

■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：2003年6月16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・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・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
当ファンドの運用方法	■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。 ■ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円換算ベース）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。 ■実質組入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。 ■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	■毎月5日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）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。 ※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・ 豪ドル債ファンド

## 【運用報告書(全体版)】

第43作成期（2024年5月8日から2024年11月5日まで）

第 251 期 / 第 252 期 / 第 253 期  
決算日2024年6月5日 決算日2024年7月5日 決算日2024年8月5日

第 254 期 / 第 255 期 / 第 256 期  
決算日2024年9月5日 決算日2024年10月7日 決算日2024年11月5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。



〒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・豪ドル債ファンド

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30期の運用実績

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		投資信託 証券組入 率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(円換算ベース)	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
227期(2022年6月6日)	4,379	5	1.2	272.17	1.4	98.9	51,654
228期(2022年7月5日)	4,210	5	△3.7	267.78	△1.6	98.9	49,020
229期(2022年8月5日)	4,354	5	3.5	272.27	1.7	98.8	49,888
230期(2022年9月5日)	4,401	5	1.2	275.49	1.2	98.9	49,938
231期(2022年10月5日)	4,289	5	△2.4	269.63	△2.1	99.0	47,996
232期(2022年11月7日)	4,288	5	0.1	270.54	0.3	99.1	47,594
233期(2022年12月5日)	4,263	5	△0.5	269.06	△0.6	98.9	47,034
234期(2023年1月5日)	4,115	5	△3.4	259.70	△3.5	98.8	45,146
235期(2023年2月6日)	4,288	5	4.3	270.33	4.1	99.0	46,692
236期(2023年3月6日)	4,201	5	△1.9	265.43	△1.8	99.0	45,418
237期(2023年4月5日)	4,202	5	0.1	266.08	0.2	99.0	44,910
238期(2023年5月8日)	4,293	5	2.3	272.13	2.3	98.8	45,502
239期(2023年6月5日)	4,290	5	0.0	272.05	△0.0	99.0	45,117
240期(2023年7月5日)	4,413	5	3.0	280.45	3.1	99.0	45,572
241期(2023年8月7日)	4,267	5	△3.2	270.76	△3.5	99.3	43,674
242期(2023年9月5日)	4,350	5	2.1	276.46	2.1	99.0	44,126
243期(2023年10月5日)	4,232	5	△2.6	269.48	△2.5	98.9	42,605
244期(2023年11月6日)	4,357	5	3.1	278.04	3.2	98.9	43,382
245期(2023年12月5日)	4,439	5	2.0	283.66	2.0	99.3	43,521
246期(2024年1月5日)	4,524	5	2.0	289.36	2.0	98.9	43,635
247期(2024年2月5日)	4,540	5	0.5	290.55	0.4	99.0	43,274
248期(2024年3月5日)	4,586	5	1.1	293.95	1.2	99.2	43,133
249期(2024年4月5日)	4,696	5	2.5	301.07	2.4	99.0	43,644
250期(2024年5月7日)	4,716	5	0.5	303.12	0.7	99.1	43,474
251期(2024年6月5日)	4,783	5	1.5	307.96	1.6	98.8	43,359
252期(2024年7月5日)	5,015	5	5.0	323.44	5.0	99.3	44,737
253期(2024年8月5日)	4,525	5	△9.7	292.18	△9.7	98.9	40,050
254期(2024年9月5日)	4,625	5	2.3	299.13	2.4	99.2	40,598
255期(2024年10月7日)	4,801	5	3.9	310.97	4.0	99.4	41,874
256期(2024年11月5日)	4,680	5	△2.4	303.94	△2.3	99.1	40,482

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※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・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

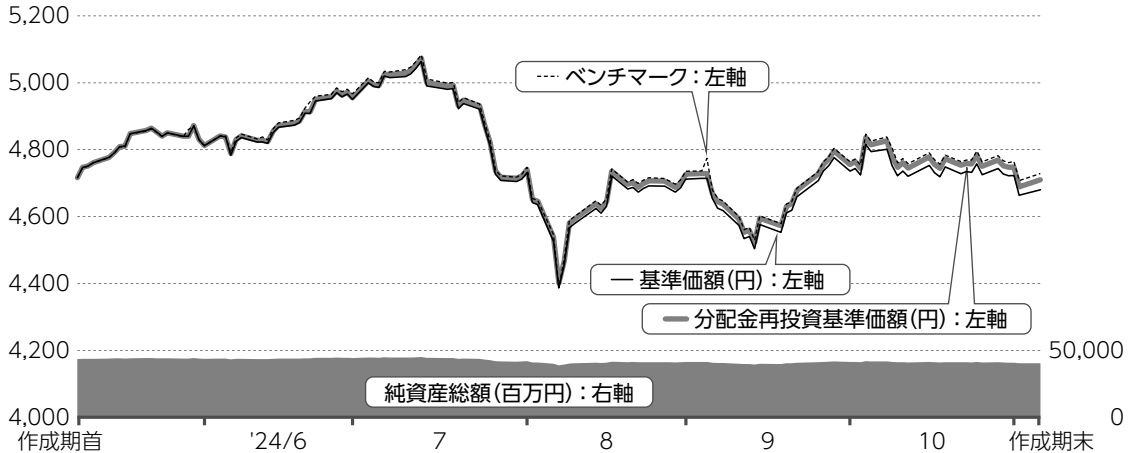
決算期	年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円換算ベース)		投資信託 証券組入 比 率
			騰 落 率		騰 落 率	
第251期	(期 首) 2024年5月7日	円	%		%	%
		4,716	—	303.12	—	99.1
	5月末	4,812	2.0	309.24	2.0	98.5
第252期	(期 末) 2024年6月5日	4,788	1.5	307.96	1.6	98.8
	(期 首) 2024年6月5日	4,783	—	307.96	—	98.8
	6月末	4,950	3.5	319.24	3.7	99.0
第253期	(期 末) 2024年7月5日	5,020	5.0	323.44	5.0	99.3
	(期 首) 2024年7月5日	5,015	—	323.44	—	99.3
	7月末	4,731	△5.7	305.12	△5.7	98.8
第254期	(期 末) 2024年8月5日	4,530	△9.7	292.18	△9.7	98.9
	(期 首) 2024年8月5日	4,525	—	292.18	—	98.9
	8月末	4,712	4.1	304.39	4.2	99.0
第255期	(期 末) 2024年9月5日	4,630	2.3	299.13	2.4	99.2
	(期 首) 2024年9月5日	4,625	—	299.13	—	99.2
	9月末	4,736	2.4	306.21	2.4	99.2
第256期	(期 末) 2024年10月7日	4,806	3.9	310.97	4.0	99.4
	(期 首) 2024年10月7日	4,801	—	310.97	—	99.4
	10月末	4,723	△1.6	306.26	△1.5	98.9
	(期 末) 2024年11月5日	4,685	△2.4	303.94	△2.3	99.1

※期末基準価額は分配金込み、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(2024年5月8日から2024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、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	4,716円
作成期末 (当作成期既払分配金30円(税引前))	4,680円
騰落率 (分配金再投資ベース)	-0.1%

## 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(円換算ベース)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(2024年5月8日から2024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(円換算ベース)を上回る投資成果を目指しました。

実質組入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**

- 債券利子収入を享受したこと
- 売り持ちとしていた米国の金利が上昇(債券価格は下落)したこと

**下落要因**

- オーストラリアの金利が上昇したこと
- 一部組入れを行なったメキシコペソが下落したこと
- 為替市場において、豪ドル安・円高となったこと

投資環境について(2024年5月8日から2024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。為替市場は豪ドル安・円高となりました。

### 債券市場

期の前半は、RBA(オーストラリア準備銀行)が高いインフレ率に対して懸念を示していたことなどが金利上昇要因となったものの、同国の2024年1-3月期GDP(国内総生産)が市場予想を下回ったことや、米国における利下げ観測の高まりを受けた世界的な金利低下の流れを受けて、オーストラリア国債利回りも低下しました。

期の後半は、米国をはじめとする先進国債券市場の金利が上昇していたことに加え、市場予想を上回る雇用者数の伸びや目標水準を上回るインフレ率に対してRBAが警戒感を示したことなどから、オーストラリア国債利回りも上昇しました。

期を通じて見ると、オーストラリア国債利回りは上昇しましたが、社債なども含む債券の利子収入によりオーストラリア債券市場は上昇しました。

### 為替市場

期の前半は、主に7月にかけて交易関係が強い中国の景気に対する悲観論が高まり、オーストラリア経済への波及が懸念されたことを背景に、豪ドルは対円で下落しました。

一方、期の後半は、豪中銀が同国のインフレ率上昇に対して警戒感を示したことや市場予想を大幅に上回る雇用者数が発表されたことなどを背景に、豪ドルは対円で上昇しました。

期を通じて見ると、豪ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2024年5月8日から2024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: 金利の変動による債券価格の感応度)戦略

デュレーション戦略では、オーストラリアについては期を通じて小幅なオーバーウェイトとしました。その他の地域では、米国や日本を売り持ちとする一方、期後半にかけて英国を小幅な買い持ちとしました。期を通じて、ポートフォリオ全体のデュレーションはアンダーウェイトとしました。

### ●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、利回りの観点から魅力的と判断していた短中期ゾーンをオーバーウェイトとする一方、根強いインフレ懸念などを踏まえ長期ゾーンをアンダーウェイトとしました。

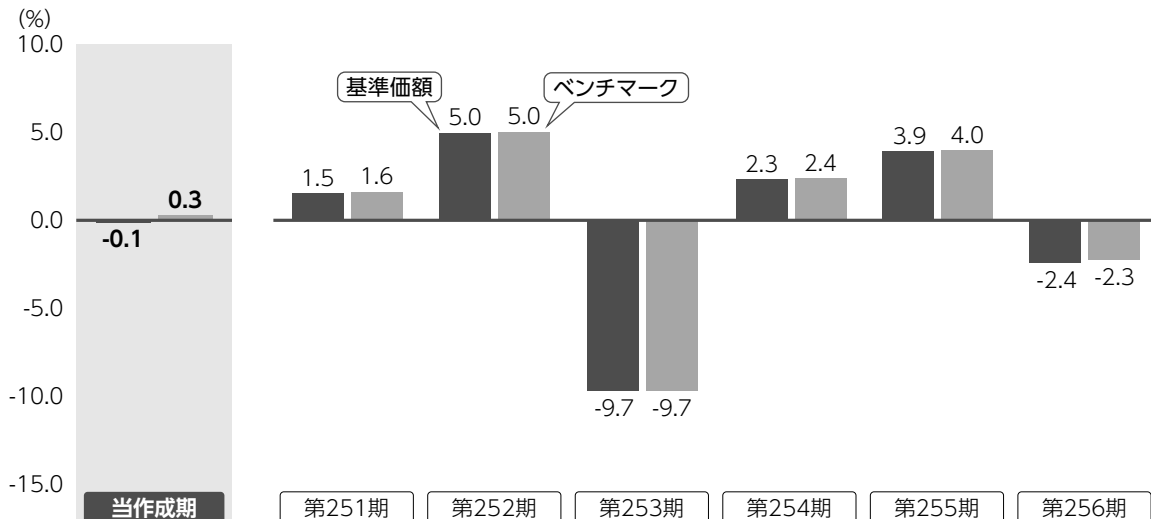
### ●種別配分

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オーバーウェイトとしました。

ベンチマークとの差異について(2024年5月8日から2024年11月5日まで)

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(円換算ベース)をベンチマークとしています。記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※当作成期の基準価額は分配金再投資ベース、各期は分配金(税引前)込み。

ベンチマークとの差異の状況および要因

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+0.3%と比較して0.4%下回りました。

プラス要因

- 売り持ちとしていた米国の金利が上昇したこと
- オーストラリアの社債やモーゲージ債を選択的に投資したこと

マイナス要因

- 期末にかけて組入れを行っていた英国の金利が上昇したこと
- 一部組入れを行ったメキシコペソが下落したこと



## 分配金について(2024年5月8日から2024年11月5日まで)

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、以下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：円、1万口当たり、税引前)

項目	第251期	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期
当期分配金	5	5	5	5	5	5
(対基準価額比率)	(0.10%)	(0.10%)	(0.11%)	(0.11%)	(0.10%)	(0.11%)
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	287	294	295	301	307	308

※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

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

オーストラリアについては、国内の労働市場のひっ迫を背景とした高水準の賃金インフレや政策目標を上回るCPI(消費者物価指数)などを踏まえ、これまでRBAが積極的

な利上げを行ってきた点はオーストラリア債券の下押し要因となっておりました。一方で、利上げに伴うオーストラリア債券利回りの上昇は中長期的なパフォーマンスの下支えになると期待されます。

かかる環境下、オーストラリアの金利リスクはベンチマークよりも小幅に少なめとしています。年限別では、市場参加者がRBAによる金融政策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

### 約款変更について

該当事項はございません。

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### 1万口当たりの費用明細 (2024年5月8日から2024年11月5日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
<b>(a) 信託報酬</b>	32円	0.673%	<b>信託報酬</b> ＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) <span style="border: 1px solid black; padding: 2px;">期中の平均基準価額は4,770円です。</span>
（投信会社）	(16)	(0.345)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(15)	(0.312)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.016)	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>(b) 売買委託手数料</b>	-	-	<b>売買委託手数料</b> ＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（株式）	(-)	(-)	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
（先物・オプション）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
<b>(c) 有価証券取引税</b>	-	-	<b>有価証券取引税</b> ＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
（株式）	(-)	(-)	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
（公社債）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
<b>(d) その他費用</b>	0	0.001	<b>その他費用</b> ＝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)	(0.001)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(-)	(-)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
<b>合計</b>	<b>32</b>	<b>0.674</b>	

※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。

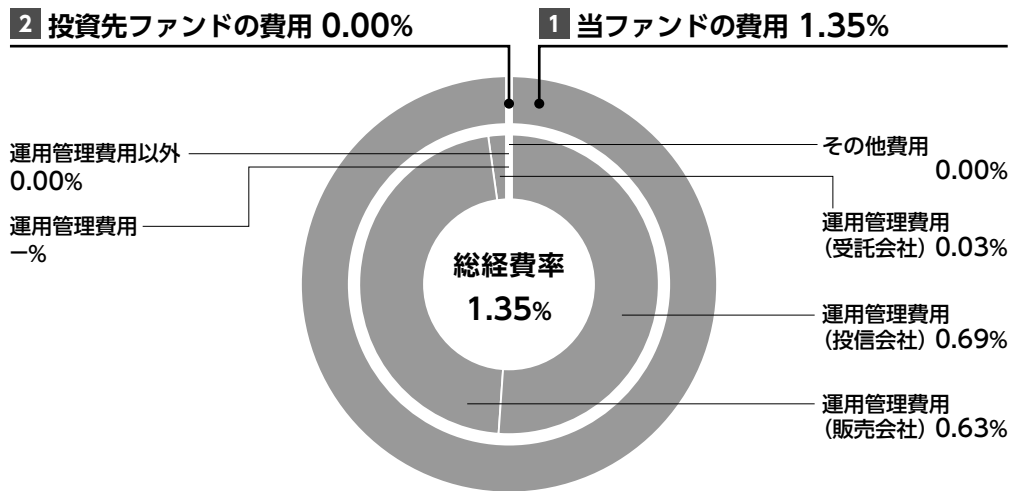
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



## 参考情報 総経費率(年率換算)



<b>総経費率(1 + 2)</b>	<b>1.35%</b>
<b>1</b> 当ファンドの費用の比率	<b>1.35%</b>
<b>2</b> 投資先ファンドの運用管理費用の比率	<b>-%</b>
投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	<b>0.00%</b>

※ **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、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1.35%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況(2024年5月8日から2024年11月5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
		口	千円	口	千円
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	—	—	198,478	2,107,226
	PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	—	—	67,054	526,774

※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(2024年5月8日から2024年11月5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  
(2024年5月8日から2024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(2024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	作成期首	作成期末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	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	3,300,214	3,101,736	31,904,456	78.8
PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	1,138,085	1,071,031	8,211,594	20.3
合 計	4,438,299	4,172,767	40,116,051	99.1

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

## ■ 投資信託財産の構成

(2024年11月5日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	40,116,051	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	481,427	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	40,597,479	100.0

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年6月5日) (2024年7月5日) (2024年8月5日) (2024年9月5日) (2024年10月7日) (2024年11月5日)

項 目	第251期末	第252期末	第253期末	第254期末	第255期末	第256期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>43,497,410,812円</b>	<b>44,923,776,057円</b>	<b>40,161,427,077円</b>	<b>40,722,525,900円</b>	<b>42,006,881,510円</b>	<b>40,597,479,171円</b>
コール・ローン等	639,533,276	501,751,248	535,674,889	442,362,412	401,818,944	481,427,998
投資信託受益証券(評価額)	42,857,877,536	44,422,024,809	39,625,752,188	40,280,163,488	41,605,062,566	40,116,051,173
<b>(B) 負 債</b>	<b>138,343,558</b>	<b>186,445,897</b>	<b>110,508,555</b>	<b>123,573,551</b>	<b>132,605,369</b>	<b>115,209,935</b>
未払収益分配金	45,322,913	44,606,330	44,251,049	43,891,302	43,609,351	43,247,911
未払解約金	45,585,470	92,606,502	16,346,832	32,483,949	40,397,148	27,661,767
未払信託報酬	47,273,842	49,071,732	49,749,341	47,036,967	48,437,537	44,138,924
その他未払費用	161,333	161,333	161,333	161,333	161,333	161,333
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>43,359,067,254</b>	<b>44,737,330,160</b>	<b>40,050,918,522</b>	<b>40,598,952,349</b>	<b>41,874,276,141</b>	<b>40,482,269,236</b>
元 本	90,645,827,743	89,212,660,172	88,502,098,521	87,782,604,634	87,218,702,430	86,495,822,146
次期繰越損益金	△47,286,760,489	△44,475,330,012	△48,451,179,999	△47,183,652,285	△45,344,426,289	△46,013,552,910
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>90,645,827,743口</b>	<b>89,212,660,172口</b>	<b>88,502,098,521口</b>	<b>87,782,604,634口</b>	<b>87,218,702,430口</b>	<b>86,495,822,146口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>4,783円</b>	<b>5,015円</b>	<b>4,525円</b>	<b>4,625円</b>	<b>4,801円</b>	<b>4,680円</b>

※当作成期における作成期首元本額92,180,024,990円、作成期中追加設定元本額346,049,679円、作成期中一部解約元本額6,030,252,523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。

# 三井住友・豪ドル債ファンド

## ■ 損益の状況

(自2024年5月8日) (自2024年6月6日) (自2024年7月6日) (自2024年8月6日) (自2024年9月6日) (自2024年10月8日)  
 至2024年6月5日 至2024年7月5日 至2024年8月5日 至2024年9月5日 至2024年10月7日 至2024年11月5日

項 目	第251期	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期
(A) 配 当 等 取 益	103,746,470円	101,887,657円	101,044,321円	100,505,420円	99,986,731円	98,967,417円
受 取 配 当 金	103,718,090	101,859,145	101,004,862	100,430,970	99,913,972	98,896,055
受 取 利 息	28,380	28,512	39,459	74,450	72,759	71,362
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	595,532,359	2,052,517,514	△ 4,337,539,251	862,958,907	1,527,574,340	△ 1,057,315,615
売 買 益	609,507,678	2,070,298,538	13,372,217	869,917,703	1,531,336,644	4,807,281
売 買 損	△ 13,975,319	△ 17,781,024	△ 4,350,911,468	△ 6,958,796	△ 3,762,304	△ 1,062,122,896
(C) 信 託 報 酬 等	△ 47,435,175	△ 49,233,065	△ 49,910,674	△ 47,198,300	△ 48,598,870	△ 44,300,257
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	651,843,654	2,105,172,106	△ 4,286,405,604	916,266,027	1,578,962,201	△ 1,002,648,455
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 5,904,961,704	△ 47,241,437,576	△ 5,206,195,903	△ 3,117,283,803	△ 6,464,947,845	△ 4,886,041,165
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△41,988,319,526	△41,329,699,885	△41,003,239,543	△40,673,796,007	△40,414,831,294	△40,081,615,379
( 配 当 等 相 当 額 )	( 306,877,424)	( 305,051,237)	( 304,241,073)	( 303,123,221)	( 302,038,632)	( 300,335,488)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△42,295,196,950)	(△41,634,751,122)	(△41,307,480,616)	(△40,976,919,228)	(△40,716,869,926)	(△40,381,950,867)
(G) 合 計 ( D + E + F )	△47,241,437,576	△44,430,723,682	△48,406,928,950	△47,139,760,983	△45,300,816,938	△45,970,304,999
(H) 取 益 分 配 金	△ 45,322,913	△ 44,606,330	△ 44,251,049	△ 43,891,302	△ 43,609,351	△ 43,247,911
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△47,286,760,489	△44,475,330,012	△48,451,179,999	△47,183,652,285	△45,344,426,289	△46,013,552,910
追 加 信 託 差 損 益 金	△41,988,319,526	△41,329,699,885	△41,003,239,543	△40,673,796,007	△40,414,831,294	△40,081,615,379
( 配 当 等 相 当 額 )	( 306,877,424)	( 305,051,237)	( 304,241,073)	( 303,123,221)	( 302,038,632)	( 300,335,488)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△42,295,196,950)	(△41,634,751,122)	(△41,307,480,616)	(△40,976,919,228)	(△40,716,869,926)	(△40,381,950,867)
分 配 準 備 積 立 金	2,302,756,762	2,319,888,081	2,307,774,910	2,340,153,010	2,378,350,122	2,370,301,588
繰 越 損 益 金	△ 7,601,197,725	△ 5,465,518,208	△ 9,755,715,366	△ 8,850,009,288	△ 7,307,945,117	△ 8,302,239,119

※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。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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に要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は105,614,851円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第251期	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期
(a) 経費控除後の配当等取益	96,707,090円	99,558,933円	51,133,647円	95,582,637円	97,002,760円	54,667,160円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	306,877,424	305,051,237	304,241,073	303,123,221	302,038,632	300,335,488
(d) 分配準備積立金	2,251,372,585	2,264,935,478	2,300,892,312	2,288,461,675	2,324,956,713	2,358,882,339
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,654,957,099	2,669,545,648	2,656,267,032	2,687,167,533	2,723,998,105	2,713,884,987
1万口当たり当期分配対象額	292.89	299.23	300.14	306.12	312.32	313.76
(f) 分配金	45,322,913	44,606,330	44,251,049	43,891,302	43,609,351	43,247,911
1万口当たり分配金	5	5	5	5	5	5

## ■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第251期	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期
	5円	5円	5円	5円	5円	5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。

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	・ 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	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	オーストラリアドル建て・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
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。）。
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割合は、政府系証券を除き、取得時において、純資産額の10%以下とします。 ・ エマージングマーケットへの投資割合は、取得時において、純資産額の10%以下とします。 ・ 非流動性資産への投資割合は、純資産総額の15%以下とします。
分配方針	毎月、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	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。 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。
申込手数料	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(2024年2月29日に終了した期間)

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:

外国税控除後の受取利息	AUD	15,030
雑収入		325
総収益		15,355

## 費用:

支払利息		10
総費用		10

投資純損益		15,345
-------	--	--------

---

## 実現純損益:

投資有価証券		(1,631)
金融派生商品 (市場または中央清算機関取引)		(4,668)
金融派生商品 (OTC)		(6,516)
外国通貨		(11)
実現純損益		(12,826)

## 未実現評価損益の純変動額:

投資有価証券		7,509
金融派生商品 (市場または中央清算機関取引)		5,795
金融派生商品 (OTC)		1,343
外貨建資産および負債		(439)
未実現評価損益の純変動額		14,208
純損益		1,382

運用の結果による純資産の純増減額	AUD	16,727
------------------	-----	--------

---

# 三井住友・豪ドル債ファンド

## ■ 投資明細表(2024年2月29日現在)

### PIMCOケイマン・オーストラリア・マルチセクター・ファンド

\*下記明細表中の資産名・業種の日本語表記については、末尾の【英語表記変換表】にてご確認ください。

額面金額 時価 (単位：千) (単位：千)			額面金額 時価 (単位：千) (単位：千)	額面金額 時価 (単位：千) (単位：千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 110.2%</b>			<b>U.S. GOVERNMENT AGENCIES 11.8%</b>	
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 9.5%</b>			<b>Fannie Mae</b>	
<b>BANKING &amp; FINANCE 7.3%</b>			6.000% due 08/01/2026 \$ 12 AUD 18	
<b>HSBC Commercial Finance Pty Ltd.</b>			6.000% due 04/25/2043 15 23	
3.600% due 11/11/2031 AUD 1,400 AUD 1,124			6.000% due 02/25/2044 11 17	
<b>ASX Ltd.</b>			6.000% due 07/25/2044 52 82	
5.266% due 02/26/2027 800 800			6.258% due 09/01/2044 36 56	
<b>Bank of America N.A.</b>			<b>Fannie Mae, TBA (c)</b>	
5.497% due 10/30/2026 2,300 2,340			4.000% due 05/01/2054 5,200 7,357	
<b>Bank of Queensland Ltd.</b>			6.500% due 03/01/2054 20,700 32,351	
5.544% due 05/09/2028 800 803			<b>Freddie Mac</b>	
<b>BNP Paribas S.A.</b>			4.500% due 09/01/2053 806 1,172	
5.286% due 02/15/2029 1,600 1,608			4.500% due 10/01/2053 177 257	
<b>Credit Agricole S.A.</b>			5.981% due 08/01/2035 3 5	
4.400% due 07/08/2027 700 674			6.021% due 09/01/2035 1 1	
<b>HSBC Holdings PLC</b>			<b>Small Business Administration</b>	
5.364% due 06/01/2028 900 905			5.090% due 10/01/2025 4 6	
<b>HSBC Holdings PLC</b>			<b>Total U.S. Government Agencies (Cost AUD 41,281)</b>	
2.251% due 11/22/2027 \$ 900 1,266			<b>41,345</b>	
2.633% due 11/07/2025 1,500 2,253			<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 20.8%</b>	
<b>ICPF Finance Pty Ltd.</b>			<b>Alternative Loan Trust</b>	
2.725% due 10/11/2030 AUD 1,300 1,039			5.855% due 07/25/2046 15 19	
<b>NatWest Group PLC</b>			6.090% due 11/20/2035 32 44	
2.875% due 09/19/2026 GBP 100 186			<b>Ashford Hospitality Trust</b>	
4.269% due 03/22/2025 \$ 400 614			6.490% due 06/15/2035 140 214	
<b>New York Life Global Funding</b>			<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>	
5.350% due 09/19/2028 AUD 900 910			5.041% due 01/25/2035 2 3	
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>			<b>Beast Mortgage Trust</b>	
2.920% due 05/08/2026 GBP 200 374			6.182% due 04/15/2036 700 1,065	
<b>Standard Chartered PLC</b>			<b>Bluestone Prime Trust</b>	
2.900% due 06/28/2025 AUD 2,500 2,481			5.044% due 06/21/2053 AUD 831 829	
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>			<b>BX Commercial Mortgage Trust</b>	
4.436% due 04/02/2024 (b) \$ 1,600 2,454			6.121% due 10/15/2038 \$ 547 833	
<b>Suncorp-Metway Ltd.</b>			6.331% due 02/15/2039 1,183 1,806	
5.405% due 07/12/2028 AUD 700 704			<b>BX Trust</b>	
<b>UBS AG</b>			6.180% due 11/15/2036 1,284 1,953	
5.647% due 05/12/2026 500 504			<b>Chase Home Lending Mortgage Trust</b>	
<b>UBS Group AG</b>			3.500% due 06/25/2062 644 893	
3.091% due 05/14/2032 \$ 1,000 1,291			<b>CIM Trust</b>	
6.373% due 07/15/2026 1,700 2,629			5.000% due 05/25/2062 635 964	
<b>Westpac Banking Corp.</b>			5.500% due 08/25/2064 618 946	
4.800% due 02/16/2028 AUD 500 501			6.639% due 12/25/2067 631 970	
<b>25,460</b>			<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>	
<b>INDUSTRIALS 1.3%</b>			5.319% due 08/25/2035 29 42	
<b>Central Nippon Expressway Co. Ltd.</b>			6.243% due 03/25/2034 2 3	
1.873% due 09/26/2024 2,400 2,354			<b>Commercial Mortgage Trust</b>	
<b>Pacific National Finance Pty Ltd.</b>			2.240% due 02/10/2037 700 1,030	
4.750% due 03/22/2028 \$ 350 510			<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>	
<b>Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.</b>			4.711% due 11/25/2034 15 20	
3.375% due 04/30/2025 200 299			<b>Credit Suisse Mortgage Capital</b>	
3.625% due 04/28/2026 300 443			1.756% due 10/25/2066 1,157 1,534	
<b>Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.</b>			<b>Credit Suisse Mortgage Capital Trust</b>	
5.350% due 09/15/2026 AUD 500 501			2.000% due 01/25/2060 819 1,080	
<b>WestConnex Finance Co. Pty Ltd.</b>			3.904% due 04/25/2062 603 867	
3.150% due 03/31/2031 500 429			<b>Equity One Mortgage Pass-Through Trust</b>	
<b>4,536</b>			5.004% due 07/25/2034 5,546 8,347	
<b>UTILITIES 0.8%</b>			<b>Extended Stay America Trust</b>	
<b>AGI Finance Pty Ltd.</b>			6.512% due 07/15/2038 641 983	
6.109% due 06/28/2030 800 827			<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>	
<b>Telstra Group Ltd.</b>			5.595% due 11/25/2036 61 92	
5.650% due 03/06/2034 (c) 500 500			<b>Firstmac Mortgage Funding Trust No.4</b>	
<b>Woodside Finance Ltd.</b>			5.025% due 09/24/2052 AUD 665 659	
3.700% due 09/15/2026 \$ 610 895			5.498% due 01/17/2051 1,001 1,003	
<b>Worley Financial Services Pty Ltd.</b>			5.509% due 08/12/2055 1,700 1,700	
5.950% due 10/13/2028 AUD 900 911			<b>Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates</b>	
<b>3,133</b>			6.281% due 10/25/2044 \$ 59 82	
<b>Total Corporate Bonds &amp; Notes (Cost AUD 32,397)</b>			8.281% due 02/25/2045 104 148	
<b>33,129</b>			6.481% due 07/25/2044 23 33	
			<b>FWD Securitization Trust</b>	
			2.240% due 01/25/2050 \$ 354 AUD 500	
			<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>	
			5.975% due 11/25/2045 9 12	
			<b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>	
			6.543% due 07/15/2025 105 161	
			<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>	
			5.076% due 09/25/2035 58 82	
			<b>Independence Plaza Trust</b>	
			3.753% due 07/10/2035 700 1,028	
			<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b>	
			5.815% due 09/25/2046 36 47	
			5.855% due 05/25/2046 8 11	
			5.915% due 07/25/2035 8 12	
			<b>Kingfisher Trust</b>	
			5.355% due 11/24/2048 AUD 989 991	
			<b>La Trobe Financial Capital Markets Trust</b>	
			5.056% due 01/14/2053 519 518	
			<b>Liberty PRIME</b>	
			5.045% due 11/25/2052 304 304	
			<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>	
			5.995% due 10/25/2034 \$ 145 213	
			6.055% due 08/25/2033 1,515 2,255	
			<b>Luminant Mortgage Trust</b>	
			5.775% due 12/25/2036 22 29	
			5.835% due 10/25/2046 13 17	
			<b>Medallion Trust</b>	
			5.572% due 01/21/2052 AUD 1,015 1,018	
			5.698% due 02/18/2048 1,128 1,137	
			<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>	
			4.970% due 05/25/2033 \$ 8 11	
			5.857% due 02/25/2033 6 8	
			<b>MFA Trust</b>	
			4.400% due 03/25/2068 625 922	
			<b>MHC Commercial Mortgage Trust</b>	
			6.233% due 04/15/2038 587 897	
			<b>MHC Trust</b>	
			6.282% due 05/15/2038 317 485	
			<b>Mill City Mortgage Loan Trust</b>	
			2.750% due 08/25/2059 472 685	
			<b>Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust</b>	
			5.545% due 10/25/2036 535 437	
			<b>MTN Commercial Mortgage Trust</b>	
			6.717% due 03/15/2039 700 1,056	
			<b>National RMBS Trust</b>	
			5.568% due 12/20/2047 AUD 444 446	
			<b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>	
			2.750% due 07/25/2059 \$ 859 1,245	
			2.750% due 11/25/2059 1,035 1,488	
			3.500% due 10/25/2059 277 394	
			4.500% due 05/25/2058 977 1,445	
			<b>Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</b>	
			4.610% due 10/25/2035 66 78	
			<b>DBX Trust</b>	
			5.949% due 02/25/2063 614 939	
			6.065% due 06/25/2057 45 66	
			6.520% due 07/25/2063 631 976	
			6.567% due 06/25/2063 615 950	
			<b>Pepper Residential Securities Trust No.25</b>	
			5.578% due 03/12/2061 AUD 430 431	
			6.362% due 03/12/2061 \$ 16 25	
			<b>Pepper Residential Securities Trust No.39</b>	
			5.208% due 07/16/2065 AUD 1,000 1,000	
			5.658% due 07/16/2065 1,100 1,100	
			<b>Petersen PLC</b>	
			5.593% due 12/23/2058 GBP 311 604	
			<b>Progress Trust</b>	
			5.524% due 02/21/2048 AUD 796 798	
			<b>PRPM LLC</b>	
			4.000% due 08/25/2053 \$ 629 933	

# 三井住友・豪ドル債ファンド

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>RedZed Trust</b>		
5.105% due 06/09/2053	AUD 397	397
<b>Resimac Bastille Trust</b>		
6.055% due 01/09/2055	532	536
<b>RESIMAC Premier</b>		
5.802% due 02/07/2052	125	125
6.132% due 07/10/2052	\$ 252	386
<b>SMRT Corporation Ltd.</b>		
6.318% due 01/15/2039	1,400	2,130
<b>Structured Asset Mortgage Investments II Trust</b>		
5.875% due 05/25/2046	24	13
<b>Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust</b>		
6.440% due 11/23/2035	1,800	2,721
6.943% due 04/25/2035	16	24
<b>TORRENS Trust</b>		
5.829% due 02/18/2049	AUD 452	454
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>		
2.900% due 10/25/2059	\$ 1,059	1,524
6.435% due 05/25/2059	692	1,082
6.435% due 10/25/2059	526	815
<b>Triton Bond Trust</b>		
5.005% due 02/09/2053	AUD 970	965
<b>Verus Securitization Trust</b>		
5.811% due 05/25/2068	\$ 593	907
6.443% due 08/25/2068	650	1,005
6.478% due 08/25/2068	626	965
<b>Waikiki Beach Hotel Trust</b>		
6.865% due 12/15/2033	700	1,062
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>		
4.830% due 06/25/2033	4	6
5.841% due 04/25/2047	20	26
5.955% due 11/25/2045	31	44
5.975% due 12/25/2045	89	133
<b>Westpac Securitisation Trust</b>		
5.098% due 01/18/2047	AUD 669	668
5.356% due 08/21/2055	2,200	2,205
<b>WSTN Trust</b>		
6.297% due 07/05/2037	\$ 500	774
<b>Total Mortgage-Backed Securities (Cost AUD 69,853)</b>		<b>72,883</b>
<b>ASSET-BACKED SECURITIES 3.8%</b>		
<b>Avoca CLO XV DAC</b>		
4.852% due 04/15/2031	EUR 388	641
<b>Avoca CLO XVII DAC</b>		
4.762% due 10/15/2032	300	495
<b>Bastille Euro CLO DAC</b>		
5.092% due 01/15/2034	500	831
<b>Carlyle Euro CLO DAC</b>		
4.531% due 08/15/2030	344	569
<b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.</b>		
4.051% due 11/15/2031	399	659
<b>Dryden 35 Euro CLO DAC</b>		
4.909% due 01/17/2033	500	826
<b>Dryden 44 Euro CLO DAC</b>		
4.822% due 04/15/2034	500	821
<b>Fidelity Grand Harbour CLO DAC</b>		
5.125% due 03/15/2032	500	829
<b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>		
4.700% due 10/20/2030	326	542
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>		
4.672% due 07/15/2031	348	574
<b>Private Driver Australia</b>		
5.584% due 02/21/2032	AUD 598	598
<b>Regatta XI Funding Ltd.</b>		
6.648% due 07/17/2031	\$ 617	947
<b>TCW CLO Ltd.</b>		
6.556% due 04/25/2031	526	809
<b>Toro European CLO DAC</b>		
4.711% due 02/15/2034	EUR 100	164

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Venture XXIX CLO Ltd.</b>		
6.558% due 09/07/2030	\$ 603	927
<b>VOYA CLO</b>		
6.556% due 06/07/2030	767	1,180
<b>Voya Euro CLO I DAC</b>		
4.692% due 10/15/2030	EUR 1,154	1,914
<b>Total Asset-Backed Securities (Cost AUD 11,971)</b>		<b>13,326</b>
<b>SOVEREIGN ISSUES 61.5%</b>		
<b>Australia Government Bond</b>		
0.500% due 09/21/2026	AUD 100	92
2.750% due 06/21/2035	5,500	4,791
2.750% due 05/21/2041	14,300	11,432
3.250% due 04/21/2025	100	99
3.250% due 06/21/2039	12,700	11,143
<b>Australian Capital Territory</b>		
1.750% due 05/17/2030	1,500	1,291
1.750% due 10/23/2031	6,900	5,688
4.500% due 10/23/2034	2,200	2,155
<b>Australian Postal Corp.</b>		
4.992% due 12/08/2027	1,000	1,009
<b>BNG Bank NV</b>		
1.600% due 11/27/2030	3,900	3,178
1.900% due 11/26/2025	2,500	2,394
3.250% due 07/15/2025	3,900	3,839
3.300% due 04/26/2029	1,700	1,602
3.500% due 07/19/2027	3,500	3,400
<b>CPPIB Capital, Inc.</b>		
1.500% due 06/23/2028	1,500	1,325
4.200% due 05/02/2028	1,300	1,287
5.200% due 03/04/2034	1,900	1,824
<b>European Investment Bank</b>		
2.900% due 10/17/2025	7,600	7,436
<b>International Bank for Reconstruction &amp; Development</b>		
4.250% due 06/24/2025	8,200	8,196
<b>International Finance Corp.</b>		
1.250% due 02/06/2031	3,700	2,954
4.450% due 05/14/2027	4,700	4,729
<b>Kommunalbanken AJS</b>		
3.000% due 12/09/2026	4,800	4,624
4.250% due 07/16/2025	2,000	1,994
5.250% due 07/15/2024	8,900	8,920
<b>Nederlandse Waterschapbank NV</b>		
5.250% due 04/18/2024	2,500	2,502
<b>New South Wales Treasury Corp.</b>		
1.500% due 02/20/2032	3,100	2,472
2.000% due 03/08/2033	13,300	10,694
2.500% due 11/22/2032	2,700	2,298
2.750% due 11/20/2025 (d)	4,000	6,342
3.000% due 02/20/2030	9,900	9,152
<b>Northern Territory Treasury Corp.</b>		
3.100% due 05/21/2029	4,600	4,116
3.500% due 05/21/2030	9,500	9,025
4.100% due 11/21/2042	700	577
<b>Province of Alberta</b>		
3.600% due 04/11/2028	1,200	1,148
<b>Province of British Columbia Canada</b>		
4.250% due 11/27/2024	3,200	3,193
<b>Province of Ontario</b>		
3.100% due 08/26/2025	4,900	4,798
<b>Queensland Treasury Corp.</b>		
1.500% due 08/20/2032	6,000	4,723
2.750% due 08/20/2027	11,200	10,748
4.200% due 02/20/2047	4,200	3,649
<b>South Australian Government Financing Authority</b>		
1.750% due 05/24/2034	12,100	9,108
3.000% due 05/24/2028	3,200	3,069
<b>Svensk Exportkredit AB</b>		
4.300% due 05/30/2028	500	494

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Tasmanian Public Finance Corp.</b>		
2.250% due 01/22/2032	AUD 1,100	935
<b>Treasury Corp. of Victoria</b>		
1.500% due 09/10/2031	9,900	7,983
2.250% due 09/15/2033	11,900	9,573
4.250% due 12/20/2032	5,000	4,838
4.750% due 09/15/2036	2,800	2,714
<b>Western Australian Treasury Corp.</b>		
3.000% due 10/21/2027	4,900	4,734
<b>Total Sovereign Issues (Cost AUD 237,235)</b>		<b>214,387</b>
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 2.7%</b>		
<b>CERTIFICATES OF DEPOSIT (e) 0.9%</b>		
<b>Cooperative Rabobank UA</b>		
4.350% due 05/09/2024	2,000	1,983
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
4.549% due 03/01/2024	1,000	1,000
		<b>2,983</b>
<b>TIME DEPOSITS 1.8%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
3.350% due 03/01/2024	AUD 1,166	1,166
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
4.830% due 03/01/2024	\$ 55	85
<b>BNP Paribas Bank</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 1	0
3.350% due 03/01/2024	AUD 744	744
3.500% due 03/01/2024	NZD 54	50
4.400% due 03/01/2024	GBP 1	1
6.680% due 03/01/2024	ZAR 278	22
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 52	1
0.520% due 03/01/2024	CHF 0	1
2.750% due 03/01/2024	DKK 5	1
4.830% due 03/01/2024	\$ 5	8
<b>Citibank N.A.</b>		
4.830% due 03/01/2024	270	415
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.830% due 03/01/2024	140	215
<b>DnB Bank ASA</b>		
2.950% due 03/01/2024	SEK 2	0
3.350% due 03/01/2024	AUD 538	538
<b>HSBC Bank PLC</b>		
3.070% due 03/01/2024	EUR 31	52
4.400% due 03/01/2024	GBP 2	5
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.830% due 03/01/2024	\$ 161	247
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 2,190	23
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	17,883	184
3.070% due 03/01/2024	EUR 2	3
4.400% due 03/01/2024	GBP 1	1
4.830% due 03/01/2024	\$ 588	904
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 830	9
3.070% due 03/01/2024	EUR 23	38
4.400% due 03/01/2024	GBP 7	13
4.830% due 03/01/2024	\$ 1,041	1,599
		<b>6,325</b>
<b>Total Short-Term Instruments (Cost AUD 9,309)</b>		<b>9,308</b>

## 三井住友・豪ドル債ファンド

	時価
	(単位：千)
Total Investments in Securities (a) 110.2% (Cost AUD 402,046)	AUD 384,378
Financial Derivative Instruments (f)(g) (0.4%) (Cost or Premiums, net AUD (1,193))	(1,560)
Other Assets and Liabilities, net (9.8%)	<u>(34,054)</u>
Net Assets 100.0%	<u>AUD 348,764</u>

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### 【英語表記変換表】

資産名		業種	
INVESTMENTS IN SECURITIES	投資有価証券	BANKING & FINANCE	銀行および金融
CORPORATE BONDS & NOTES	社債券等	INDUSTRIALS	一般事業
U.S. GOVERNMENT AGENCIES	米国政府機関債	UTILITIES	公共事業
MORTGAGE-BACKED SECURITIES	モーゲージ証券		
ASSET-BACKED SECURITIES	資産担保証券		
SOVEREIGN ISSUES	ソブリン債		
SHORT-TERM INSTRUMENTS	短期証券		
CERTIFICATES OF DEPOSIT	譲渡性定期預金		
TIME DEPOSITS	定期性預金		
Financial Derivative Instruments	金融派生商品		
Other Assets and Liabilities, net	その他の資産および負債（純額）		
Net Assets	純資産		

## ■ 損益計算書 (2024年2月29日に終了した期間)

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：

外国税控除後の受取利息	AUD	3,641
雑収入		48
総収益		3,689

## 費用：

支払利息		0
総費用		0

投資純損益		<u>3,689</u>
-------	--	--------------

## 実現純損益：

投資有価証券		(137)
金融派生商品 (市場または中央清算機関取引)		(523)
金融派生商品 (OTC)		60
外国通貨		120
実現純損益		(480)

## 未実現評価損益の純変動額：

投資有価証券		1,663
金融派生商品 (市場または中央清算機関取引)		349
金融派生商品 (OTC)		(85)
外貨建資産および負債		(16)
未実現評価損益の純変動額		1,911
純損益		1,431

運用の結果による純資産の純増減額	AUD	<u>5,120</u>
------------------	-----	--------------

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

## ■ 投資明細表(2024年2月29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

※下記明細表中の投資名・業種(日本語表記については、末尾の【英語表記変換表】にてご確認ください)。

	額面金額	時価
	(単位:千)	(単位:千)
<b>INVESTMENTS IN SECURITIES 100.1%</b>		
<b>CORPORATE BONDS &amp; NOTES 60.4%</b>		
<b>BANKING &amp; FINANCE 43.4%</b>		
<b>Banco Santander S.A.</b>		
5.615% due 09/26/2024	AUD 2,200	2,198
5.796% due 01/23/2029	1,000	1,007
<b>Bank of Queensland Ltd.</b>		
5.456% due 10/29/2025	1,500	1,505
<b>Barclays PLC</b>		
3.250% due 06/26/2024	3,000	2,981
5.583% due 05/20/2027	3,500	3,475
6.515% due 06/26/2024	750	753
<b>BNP Paribas S.A.</b>		
1.795% due 09/03/2027	3,800	3,446
<b>BPCE S.A.</b>		
6.342% due 09/29/2028	1,400	1,416
<b>Commonwealth Bank of Australia</b>		
6.160% due 09/10/2030 (b)	2,800	2,818
<b>Cooperative Rabobank UA</b>		
4.842% due 02/26/2027	700	702
<b>Credit Agricole S.A.</b>		
4.400% due 07/06/2027	3,000	2,887
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.678% due 02/24/2026	600	601
5.065% due 06/26/2026	600	600
<b>GAIF Bond Issuer Pty Ltd.</b>		
3.400% due 09/30/2026	\$ 1,000	1,464
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>		
5.873% due 05/02/2024	AUD 4,000	4,003
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>		
4.250% due 11/22/2027	6,600	6,341
<b>NatWest Markets PLC</b>		
5.055% due 08/12/2025	1,600	1,594
<b>Westpac Banking Corp.</b>		
4.800% due 02/16/2028	600	601
		<u>38,392</u>
<b>INDUSTRIALS 10.9%</b>		
<b>Aurizon Network Pty Ltd.</b>		
2.900% due 09/02/2030	1,500	1,236
4.000% due 06/21/2024	3,100	3,091
<b>Transurban Queensland Finance Pty Ltd.</b>		
3.250% due 08/05/2031	800	683
<b>Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.</b>		
1.200% due 04/08/2024	1,700	1,694
1.400% due 08/25/2025	900	851
<b>WestConnex Finance Co. Pty Ltd.</b>		
3.150% due 03/31/2031	2,400	2,058
		<u>9,613</u>
<b>UTILITIES 6.1%</b>		
<b>DBNGP Finance Co. Pty Ltd.</b>		
4.225% due 05/28/2025	2,700	2,664
<b>Network Finance Co. Pty Ltd.</b>		
2.578% due 10/03/2026	800	711
6.061% due 06/19/2030	1,000	1,032
<b>NSW Electricity Networks Finance Pty Ltd.</b>		
5.770% due 05/29/2030	1,000	1,012
		<u>5,419</u>
<b>Total Corporate Bonds &amp; Notes</b>		<u>53,424</u>
<b>(Cost AUD 55,107)</b>		
<b>U.S. GOVERNMENT AGENCIES 0.0%</b>		
<b>Fannie Mae</b>		
5.838% due 06/25/2029	\$ 1	1
<b>Total U.S. Government Agencies</b>		<u>1</u>
<b>(Cost AUD 1)</b>		
<b>MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.4%</b>		
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>		
6.095% due 02/25/2035	8	11
6.115% due 02/25/2035	9	12

	額面金額	時価
	(単位:千)	(単位:千)
<b>CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates</b>		
4.739% due 07/25/2033	\$ 2	3
<b>Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates</b>		
6.481% due 07/25/2044	6	8
<b>Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates</b>		
5.921% due 10/25/2033	5	6
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>		
5.857% due 02/25/2033	2	3
<b>Pepper I-Prime Trust</b>		
5.096% due 01/22/2053	AUD 291	291
<b>Total Mortgage-Backed Securities</b>		<u>334</u>
<b>(Cost AUD 331)</b>		
<b>SOVEREIGN ISSUES 32.0%</b>		
<b>BNG Bank NV</b>		
3.500% due 07/19/2027	7,100	6,898
<b>Kommunalbanken AIS</b>		
3.000% due 12/09/2026	3,600	3,468
<b>Nederlandse Waterschapbank NV</b>		
3.300% due 05/02/2029	1,600	1,506
3.450% due 07/17/2028	3,100	2,976
<b>New South Wales Treasury Corp.</b>		
2.000% due 03/08/2033	5,900	4,744
3.000% due 03/20/2028	700	673
<b>Queensland Treasury Corp.</b>		
2.750% due 08/20/2027	5,300	5,086
<b>Treasury Corp. of Victoria</b>		
4.250% due 12/20/2032	2,000	1,935
<b>Western Australian Treasury Corp.</b>		
3.000% due 10/21/2026	800	780
3.250% due 07/20/2028	200	194
<b>Total Sovereign Issues</b>		<u>28,260</u>
<b>(Cost AUD 28,630)</b>		
<b>SHORT-TERM INSTRUMENTS 7.3%</b>		
<b>CERTIFICATES OF DEPOSIT 4.5%</b>		
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp. (c)</b>		
4.423% due 03/11/2024	1,000	999
4.523% due 06/03/2024	1,000	988
4.536% due 03/18/2024	1,000	988
4.549% due 03/01/2024	1,000	1,000
		<u>3,985</u>
<b>COMMERCIAL PAPER 1.1%</b>		
<b>Volkswagen International</b>		
4.734% due 03/19/2024 (c)	1,000	997
<b>TIME DEPOSITS 1.7%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
3.350% due 03/01/2024	503	503
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
4.830% due 03/01/2024	\$ 7	11
<b>BNP Paribas Bank</b>		
3.350% due 03/01/2024	AUD 321	321
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
2.750% due 03/01/2024	DKK 5	1
4.830% due 03/01/2024	\$ 1	1
<b>Citibank N.A.</b>		
4.830% due 03/01/2024	33	51
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.830% due 03/01/2024	17	26
<b>DnB Bank ASA</b>		
3.350% due 03/01/2024	AUD 232	232
<b>HSBC Bank PLC</b>		
3.070% due 03/01/2024	EUR 2	3
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.830% due 03/01/2024	\$ 20	30

	額面金額	時価
	(単位:千)	(単位:千)
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 11	0
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	89	1
4.830% due 03/01/2024	\$ 72	110
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 4	0
3.070% due 03/01/2024	EUR 1	2
4.830% due 03/01/2024	\$ 127	195
		<u>1,487</u>
<b>Total Short-Term Instruments</b>		<u>6,469</u>
<b>(Cost AUD 6,470)</b>		
<b>Total Investments in Securities (a) 100.1%</b>	<b>AUD</b>	<b>88,488</b>
<b>(Cost AUD 90,539)</b>		
<b>Financial Derivative</b>		
<b>Instruments (d)(e) (0.0%)</b>		<b>(26)</b>
<b>(Cost or Premiums, net AUD 0)</b>		
<b>Other Assets and Liabilities, net (0.1%)</b>		<b>(50)</b>
<b>Net Assets 100.0%</b>	<b>AUD</b>	<b>88,412</b>

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### 【英語表記変換表】

資産名		業種	
INVESTMENTS IN SECURITIES	投資有価証券	BANKING & FINANCE	銀行および金融
CORPORATE BONDS & NOTES	社債券等	INDUSTRIALS	一般事業
U.S. GOVERNMENT AGENCIES	米国政府機関債	UTILITIES	公共事業
MORTGAGE-BACKED SECURITIES	モーゲージ証券		
SOVEREIGN ISSUES	ソブリン債		
SHORT-TERM INSTRUMENTS	短期証券		
CERTIFICATES OF DEPOSIT	譲渡性定期預金		
COMMERCIAL PAPER	コマーシャルペーパー		
TIME DEPOSITS	定期性預金		
Financial Derivative Instruments	金融派生商品		
Other Assets and Liabilities, net	その他の資産および負債（純額）		
Net Assets	純資産		