | |
| Mastr Asset-Backed Securities Trust | | | Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed | | | 1.793% due 12/24/2059 | EUR 12,335 | 11,838 |
| 3.806% due 11/25/2036 | 26 | 15 | Pass-Through Certificates | | | Soundview Home Loan Trust | | |
| 4.141% due 01/25/2036 | 7,500 | 6,672 | 4.336% due 07/25/2035 | 7,965 | 7,845 | 4.006% due 06/25/2036 (c) | \$ 7,737 | 6,348 |
| 4.736% due 08/25/2037 | 15,101 | 12,413 | Option One Mortgage Loan Trust | | | 4.051% due 06/25/2036 (c) | 46,197 | 38,888 |
| Mastr Specialized Loan Trust | | | 3.686% due 02/25/2037 | 15,375 | 7,894 | 4.066% due 07/25/2036 | 24,020 | 20,998 |
| 4.306% due 02/25/2036 | 5,342 | 4,147 | 3.706% due 03/25/2037 | 8,563 | 8,044 | 4.561% due 03/25/2036 | 8,102 | 6,960 |
| MBRT | | | 3.726% due 03/25/2037 | 36,689 | 31,460 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | |
| 5.062% due 11/15/2036 | 6,435 | 6,167 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through | | | 4.561% due 12/25/2035 | 830 | 804 |
| Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust | | | Certificates | | | SREIT Trust | | |
| 6.586% due 10/25/2037 | 13,033 | 12,145 | 4.321% due 09/25/2035 | 3,107 | 2,974 | 4.857% due 10/15/2038 | 24,605 | 23,162 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | 4.366% due 09/25/2035 (c) | 25,075 | 21,044 | 5.205% due 10/15/2038 | 20,425 | 18,843 |
| 2.845% due 02/25/2033 | 8 | 8 | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | |
| 3.868% due 05/25/2037 | 20,107 | 11,076 | 3.746% due 09/25/2036 | 26,527 | 5,363 | 3.546% due 09/25/2051 | GBP 2,000 | 2,231 |
| 4.306% due 07/25/2034 | 4,854 | 4,221 | Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through | | | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | |
| 4.381% due 09/25/2035 | 1,385 | 1,346 | Trust (c) | | | 2.771% due 05/25/2035 (c) | \$ 56 | 43 |
| 4.666% due 10/25/2035 | 830 | 812 | 3.622% due 07/25/2035 | 9,601 | 6,963 | 3.133% due 06/25/2037 | 2,004 | 1,830 |
| Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust | | | 3.896% due 11/25/2036 | 15,163 | 12,154 | 3.810% due 07/25/2035 (c) | 2,194 | 1,162 |
| 3.836% due 07/25/2036 | 5,076 | 4,282 | Precise Mortgage Funding PLC | | | 3.906% due 10/25/2035 | 4,271 | 3,912 |
| 3.846% due 02/25/2037 | 7,620 | 3,644 | 0.000% due 12/12/2055 | GBP 0 | 1,130 | 4.561% due 08/25/2035 | 9,770 | 8,747 |
| 3.886% due 07/25/2036 | 45,517 | 18,409 | PRET LLC | | | Structured Asset Investment Loan Trust | | |
| 4.066% due 06/25/2036 | 20,749 | 18,302 | 1.843% due 09/25/2051 | \$ 42,432 | 38,399 | 3.736% due 06/25/2036 | 6,701 | 6,423 |
| 4.086% due 07/25/2036 | 45,294 | 18,369 | Quest Trust | | | 4.306% due 04/25/2035 | 4,464 | 4,381 |
| 4.126% due 03/25/2036 | 4,555 | 4,367 | 5.011% due 03/25/2035 | 2,667 | 2,644 | 4.386% due 02/25/2034 | 14,796 | 14,296 |
| 4.321% due 07/25/2035 | 5,965 | 5,751 | RAAC Trust | | | 4.786% due 12/25/2034 | 2,867 | 2,823 |
| 4.586% due 03/25/2033 | 75 | 73 | 4.291% due 02/25/2036 (c) | 9,049 | 8,328 | Structured Asset Mortgage Investments II Trust | | |
| 4.586% due 07/25/2037 | 345 | 334 | 4.336% due 06/25/2047 | 21,346 | 16,791 | 4.006% due 09/25/2047 (c) | 21,264 | 22,853 |
| Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust | | | RBSCG Mortgage Loan Trust | | | 4.026% due 05/25/2036 | 9,948 | 7,658 |
| 0.774% due 11/15/2052 (g) | 132,167 | 3,646 | 6.000% due 01/25/2037 (c) | 2 | 2 | 4.155% due 04/19/2035 | 1,655 | 1,548 |
| Morgan Stanley Capital I Trust | | | Real Estate Asset Liquidity Trust | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | |
| 2.428% due 04/05/2042 | 13,500 | 10,198 | 2.419% due 06/12/2054 | CAD 5,647 | 4,040 | 4.140% due 09/19/2032 | 20 | 19 |
| 5.062% due 08/15/2033 | 2,619 | 2,556 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust | | |
| 5.790% due 12/15/2023 | 21,942 | 20,312 | 4.306% due 11/25/2034 | \$ 53 | 45 | 3.716% due 05/25/2036 | 6,031 | 5,827 |
| 6.489% due 12/15/2023 | 40,574 | 37,162 | 4.586% due 09/25/2037 | 37 | 31 | 3.836% due 05/25/2036 | 3,750 | 3,064 |
| Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust | | | 5.612% due 04/25/2037 | 10,124 | 3,114 | 3.846% due 04/25/2036 | 51 | 51 |
| 4.126% due 02/25/2036 (c) | 18,209 | 17,982 | 5.675% due 06/25/2037 (c) | 3,910 | 1,207 | 3.896% due 07/25/2036 | 17,559 | 17,049 |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | Residential Accredit Securities Corporation Trust | | | 3.906% due 10/25/2036 | 2,804 | 1,925 |
| 4.096% due 02/25/2036 | 14,415 | 13,278 | 3.806% due 02/25/2037 | 22,285 | 21,082 | 4.086% due 04/25/2031 | 8,945 | 8,768 |
| Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust | | | 3.886% due 01/25/2037 | 35,930 | 26,406 | 4.516% due 11/25/2035 | 9,825 | 9,781 |
| 4.046% due 07/25/2036 | 10,169 | 4,363 | 4.081% due 04/25/2036 | 7,681 | 7,540 | Summerhill Residential | | |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | 4.201% due 03/25/2036 | 5,500 | 5,037 | 0.000% due 03/24/2059 | EUR 5 | 4 |
| 2.982% due 11/25/2037 | 1,247 | 923 | 4.561% due 09/25/2035 | 6,582 | 6,382 | 1.793% due 03/24/2059 | 147,216 | 144,290 |

三井住友・ピムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジなし / 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) |
|---|-----------------|------------------|--|-----------------|---------------|--|-----------------|---------------|
| 2.193% due 03/24/2059 | EUR 22,011 | \$ 21,535 | | | | | | |
| 2.743% due 03/24/2059 | 17,746 | 17,350 | | | | | | |
| 3.343% due 03/24/2059 | 14,202 | 13,785 | | | | | | |
| 4.593% due 03/24/2059 | 8,521 | 8,256 | | | | | | |
| 5.943% due 03/24/2059 | 4,256 | 4,123 | | | | | | |
| 6.500% due 03/24/2059 | 6,588 | 5,512 | | | | | | |
| 6.943% due 03/24/2059 | 4,256 | 4,125 | | | | | | |
| 7.000% due 03/24/2059 | 35,506 | 27,651 | | | | | | |
| Sutherland Commercial Mortgage Loans | | | | | | | | |
| 3.192% due 05/25/2037 | \$ 50 | 50 | | | | | | |
| Taurus UK DAC | | | | | | | | |
| 2.637% due 06/22/2029 | GBP 5,417 | 6,119 | | | | | | |
| Terwin Mortgage Trust | | | | | | | | |
| 4.966% due 03/25/2035 | \$ 2,943 | 2,712 | | | | | | |
| Tharaldson Hotel Portfolio Trust | | | | | | | | |
| 5.499% due 11/11/2034 | 4,718 | 4,428 | | | | | | |
| Towd Point Mortgage Trust | | | | | | | | |
| 3.750% due 09/25/2062 | 104,988 | 97,533 | | | | | | |
| Trinidad Mortgage Securities PLC | | | | | | | | |
| 3.110% due 01/24/2059 | GBP 5,042 | 5,746 | | | | | | |
| Truman Capital Mortgage Loan Trust | | | | | | | | |
| 3.846% due 03/25/2036 | \$ 849 | 838 | | | | | | |
| Verus Securitization Trust | | | | | | | | |
| 4.474% due 04/25/2067 | 32,656 | 30,704 | | | | | | |
| Wachovia Mortgage Loan Trust | | | | | | | | |
| 4.276% due 10/25/2035 | 3,180 | 2,781 | | | | | | |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | | | | | |
| 4.306% due 01/25/2045 | 412 | 370 | | | | | | |
| Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC | | | | | | | | |
| 0.000% due 12/21/2049 | GBP 0 | 272 | | | | | | |
| 3.040% due 12/21/2049 | 27,586 | 31,734 | | | | | | |
| 3.798% due 12/21/2049 | 4,921 | 5,658 | | | | | | |
| 4.240% due 12/21/2049 | 2,460 | 2,827 | | | | | | |
| 4.740% due 12/21/2049 | 1,406 | 1,615 | | | | | | |
| 5.240% due 12/21/2049 | 1,406 | 1,614 | | | | | | |
| 6.670% due 12/21/2049 | 0 | 3,395 | | | | | | |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates | | | | | | | | |
| WMALT Trust (c) | | | | | | | | |
| 2.221% due 10/25/2046 | \$ 10,743 | 8,696 | | | | | | |
| 5.500% due 11/25/2035 | 62 | 54 | | | | | | |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | | | | | | |
| 4.006% due 03/25/2037 | 794 | 769 | | | | | | |
| Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | | | | | |
| 4.186% due 04/25/2034 | 3,873 | 3,657 | | | | | | |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | | | | | | |
| 4.464% due 10/25/2036 (c) | 174 | 159 | | | | | | |
| WFRBS Commercial Mortgage Trust | | | | | | | | |
| 0.423% due 03/15/2047 (g) | 8,800 | 50 | | | | | | |
| モーゲージ証券合計 | | 3,574,196 | | | | | | |
| (原簿 \$3,974,104) | | | | | | | | |
| 資産担保証券 4.1% | | | | | | | | |
| AASET Trust | | | | | | | | |
| 3.967% due 05/16/2042 | 153 | 118 | | | | | | |
| ALESCO Preferred Funding XI Ltd. | | | | | | | | |
| 4.054% due 12/23/2036 | 5,000 | 4,306 | | | | | | |
| American Homes 4 Rent Trust | | | | | | | | |
| 6.231% due 10/17/2036 | 1,150 | 1,131 | | | | | | |
| Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | | | | | | |
| 5.226% due 05/15/2037 | 3,146 | 3,061 | | | | | | |
| Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion | | | | | | | | |
| 2.909% due 02/28/2032 | EUR 2,000 | 1,928 | | | | | | |
| BlueMountain CLO XXII Ltd. | | | | | | | | |
| 5.158% due 07/15/2031 | \$ 3,900 | 3,779 | | | | | | |
| BPCE Ltd. | | | | | | | | |
| 5.816% due 01/16/2037 | 13,800 | 13,672 | | | | | | |
| 6.518% due 01/16/2037 | 3,468 | 3,441 | | | | | | |
| 7.216% due 01/16/2037 | 13,516 | 13,133 | | | | | | |
| Cairn CLO III DAC | | | | | | | | |
| 2.688% due 10/20/2028 | EUR 2,270 | \$ 2,216 | | | | | | |
| Cairn CLO VI DAC | | | | | | | | |
| 0.935% due 07/25/2029 | 1,584 | 1,548 | | | | | | |
| Castlelake Aircraft Securitization Trust | | | | | | | | |
| 4.125% due 06/15/2043 | \$ 1,461 | 1,281 | | | | | | |
| Cologix Canadian Issuer LP | | | | | | | | |
| 4.940% due 01/25/2052 | CAD 1,800 | 1,217 | | | | | | |
| FAB CBO BV | | | | | | | | |
| 1.826% due 08/20/2080 (c) | EUR 80 | 78 | | | | | | |
| Gateway Casinos & Entertainment Ltd. | | | | | | | | |
| 5.000% due 03/12/2038 | CAD 8,464 | 5,402 | | | | | | |
| Goodgreen | | | | | | | | |
| 3.830% due 10/15/2053 | \$ 4,635 | 4,212 | | | | | | |
| Harley Marine Financing LLC | | | | | | | | |
| 6.682% due 05/15/2043 | 4,913 | 4,318 | | | | | | |
| Humboldt Americas LLC | | | | | | | | |
| 0.000% due 11/30/2022 | COP 62,570,000 | 12,281 | | | | | | |
| Jubilee CLO DAC | | | | | | | | |
| 2.128% due 07/12/2028 | EUR 87 | 86 | | | | | | |
| KKR CLO 18 Ltd. | | | | | | | | |
| 5.134% due 07/18/2030 | \$ 1,792 | 1,755 | | | | | | |
| LoanCore Issuer Ltd. | | | | | | | | |
| 4.712% due 07/15/2036 | 2,350 | 2,253 | | | | | | |
| 4.712% due 11/15/2038 | 19,100 | 18,319 | | | | | | |
| METAL LLC | | | | | | | | |
| 4.581% due 10/15/2042 | 11,855 | 9,558 | | | | | | |
| MF1 LLC | | | | | | | | |
| 5.617% due 06/19/2037 | 22,100 | 21,693 | | | | | | |
| 6.102% due 09/17/2037 | 9,600 | 9,503 | | | | | | |
| 6.117% due 06/19/2037 | 8,236 | 8,034 | | | | | | |
| MMceps Funding XVII Ltd. | | | | | | | | |
| 3.432% due 12/01/2035 | 544 | 535 | | | | | | |
| National Collegiate Student Loan Trust | | | | | | | | |
| 2.624% due 10/25/2033 | 4,462 | 4,290 | | | | | | |
| Navient Private Education Loan Trust | | | | | | | | |
| 4.312% due 11/15/2068 | 1,550 | 1,487 | | | | | | |
| 5.562% due 12/15/2045 | 3,003 | 3,027 | | | | | | |
| Netnet Student Loan Trust | | | | | | | | |
| 4.386% due 09/25/2065 | 2,798 | 2,760 | | | | | | |
| Rockford Tower Europe CLO DAC | | | | | | | | |
| 2.060% due 12/20/2031 | EUR 12,800 | 12,324 | | | | | | |
| Sapphire Aviation Finance I Ltd. | | | | | | | | |
| 4.250% due 03/15/2040 | \$ 17,848 | 13,603 | | | | | | |
| Saranac CLO III Ltd. | | | | | | | | |
| 5.202% due 06/22/2030 | 26,301 | 25,876 | | | | | | |
| SMB Private Education Loan Trust | | | | | | | | |
| 0.000% due 02/16/2055 | 3 | 6,208 | | | | | | |
| 3.940% due 02/16/2055 | 25,092 | 23,095 | | | | | | |
| 4.241% due 02/16/2055 | 25,092 | 24,319 | | | | | | |
| 4.550% due 02/16/2055 | 6,414 | 7,696 | | | | | | |
| 4.950% due 02/16/2055 | 2,185 | 1,977 | | | | | | |
| 5.950% due 02/16/2055 | 3,907 | 3,591 | | | | | | |
| Sound Point CLO XV Ltd. | | | | | | | | |
| 5.225% due 01/23/2029 | 1,568 | 1,546 | | | | | | |
| Taberna Preferred Funding I Ltd. | | | | | | | | |
| 4.218% due 07/05/2035 | 3,362 | 3,064 | | | | | | |
| Theorem Funding Trust | | | | | | | | |
| 6.060% due 12/15/2028 | 8,372 | 8,224 | | | | | | |
| Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. | | | | | | | | |
| 4.212% due 05/17/2032 | 472 | 399 | | | | | | |
| TICP CLO III-2 Ltd. | | | | | | | | |
| 5.083% due 04/20/2028 | 10,405 | 10,302 | | | | | | |
| Tropic CDO V Ltd. | | | | | | | | |
| 4.399% due 07/15/2036 | 10,258 | 9,745 | | | | | | |
| TRTX Issuer Ltd. | | | | | | | | |
| 4.441% due 02/15/2039 | 4,500 | 4,351 | | | | | | |
| TruPS Financials Note Securitization Ltd. | | | | | | | | |
| 4.844% due 03/30/2039 | 19,898 | 18,960 | | | | | | |
| 5.097% due 09/20/2039 | 3,631 | 3,440 | | | | | | |
| Upstart Pass-Through Trust | | | | | | | | |
| 3.800% due 04/20/2030 | \$ 27,081 | \$ 25,314 | | | | | | |
| Upstart Securitization Trust | | | | | | | | |
| 5.500% due 06/20/2032 | 11,653 | 11,549 | | | | | | |
| Venture XVII CLO Ltd. | | | | | | | | |
| 4.959% due 04/15/2027 | 25,095 | 24,656 | | | | | | |
| Venture XXI CLO Ltd. | | | | | | | | |
| 4.959% due 07/15/2027 | 212 | 212 | | | | | | |
| 資産担保証券合計 | | 397,273 | | | | | | |
| (原簿 \$427,456) | | | | | | | | |
| ソブリン債 6.2% | | | | | | | | |
| Abu Dhabi Government International Bond | | | | | | | | |
| 3.875% due 04/16/2050 | 2,600 | 2,021 | | | | | | |
| Argentina Government International Bond | | | | | | | | |
| 0.500% due 07/09/2030 | 78,827 | 16,176 | | | | | | |
| 1.000% due 07/09/2029 | 4,943 | 1,023 | | | | | | |
| 1.500% due 07/09/2035 | 51,459 | 10,237 | | | | | | |
| 1.500% due 07/09/2046 | 1,035 | 212 | | | | | | |
| 3.500% due 07/09/2041 | 44,349 | 10,644 | | | | | | |
| 3.875% due 01/09/2038 | 25,740 | 6,696 | | | | | | |
| Argentina Treasury Bond BONCOR (i) | | | | | | | | |
| 1.400% due 03/25/2023 | ARS 581,348 | 6,042 | | | | | | |
| 1.450% due 08/13/2023 | 289,924 | 2,603 | | | | | | |
| Argentine Bonos del Tesoro | | | | | | | | |
| 15.500% due 10/17/2026 | 49,200 | 36 | | | | | | |
| | | | | | | | | |

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

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|---|----------------|----------------|
| 14,730% due 04/24/2024 RUB | 5,057,901 | \$ 40,988 |
| Serbia Government International Bond | | |
| 1.650% due 03/03/2023 EUR | 4,900 | 2,877 |
| 3.125% due 05/15/2027 | 4,434 | 3,744 |
| South Africa Government International Bond | | |
| 8.000% due 01/31/2030 ZAR | 61,300 | 2,865 |
| 8.250% due 03/31/2032 | 73,300 | 3,285 |
| 8.750% due 02/28/2048 | 34,700 | 1,427 |
| 8.875% due 02/28/2035 | 52,400 | 2,328 |
| 10,500% due 12/1/2028 | 2,153,900 | 122,824 |
| State Agency of Roads of Ukraine | | |
| 6.250% due 06/24/2030 (h) | \$ 1,200 | 181 |
| Turkey Government International Bond | | |
| 4.250% due 03/13/2025 | 34,000 | 30,894 |
| 5.250% due 03/13/2030 | 29,000 | 21,743 |
| 6.125% due 10/24/2028 | 10,100 | 8,445 |
| 7.625% due 04/26/2029 | 30,900 | 27,407 |
| Turkiye Ithracat Kredi Bankasi AJS | | |
| 8.250% due 01/24/2024 | 3,000 | 2,959 |
| Ukraine Government International Bond | | |
| 4.375% due 01/27/2032 (h) EUR | 1,658 | 262 |
| 7.750% due 09/01/2025 | \$ 4,390 | 951 |
| United Kingdom Gilt | | |
| 1.250% due 07/31/2051 GBP | 180 | 120 |
| 1.500% due 07/22/2047 | 80 | 59 |
| 1.750% due 01/22/2049 | 160 | 125 |
| 3.250% due 01/22/2044 | 150 | 158 |
| 3.500% due 01/22/2045 | 140 | 153 |
| Venezuela Government International Bond (c) | | |
| 6.000% due 12/09/2049 | \$ 3,367 | 219 |
| 7.000% due 03/31/2038 | 1,883 | 141 |
| 7.650% due 04/21/2025 | 5,349 | 401 |
| 7.750% due 04/13/2024 | 1,200 | 78 |
| 8.250% due 10/13/2024 | 5,991 | 434 |
| 9.000% due 05/07/2023 | 3,161 | 205 |
| 9.250% due 09/15/2027 | 4,274 | 321 |
| 9.250% due 05/07/2028 | 6,512 | 488 |
| 11,750% due 10/21/2028 | 680 | 51 |
| 11,950% due 08/05/2031 | 6,000 | 450 |
| ソブリン債合計 | | 596,820 |
| (原価 \$860,427) | | |
| | 株式数 | |
| 普通株式 1.3% | | |
| Cairo Mezz PLC | 847,444 | 96 |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. | 5,292,182 | 7,568 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. (I) | 421,249 | 46 |
| Credit Suisse Group AG | 601,156 | 2,492 |
| Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A. | 10,169,333 | 10,040 |
| iHeartMedia, Inc. Class A | 1,246,745 | 10,323 |
| iHeartMedia, Inc. Class B | 967,427 | 7,209 |
| Intelsat S.A. (I) | 963,915 | 26,990 |
| National Bank of Greece S.A. | 102,570 | 372 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC (I) | 151,112 | 27,423 |
| Noble Corp. PLC | 768,399 | 27,693 |
| Stearns Holdings LLC | 110,747 | 0 |
| Voyager Aviation Holdings LLC | 616 | 0 |

| | 株式数 | 時価 (単位：千) |
|---|-------------------------|----------------|
| Westmoreland Mining Holdings LLC (I) | 8,912 | \$ 98 |
| 普通株式合計 | | 120,350 |
| (原価 \$176,368) | | |
| 商業不動産株式 0.3% | | |
| CBL & Associates Properties, Inc. | 6 | 172 |
| Uniti Group, Inc. | 110 | 850 |
| VICI Properties, Inc. | 760 | 24,350 |
| 商業不動産株式合計 | | 25,372 |
| (原価 \$6,351) | | |
| 新株予約権 0.0% | | |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. | 210 | 1,040 |
| 新株予約権合計 | | 1,040 |
| (原価 \$0) | | |
| ワラント 0.0% | | |
| Intelsat S.A. | 26 | 91 |
| 02/17/2027 | | |
| Sequa Corp. | 10 | 8 |
| 12/31/2049 | | |
| Stearns Holdings LLC | 1 | 0 |
| 12/31/2049 | | |
| Windstream Services LLC | 226 | 3,732 |
| 09/21/2055 | | |
| ワラント合計 | | 3,831 |
| (原価 \$22,629) | | |
| 優先証券 0.0% | | |
| Cayenne Aviation LLC | 3,693 | 1,057 |
| 9.500% | | |
| Sequa Corp. | 1,418 | 1,828 |
| 15.000% | | |
| 優先証券合計 | | 2,885 |
| (原価 \$2,292) | | |
| | PRINCIPAL AMOUNT (000s) | |
| 短期証券 11.0% | | |
| コマーシャル・ペーパー 4.0% | | |
| Federal Home Loan Bank | | |
| 3.060% due 01/03/2023 | \$ 104,700 | 104,703 |
| 3.060% due 01/04/2023 | 77,700 | 77,702 |
| 3.070% due 01/06/2023 | 98,700 | 98,701 |
| 3.070% due 01/10/2023 | 98,600 | 98,607 |
| レボ取引 6.2% | | |
| | | 597,100 |
| 定期性預金 0.6% | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | | |
| 1.410% due 11/01/2022 GBP | 276 | 318 |
| 1.620% due 11/01/2022 AUD | 1,199 | 767 |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 5,180 | 5,180 |
| Bank of Nova Scotia | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | CAD 427 | 427 |
| 2.810% due 11/01/2022 | CAD 164 | 120 |
| BNP Paribas Bank | | |
| (0.240%) due 11/01/2022 CHF | 1 | 1 |
| 0.310% due 11/01/2022 EUR | 1,602 | 1,583 |
| 0.420% due 11/01/2022 DKK | 3 | 0 |
| 1.290% due 11/01/2022 NOK | 562 | 54 |
| 1.620% due 11/01/2022 AUD | 81 | 52 |
| 2.050% due 11/01/2022 NZD | 509 | 296 |
| 5.150% due 11/01/2022 ZAR | 8,091 | 440 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|----------------------|
| Brown Brothers Harriman & Co. | | |
| (0.270%) due 11/01/2022 | ¥ 132 | \$ 1 |
| 0.310% due 11/01/2022 EUR | 1 | 1 |
| 0.850% due 11/01/2022 SEK | 1 | 0 |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 3 | 3 |
| Citibank N.A. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 4,337 | 4,337 |
| DBS Bank Ltd. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | 2,702 | 2,702 |
| HSBC Bank PLC | | |
| 0.310% due 11/01/2022 EUR | 558 | 551 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 5,782 | 5,782 |
| MUFG Bank Ltd. | | |
| (0.270%) due 11/01/2022 | ¥ 251,387 | 1,691 |
| Royal Bank of Canada | | |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 5,725 | 5,725 |
| 2.810% due 11/01/2022 CAD | 129 | 94 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| (0.270%) due 11/01/2022 | ¥ 2 | 0 |
| 0.310% due 11/01/2022 EUR | 12,088 | 11,947 |
| 1.410% due 11/01/2022 GBP | 222 | 256 |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 4,392 | 4,392 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | |
| (0.270%) due 11/01/2022 | ¥ 44,520 | 300 |
| 1.410% due 11/01/2022 GBP | 1,469 | 1,691 |
| 2.580% due 11/01/2022 | \$ 4,474 | 4,474 |
| | | 53,185 |
| 米国短期証券 0.3% | | |
| 2.759% due 11/25/2022 (k) | 13,900 | 13,870 |
| 2.901% due 12/01/2022 (j)(lr) | 13,300 | 13,262 |
| | | 27,132 |
| 短期証券合計 | | 1,057,130 |
| (原価\$1,057,127) | | |
| 有価証券に対する投資合計126.3% | | \$ 12,119,648 |
| (原価\$13,587,614) | | |
| 金融デリバティブ商品 (1.5%) | | (148,626) |
| (原価またはプレミアム (純額) \$(32,050)) | | |
| その他資産および負債 純額(24.8%) | | (2,376,583) |
| 純資産 100.0% | | \$ 9,594,439 |

マネー・マーケット・マザーファンド

第12期 (2022年3月2日から2023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 |
| 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 |
| 12期 (2023年3月1日) | 9,991 | △0.0 | 74.7 | 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

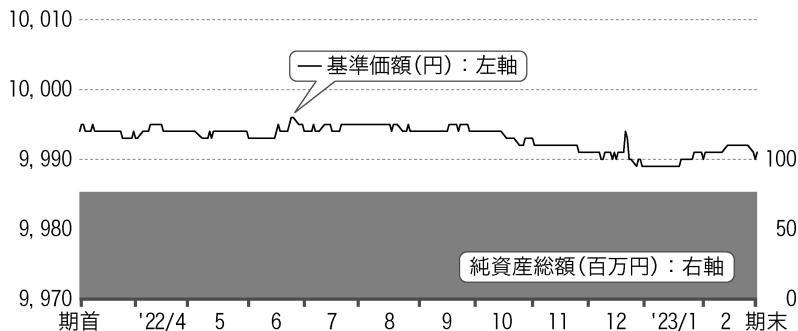
| 年月日 | 基準価額 | | 公社債 組入比率 |
|-------------------|------------|--------|-------------|
| | | 騰落率 | |
| (期首) 2022年3月1日 | 円 9,994 | % - | % 76.0 |
| 3月末 | 9,993 | △0.0 | 76.1 |
| 4月末 | 9,994 | 0.0 | 76.0 |
| 5月末 | 9,993 | △0.0 | 74.8 |
| 6月末 | 9,994 | 0.0 | 74.8 |
| 7月末 | 9,995 | 0.0 | 74.8 |
| 8月末 | 9,994 | 0.0 | 74.7 |
| 9月末 | 9,994 | 0.0 | 74.8 |
| 10月末 | 9,993 | △0.0 | 74.8 |
| 11月末 | 9,991 | △0.0 | 74.7 |
| 12月末 | 9,989 | △0.1 | 74.8 |
| 2023年1月末 | 9,990 | △0.0 | 74.8 |
| 2月末 | 9,990 | △0.0 | 74.7 |
| (期末) 2023年3月1日 | 9,991 | △0.0 | 74.7 |

※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 (2022年3月2日から2023年3月1日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|--------|
| 期首 | 9,994円 |
| 期末 | 9,991円 |
| 騰落率 | -0.0% |

▶ 基準価額の変動要因 (2022年3月2日から2023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 (2022年3月2日から2023年3月1日まで)

短期金利は低下しました。

世界的にインフレが高止まりを続けたことや、欧米中央銀行による大幅な利上げの継続を背景に円安が進行したことから、国内でも物価上昇率が拡大し、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は前年比+4%台まで上昇しました。しかし、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方から、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、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、年末越え運用ニーズの強まりから一時的に大きく低下す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 (2022年3月2日から2023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の下、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 (2022年3月2日から2023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

商品市況の高騰や為替の円安を背景に、当面は物価上昇率の高止まりが続きますが、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方を維持し、マイナス金利政策を継続する見込みです。従って、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(2022年3月2日から2023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9,993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(2022年3月2日から2023年3月1日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------|--------|----------|
| 国内 | | 千円 | 千円 |
| | 国債証券 | 14,088 | — |
| | 特殊債証券 | 43,359 | — |
| | | | (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。

■ 利害関係人との取引状況等(2022年3月2日から2023年3月1日まで)

当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3月2日から2023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 (2023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 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 14,000 | 14,077 | 18.4 | — | — | — | 18.4 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) | (—) |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 43,000 | 43,129 | 56.3 | — | — | — | 56.3 |
| | (43,000) | (43,129) | (56.3) | (—) | (—) | (—) | (56.3) |
| 合 計 | 57,000 | 57,206 | 74.7 | — | — | — | 74.7 |
| | (43,000) | (43,129) | (56.3) | (—) | (—) | (—) | (56.3) |

※()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。

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 |
| 国 債 証 券 | 332 10年国債 | % | 千円 | 千円 | |
| | | 0.6000 | 14,000 | 14,077 | 2023/12/20 |
| | 小 計 | — | 14,000 | 14,077 | — |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 189 政保道路機構 | 0.5410 | 14,000 | 14,013 | 2023/04/28 |
| | 2 政保新関西空港 | 0.8820 | 14,000 | 14,044 | 2023/06/27 |
| | 200 政保道路機構 | 0.8010 | 15,000 | 15,071 | 2023/09/29 |
| | 小 計 | — | 43,000 | 43,129 | — |
| | 合 計 | — | 57,000 | 57,206 | — |

■ 投資信託財産の構成

(2023年3月1日現在)

| 項 目 | 期 | 末 |
|-------------------------|--------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 57,206 | 74.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 19,355 | 25.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 76,561 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年3月1日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------|-------------|
| (A) 資 産 | 76,561,741円 |
| コール・ローン等 | 19,305,618 |
| 公社債(評価額) | 57,206,522 |
| 未収利息 | 47,530 |
| 前払費用 | 2,071 |
| (B) 負 債 | 300 |
| その他未払費用 | 300 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 76,561,441 |
| 元 本 | 76,632,575 |
| 次期繰越損益金 | △ 71,134 |
| (D) 受益権総口数 | 76,632,575口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,991円 |

※当期における期首元本額76,632,575円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額0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2022年3月2日 至2023年3月1日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 414,167円 |
| 受 取 利 息 | 422,396 |
| 支 払 利 息 | △ 8,229 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △434,550 |
| 売 買 損 益 | △434,550 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 4,028 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 24,411 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 46,723 |
| (F) 合 計(D+E) | △ 71,134 |
| 次期繰越損益金(F) | △ 71,134 |

※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。