

■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 | 無期限（設定日：2018年3月27日） |
| 運用方針 | 外国投資信託証券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して安定運用を行います。 |
| 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。 PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等 PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等。また、資産の60%を社債等に投資します。 |
| 当ファンドの運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> ■主としてオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはその関連派生商品（先物取引、オプション取引、各種スワップ取引等）で運用します。 ■外貨建資産については、原則として円に対しての為替ヘッジを行いません。 ■ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ■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 | <ul style="list-style-type: none"> ■年1回（原則として毎年11月5日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入と売買取引（評価益を含みません。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。 <small>※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。</small> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）</p> </div> |

三井住友・豪ドル債ファンド (年1回決算型)

【運用報告書(全体版)】

(2018年11月6日から2019年11月5日まで)

第 **2** 期

決算日 2019年11月5日

受益者の皆さまへ

当ファンドは外国投資信託証券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して安定運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
(旧:三井住友アセットマネジメント)
 〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<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

フリーダイヤル 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・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | (ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円ベース) | | PIMCOケイマン オーストラリア・ マルチセクター・ ファンド組入比率 | PIMCOケイマン オーストラリア・ コーポレート・ ファンド組入比率 | 純資産額 総 |
|---------------------|-------------|-----------|-----------|--|-----------|---|--|-----------|
| | (分配落) | 税込 分配金 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | |
| (設定日) 2018年3月27日 | 円 10,000 | 円 - | % - | 100.00 | % - | % - | % - | 百万円 1 |
| 1期(2018年11月5日) | 10,074 | 0 | 0.7 | 102.28 | 2.3 | 77.8 | 19.4 | 334 |
| 2期(2019年11月5日) | 10,061 | 0 | △0.1 | 103.72 | 1.4 | 77.6 | 18.8 | 558 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスは、前日の指数を当日の対顧客電信売買の仲値により邦貨換算したもので、設定日を100として2019年11月5日現在知りえた情報にもとづき指数化した当社計算値です。

※ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ビーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）は、委託会社の関係会社ではありません。ブルームバーグは、三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）を承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ビーの商標またはサービスマークであり、委託会社に対してライセンスされています。ブルームバーグは、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスに関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

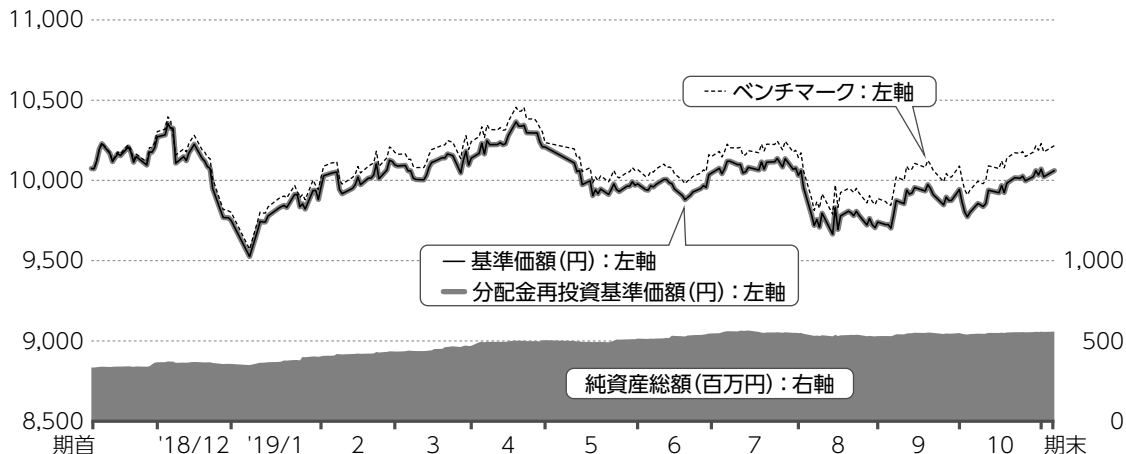
| 年月日 | 基準価額 | | (ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円ベース) | | PIMCOケイマン オーストラリア・ マルチセクター・ ファンド組入比率 | PIMCOケイマン オーストラリア・ コーポレート・ ファンド組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|--|--------|---|--|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2018年11月5日 | 円 10,074 | % - | 102.28 | % - | % 77.8 | % 19.4 |
| 11月末 | 10,271 | 2.0 | 104.62 | 2.3 | 77.5 | 19.2 |
| 12月末 | 9,751 | △3.2 | 99.51 | △2.7 | 76.5 | 19.0 |
| 2019年1月末 | 9,958 | △1.2 | 101.71 | △0.6 | 77.7 | 19.1 |
| 2月末 | 10,097 | 0.2 | 103.30 | 1.0 | 77.5 | 19.1 |
| 3月末 | 10,139 | 0.6 | 103.99 | 1.7 | 81.3 | 19.9 |
| 4月末 | 10,208 | 1.3 | 103.92 | 1.6 | 75.5 | 18.5 |
| 5月末 | 9,978 | △1.0 | 102.22 | △0.1 | 77.1 | 18.8 |
| 6月末 | 10,045 | △0.3 | 103.04 | 0.7 | 77.5 | 18.9 |
| 7月末 | 10,031 | △0.4 | 102.97 | 0.7 | 77.8 | 18.8 |
| 8月末 | 9,740 | △3.3 | 100.39 | △1.9 | 78.7 | 19.1 |
| 9月末 | 9,943 | △1.3 | 102.44 | 0.2 | 78.6 | 19.0 |
| 10月末 | 10,071 | △0.0 | 103.86 | 1.5 | 77.8 | 18.8 |
| (期末) 2019年11月5日 | 10,061 | △0.1 | 103.72 | 1.4 | 77.6 | 18.8 |

※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（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 10,074円 |
| 期末 | 10,061円 (分配金0円(税引前)込み) |
| 騰落率 | -0.1% (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)

※当ファンドのベンチマークは、ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円ベース)です。

※ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)は、委託会社の関係会社ではありません。ブルームバーグは、三井住友・豪ドル債ファンド(年1回決算型)を承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標またはサービスマークであり、委託会社に対してライセンスされています。ブルームバーグは、ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックスに関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。

基準価額の主な変動要因（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

当ファンドは投資信託証券への投資を通じてオーストラリアドル建ての債券等に投資を行い、ベンチマークであるブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ベース）を上回る投資成果を目指しました。

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- オーストラリアで利下げが続き、金利が低下（債券価格は上昇）したこと

下落要因

- 為替相場において、豪ドル安・円高が進行したこと

組入れファンドの状況

| 組入れファンド | 投資資産 | 期末組入比率 |
|-----------------------------------|------|--------|
| PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド | 外国債券 | 77.6% |
| PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド | 外国債券 | 18.8% |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

オーストラリア債券市場は上昇しました。為替市場では豪ドル安・円高となりました。

債券市場

期首から8月にかけて、米中通商問題の長期化や世界経済の減速懸念を背景に世界的に金利低下が進みました。加えて、RBA（オーストラリア準備銀行）が国内経済に対する慎重な見方を示しつつ、6月と7月に利下げを行うなど緩和的な金融政策を継続したこともあり、オーストラリア債券市場でも金利低下が進みました。

9月以降は、米中通商問題の進展期待が高まったことなどから、グローバルでは金利低下傾向は一服しました。ただしオーストラリアでは、RBAが引き続き国内経済に対する慎重な見方を示し、10月にも利下げを実施したことなどが相場を下支えたため、債券市場は期末まで、もみあい推移しました。

当期のブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（豪ドルベース）は、10.3%上昇しました。

為替市場

期首から年末にかけて、世界経済の減速懸念が高まる中、豪ドルは対円および対米ドルで下落しました。特に12月には、世界的な株価下落の影響もあり、豪ドルは対円で急落しました。

1月から4月にかけては、中国の景気刺激策が好感されたことで上海総合指数や商品市場が上昇したことに伴い、豪ドルは一時下落幅を縮小しました。しかし、5月から8月にかけては、米中通商問題の波及懸念の高まりや、RBAの利下げを含む緩和的な金融政策を継続から、豪ドルは下落しました。その後9月以降は、米中通商交渉の進展期待などを背景に、豪ドルは円に対して上昇基調で推移しました。期を通してみれば、豪ドルは対円および対米ドル双方で下落しました。

当期の豪ドル・円は期首81円51銭から期末74円84銭と6円67銭の豪ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

当ファンド

「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」を組み入れました。

組入れファンド

●デュレーション（投資資金の平均回収期間）戦略

オーストラリアのデュレーション戦略では、期を通して金利リスクを若干のオーバーウェイト（長め）としました。一方で、日本を売り持ちするなど、ポートフォリオ全体としてのデュレーションは若干のアンダーウェイト

（短め）としました。

●イールドカーブ（利回り曲線）戦略

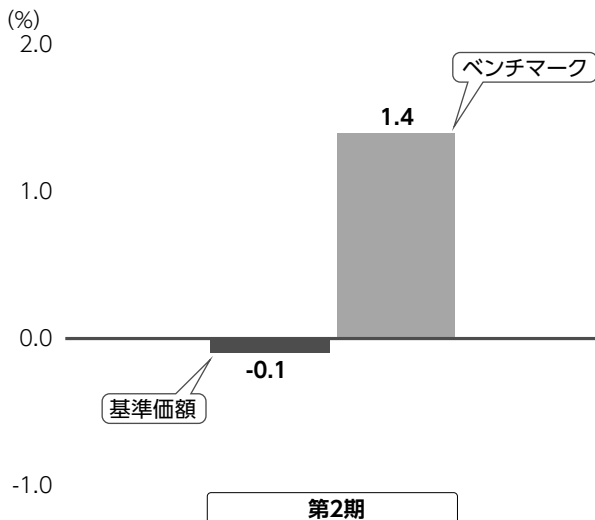
イールドカーブ戦略では、キャリーやロールダウン（時間の経過とともに保有する債券の利回りが低下し、債券価格が上昇すること）の観点から優れていると判断した中期債へ重点投資しました。

●種別配分

セクター戦略では、財務が健全であると考えられるオーストラリアの金融社債やモーゲージ債（不動産ローン債権担保証券）を継続保有しました。また、非金融社債についても銘柄を選別しながら保有しました。

ベンチマークとの差異について（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



当ファンドは、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は-0.1%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの騰落率+1.4%を1.5%下回りました。

マイナス要因

- オーストラリアのインフレ連動債へ投資したこと
- オーストラリア、米国の超長期ゾーンの金利をアンダーウェイトしたこと

分配金について（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第2期 |
|-----------|------|
| 当期分配金 | — |
| （対基準価額比率） | （—％） |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 785 |

※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。

当期の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。

なお、収益分配に充てなかった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。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」に投資します。

組入れファンド

世界の景気については、今後数四半期にわたりさらに減速するとみており、2020年の実質GDP（国内総生産）成長率は前年比2%～2.5%と予想しています。世界的な景気減速と貿易摩擦の激化で投資と輸入の伸びが引き続き抑えられることに加え、企業の生産低下と利益の伸び鈍化から労働市場の軟化が続き、消費低下につながると予想しています。

また、米国の実質GDP成長率は、2019年第2四半期の3.2%（前期比年率）をピークに低下を続け、2020年には1.25%～1.75%のレンジになると予想しています。オーストラリアと経済的結びつきが強い中国の実質GDP成長率も、5.0%～6.0%のレンジへの低下を予想しています。引き続き米中貿易協議の進展には注意をする必要があります。

オーストラリアに目を向けると、資源主導型の経済モデルからの転換には時間を要するものの、RBAによる政策金利の引下げ継続など緩和的な金融環境を背景に、緩やかな経済成長が続くとみています。また、資源価格については一時的に変動幅が高まる可能性はあるものの、供給調整の進展を背景に当面は底堅く推移することが見込まれ、貿易収支の改善や国民所得の押し上げが景気回復のサ

ポート材料になると考えられます。

このような環境下、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」の合算ベースで、オーストラリアの債券に対する金利リスクはベンチマーク並みの水準としています。年限

別では、市場参加者がRBAによる利下げを十分に織り込んでいることを念頭に置きつつ、市場動向に応じて柔軟に対応する方針とします。セクター別には、銘柄を厳選した上でオーストラリアのモーゲージ債や一部社債などへの選択投資を継続します。

3 お知らせ

合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

約款変更について

- 委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)

■ 1万口当たりの費用明細(2018年11月6日から2019年11月5日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-----------|------|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 136円 | 1.353% | 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) |
| (投信会社) | (69) | (0.693) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| (販売会社) | (63) | (0.627) | 販売会社：交付運用報告書等各种資料の送付、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) | (3) | (0.033) | 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) その他費用 | 1 | 0.007 | その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 |
| (監査費用) | (1) | (0.005) | 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) | (0.001) | その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 137 | 1.360 | |

期中の平均基準価額は10,019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。

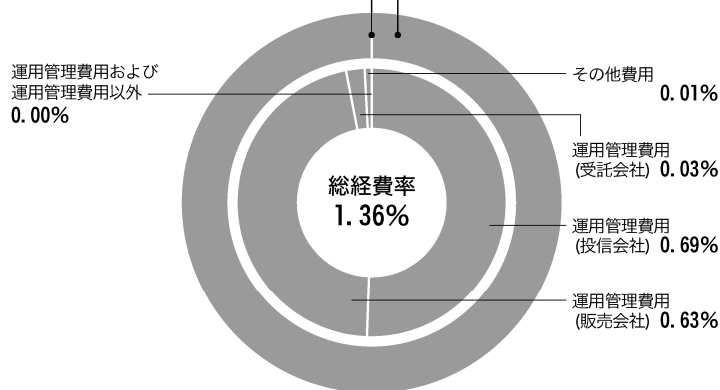
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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。当該投資信託証券の費用は後掲の「組入れ投資信託証券の内容」をご覧ください。

■ 参考情報 総経費率（年率換算）

② 投資先ファンドの費用 0.00% ① 当ファンドの費用 1.36%



| | |
|-----------------|-------|
| 総経費率(①+②) | 1.36% |
| ① 当ファンドの費用の比率 | 1.36% |
| ② 投資先ファンドの費用の比率 | 0.00% |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

※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1.36%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況（2018年11月6日から2019年11月5日まで）

投資信託証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|--------------------------------|--------|---------|-------|--------|
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国内 | PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド | □ | 千円 | □ | 千円 |
| | | 21,611 | 201,020 | 1,642 | 15,354 |
| | PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド | 7,366 | 50,192 | 565 | 3,831 |
| 合 計 | | 28,977 | 251,213 | 2,207 | 19,185 |

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等（2018年11月6日から2019年11月5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（2018年11月6日から2019年11月5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（2019年11月5日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファ ン ド 名 | 期首(前期末) | | 期 末 | |
|--------------------------------|---------|--------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 組 入 比 率 |
| | □ | □ | 千円 | % |
| PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド | 27,453 | 47,422 | 433,342 | 77.6 |
| PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド | 9,151 | 15,952 | 104,677 | 18.8 |
| 合 計 | 36,604 | 63,374 | 538,019 | 96.4 |

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■ 投資信託財産の構成

（2019年11月5日現在）

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 538,019 | % 95.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 23,822 | 4.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 561,841 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年11月5日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 561,841,972円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 23,822,712 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 538,019,260 |
| (B) 負 債 | 3,624,578 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 3,609,790 |
| 未 払 利 息 | 57 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 14,731 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 558,217,394 |
| 元 本 | 554,841,122 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 3,376,272 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 554,841,122口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 10,061円 |

※当期における期首元本額332,057,819円、期中追加設定元本額248,739,449円、期中一部解約元本額25,956,146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

| | 当 期 |
|---------------------------|-----|
| 1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前) | －円 |

■ 損益の状況

（自2018年11月6日 至2019年11月5日）

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 25,363,002円 |
| 受 取 配 当 金 | 25,372,397 |
| 支 払 利 息 | △ 9,395 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △18,388,494 |
| 売 買 損 益 | 802,177 |
| 売 買 損 益 | △19,190,671 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 6,355,546 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 618,962 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 920,837 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,836,473 |
| (配 当 等 相 当 額) | (20,604,751) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△18,768,278) |
| (G) 計 (D + E + F) | 3,376,272 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | 3,376,272 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,836,473 |
| (配 当 等 相 当 額) | (20,604,751) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△18,768,278) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 22,995,122 |
| 繰 越 損 益 金 | △21,455,323 |

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※当ファンドの運用の指図にかかる権限の一部委託に要する費用は1,674,848円(消費税等相当額を含む)です。(2018年11月6日～2019年11月5日、当社計算値)

※期末における、費用控除後の配当等収益(19,007,456円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(20,604,751円)および分配準備積立金(3,987,666円)より分配可能額は43,599,873円(1万口当たり785円)ですが、分配は行っておりません。

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。

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■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 | ・PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド |
| 形態 | ケイマン籍外国投資信託（円建て） |
| 主要投資対象 | 外国債券 |
| 運用の基本方針 | ベンチマークを上回ることを目指して運用を行います。 PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。 PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。また、通常、資産の60%を社債等に投資します。 ・投資する債券は、原則として、取得時において、BBB-格相当以上とし、ポートフォリオの平均格付けはA-格以上とします。 ※格付けは、主要格付機関のいずれかからの格付けによるものとし、いずれの主要格付機関からの格付けもないものについては、PIMCOが同等の信用度を認めたものに投資することができるものとします。 ※保有する債券が、格下げにより、上記の最低格付けを下回った場合は、当該銘柄を継続して保有することがあります。 ・オーストラリアドル建て以外の資産については、少なくともその85%を対オーストラリアドルでヘッジします（外貨建資産の対円でのヘッジは行いません。）。 |
| 決算日 | 年1回、原則として毎年2月末 |
| 分配方針 | 毎月、分配を行う方針です。 |
| ベンチマーク | PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円ベース) PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・ブルームバーグオーストラリア債券 (Credit) インデックス (円ベース) |
| 主な投資制限 | ・株式関連証券への投資は、転換社債、優先株を除き行いません。 ・同一銘柄または同一発行者にかかる証券への投資は、政府系証券を除き、取得時において、純資産総額の10%以下とします。 ・エマージングマーケットへの投資は、取得時において、純資産総額の10%以下とします。 |
| 運用報酬等 | ありません。 |
| 管理およびその他の費用 | 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。その他の費用・手数料については、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。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 |
| 投資顧問会社 | PIMCO (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、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」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。

■ 損益計算書(2018年3月1日から2019年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

(単位：千)

| | | |
|-----------------------|-----|----------|
| 投資収益： | | |
| 受取利息 | AUD | 28,744 |
| 雑収入 | | 0 |
| 総収益 | | 28,744 |
| 費用： | | |
| 支払利息 | | 25 |
| 雑費 | | 1 |
| 総費用 | | 26 |
| 投資純利益 | | 28,718 |
| 実現純利益（損失）： | | |
| 投資有価証券 | | 15,146 |
| 金融派生商品（市場または中央清算機関取引） | | 7,879 |
| 金融派生商品（OTC） | | (17,948) |
| 外国通貨 | | 7 |
| 実現純利益 | | 5,084 |
| 未実現評価益（評価損）の純変動額： | | |
| 投資有価証券 | | 19,902 |
| 金融派生商品（市場または中央清算機関取引） | | 1,352 |
| 金融派生商品（OTC） | | 2,285 |
| 外貨建資産および負債 | | (549) |
| 未実現評価益の純変動額 | | 22,990 |
| 純利益 | | 28,074 |
| 運用の結果による純資産の純増加額 | AUD | 56,792 |

残高が“0”表記であるものについては、実際額が金額単位の千未満で四捨五入により“0”となったものを含みます。

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■ 投資明細表(2019年2月28日現在)

P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|----------------------------------|----------------|--------------|---------------------------------------|----------------|--------------|
| 投資有価証券 106.2% | | | 4.400% 期日 07/06/2027 | AUD 3,700 | 3,758 |
| | | | DBS Group Holdings Ltd. | | |
| 社債券等 34.9% | | | 0.000% 期日 03/16/2028 | 2,400 | 2,376 |
| 銀行および金融 20.0% | | | Deutsche Bank AG | | |
| AAI Ltd. | | | 3.472% 期日 01/30/2023 | 6,700 | 6,514 |
| 5.260% 期日 10/06/2042 | AUD 1,000 | AUD 1,046 | 3.750% 期日 01/30/2023 | 3,100 | 3,068 |
| ABN AMRO Bank NV | | | 4.250% 期日 10/14/2021 | USD 1,300 | 1,817 |
| 3.250% 期日 04/09/2020 | 800 | 807 | GE Capital Australia Funding Pty Ltd. | | |
| Banco Santander S.A. | | | 5.000% 期日 09/26/2019 | AUD 1,400 | 1,411 |
| 4.000% 期日 01/19/2023 | 3,000 | 3,054 | 5.500% 期日 08/08/2022 | 600 | 636 |
| Bank of America Corp. | | | Goldman Sachs Group, Inc. | | |
| 3.120% 期日 03/05/2020 | 8,000 | 8,033 | 3.590% 期日 05/02/2024 | 7,500 | 7,516 |
| 4.250% 期日 03/05/2020 | 2,660 | 2,705 | 3.600% 期日 05/16/2023 | 6,500 | 6,608 |
| Barclays Bank PLC | | | 5.000% 期日 08/21/2019 | 2,800 | 2,833 |
| 10.000% 期日 05/21/2021 | GBP 4,100 | 8,826 | Goodman U.S. Finance One LLC | | |
| BNG Bank NV | | | 6.375% 期日 04/15/2021 | USD 2,900 | 4,297 |
| 3.500% 期日 07/19/2027 | AUD 5,500 | 5,820 | Insurance Australia Ltd. | | |
| China Resources Land Ltd. | | | 4.842% 期日 03/19/2040 | AUD 3,000 | 3,002 |
| 4.125% 期日 02/26/2029 | USD 200 | 280 | JPMorgan Chase & Co. | | |
| Citigroup, Inc. | | | 3.085% 期日 12/09/2019 | 2,700 | 2,711 |
| 3.268% 期日 08/07/2019 | AUD 7,274 | 7,297 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | | |
| 3.750% 期日 10/27/2023 | 3,500 | 3,598 | 6.250% 期日 05/19/2021 | 2,300 | 2,507 |
| Commonwealth Bank of Australia | | | Landwirtschaftliche Rentenbank | | |
| 2.000% 期日 04/22/2027 | EUR 1,600 | 2,593 | 4.250% 期日 01/24/2023 | 6,900 | 7,438 |
| 3.000% 期日 01/11/2024 | AUD 1,500 | 1,511 | Lloyds Banking Group PLC | | |
| 3.978% 期日 11/05/2024 | 1,100 | 1,107 | 4.000% 期日 03/07/2025 | 2,300 | 2,316 |
| 4.518% 期日 06/03/2026 | 1,900 | 1,953 | Macquarie Bank Ltd. | | |
| 5.000% 期日 03/19/2020 | USD 2,000 | 2,871 | 2.850% 期日 07/29/2020 | USD 2,420 | 3,392 |
| Cooperatieve Rabobank UA | | | 2.968% 期日 03/03/2020 | AUD 5,000 | 5,026 |
| 4.583% 期日 07/02/2025 | AUD 4,400 | 4,464 | 4.875% 期日 06/10/2025 | USD 3,000 | 4,298 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. | | | 6.625% 期日 04/07/2021 | 987 | 1,471 |
| 7.125% 期日 01/27/2022 | USD 800 | 1,159 | Mitsubishi Corporation Finance PLC | | |
| 7.125% 期日 04/25/2022 | 200 | 290 | 3.197% 期日 10/09/2019 | 2,000 | 2,811 |
| 7.500% 期日 03/09/2020 | 600 | 860 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | |
| Credit Agricole S.A. | | | 2.757% 期日 09/13/2026 | 500 | 661 |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | 額面金額 (単位：千) | | 時価 (単位：千) | | | | 額面金額 (単位：千) | | 時価 (単位：千) | |
|---------------------------------------|-----|----------------|--|--------------|--|--|-----|----------------|--|--------------|--|
| National Australia Bank Ltd. | | | | | | 0.000% 期日 11/25/2025 | AUD | 2,500 | | 1,740 | |
| 2.000% 期日 11/12/2024 | EUR | 1,800 | | 2,906 | | CVS Health Corp. | | | | | |
| Nederlandse Waterschapsbank NV | | | | | | 3.700% 期日 03/09/2023 | USD | 1,600 | | 2,262 | |
| 4.750% 期日 04/11/2023 | AUD | 14,000 | | 15,352 | | FBG Finance Pty Ltd. | | | | | |
| QBE Insurance Group Ltd. | | | | | | 3.750% 期日 09/06/2024 | AUD | 4,200 | | 4,306 | |
| 6.090% 期日 09/29/2040 | | 800 | | 830 | | General Motors Financial Co., Inc. | | | | | |
| 7.500% 期日 11/24/2043 | USD | 1,800 | | 2,746 | | 3.850% 期日 02/21/2023 | | 5,800 | | 5,807 | |
| QNB Finance Ltd. | | | | | | GLP China Holdings Ltd. | | | | | |
| 4.048% 期日 02/12/2020 | | 4,900 | | 6,904 | | 4.974% 期日 02/26/2024 | USD | 200 | | 283 | |
| Scentre Group Trust 1 | | | | | | Holcim Finance Australia Pty Ltd. | | | | | |
| 4.500% 期日 09/08/2021 | AUD | 2,300 | | 2,392 | | 3.500% 期日 06/16/2022 | AUD | 3,700 | | 3,774 | |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | | | Incitec Pivot Finance LLC | | | | | |
| 3.080% 期日 04/07/2020 | | 3,500 | | 3,515 | | 3.950% 期日 08/03/2027 | USD | 4,400 | | 5,759 | |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | | | | 6.000% 期日 12/10/2019 | | 6,710 | | 9,612 | |
| 4.436% 期日 04/02/2024 | USD | 1,600 | | 2,284 | | Newcrest Finance Pty Ltd. | | | | | |
| Suncorp-Metway Ltd. | | | | | | 4.200% 期日 10/01/2022 | | 1,700 | | 2,408 | |
| 3.750% 期日 11/05/2019 | AUD | 1,500 | | 1,513 | | 4.450% 期日 11/15/2021 | | 1,900 | | 2,708 | |
| WEA Finance LLC | | | | | | Nissan Financial Services Australia Pty Ltd. | | | | | |
| 3.750% 期日 09/17/2024 | USD | 1,800 | | 2,537 | | 2.500% 期日 09/06/2019 | AUD | 1,700 | | 1,698 | |
| Westpac Banking Corp. | | | | | | Oracle Corp. | | | | | |
| 4.960% 期日 03/10/2026 | AUD | 8,000 | | 8,272 | | 1.900% 期日 09/15/2021 | USD | 1,300 | | 1,786 | |
| | | | | 183,992 | | Pacific National Finance Pty Ltd. | | | | | |
| 一般事業 13.8% | | | | | | 4.625% 期日 09/23/2020 | | 4,000 | | 5,693 | |
| Airport Motorway Trust | | | | | | 4.750% 期日 03/22/2028 | | 2,400 | | 3,246 | |
| 5.500% 期日 12/09/2020 | | 1,500 | | 1,567 | | Sands China Ltd. | | | | | |
| APT Pipelines Ltd. | | | | | | 4.600% 期日 08/08/2023 | | 800 | | 1,142 | |
| 1.375% 期日 03/22/2022 | EUR | 600 | | 981 | | Santos Finance Ltd. | | | | | |
| 3.875% 期日 10/11/2022 | USD | 4,000 | | 5,669 | | 4.125% 期日 09/14/2027 | | 6,500 | | 8,481 | |
| Aurizon Network Pty Ltd. | | | | | | Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. | | | | | |
| 4.000% 期日 06/21/2024 | AUD | 3,100 | | 3,172 | | 3.375% 期日 04/30/2025 | | 200 | | 272 | |
| BlueScope Finance Americas LLC | | | | | | 3.625% 期日 04/28/2026 | | 300 | | 411 | |
| 4.625% 期日 05/25/2023 | USD | 2,000 | | 2,838 | | 3.900% 期日 03/22/2023 | | 480 | | 672 | |
| Boral Finance Pty Ltd. | | | | | | Transurban Finance Co. Pty Ltd. | | | | | |
| 3.000% 期日 11/01/2022 | | 200 | | 273 | | 2.000% 期日 08/28/2025 | EUR | 400 | | 671 | |
| Brambles USA, Inc. | | | | | | 4.125% 期日 02/02/2026 | USD | 5,100 | | 7,117 | |
| 5.350% 期日 04/01/2020 | | 6,500 | | 9,328 | | Transurban Queensland Finance Pty Ltd. | | | | | |
| Brisbane Square Finance Pty Ltd. | | | | | | 4.900% 期日 12/08/2021 | AUD | 2,900 | | 3,051 | |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | |
|--|-----|--|--|----------------|--------------|---|--|--|--|----------------|--------------|-----------|--------|
| Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd. | | | | | | (取得原価 AUD 67,266) | | | | | | | |
| 2.950% 期日 06/22/2020 | | | | 7,500 | 7,525 | モーゲージ証券 9.1% | | | | | | | |
| 3.250% 期日 04/13/2021 | | | | 2,200 | 2,216 | Alternative Loan Trust | | | | | | | |
| 3.317% 期日 09/14/2022 | | | | 500 | 500 | 2.700% 期日 07/25/2046 | | | | | | 31 | 42 |
| Woodside Finance Ltd. | | | | | | 2.810% 期日 11/20/2035 | | | | | | 72 | 98 |
| 3.650% 期日 03/05/2025 | USD | | | 2,700 | 3,716 | American Home Mortgage Investment Trust | | | | | | | |
| 3.700% 期日 09/15/2026 | | | | 500 | 676 | 4.237% 期日 10/25/2034 | | | | | | 7 | 10 |
| 4.500% 期日 03/04/2029 | | | | 800 | 1,121 | 4.312% 期日 09/25/2045 | | | | | | 16 | 23 |
| 4.600% 期日 05/10/2021 | | | | 4,100 | 5,861 | Apollo Trust | | | | | | | |
| Woolworths Group Ltd. | | | | | | 3.335% 期日 02/08/2043 | | | | | | AUD 549 | 551 |
| 4.000% 期日 09/22/2020 | | | | 6,600 | 9,352 | 3.405% 期日 07/13/2043 | | | | | | 941 | 948 |
| | | | | | | Bayview Opportunity Master Fund IVa Trust | | | | | | | |
| | | | | | | 3.721% 期日 02/28/2033 | | | | | | USD 109 | 153 |
| | | | | | | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | | | | |
| 公共事業 1.1% | | | | | | 4.350% 期日 01/25/2035 | | | | | | 7 | 10 |
| AT&T, Inc. | | | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | | | | |
| 4.600% 期日 09/19/2028 | AUD | | | 6,800 | 7,106 | 4.381% 期日 08/25/2035 | | | | | | 140 | 197 |
| DBNGP Finance Co. Pty Ltd. | | | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | | | | |
| 4.225% 期日 05/28/2025 | | | | 2,700 | 2,803 | 5.038% 期日 03/25/2034 | | | | | | 7 | 10 |
| | | | | | | Civic Mortgage LLC | | | | | | | |
| | | | | | | 4.349% 期日 11/25/2022 | | | | | | 1,109 | 1,560 |
| | | | | | | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | | | | |
| 社債券等合計 | | | | | | 4.284% 期日 11/25/2034 | | | | | | 42 | 59 |
| (取得原価 AUD 308,316) | | | | | | Equity One Mortgage Pass-Through Trust | | | | | | | |
| | | | | | | 3.130% 期日 07/25/2034 | | | | | | 7,857 | 11,021 |
| | | | | | | First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | | | | |
| 米国政府機関債 7.3% | | | | | | 2.650% 期日 11/25/2036 | | | | | | 414 | 566 |
| Fannie Mae | | | | | | Firstmac Mortgage Funding Trust | | | | | | | |
| 3.452% 期日 09/01/2044 | USD | | | 92 | 129 | 3.455% 期日 12/10/2044 | | | | | | AUD 4,014 | 4,035 |
| 6.000% 期日 08/01/2026 | | | | 86 | 130 | Firstmac Mortgage Funding Trust No.4 | | | | | | | |
| 6.000% 期日 04/25/2043 | | | | 27 | 43 | 2.909% 期日 03/08/2049 | | | | | | 1,119 | 1,113 |
| 6.000% 期日 02/25/2044 | | | | 22 | 34 | 3.159% 期日 03/08/2049 | | | | | | 1,300 | 1,292 |
| 6.000% 期日 07/25/2044 | | | | 125 | 196 | Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates | | | | | | | |
| Fannie Mae, TBA | | | | | | 3.315% 期日 02/25/2045 | | | | | | USD 261 | 367 |
| 3.500% 期日 04/01/2049 | | | | 21,700 | 30,499 | 3.532% 期日 10/25/2044 | | | | | | 150 | 214 |
| 4.000% 期日 04/01/2049 | | | | 25,400 | 36,376 | 3.732% 期日 07/25/2044 | | | | | | 62 | 90 |
| Freddie Mac | | | | | | | | | | | | | |
| 4.425% 期日 08/01/2035 | | | | 17 | 25 | | | | | | | | |
| 4.521% 期日 09/01/2035 | | | | 7 | 10 | | | | | | | | |
| Small Business Administration | | | | | | | | | | | | | |
| 5.090% 期日 10/01/2025 | | | | 33 | 48 | | | | | | | | |
| | | | | | | 米国政府機関債合計 | | | | | | | 67,490 |
| | | | | | | | | | | | | | |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | |
|--|------------|----------------|--------------|---|------------|----------------|--------------|------------|-----|-------|
| GreenPoint Mortgage Funding Trust | | | | National RMBS Trust | | | | | | |
| 3.030% 期日 | 11/25/2045 | 25 | 31 | 3.155% 期日 | 12/20/2047 | AUD 1,599 | 1,610 | | | |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | | Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust | | | | | | |
| 4.519% 期日 | 09/25/2035 | 210 | 301 | 4.078% 期日 | 10/25/2035 | USD 142 | 198 | | | |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | OBX Trust | | | | | | |
| 2.672% 期日 | 07/21/2036 | 14 | 18 | 3.140% 期日 | 06/25/2057 | 251 | 350 | | | |
| IDOL Trust | | | | Pepper Residential Securities Trust No.13 | | | | | | |
| 2.755% 期日 | 06/17/2045 | AUD 461 | 459 | 2.925% 期日 | 11/10/2056 | AUD 1,698 | 1,699 | | | |
| 3.315% 期日 | 03/24/2047 | 1,397 | 1,409 | Pepper Residential Securities Trust No.20 | | | | | | |
| 3.322% 期日 | 10/13/2043 | 163 | 164 | 3.125% 期日 | 09/16/2059 | 3,627 | 3,615 | | | |
| IndyMac INDX Mortgage Loan Trust | | | | Pepper Residential Securities Trust No.22 | | | | | | |
| 2.680% 期日 | 09/25/2046 | USD 66 | 84 | 3.485% 期日 | 06/20/2060 | 3,761 | 5,283 | | | |
| 2.700% 期日 | 05/25/2046 | 18 | 24 | Pepper Residential Securities Trust No.23 | | | | | | |
| 2.970% 期日 | 07/25/2035 | 21 | 28 | 3.503% 期日 | 08/18/2060 | 3,300 | 4,639 | | | |
| Interstar Millennium Trust | | | | Progress Trust | | | | | | |
| 2.262% 期日 | 03/27/2038 | AUD 69 | 66 | 2.685% 期日 | 07/20/2046 | 1,775 | 1,757 | | | |
| Kingfisher Trust | | | | 2.810% 期日 | | | | 07/22/2045 | 958 | 954 |
| 2.925% 期日 | 11/24/2048 | 3,245 | 3,243 | 3.110% 期日 | 02/21/2048 | 2,951 | 2,955 | | | |
| Liberty | | | | 3.275% 期日 | | | | 12/12/2040 | 494 | 495 |
| 3.105% 期日 | 10/10/2049 | 5,527 | 5,514 | PUMA | | | | | | |
| Light Trust No.4 | | | | 2.715% 期日 | | | | 10/18/2045 | 689 | 688 |
| 3.260% 期日 | 03/22/2044 | 569 | 572 | REDS Trust | | | | | | |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | 3.205% 期日 | | | | 05/24/2044 | 415 | 417 |
| 3.050% 期日 | 10/25/2034 | USD 145 | 199 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | | | |
| 3.110% 期日 | 08/25/2033 | 3,068 | 4,333 | 3.050% 期日 | 06/25/2032 | USD 4 | 5 | | | |
| Luminent Mortgage Trust | | | | RESIMAC Bastille Trust | | | | | | |
| 2.660% 期日 | 12/25/2036 | 49 | 66 | 3.364% 期日 | 12/16/2059 | 406 | 570 | | | |
| 2.690% 期日 | 10/25/2046 | 30 | 41 | RMAT LP | | | | | | |
| Medallion Trust | | | | 4.090% 期日 | | | | 05/25/2048 | 858 | 1,208 |
| 2.551% 期日 | 10/26/2046 | AUD 1,680 | 1,679 | Securitised Australian Mortgage Trust | | | | | | |
| 3.260% 期日 | 11/22/2042 | 1,835 | 1,846 | 2.665% 期日 | 02/20/2046 | AUD 1,626 | 1,614 | | | |
| 3.325% 期日 | 02/18/2048 | 3,355 | 3,394 | Structured Asset Mortgage Investments II Trust | | | | | | |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 2.710% 期日 | 05/25/2046 | USD 36 | 29 | | | |
| 4.362% 期日 | 02/25/2033 | USD 22 | 31 | Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust | | | | | | |
| 4.398% 期日 | 05/25/2033 | 27 | 38 | 4.009% 期日 | 04/25/2035 | 67 | 92 | | | |
| Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust | | | | Superannuation Members Home Loan Securitisation Fund | | | | | | |
| 2.600% 期日 | 10/25/2036 | 737 | 648 | 3.031% 期日 | 04/27/2048 | AUD 3,227 | 3,232 | | | |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | |
|---|-------------------|----------------|--------------|---|---------------|----------------|--------------|---------------|--------|--------|
| SWAN Trust | | | | Australia Government Bond | | | | | | |
| 3.155% | 期日 04/25/2041 | 1,066 | 1,068 | 0.750% | 期日 11/21/2027 | 30,600 | 32,141 | | | |
| TORRENS Trust | | | | 1.250% | 期日 02/21/2022 | 15,800 | 18,495 | | | |
| 3.255% | 期日 02/18/2048 | 1,457 | 1,464 | 2.250% | 期日 11/21/2022 | 34,300 | 35,055 | | | |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 2.750% | 期日 04/21/2024 | 40,600 | 42,639 | | | |
| 2.750% | 期日 11/25/2045 USD | 75 | 105 | 3.000% | 期日 09/20/2025 | 9,900 | 14,151 | | | |
| 2.760% | 期日 12/25/2045 | 275 | 384 | 3.000% | 期日 03/21/2047 | 3,600 | 3,832 | | | |
| 3.092% | 期日 04/25/2047 | 52 | 72 | 3.250% | 期日 06/21/2039 | 12,700 | 14,155 | | | |
| 4.128% | 期日 06/25/2033 | 12 | 17 | 3.750% | 期日 04/21/2037 | 9,700 | 11,568 | | | |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | | 4.250% | 期日 04/21/2026 | 35,900 | 41,461 | | | |
| 4.613% | 期日 09/25/2034 | 123 | 179 | 4.500% | 期日 04/21/2033 | 6,100 | 7,757 | | | |
| Westpac Securitisation Trust | | | | Export-Import Bank of Korea | | | | | | |
| 2.660% | 期日 07/21/2045 AUD | 684 | 680 | 3.141% | 期日 04/17/2019 | 500 | 500 | | | |
| 2.725% | 期日 01/18/2047 | 2,291 | 2,275 | 4.500% | 期日 04/17/2019 | 600 | 601 | | | |
| 3.185% | 期日 01/20/2041 | 3 | 3 | Industrial Bank of Korea | | | | | | |
| モーゲージ証券合計 | | | | 3.250% | | | | 期日 03/05/2020 | 5,600 | 5,629 |
| (取得原価 AUD 82,402) | | | | Kommunalbanken A/S | | | | | | |
| | | | | 3.000% | | | | 期日 12/09/2026 | 14,800 | 15,146 |
| | | | | 5.250% | | | | 期日 07/15/2024 | 8,900 | 10,184 |
| 資産担保証券 0.8% | | | | Korea Development Bank | | | | | | |
| Cairn CLO III BV | | | | 4.500% | | | | 期日 11/22/2019 | 500 | 506 |
| 0.650% | 期日 10/20/2028 EUR | 600 | 957 | Korea South-East Power Co. Ltd. | | | | | | |
| Driver Australia Five Trust | | | | 5.750% | | | | 期日 09/25/2020 | 2,400 | 2,504 |
| 2.810% | 期日 07/21/2026 AUD | 1,472 | 1,470 | New South Wales Treasury Corp. | | | | | | |
| Driver Australia Four Trust | | | | 2.750% | | | | 期日 11/20/2025 | 15,000 | 22,150 |
| 2.830% | 期日 08/21/2025 | 263 | 263 | 3.000% | 期日 04/20/2029 | 12,100 | 12,526 | | | |
| Grosvenor Place CLO BV | | | | Northern Territory Treasury Corp. | | | | | | |
| 0.720% | 期日 10/30/2029 EUR | 1,100 | 1,758 | 3.500% | 期日 05/21/2030 | 13,500 | 14,151 | | | |
| Monarch Grove CLO | | | | Queensland Treasury Corp. | | | | | | |
| 3.651% | 期日 01/25/2028 USD | 1,500 | 2,089 | 3.250% | 期日 07/21/2026 | 34,600 | 36,643 | | | |
| TICP CLO I Ltd. | | | | 4.750% | | | | 期日 07/21/2025 | 32,100 | 36,908 |
| 3.561% | 期日 07/20/2027 | 700 | 977 | 6.000% | 期日 07/21/2022 | 17,000 | 19,250 | | | |
| 資産担保証券合計 | | | | South Australian Government Financing Authority | | | | | | |
| (取得原価 AUD 7,173) | | | | 1.500% | | | | 期日 09/22/2022 | 12,600 | 12,390 |
| | | | | 2.750% | | | | 期日 05/24/2030 | 2,900 | 2,879 |
| ソブリン債 51.8% | | | | 3.000% | | | | 期日 09/20/2027 | 9,700 | 10,050 |
| Asian Development Bank | | | | 3.000% | | | | 期日 05/24/2028 | 5,900 | 6,080 |
| 5.000% | 期日 03/09/2022 AUD | 5,800 | 6,294 | | | | | | | |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|-----------------------------------|--|----------------|--------------|---------------------------------|-----|----------------|--------------|
| Western Australian Treasury Corp. | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 984 | 1,384 |
| 2.750% 期日 07/24/2029 | | 1,900 | 1,905 | HSBC Bank PLC | | | |
| 3.000% 期日 10/21/2027 | | 30,800 | 31,935 | (0.570%) 期日 03/01/2019 | EUR | 3 | 6 |
| 3.250% 期日 07/20/2028 | | 6,600 | 6,949 | 0.360% 期日 03/01/2019 | GBP | 57 | 107 |
| ソブリン債合計 | | | | JPMorgan Chase Bank N.A. | | | |
| (取得原価 AUD 449,982) | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 2,430 | 3,416 |
| | | | | MUFU Bank Ltd. | | | |
| | | | | (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 38,918 | 491 |
| | | | | National Australia Bank Ltd. | | | |
| | | | | 0.760% 期日 03/01/2019 | AUD | 1,603 | 1,603 |
| | | | | Royal Bank of Canada | | | |
| | | | | 0.870% 期日 03/01/2019 | CAD | 0 | 1 |
| | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 1 | 1 |
| | | | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | |
| | | | | (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 51,805 | 654 |
| | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 1,318 | 1,853 |
| | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | |
| | | | | (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 7,142 | 90 |
| | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 2 | 3 |
| | | | | | | | |
| | | | | 16,071 | | | |
| | | | | ギリシャ短期国債 0.1% | | | |
| | | | | 0.910% 期日 03/01/2019 | EUR | 300 | 480 |
| | | | | 短期証券合計 | | | |
| | | | | (取得原価 AUD 20,805) | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | 投資有価証券合計 106.2% | | AUD | 978,053 |
| | | | | (取得原価 AUD 935,944) | | | |
| | | | | 金融派生商品 (0.1%) | | | (1,049) |
| | | | | (取得原価またはプレミアム、純額 AUD (1,442)) | | | |
| | | | | その他の資産および負債 (純額) (6.1%) | | | (56,393) |
| | | | | 純資産 100.0% | | AUD | 920,611 |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■ 損益計算書(2018年3月1日から2019年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

(単位：千)

| | | |
|-----------------------|-----|--------|
| 投資収益： | | |
| 受取利息 | AUD | 7,482 |
| 雑収入 | | 0 |
| 総収益 | | 7,482 |
| 費用： | | |
| 支払利息 | | 0 |
| 雑費 | | 1 |
| 総費用 | | 1 |
| 投資純利益 | | 7,481 |
| 実現純利益（損失）： | | |
| 投資有価証券 | | 243 |
| 金融派生商品（市場または中央清算機関取引） | | 141 |
| 金融派生商品（OTC） | | (158) |
| 外国通貨 | | 306 |
| 実現純利益 | | 532 |
| 未実現評価益（評価損）の純変動額： | | |
| 投資有価証券 | | 1,764 |
| 金融派生商品（市場または中央清算機関取引） | | 320 |
| 金融派生商品（OTC） | | (14) |
| 外貨建資産および負債 | | (26) |
| 未実現評価益の純変動額 | | 2,044 |
| 純利益 | | 2,576 |
| 運用の結果による純資産の純増加額 | AUD | 10,057 |

残高が“0”表記であるものについては、実際額が金額単位の千未満で四捨五入により“0”となったものを含みます。

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

■ 投資明細表(2019年2月28日現在)

PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|--|----------------|--------------|
| 投資有価証券 99.7% | | | 4.500% 期日 04/16/2019 | 7,200 | 7,219 |
| | | | Mizuho Bank Ltd. | | |
| 社債券等 61.4% | | | 2.991% 期日 08/23/2019 | 4,900 | 4,913 |
| 銀行および金融 45.6% | | | MUFG Bank Ltd. | | |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | | | 3.400% 期日 03/20/2023 | 6,400 | 6,528 |
| 3.240% 期日 04/07/2021 AUD 2,700 AUD | 2,733 | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| Bank of America Corp. | | | 3.244% 期日 07/19/2019 | 3,300 | 3,309 |
| 3.120% 期日 03/05/2020 | 3,100 | 3,113 | Suncorp-Metway Ltd. | | |
| Bank of Queensland Ltd. | | | 3.500% 期日 04/12/2021 | 500 | 509 |
| 3.090% 期日 11/06/2019 | 2,600 | 2,608 | UBS AG | | |
| 3.224% 期日 04/29/2019 | 1,900 | 1,902 | 2.685% 期日 03/08/2021 | 3,400 | 3,395 |
| Barclays Bank PLC | | | 2.820% 期日 08/27/2019 | 3,000 | 3,006 |
| 3.165% 期日 04/04/2019 | 500 | 500 | 4.000% 期日 08/27/2019 | 6,500 | 6,551 |
| BNG Bank NV | | | Wells Fargo & Co. | | |
| 3.500% 期日 07/19/2027 | 3,100 | 3,280 | 3.394% 期日 07/27/2021 | 7,400 | 7,469 |
| Citigroup, Inc. | | | | | 94,647 |
| 3.268% 期日 08/07/2019 | 3,700 | 3,712 | 一般事業 15.1% | | |
| 3.590% 期日 05/04/2021 | 6,300 | 6,381 | Airport Motorway Trust | | |
| Commonwealth Bank of Australia | | | 5.500% 期日 12/09/2020 | 2,300 | 2,402 |
| 2.961% 期日 07/17/2020 | 1,600 | 1,610 | APT Pipelines Ltd. | | |
| 3.273% 期日 07/12/2021 | 500 | 507 | 3.750% 期日 10/20/2023 | 520 | 536 |
| Credit Suisse AG | | | 7.750% 期日 07/22/2020 | 1,600 | 1,708 |
| 4.000% 期日 07/16/2019 | 10,560 | 10,623 | FBG Finance Pty Ltd. | | |
| GE Capital Australia Funding Pty Ltd. | | | 3.750% 期日 08/07/2020 | 3,600 | 3,655 |
| 5.250% 期日 09/04/2020 | 2,000 | 2,055 | 3.750% 期日 09/06/2024 | 3,000 | 3,076 |
| 5.500% 期日 08/08/2022 | 1,300 | 1,377 | Ford Motor Credit Co. LLC | | |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | 3.588% 期日 06/02/2020 | 4,800 | 4,809 |
| 5.000% 期日 08/21/2019 | 5,100 | 5,160 | Toyota Motor Credit Corp. | | |
| Lloyds Banking Group PLC | | | 2.750% 期日 07/26/2021 | 4,000 | 4,034 |
| 4.250% 期日 11/22/2027 | 6,100 | 6,187 | Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd. | | |
| Metropolitan Life Global Funding I | | | 2.950% 期日 06/22/2020 | 5,000 | 5,016 |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| 3.250% 期日 08/13/2019 | 3,600 | 3,609 |
| 4.000% 期日 11/21/2019 | 1,300 | 1,312 |
| WSO Finance Pty Ltd. | | |
| 4.500% 期日 03/31/2027 | 1,200 | 1,278 |
| | | 31,435 |
| 公共事業 0.7% | | |
| Korea National Oil Corp. | | |
| 3.139% 期日 10/08/2019 | 1,400 | 1,402 |
| 社債券等合計 | | 127,484 |
| (取得原価 AUD 126,377) | | |
| 米国政府機関債 0.0% | | |
| Fannie Mae | | |
| 2.890% 期日 06/25/2029 | USD 2 | 3 |
| 米国政府機関債合計 | | 3 |
| (取得原価 AUD 3) | | |
| モーゲージ証券 3.1% | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | |
| 3.150% 期日 02/25/2035 | 17 | 24 |
| 3.170% 期日 02/25/2035 | 19 | 27 |
| CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates | | |
| 4.010% 期日 07/25/2033 | 23 | 32 |
| Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates | | |
| 3.732% 期日 07/25/2044 | 15 | 23 |
| GMACM Mortgage Loan Trust | | |
| 4.509% 期日 06/25/2034 | 35 | 49 |
| Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates | | |
| 4.988% 期日 10/25/2033 | 20 | 28 |
| Liberty | | |
| 2.605% 期日 10/25/2050 | AUD 935 | 934 |
| Medallion Trust | | |
| 3.280% 期日 03/21/2044 | 2,630 | 2,650 |

| | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|--|----------------|--------------|
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | |
| 4.362% 期日 02/25/2033 | USD 7 | 10 |
| Progress Trust | | |
| 3.475% 期日 06/18/2044 | AUD 2,577 | 2,597 |
| Superannuation Members Home Loan Securitisation Fund | | |
| 3.325% 期日 07/09/2043 | 22 | 22 |
| モーゲージ証券合計 | | 6,396 |
| (取得原価 AUD 6,332) | | |
| ソブリン債 30.7% | | |
| Australia Government Bond | | |
| 3.750% 期日 04/21/2037 | 10,500 | 12,522 |
| Australian Postal Corp. | | |
| 2.868% 期日 12/01/2021 | 1,800 | 1,810 |
| 5.000% 期日 11/13/2020 | 3,500 | 3,651 |
| Export-Import Bank of Korea | | |
| 4.250% 期日 05/21/2020 | 4,900 | 4,998 |
| 4.500% 期日 04/17/2019 | 3,500 | 3,508 |
| Kommunalbanken A/S | | |
| 3.000% 期日 12/09/2026 | 3,600 | 3,684 |
| Queensland Treasury Corp. | | |
| 3.250% 期日 07/21/2026 | 3,900 | 4,131 |
| 4.750% 期日 07/21/2025 | 3,100 | 3,564 |
| Treasury Corporation of Victoria | | |
| 4.250% 期日 12/20/2032 | 4,500 | 5,271 |
| Western Australian Treasury Corp. | | |
| 3.000% 期日 10/21/2026 | 18,900 | 19,662 |
| 3.250% 期日 07/20/2028 | 900 | 948 |
| ソブリン債合計 | | 63,749 |
| (取得原価 AUD 60,602) | | |
| 短期証券 4.5% | | |
| 定期性預金 4.5% | | |
| Australia and New Zealand Banking Group Ltd. | | |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | USD 346 | 487 |

三井住友・豪ドル債ファンド（年1回決算型）

| | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) | | | 額面金額 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
|-------------------------------|-----|----------------|--------------|---------------------------------|-----|----------------|--------------|
| Bank of Nova Scotia | | | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | | 582 | 818 | (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 4 | 0 |
| Brown Brothers Harriman & Co. | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 316 | 444 |
| 0.760% 期日 03/01/2019 | AUD | 44 | 44 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 0 | AUD 1 | (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 1 | 0 |
| Citibank N.A. | | | | 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 1 | 1 |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | | 134 | 189 | <hr/> | | | |
| Deutsche Bank AG | | | | 9,236 | | | |
| (0.570%) 期日 03/01/2019 | EUR | 3 | 4 | 短期証券合計 | | | |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | USD | 236 | 331 | (取得原価 AUD 9,236) | | | |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | | | 投資有価証券合計(a) 99.7% | | | |
| 1.900% 期日 03/01/2019 | | 582 | 818 | (取得原価 AUD 202,550) | | | |
| MUFG Bank Ltd. | | | | 金融派生商品(b)(d) 0.0% | | | |
| (0.270%) 期日 03/01/2019 | JPY | 3 | 0 | (取得原価またはプレミアム、純額 AUD 0) | | | |
| National Australia Bank Ltd. | | | | その他の資産および負債 (純額) 0.3% | | | |
| 0.760% 期日 03/01/2019 | AUD | 6,099 | 6,099 | <hr/> | | | |
| | | | | 純資産 100.0% | | | |
| | | | | <hr/> | | | |
| | | | | AUD 207,444 | | | |