

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20作成期(2023年11月14日から2024年5月13日まで)

第 39 期 / 第 40 期

第39期: 決算日 2024年2月13日

第40期: 決算日 2024年5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(評価損益を含みまず。)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 債 率	投 資 信 託 入 率	純 資 産 額
		税 分 配 込 金 騰 落	騰 落 中 率			
31期(2022年2月14日)	円 9,860	円 50	% △0.5	% 0.0	% 95.3	百万円 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
39期(2024年2月13日)	10,003	380	3.8	0.0	96.1	4,846
40期(2024年5月13日)	10,008	490	4.9	0.0	97.0	5,128

※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 債 率	投 資 信 託 入 率
		騰 落 率	騰 落 率		
第39期	(期 首) 2023年11月13日	円 10,007	% —	% 0.0	% 96.1
	11月末	9,975	△0.3	0.0	99.1
	12月末	9,803	△2.0	0.0	98.9
	2024年1月末	10,309	3.0	0.0	93.0
	(期 末) 2024年2月13日	10,383	3.8	0.0	96.1
第40期	(期 首) 2024年2月13日	10,003	—	0.0	96.1
	2月末	10,085	0.8	0.0	100.2
	3月末	10,237	2.3	0.0	98.7
	4月末	10,436	4.3	0.0	92.8
	(期 末) 2024年5月13日	10,498	4.9	0.0	97.0

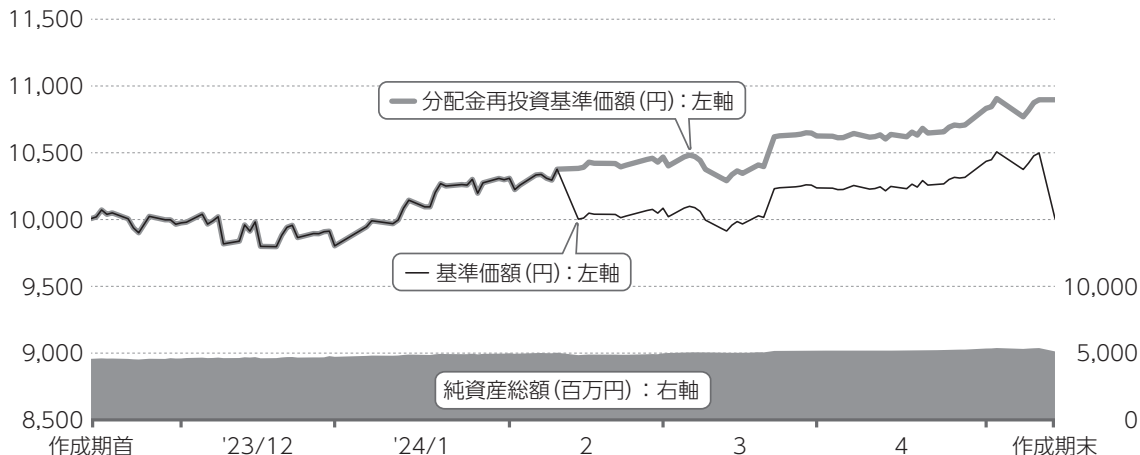
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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11月14日から2024年5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	10,007円
作成期末	10,008円 (当作成期既払分配金870円(税引前))
騰落率	+8.9% (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11月14日から2024年5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
- 期の前半において、米インフレの鈍化やFRB（米連邦準備制度理事会）高官による利下げを示唆する発言などを背景に早期利下げ観測が高まったことで、米国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと
- リスク資産を選好する動きから、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと
- 底堅い米国の経済指標やインフレの下げ渋りを背景に利下げの開始時期が後ずれするとの見方が広がったことで、米ドル高・円安となったこと

下落要因

- 売り持ちポジションとしていたコロンビアペソにおいて、米ドル安・ペソ高が進行したこと

投資環境について（2023年11月14日から2024年5月13日まで）

米国債券市場は上昇しました。米国ハイイールド社債市場と新興国債券市場も上昇しました。

為替市場では、米ドル高・円安となりました。

債券市場

期の前半は米インフレの鈍化やFRB高官による利下げを示唆する発言などを背景に早期利下げ観測が高まり、米国を中心に世界的に金利は低下しました。期の後半にかけては、米景気の底堅さを維持する経済指標に加え、インフレが再加速するとの懸念から利下げ開始が後ろ倒しされるとの見方が強まり、金利は上昇に転じました。ただし、期を通じてみると金利が低下したことから米国債券市場は上昇しました。また、リスク資産を選好する動きからスプレッドが縮小し、米国ハイイールド社債市場と新興国債券市場も上昇しました。

為替市場

為替市場では、底堅い米国の経済指標やインフレの下げ渋りを背景に利下げの開始時期が後ずれするとの見方が広がり、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11月14日から2024年5月13日まで）

当ファンド

「ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラスJ(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リスク分散の観点から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。相対的に金利水準が高く今後の金利低下が見込める米国の金利リスクを積み増したほか、相対的に投資妙味が低く金融緩和政策の更なる修正の可能性が高い日本の金利リスクを引き続き売り持ちとしました。

●債券セクター配分

セクター戦略については、米政府関連債や米政府系住宅ローン担保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される資産について、全体で高位の組入れを維持していました。一方、ハイイールド社債やバンクローンについては組入れを抑制しつつも厳選した銘柄に投資していました。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住宅ローン担保証券への投資を継続しています。利回りが相対的に高い新興国については、メキシコや南アフリカ等への分散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11月14日から2024年5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11月14日から2024年5月13日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第39期	第40期
当期分配金	380	490
（対基準価額比率）	（3.66%）	（4.67%）
当期の収益	375	485
当期の収益以外	4	4
翌期繰越分配対象額	998	995

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。

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。

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

- 主要投資対象である外国籍投資信託における米ドル以外の通貨の組入比率の制限を10%程度から15%程度に緩和するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2024年5月9日)

1万口当たりの費用明細（2023年11月14日から2024年5月13日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	93円	0.919%	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10,120円です。
（投信会社）	(53)	(0.520)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(39)	(0.383)	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)	(0.016)	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) 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	0.002	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)	(0.002)	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	93	0.921	

※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。

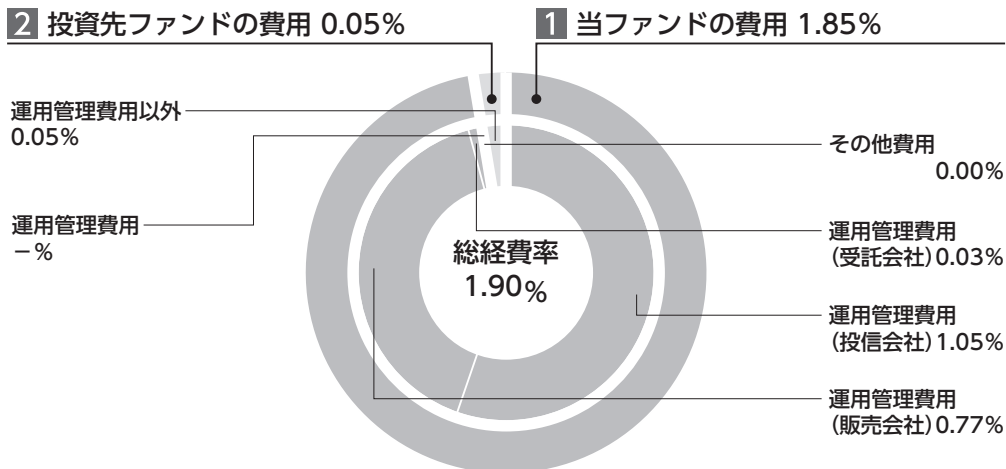
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)		1.90%
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	0.05%

※**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1.90%です。

■ ■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年11月14日から2024年5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
		60,464	726,943	40,226	495,983

※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11月14日から2024年5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11月14日から2024年5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（2024年5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)	370,554	390,792	4,973,218	97.0
合計	370,554	390,792	4,973,218	97.0

※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

(2024年5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	4,973,218	91.8
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	444,565	8.2
投資信託財産総額	5,419,239	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2024年2月13日) (2024年5月13日)	
	第39期末	第40期末
(A) 資 産	5,057,515,355円	5,419,239,034円
コール・ローン等	399,526,482	444,565,729
投資信託受益証券(評価額)	4,656,533,832	4,973,218,992
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,455,041	1,454,313
(B) 負 債	210,601,621	290,530,832
未払収益分配金	184,127,061	251,098,621
未払解約金	4,291,934	16,057,869
未払信託報酬	22,120,072	23,311,944
その他未払費用	62,554	62,398
(C) 純資産総額(A - B)	4,846,913,734	5,128,708,202
元 本	4,845,448,984	5,124,461,660
次期繰越損益金	1,464,750	4,246,542
(D) 受益権総口数	4,845,448,984口	5,124,461,660口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,003円	10,008円

※当作成期における作成期首元本額4,569,186,934円、作成期中追加設定元本額735,446,259円、作成期中一部解約元本額180,171,533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39期	第40期
		380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11月14日 至2024年2月13日		自2024年2月14日 至2024年5月13日	
	第39期	第40期	第39期	第40期
(A) 配 当 等 収 益	62,913,871円	64,780,134円		
受 取 配 当 金	62,920,561	64,767,348		
受 取 利 息	593	14,259		
支 払 利 息	△ 7,283	△ 1,473		
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	141,429,299	207,289,937		
売 買 益	142,072,844	208,764,100		
売 買 損	△ 643,545	△ 1,474,163		
(C) 信 託 報 酬 等	△ 22,185,587	△ 23,375,987		
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	182,157,583	248,694,084		
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	114,261,481	110,506,135		
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 110,827,253	△ 103,855,056		
(配 当 等 相 当 額)	(371,504,334)	(401,849,274)		
(売 買 損 益 相 当 額)	(△482,331,587)	(△505,704,330)		
(G) 合 計 (D + E + F)	185,591,811	255,345,163		
(H) 収 益 分 配 金	△ 184,127,061	△ 251,098,621		
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	1,464,750	4,246,542		
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 110,827,253	△ 103,855,056		
(配 当 等 相 当 額)	(371,504,341)	(401,849,282)		
(売 買 損 益 相 当 額)	(△482,331,594)	(△505,704,338)		
分 配 準 備 積 立 金	112,292,003	108,101,598		

※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16,246,674円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第39期	第40期
(a) 経費控除後の配当等収益	56,084,402円	59,215,692円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	126,073,181	189,478,392
(c) 収益調整金	371,504,341	401,849,282
(d) 分配準備積立金	114,261,481	110,506,135
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	667,923,405	761,049,501
1万口当たり当期分配対象額	1,378.46	1,485.13
(f) 分配金	184,127,061	251,098,621
1万口当たり分配金	380	490

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。 ●原則として対円での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（2023年10月31日に終了した期間）

（単位：千米ドル）

投資収益	
受取利息(外国税控除後)	23,195
総収益	23,195
費用	
顧問費用 - W (USD)	142
管理手数料 - M (JPY助言)	777
管理手数料 - M (USD助言)	276
管理手数料 - P (JPY)	204
管理手数料 - R (USD)	122
管理手数料 - S (USD)	82
管理手数料 - T (JPY)	4,430
管理手数料 - U2 (JPY)	273
管理手数料 - X (JPY)	28
管理事務代行費用 - R (USD)	37
管理事務代行費用 - S (USD)	25
管理事務代行費用 - W (USD)	44
販売手数料 - M (JPY助言)	674
販売手数料 - M (USD助言)	239
販売手数料 - P (JPY)	204
代行手数料 - M (JPY助言)	52
代行手数料 - M (USD助言)	18
支払利息	2,673
総費用	10,300
投資純損益	12,895
実現純損益	
有価証券に対する投資(外国税控除後)	(128)
関連ファンドに対する投資	231,638
OTC金融デリバティブ商品	(570,750)
外国為替	3,475
実現純損益	(335,765)
未実現損益の純変動額	
有価証券に対する投資	21
関連ファンドに対する投資	299,928
OTC金融デリバティブ商品	73,407
外貨建資産および負債	74
未実現損益の純変動額	373,430
純損益	37,665
運用の結果による純資産の純増減額	50,560

■ 投資明細表（2023年10月31日現在）

※下記明細表中の資産名・通貨略称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 (単位:千)	時価 (単位:千)
INVESTMENTS IN SECURITIES 3.4%		
SHORT-TERM INSTRUMENTS 3.4%		
TIME DEPOSITS 0.0%		
Bank of Nova Scotia		
4.830% due 11/01/2023	\$ 27	\$ 27
Brown Brothers Harriman & Co.		
4.830% due 11/01/2023	2	2
Citibank N.A.		
4.830% due 11/01/2023	113	113
DBS Bank Ltd.		
4.830% due 11/01/2023	97	97
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.830% due 11/01/2023	206	206
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.370%) due 11/01/2023	¥ 2	0
4.830% due 11/01/2023	\$ 11	11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.370%) due 11/01/2023	¥ 9	0
4.830% due 11/01/2023	\$ 262	262
		718
U.S. TREASURY BILLS 3.4%		
5.334% due 11/14/2023 (a)	14,000	13,973
5.355% due 11/21/2023 (a)	21,261	21,199
5.365% due 12/12/2023 (a)	13,000	12,922
5.372% due 01/18/2024 (b)(d)	7,800	7,710
5.374% due 12/07/2023 (a)(d)	5,600	5,570
5.377% due 12/14/2023 (b)	26,200	26,035
5.385% due 01/25/2024 (a)	22,700	22,416
5.396% due 11/24/2023 (a)(d)	9,200	9,169
5.405% due 01/04/2024 (a)(d)	20,600	20,406
5.405% due 01/11/2024 (b)	154,700	153,085
5.414% due 01/23/2024 (a)	18,000	17,780
5.414% due 01/16/2024 (a)(d)	10,700	10,580
5.431% due 01/30/2024 (a)(d)	10,300	10,163
5.441% due 02/06/2024 (a)(d)	17,300	17,052
	348,060	
Total Short-Term Instruments		348,778
(Cost \$348,759)		
Total Investments in Securities		348,778
(Cost \$348,759)		
	口数 (単位:千)	
INVESTMENTS IN AFFILIATES 97.8%		
OTHER INVESTMENT COMPANIES 97.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
(Cost \$10,020,480)	693,561	10,181,475
Total Investments in Affiliates		10,181,475
(Cost \$10,020,480)		
Total Investments 101.2%		\$10,530,253
(Cost \$10,369,239)		
Financial Derivative		
Instruments (c) (1.2%)		(123,895)
(Cost or Premiums, net \$0)		
Other Assets and Liabilities, net (0.0%)		(667)
Net Assets 100.0%		\$10,405,691

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書（2023年10月31日に終了した期間）

(単位：千米ドル)

投資収益	
受取利息（外国税控除後）	584,256
受取配当金（外国税控除後）	896
雑収入	2,092
総収益	<u>587,244</u>
費用	
支払利息	2,725
総費用	<u>2,725</u>
投資純損益	<u>584,519</u>
実現純損益	
有価証券に対する投資（外国税控除後）	(557,592)
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	(81,534)
OTC金融デリバティブ商品	102,990
外国為替	9,111
実現純損益	<u>(527,025)</u>
未実現損益の純変動額	
有価証券に対する投資	56,671
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	300,649
OTC金融デリバティブ商品	127,021
外貨建資産および負債	(4,910)
未実現損益の純変動額	<u>479,431</u>
純損益	<u>(47,594)</u>
運用の結果による純資産の純増減額	<u>536,925</u>
外国源泉課税	1,226

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（2023年10月31日現在）

※下記明細表中の資産名・通貨略称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ませ。

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)							
INVESTMENTS IN SECURITIES 148.7%									
BANK LOAN OBLIGATIONS 4.3%									
Advantage Loyalty IP Ltd.									
10.427% due 04/20/2028	\$ 9,453	\$ 9,600							
AmSurg LLC									
13.258% due 04/29/2027	78,267	91,831							
16.695% due 04/28/2028 (b)	39,584	36,017							
Azalea TopCo, Inc.									
9.184% due 07/24/2026	818	778							
Carnival Corp.									
7.618% due 06/30/2025	EUR 11,263	11,919							
8.689% due 10/18/2028	\$ 2,290	2,252							
Cengage Learning, Inc.									
10.405% due 07/14/2026	11,893	11,783							
Charter Communications Operating LLC									
7.074-7.133% due 02/01/2027	3,069	3,065							
DIRECTV Financing LLC									
10.439% due 08/02/2027	7,101	6,923							
Envalfir Finance GmbH									
9.448% due 03/29/2030	EUR 10,900	10,686							
10.883% due 03/29/2030	\$ 19,602	18,070							
Envision Healthcare Corp.									
13.250% due 07/10/2026	23,591	23,591							
Finastra USA, Inc.									
2.579% due 09/13/2029 (c)	614	603							
12.582% due 09/13/2029	6,161	6,053							
GTCR W Merger Sub LLC									
8.334% due 09/20/2030	9,200	9,146							
iHeartCommunications, Inc.									
8.439% due 05/01/2026	49,324	42,248							
Igvia, Inc.									
5.868% due 03/07/2024	EUR 3,900	4,123							
Lealand Finance Co. BV									
3.000-6.439% due 06/30/2025	\$ 613	337							
8.439% due 06/28/2024	261	190							
Poseidon Bidco SAS									
9.222% due 09/30/2028	EUR 39,600	42,014							
Pug LLC									
8.939% due 02/12/2027	\$ 780	738							
Sigma Holdco BV									
7.413% due 07/02/2025	EUR 1,820	1,920							
Sotera Health Holdings LLC									
8.395% due 12/11/2026	\$ 3,362	3,340							
SS&S Technologies Holdings, Inc.									
7.189% due 04/16/2025	2,824	2,825							
SVF II Finc (Cayman) LP									
5.000% due 12/21/2025	32,083	30,109							
Syniverse Holdings LLC									
12.390% due 05/13/2027	24,909	22,192							
Team Health Holdings, Inc.									
8.189% due 02/06/2024	1,685	1,650							
TransDigm, Inc.									
8.640% due 02/22/2027	786	787							
8.640% due 08/24/2028	24,180	24,180							
U.S. Renal Care, Inc.									
10.446% due 06/20/2028	3,155	1,956							
United Airlines, Inc.									
9.189% due 04/21/2028	2,439	2,438							
Westmoreland Coal Co.									
8.000% due 03/15/2029	349	260							
Windstream Services LLC									
9.424% due 02/23/2027	4,920	4,846							
11.674% due 09/21/2027	8,020	7,450							
Total Bank Loan Obligations	435,920								
(Cost \$444,839)									
CORPORATE BONDS & NOTES 15.6%									
BANKING & FINANCE 7.4%									
AGFC Capital Trust I									
7.405% due 01/15/2067	2,200	1,157							
AIB Group PLC									
5.250% due 10/23/2031	EUR 4,060	\$ 4,326							
6.608% due 09/13/2029	\$ 5,200	5,088							
Armor Holdco, Inc.									
8.500% due 11/15/2029	200	175							
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates									
5.849% due 06/15/2050	7,900	6,006							
Aroundtown S.A.									
5.375% due 03/21/2029	11,300	8,843							
Avolon Holdings Funding Ltd.									
2.528% due 11/18/2027	43,530	36,373							
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA									
1.875% due 01/09/2026	EUR 7,100	6,735							
2.625% due 04/28/2025	1,000	996							
3.625% due 09/24/2024	900	929							
6.750% due 03/02/2026	12,961	13,648							
7.708% due 01/18/2028	1,200	1,111							
8.000% due 01/22/2030	5,237	5,217							
8.500% due 09/10/2030	2,000	1,992							
Banco de Credito del Peru S.A.									
4.650% due 09/17/2024	PEN 16,400	4,133							
Banco Santander S.A. (d)									
6.527% due 11/07/2027	\$ 11,000	11,022							
6.607% due 11/07/2028	8,400	8,413							
Bank of Nova Scotia									
4.900% due 06/04/2025 (e)(f)	1,124	1,029							
Barclays PLC									
4.972% due 05/16/2029	2,600	2,394							
6.490% due 09/13/2029	8,500	8,290							
6.682% due 09/13/2034	9,900	9,368							
7.437% due 11/02/2033	400	399							
BPCE S.A.									
6.714% due 10/19/2029	19,000	18,741							
7.003% due 10/19/2034	11,600	11,278							
Brandywine Operating Partnership LP									
3.950% due 11/15/2027	2,000	1,659							
4.550% due 10/01/2029	1,500	1,149							
CA Immobilien Anlagen AG									
1.000% due 10/27/2025	EUR 3,400	3,214							
CaixaBank S.A.									
6.208% due 01/18/2029	\$ 5,400	5,214							
6.840% due 09/13/2034	7,800	7,376							
CFH Holdings Group Co. Ltd. (b)									
4.375% due 04/12/2027	300	17							
4.450% due 08/17/2026	500	32							
5.950% due 10/20/2025	200	15							
6.000% due 07/16/2025	200	14							
6.450% due 11/07/2024	600	39							
Corestate Capital Holding S.A. (g)									
8.000% due 12/31/2026	EUR 8,491	6,066							
10.000% due 12/31/2026	1,300	1,374							
Corsair International Ltd.									
8.802% due 01/28/2027	10,000	10,411							
9.152% due 01/28/2029	4,100	4,247							
Country Garden Holdings Co. Ltd. (b)									
2.700% due 07/12/2026	\$ 2,100	92							
3.125% due 10/22/2025	3,400	147							
3.875% due 10/22/2030	1,700	78							
CPI Property Group S.A.									
2.750% due 05/12/2026	EUR 2,100	1,850							
Credit Suisse AG									
0.495% due 02/02/2024	\$ 5,200	5,116							
5.500% due 08/20/2026	EUR 14,000	15,202							
7.500% due 02/15/2028	\$ 10,500	10,907							
Credit Suisse Group AG AT1 Claim (b)									
	9,046	995							
Cromwell Ereit Lux Finco Sari									
2.125% due 11/19/2025	EUR 433	418							
CTP NV									
1.250% due 08/21/2029	7,500	5,937							
1.500% due 09/27/2031	EUR 8,200	\$ 6,001							
Deutsche Bank AG									
1.375% due 02/17/2032	8,500	6,708							
1.750% due 11/19/2030	6,200	5,286							
2.129% due 11/24/2026 (l)	\$ 1,200	1,084							
3.035% due 05/28/2032 (l)	700	522							
3.547% due 09/18/2031	7,400	6,815							
3.961% due 11/26/2025	3,127	3,016							
6.720% due 01/18/2029	2,900	2,848							
EPR Properties									
4.750% due 12/15/2026	256	234							
4.950% due 04/15/2028	1,132	987							
G City Europe Ltd.									
4.250% due 09/11/2025	EUR 400	37							

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)						
7.482% due 08/29/2029	GBP 4,800	\$ 5,976	Broadcom, Inc.					
Seazen Group Ltd.			2.450% due 02/15/2031	\$ 7,900	\$ 6,065	Syngenta Finance NV		
6.000% due 08/12/2024	\$ 700	301	3.137% due 11/15/2035	4,435	3,130	4.892% due 04/24/2025	\$ 800	\$ 782
Societe Generale S.A.			3.499% due 04/15/2034	4,513	3,440	Times Square Hotel Trust		
6.446% due 01/10/2029	8,050	7,868				8.529% due 08/01/2026	823	813
6.691% due 01/10/2034	15,100	14,150	Carvana Co. (q)			U.S. Rental Care, Inc.		
Sunac China Holdings Ltd.			12.000% due 12/01/2028	11,453	8,536	10.625% due 05/28/2028	2,342	1,446
7.000% due 07/09/2025	800	128	12.000% due 12/01/2030	17,180	12,729	United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust		
SVB Financial Group			13.000% due 06/01/2030	20,329	15,161	2.700% due 05/01/2032	1,288	1,049
3.125% due 06/05/2030 (b)	100	57	14.000% due 06/01/2031			United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
U.S. Capital Funding VI Ltd.			Community Health Systems, Inc.			5.875% due 10/15/2027	20,509	20,217
5.948% due 07/10/2043	23,084	17,602	5.625% due 03/15/2027	21,336	17,351	Venture Global Calcasieu Pass LLC		
UBS Group AG			8.000% due 03/15/2026	6,401	7,691	3.875% due 08/15/2029	7,400	6,165
3.091% due 05/14/2032	2,850	2,193	CoStar Group, Inc.			3.875% due 11/01/2033	16,500	12,486
3.750% due 03/28/2025	6,200	5,972	2.800% due 07/15/2030	2,000	1,554	4.125% due 08/15/2031	5,000	4,025
3.869% due 01/12/2029	31,650	28,346	CVS Pass-Through Trust			Venture Global LNG, Inc.		
4.194% due 04/01/2031	9,150	7,826	5.779% due 01/18/2033	129	125	8.125% due 06/01/2028	7,800	7,394
5.959% due 01/12/2034	15,900	14,830	7.507% due 01/10/2032	515	525	8.375% due 06/01/2031	8,400	8,022
6.301% due 09/22/2034	4,900	4,643	8.359% due 07/10/2031	514	532	9.500% due 02/01/2029	46,750	47,524
6.327% due 12/22/2027	10,000	9,902	Energy Transfer LP			9.875% due 02/01/2032	15,550	15,777
6.442% due 08/11/2028	3,360	3,326	4.950% due 05/15/2028	424	401	Veritas U.S. Inc.		
6.537% due 08/12/2033	22,110	21,257	Exela Intermediate LLC			7.500% due 09/01/2025	1,950	1,598
7.750% due 03/01/2029	EUR 3,540	4,151	11.600% due 04/15/2026 (q)	541	92			
9.018% due 11/15/2033	\$ 4,350	4,875	Ford Foundation					
Unicredit SPA			2.815% due 08/01/2070	1,940	989			
7.830% due 12/04/2023	72,590	72,690	Greene King Finance PLC			UTILITIES 6.0%		
Unique Pub Finance Co. PLC			3.583% due 03/15/2035	GBP 1,956	2,016	Altice Financing S.A.		
7.395% due 03/28/2024	GBP 344	414	4.084% due 03/15/2035	532	556	5.750% due 08/15/2029	11,389	8,820
Uniti Group LP			5.106% due 03/15/2034	131	147	Altice France S.A.		
6.500% due 02/15/2029 (m)	\$ 2,280	1,483	7.139% due 12/15/2034	4,156	3,915	8.125% due 02/01/2027	2,744	2,316
10.500% due 02/15/2028	6,545	6,307	GTWR W-2 Merger Sub LLC			Charter Communications Operating LLC		
WCI Properties LP			7.500% due 01/15/2031	\$ 900	889	3.900% due 06/01/2052	9,800	5,536
3.500% due 02/15/2025	4,794	4,567	Imperial Brands Finance PLC			3.950% due 06/30/2062	2,600	1,389
3.750% due 02/15/2027	4,300	3,873	3.500% due 07/26/2026	1,900	1,771	4.400% due 12/01/2061	7,100	4,137
4.125% due 08/15/2030	5,684	4,694	JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust			Constellation Oil Services Holding S.A.		
4.250% due 12/01/2026	3,600	3,326	4.000% due 11/15/2032 (m)	6,106	5,408	3.000% due 12/31/2026 (q)	387	273
4.625% due 12/01/2029	3,600	3,117	Market Bidco Finco PLC			DISH DBS Corp.		
Voyager Aviation Holdings LLC			4.750% due 11/04/2027	EUR 17,800	16,152	5.250% due 12/01/2026	11,110	8,983
8.500% due 05/09/2026 (b)	4,421	2,404	Massachusetts Institute of Technology			5.750% due 12/01/2028	11,110	8,089
		757,304	4.678% due 07/01/2114	\$ 65	50	Enel Finance America LLC		
			5.600% due 07/01/2111	103	96	7.100% due 10/14/2027	1,000	1,023
			Mitchells & Butlers Finance PLC			Enel Finance International NV		
			6.013% due 12/15/2028	GBP 820	922	7.500% due 10/14/2032	600	621
			6.022% due 12/15/2030	\$ 373	346	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
			Nissan Motor Co. Ltd.			2.250% due 11/22/2024	EUR 100	82
			3.522% due 09/17/2025	8,300	7,852	2.949% due 01/24/2024	450	381
			4.345% due 09/17/2027	8,700	7,869	4.950% due 03/23/2027	\$ 1,800	1,251
			4.810% due 09/17/2030	2,250	1,912	4.950% due 02/06/2028	1,000	695
			NMG Holding Co., Inc.			5.150% due 02/11/2026	5,700	4,275
			7.125% due 04/01/2026	11,900	11,142	7.288% due 08/16/2037	500	390
			ONEOK, Inc.			8.625% due 04/28/2034	2,372	2,163
			5.800% due 11/01/2030	800	770	Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC		
			6.050% due 09/01/2033	3,500	3,356	1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	20,504
			6.625% due 09/01/2053	2,900	2,713	2.950% due 04/15/2025	5,000	3,964
			Oracle Corp.			2.950% due 01/27/2029	\$ 23,200	13,340
			3.850% due 04/01/2060	899	540	Intelsat Jackson Holdings S.A.		
			PeaceHealth Obligated Group			6.500% due 03/15/2030	70,143	61,763
			3.218% due 11/15/2050	3,100	1,735	Netflix, Inc.		
			Roadster Finance DAC			3.875% due 11/15/2029	EUR 3,065	3,181
			2.375% due 12/08/2027	EUR 1,000	889	Noble Finance II LLC		
			5.750% due 10/15/2027	GBP 3,199	3,672	8.000% due 04/15/2030	\$ 2,072	2,073
			Rolls-Royce PLC			NPC Ukrenero		
			4.625% due 02/16/2026	3,514	3,672	6.875% due 11/09/2028	1,200	324
			11.500% due 06/01/2025	\$ 2,410	2,549	Pacific Gas & Electric Co.		
			Royal Caribbean Cruises Ltd.			2.100% due 08/01/2027	1,910	1,618
			7.487% due 03/25/2049 (b)	GBP 6,300	4,969	2.500% due 02/01/2031	2,800	1,929
			Sands China Ltd.			2.950% due 03/01/2026	8,508	7,813
			4.300% due 01/08/2026	\$ 1,800	1,671	3.000% due 06/15/2028	11,288	9,559
			5.375% due 08/08/2025	2,300	2,228	3.150% due 01/01/2026	15,753	14,585
			5.650% due 08/08/2028	2,400	2,222	3.250% due 06/01/2031	3,800	2,952
						3.300% due 03/15/2027	3,838	3,443

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)								
3.300% due 12/01/2027	\$ 14,666	\$ 12,779	Windstream Escrow LLC					4.000% due 01/01/2043	\$ 5	\$ 4
3.400% due 08/15/2024	6,570	6,421	7.750% due 08/15/2028	\$ 13,507	\$ 10,723			4.000% due 11/01/2045	86	76
3.450% due 07/01/2025	12,102	11,478			517,242			4.000% due 03/01/2047	27	24
3.500% due 06/15/2025	8,068	7,678	Total Corporate Bonds & Notes		1,605,974			4.000% due 04/01/2047	230	204
3.500% due 08/01/2050	4,660	2,597	(Cost \$1,896,675)					4.000% due 08/01/2047	3,707	3,278
3.750% due 02/15/2024	10,188	10,121	CONVERTIBLE BONDS & NOTES 0.4%					4.000% due 10/01/2047	205	181
3.750% due 07/01/2028	13,613	11,944	Multiplan Corp.					4.000% due 12/01/2047	80	71
3.750% due 08/15/2042	418	258	6.000% due 10/15/2027	5,700	3,802			4.000% due 01/01/2048	46	40
3.850% due 11/15/2043	1,830	1,828	Nationwide Building Society					4.000% due 02/01/2048	514	454
3.950% due 12/01/2047	2,200	1,315	10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	10,221			4.000% due 01/01/2048	6,176	5,430
4.000% due 12/01/2046	3,144	1,904	Stichting AK Rabobank Certificaten					4.000% due 08/01/2048	3,627	3,190
4.200% due 03/01/2021	9,635	8,635	6.500% due 03/29/2170 (f)	EUR 30,963	29,586			4.000% due 09/01/2048	1,049	927
4.250% due 03/15/2046	5,219	3,298	Total Convertible Bonds & Notes		43,609			4.500% due 05/01/2033	13	12
4.300% due 03/01/2045	3,000	1,944	(Cost \$67,905)					4.500% due 02/01/2038	1	1
4.400% due 03/01/2032	7,300	6,003	MUNICIPAL BONDS & NOTES 0.1%					4.500% due 01/01/2041	156	138
4.450% due 04/15/2042	4,333	2,933	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010					4.750% due 06/01/2033	160	145
4.500% due 07/01/2040	36,242	25,754	6.630% due 02/01/2035	\$ 605	589			5.000% due 10/01/2035	60	59
4.500% due 12/15/2041	743	490	6.725% due 04/01/2035	286	283			5.000% due 12/01/2035	134	125
4.550% due 07/01/2030	50,195	43,469	7.350% due 07/01/2035	467	476			5.000% due 01/01/2036	5	5
4.600% due 06/15/2043	1,794	1,230	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022					5.000% due 05/01/2038	2	2
4.650% due 08/01/2028	100	90	0.000% due 11/01/2043	12,731	6,350			5.000% due 11/01/2039	6	6
4.750% due 02/15/2044	2,707	1,888	Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021					5.500% due 07/01/2033	18	18
4.950% due 07/01/2050	25,950	18,136	2.246% due 06/01/2029	1,600	1,332			5.500% due 06/01/2035	657	624
5.250% due 03/01/2052	7,300	5,292	3.000% due 06/01/2046	635	560			5.500% due 04/01/2036	1	1
Petrolas de Venezuela S.A. (b)			Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (b)					5.500% due 11/01/2036	11	11
5.375% due 04/12/2027	11,932	1,647	6.050% due 07/01/2032	800	202			5.500% due 03/01/2037	11	11
5.500% due 04/12/2037	10,372	1,365	6.125% due 07/01/2040	3,000	757			5.500% due 09/01/2037	4	4
6.000% due 05/16/2043	8,283	1,093	Total Municipal Bonds & Notes		10,559			5.500% due 02/01/2038	3	3
6.000% due 11/15/2026	13,183	1,691	(Cost \$12,128)					5.500% due 04/01/2038	11	11
9.000% due 11/17/2023	400	53	U.S. GOVERNMENT AGENCIES 52.4%					6.000% due 08/01/2031	20	19
9.750% due 05/17/2035	4,730	700	Fannie Mae					6.000% due 06/01/2032	1	1
Petrolas Mexicanas			0.765% due 05/25/2048 (h)	2,065	207			6.000% due 09/01/2039	358	345
5.950% due 01/28/2031	5,319	3,809	6.111% due 04/01/2037	611	546			6.000% due 10/01/2047	8	7
6.700% due 02/16/2032	58,087	42,867	3.000% due 09/01/2049	188	152			6.000% due 01/01/2053	26,626	26,056
6.950% due 01/28/2060	6,116	3,468	3.000% due 03/01/2050	16,878	13,664			6.500% due 01/01/2037	1	1
7.690% due 01/23/2050	1,570	971	3.000% due 10/01/2051	1,350	1,084			6.500% due 10/01/2037	3	3
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			3.000% due 12/01/2051	204	164			6.500% due 10/01/2053	6,847	6,815
4.263% due 06/01/2036	3,600	3,148	3.000% due 01/01/2052	10,310	8,273			7.000% due 09/01/2031	27	27
4.377% due 06/01/2039	3,990	3,407	3.000% due 03/01/2052	23,085	18,518			Fannie Mae, TBA (d)		
4.451% due 12/01/2047	7,700	6,063	3.000% due 04/01/2052	25,731	20,639			2.500% due 12/01/2053	146,000	112,203
Prosus NV			3.000% due 05/01/2052	8,343	6,696			3.000% due 11/01/2038	1,800	1,609
1.985% due 07/13/2033	EUR 5,600	3,873	3.000% due 06/01/2052	9,332	7,485			3.000% due 11/01/2053	0	0
2.085% due 01/19/2030	4,200	3,382	3.000% due 07/01/2052	6,806	5,459			3.000% due 12/01/2053	199,150	159,563
3.061% due 07/13/2031	\$ 9,600	6,919	3.000% due 08/01/2052	10,442	8,379			3.500% due 12/01/2053	652,683	544,157
4.193% due 01/19/2032	4,000	3,074	3.000% due 09/01/2052	164	132			4.000% due 12/01/2053	155,150	134,132
4.987% due 01/19/2052	1,300	803	3.000% due 10/01/2052	111	89			4.500% due 12/01/2053	101,800	80,950
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			3.500% due 08/01/2042	18	16			5.000% due 12/01/2053	3,500	3,226
9.250% due 07/06/2024	499	504	3.500% due 09/01/2047	166	142			5.500% due 12/01/2053	286,200	271,420
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			3.500% due 03/01/2048	49	42			6.000% due 12/01/2053	30,800	29,962
9.750% due 01/06/2027	443	459	3.500% due 04/01/2051	676	578			6.500% due 12/01/2053	35,100	34,867
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			3.500% due 02/01/2052	977	816			Freddie Mac		
8.200% due 04/06/2028	2,101	2,121	3.500% due 03/01/2052	1,500	1,330			1.115% due 06/15/2042 (h)	30	3
Sprint Capital Corp.			3.500% due 04/01/2052	2,751	2,301			3.000% due 11/01/2046	57	47
8.750% due 03/15/2032	2,200	2,479	3.500% due 05/01/2052	2,950	2,467			3.000% due 12/01/2047	1,779	1,469
Sprint LLC			3.500% due 06/01/2052	3,348	2,783			3.000% due 03/01/2048	101	84
7.125% due 06/15/2024	3,892	4,017	3.500% due 07/01/2052	981	819			3.000% due 12/01/2051	187	151
7.625% due 03/01/2026	839	862	4.000% due 07/01/2040	5	5			3.000% due 03/01/2052	89	71
Sprint Spectrum Co. LLC			4.000% due 12/01/2041	46	40			3.000% due 12/01/2051	538	432
5.152% due 03/20/2028	2,482	2,443	4.000% due 07/01/2042	36	31			3.000% due 04/01/2052	539	472
System Energy Resources, Inc.			4.000% due 08/01/2042	541	476			3.000% due 05/01/2052	7,575	6,075
2.140% due 12/09/2025	6,100	5,555	4.000% due 09/01/2042	125	109			3.000% due 06/01/2052	203	163
Topaz Solar Farms LLC			4.000% due 10/01/2042	20	18			3.000% due 07/01/2052	158	127
4.875% due 09/30/2039	5,109	4,602						3.000% due 09/01/2052	99	79
5.750% due 09/30/2039	7,292	6,633						3.000% due 10/01/2052	396	317
Velaris Ltd.								3.000% due 01/01/2053	242	194
8.375% due 04/30/2030	1,666	1,636						3.000% due 03/01/2053	260	209
Viast, Inc.								3.500% due 10/01/2039	108	94
6.500% due 07/15/2028	2,700	1,917						3.500% due 10/01/2047	1,837	1,657
								3.500% due 12/01/2047	801	513

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)						
3,500.00 due 03/01/2048	\$ 2,330	\$ 1,989	4,500.00 due 07/20/2053	\$ 103,767	\$ 93,851	2.125% due 02/15/2040	\$ 3,551	\$ 3,322
3,500.00 due 04/01/2048	836	714	4,500.00 due 08/20/2053	1,022	925	2.125% due 02/15/2041	1,863	1,832
3,500.00 due 10/01/2048	938	800	4,500.00 due 09/20/2053	299,110	270,538			
3,500.00 due 12/01/2048	2,300	1,866	5,000.00 due 08/20/2030	170	160	U.S. Treasury Bonds		
3,500.00 due 03/01/2049	1,432	1,221	5,000.00 due 05/20/2040	262	246	2.250% due 08/15/2046	100	60
3,500.00 due 05/01/2051	75	63	5,000.00 due 04/20/2041	7	6	2.750% due 08/15/2047 (m)	2,630	1,865
3,500.00 due 04/01/2052	2,952	2,463	5,000.00 due 05/20/2038	7	7	3.000% due 08/15/2048	155	107
3,500.00 due 06/01/2052	2,323	1,939	5,500.00 due 06/20/2038	35	34	3.000% due 02/15/2049	77	53
3,500.00 due 07/01/2052	993	828	5,500.00 due 07/20/2038	34	32	3.125% due 05/15/2048	180	127
3,500.00 due 09/01/2052	33	27	5,500.00 due 08/20/2038	233	225	4.375% due 08/15/2043 (m)	33,800	30,151
3,500.00 due 11/01/2052	836	700	5,500.00 due 09/20/2038	72	69	U.S. Treasury Notes		
4,000.00 due 09/01/2033	1	1	5,500.00 due 10/20/2038	15	14	1.625% due 02/15/2026 (o)	2,200	2,040
4,000.00 due 08/01/2042	465	410	5,500.00 due 01/20/2039	10	10	2.000% due 02/15/2025 (m)(lo)	11,021	10,572
4,000.00 due 09/01/2042	656	578	5,500.00 due 02/20/2039	26	25	2.000% due 08/15/2025 (o)	1,400	1,326
4,000.00 due 12/01/2042	7	6	5,500.00 due 09/20/2039	50	48	2.000% due 11/15/2026 (o)	800	735
4,000.00 due 04/01/2047	296	262	5,500.00 due 10/20/2039	8	7	2.250% due 11/15/2024 (m)(lo)	12,300	11,906
4,000.00 due 05/01/2047	287	254	5,500.00 due 11/20/2039	212	204	2.250% due 02/15/2027 (m)(lo)	28,000	25,789
4,000.00 due 08/01/2047	522	462	5,500.00 due 12/20/2039	24	22	2.375% due 05/15/2028 (m)(lo)	32,200	28,297
4,000.00 due 08/01/2048	602	530	5,500.00 due 01/20/2040	187	176	2.625% due 02/15/2029 (m)(lo)	5,000	4,478
4,000.00 due 09/01/2048	245	216	5,500.00 due 06/20/2040	208	203	2.750% due 08/15/2032 (m)	150,100	126,999
4,000.00 due 12/01/2048	9,227	8,119	5,500.00 due 07/20/2040	470	443	2.875% due 05/15/2032	290	249
4,000.00 due 02/01/2049	3,684	3,241	5,500.00 due 07/20/2053	21,057	20,155	Total U.S. Treasury Obligations		1,555,058
4,000.00 due 03/01/2049	287	252	5,500.00 due 08/20/2053	18,417	17,627	(Cost \$1,734,056)		
5,000.00 due 06/01/2034	65	64				MORTGAGE-BACKED SECURITIES 40.8%		
5,000.00 due 08/01/2035	39	38	Ginnie Mae, TBA (d)			Accredited Mortgage Loan Trust		
5,000.00 due 01/01/2037	2	2	2,000.00 due 11/01/2053	19,000	14,653	6.384% due 07/25/2035	7,714	7,468
5,000.00 due 01/01/2038	1	1	2,500.00 due 12/01/2053	46,200	36,816	7.134% due 07/25/2035 (b)	2,206	1,765
5,000.00 due 01/01/2039	1	1	3,000.00 due 11/01/2053	147,100	121,256	ACE Securities Preferred Home Equity Loan Trust		
5,500.00 due 01/01/2035	257	252	3,000.00 due 12/01/2053	494,900	408,181	5.749% due 08/25/2036	3,308	3,105
5,500.00 due 05/01/2037	2	2	3,500.00 due 10/01/2053	182,700	155,733	6.234% due 01/25/2035	941	763
5,500.00 due 06/01/2037	90	88	3,500.00 due 12/01/2053	99,000	84,418	6.264% due 02/25/2034	1,389	1,402
5,750.00 due 05/01/2037	83	82	4,000.00 due 11/01/2053	513,000	450,979	6.339% due 08/25/2035	4,516	4,289
6,000.00 due 07/01/2037	40	40	4,000.00 due 12/01/2053	944,000	830,204	6.369% due 11/25/2034	1,120	1,090
6,000.00 due 01/01/2053	8,304	8,121	4,500.00 due 11/01/2053	177,660	160,530	6.609% due 02/25/2035	6,632	6,153
			4,500.00 due 12/01/2053	496,000	448,368	Adjustable Rate Mortgage Trust		
Ginnie Mae			5,000.00 due 11/01/2041	277,000	257,751	6.389% due 08/25/2035	3,175	2,764
4,000.00 due 06/20/2041	1	1	5,500.00 due 11/01/2053	22,000	21,039	AFC Home Equity Loan Trust		
4,000.00 due 04/20/2047	1,441	1,290	5,500.00 due 12/01/2053	247,000	236,155	6.249% due 06/25/2029	1,587	926
4,000.00 due 05/20/2047	26,857	23,925				Alternative Loan Trust		
4,000.00 due 06/20/2047	12,851	11,325	Total U.S. Government Agencies		5,383,620	4,140% due 08/25/2035 (b)	420	385
4,000.00 due 07/20/2047	10,939	9,792	(Cost \$5,497,999)			4,158% due 08/25/2036	5,426	4,855
4,000.00 due 02/20/2048	7,567	6,768	U.S. TREASURY OBLIGATIONS 15.1%			5.268% due 09/25/2034	772	686
4,000.00 due 05/20/2049	26,126	23,437	Treasury Inflation Protected Securities (i)			5,500.00 due 04/25/2034	8,776	8,291
4,000.00 due 02/20/2050	318	287	0.125% due 07/15/2024 (m)	194,667	190,176	5,500.00 due 06/25/2035	4,396	3,424
4,000.00 due 07/20/2050	156	140	0.125% due 10/15/2024 (o)	141,986	137,773	5,500.00 due 08/25/2035 (b)	49	40
4,000.00 due 08/20/2050	24	22	0.125% due 04/15/2025 (o)	33,341	31,837	5,500.00 due 09/25/2035	2,541	1,568
4,000.00 due 09/20/2050	1,893	1,698	0.125% due 07/15/2030	54,737	46,922	5,500.00 due 02/25/2036 (b)	14	8
4,000.00 due 10/20/2050	59,971	53,798	0.125% due 01/15/2031	2,005	1,692	5,644% due 09/20/2046	542	341
4,000.00 due 11/20/2052	252	222	0.125% due 07/15/2031	7,606	6,371	5.799% due 07/25/2036	3,895	3,842
4,500.00 due 10/20/2035	416	380	0.250% due 01/15/2025	72,526	69,835	5.819% due 08/25/2046 (b)	8,362	6,782
4,500.00 due 01/20/2040	76	69	0.250% due 07/15/2029 (m)	148,070	131,114	5.839% due 05/25/2036	12,205	10,255
4,500.00 due 03/20/2040	7	7	0.250% due 02/15/2050	21,926	12,189	5.874% due 03/20/2046	4,994	3,948
4,500.00 due 07/15/2040	1,105	1,032	0.375% due 01/15/2027 (o)	5,903	5,486	5.939% due 12/25/2046	13,414	10,764
4,500.00 due 07/20/2040	1,207	1,122	0.375% due 07/15/2027 (o)	1,581	1,463	5.979% due 07/25/2036	18,309	15,296
4,500.00 due 08/15/2040	1,317	1,239	0.500% due 04/15/2024 (o)	96,682	95,057	6.000% due 11/25/2036	1,701	960
4,500.00 due 08/20/2040	871	810	0.625% due 01/15/2024 (m)	169,533	168,013	6.000% due 07/25/2037 (b)	24,518	11,622
4,500.00 due 09/20/2040	3,628	3,170	0.625% due 07/15/2032	91,088	78,043	6.039% due 01/25/2036	5,261	4,498
4,500.00 due 10/20/2040	987	918	0.750% due 02/15/2043	2,938	2,035	6.084% due 12/20/2035	5,133	4,495
4,500.00 due 01/20/2041	4,678	4,348	0.750% due 02/15/2042	6,930	5,013	6.150% due 08/25/2035 (b)	367	285
4,500.00 due 02/20/2041	2,268	2,096	0.750% due 02/15/2045	18,905	13,052	7.000% due 10/25/2037	29,361	10,459
4,500.00 due 03/20/2041	8,736	8,093	0.875% due 01/15/2029 (o)	63,316	58,326	7.089% due 10/25/2034	2,026	1,953
4,500.00 due 04/15/2041	1,054	991	0.875% due 02/15/2047	22,131	15,330	Ameriqert Mortgage Securities Trust		
4,500.00 due 04/20/2041	926	861	1.000% due 02/15/2046	11,921	8,609	5.949% due 04/25/2036	656	652
4,500.00 due 06/20/2041	7,991	7,428	1.000% due 02/15/2048	25,897	18,280	6.054% due 03/25/2036	26,883	24,379
4,500.00 due 07/20/2041	2,066	1,920	1.000% due 02/15/2049 (o)	66,655	46,012	Ameriqert Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-		
4,500.00 due 09/20/2041	206	191	1.375% due 07/15/2033	117,671	106,538	Through Certificates		
4,500.00 due 10/20/2041	1,179	1,083	1.375% due 02/15/2044	3,425	2,733	3.610% due 09/25/2032	104	106
4,500.00 due 12/20/2041	1,847	1,718	1.500% due 02/15/2053	26,958	21,153	6.459% due 01/25/2036	7,000	5,725
4,500.00 due 05/20/2043	438	407						
4,500.00 due 07/20/2043	292	272						

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)						
7.194% due 10/25/2034	\$ 9,913	\$ 8,989						
Angel Oak Mortgage Trust								
6.500% due 12/25/2087	4,068	4,011						
Argent Mortgage Loan Trust								
5.919% due 05/25/2035	18,802	16,781						
Argent Securities Trust								
5.798% due 04/25/2036	7,877	2,458						
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates								
4.131% due 09/25/2033	2,584	2,441						
6.204% due 10/25/2035	36,400	31,230						
Asset-Backed Funding Certificates Trust								
5.859% due 10/25/2036	10,129	8,252						
6.099% due 03/25/2035	10,915	10,340						
6.174% due 06/25/2035	6,550	6,181						
6.414% due 06/25/2035 (b)	4,194	3,727						
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust								
3.842% due 05/25/2036 (b)	46,467	41,083						
Atrium Hotel Portfolio Trust								
7.062% due 06/15/2035	18,395	17,797						
Austin Fairmont Hotel Trust								
7.182% due 09/15/2032	3,000	2,927						
Avon Finance								
0.000% due 12/28/2049	GBP 2,400	2,808						
 Banc of America Alternative Loan Trust (b)								
3.986% due 01/24/2024	\$ 52	42						
6.000% due 07/25/2046	1,370	1,102						
Banc of America Funding Trust								
4.129% due 02/20/2035	1,283	1,066						
4.156% due 06/20/2036	4,044	3,205						
4.429% due 01/20/2047 (b)	78	70						
6.298% due 04/25/2037	7,934	6,646						
BCAP LLC Trust								
4.229% due 04/28/2036	4,613	2,335						
5.876% due 04/28/2037	2,725	1,250						
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust								
4.703% due 11/25/2034	188	177						
Bear Stearns Alternative-A Trust								
5.775% due 04/25/2037	5,937	5,046						
5.859% due 11/25/2046	6,882	4,968						
6.159% due 08/25/2035 (b)	4,166	3,168						
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust								
1.161% due 05/25/2036 (h)	8,516	158						
4.845% due 11/25/2035 (b)	2,773	2,599						
5.224% due 06/25/2034	3,406	3,272						
5.387% due 12/25/2035	9,275	7,956						
5.438% due 09/25/2034	4,736	4,517						
5.462% due 04/25/2036	3,944	3,916						
5.739% due 06/25/2047	6,300	6,037						
5.839% due 05/25/2036 (b)	13,454	4,102						
5.844% due 07/25/2036	7,785	7,044						
5.919% due 02/25/2037	2,089	4,655						
6.054% due 02/25/2036 (b)	9,845	9,469						
6.489% due 08/25/2037	15,783	13,308						
7.464% due 03/25/2035	3,262	3,074						
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust								
5.500% due 11/25/2033	3,513	3,056						
Bear Stearns Mortgage Funding Trust								
5.839% due 02/25/2037 (b)	4,876	4,369						
Benchmark Mortgage Trust								
3.509% due 09/15/2048	47,290	41,029						
3.899% due 03/15/2062	9,775	6,555						
BHP Trust								
7.153% due 08/15/2036	10,500	10,283						
7.950% due 08/15/2036	33,656	32,883						
Bridgegate Funding PLC								
7.442% due 10/16/2062	GBP 12,821	15,532						
8.192% due 10/16/2062	18,993	22,788						
9.192% due 10/16/2062	9,971	11,992						
10.192% due 10/16/2062	GBP 7,217	\$ 8,654						
BSST Mortgage Trust								
8.165% due 02/15/2037	\$ 11,000	8,810						
8.835% due 02/15/2037	24,700	18,963						
9.835% due 02/15/2037	7,500	5,591						
BX Commercial Mortgage Trust								
6.347% due 02/15/2039	6,805	6,614						
BX Trust								
7.094% due 10/15/2036	16,400	15,715						
7.336% due 10/15/2036	7,150	6,730						
7.344% due 10/15/2036	25,610	24,145						
9.944% due 07/15/2034	6,800	6,692						
Canterbury Finance No.4 PLC								
6.042% due 05/16/2058	GBP 82,252	99,544						
Carriington Mortgage Loan Trust								
6.939% due 02/25/2035	\$ 3,468	2,912						
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage								
6.040% due 01/25/2039 (b)	504	447						
Centex Home Equity Loan Trust								
6.094% due 03/25/2035	1,952	1,925						
Chase Home Lending Mortgage Trust								
3.250% due 03/25/2083	21,203	17,664						
Chase Mortgage Finance Trust								
4.017% due 12/25/2035 (b)	3,694	3,154						
ChaseFlex Trust								
5.739% due 07/25/2037	853	700						
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates								
5.769% due 03/25/2035	298	281						
CIM Trust								
3.250% due 10/25/2058	17,962	15,283						
6.639% due 12/25/2087	4,642	4,598						
CIT Mortgage Loan Trust								
6.789% due 10/25/2037	315	314						
6.939% due 10/25/2037	28,585	27,688						
Citigroup Commercial Mortgage Trust								
0.280% due 03/11/2047 (h)	25,400	0						
Citigroup Mortgage Loan Trust								
4.313% due 08/25/2036	3,773	3,468						
4.507% due 07/25/2037 (b)	2,291	1,957						
5.714% due 08/25/2036	15,222	6,195						
5.719% due 12/25/2036	2,337	2,198						
5.759% due 12/25/2036	9,652	5,304						
5.764% due 01/25/2037 (b)	2,205	954						
6.259% due 09/25/2037	12,220	10,065						
7.250% due 05/25/2036 (b)	8,567	4,259						
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.								
6.474% due 05/25/2035	10,698	9,722						
7.939% due 07/25/2037	3,507	3,193						
Commercial Mortgage Trust								
0.177% due 04/10/2047 (h)	33,000	5						
3.633% due 02/10/2037	10,000	9,208						
8.599% due 12/15/2038	8,575	7,709						
Conseco Finance Corp.								
6.920% due 12/01/2030	805	800						
7.500% due 03/01/2030	45,434	16,682						
7.600% due 04/15/2026	4,902	1,114						
Countrywide Asset-Backed Certificates								
5.939% due 08/26/2033	178	167						
7.314% due 05/25/2035 (b)	4,282	4,123						
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust								
0.000% due 06/25/2034	1	1						
3.765% due 03/25/2037 (b)	3,573	3,079						
4.295% due 10/20/2035 (b)	4,087	3,688						
4.371% due 11/25/2037	4,383	3,917						
4.703% due 11/25/2034	7	6						
5.500% due 11/25/2035 (b)	5,427	2,885						
6.000% due 07/25/2036	17,226	8,805						
6.000% due 11/25/2037	3,330	1,277						
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.								
7.880% due 01/25/2033	\$ 1,040	\$ 975						
Credit Suisse Mortgage Capital								
3.000% due 01/29/2035	321	305						
3.000% due 06/27/2037	1,039	1,010						
5.755% due 11/27/2036	10,152	12,301						
6.199% due 10/26/2036	131	107						
Credit Suisse Mortgage Capital Trust								
0.000% due 01/25/2058	20	19						
0.000% due 04/25/2058 (h)	1	1						
3.431% due 11/10/2032	1,922	1,606						
3.618% due 01/25/2058	17,608	13,588						
4.390% due 06/25/2050	41,375	33,819						
4.454% due 04/25/2058	27,855	24,088						
5.556% due 06/01/2050	36,218	36,129						
6.194% due 07/15/2032	2,303	2,194						
6.444% due 07/15/2032	4,000	3,766						
6.644% due 07/15/2032	2,400	2,238						
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC								
7.480% due 03/25/2046	4,266	3,505						
CWABS Asset-Backed Certificates Trust								
4.341% due 12/25/2034	6,805	6,216						

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）

	額前金額 (単位：千)	時価 (単位：千)							
Encore Credit Receivables Trust									
6.365% due 11/25/2035	\$ 6,510	\$ 5,821							
Eurossail UK PLC									
6.105% due 08/13/2045	GBP 3,605	4,173							
6.289% due 06/13/2045	5,237	6,273							
Extended Stay America Trust									
8.26% due 07/15/2038	\$ 15,158	14,849							
FBR Securitization Trust									
6.114% due 10/25/2035	19,109	15,937							
6.204% due 09/25/2035	7,327	7,013							
FFMLT Trust									
6.365% due 11/25/2035	2,069	1,654							
First Franklin Mortgage Loan Trust									
4.330% due 04/25/2036	2,811	2,639							
5.749% due 11/25/2036	59,328	45,737							
5.759% due 04/25/2036	3,831	3,638							
6.114% due 03/25/2034	2,412	2,313							
6.123% due 01/25/2036	24,773	22,083							
6.144% due 05/25/2036	56	55							
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust									
0.000% due 05/25/2035 (b)(h)	1,162	21							
5.500% due 05/25/2035 (b)	1,162	686							
Fontainebleau Miami Beach Trust									
3.953% due 12/10/2036	33,098	31,391							
Fremont Home Loan Trust									
5.719% due 02/25/2037	6,602	4,955							
5.729% due 05/25/2036	6,191	5,946							
6.099% due 01/25/2036	6,000	5,597							
6.459% due 01/25/2035	6,493	5,200							
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates									
6.129% due 10/25/2035	9,882	8,167							
Glen Securities Finance DAC									
5.814% due 10/29/2038	EUR 4,363	4,565							
6.814% due 10/29/2038	3,287	3,363							
7.852% due 10/29/2038	1,607	1,656							
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.									
5.455% due 03/10/2051	\$ 11,781	10,098							
GreenPoint Mortgage Funding Trust									
5.999% due 11/25/2045	32	21							
Grifonos Finance No. 1 PLC									
4.212% due 08/29/2039	EUR 513	518							
GS Mortgage Securities Corporation Trust									
4.591% due 10/10/2032	\$ 8,215	7,823							
GSA Home Equity Trust (b)									
6.182% due 11/25/2036	2,934	662							
6.500% due 11/25/2037	20	8							
GSAMP Trust									
5.579% due 03/25/2047	3,675	3,184							
5.599% due 01/25/2037	16,585	9,373							
5.959% due 06/25/2036	10,660	10,229							
6.084% due 11/25/2035 (b)	5,536	4,885							
6.414% due 08/25/2034	3,081	2,874							
6.414% due 04/25/2035 (b)	5,325	4,827							
7.239% due 06/25/2035	3,500	3,214							
GSMSC Re securitization Trust									
2.122% due 04/26/2037	44,351	11,193							
5.614% due 09/26/2036	3,694	2,265							
GSR Mortgage Loan Trust									
1.261% due 03/25/2037 (h)	7,490	549							
5.739% due 03/25/2037	7,490	1,147							
HarborView Mortgage Loan Trust									
4.038% due 06/19/2036 (b)	6,049	3,060							
5.928% due 12/19/2036 (b)	772	711							
6.008% due 02/19/2036	9,501	5,852							
6.088% due 08/19/2045	7,547	5,589							
Hawaii Hotel Trust									
7.032% due 05/15/2038	2,000	1,959							
7.541% due 05/15/2038	12,500	12,225							
Home Equity Asset Trust									
5.919% due 10/25/2036	\$ 23,475	\$ 13,588							
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust									
5.579% due 11/25/2036	11,236	10,041							
5.679% due 04/25/2037	12,380	7,821							
5.789% due 08/25/2036	2,039	1,872							
5.979% due 09/25/2036	16,717	11,398							
6.429% due 08/25/2035	3,660	3,588							
HPLY Trust									
7.451% due 11/15/2036	4,675	4,528							
7.801% due 11/15/2036	26,212	25,322							
HSI Asset Securitization Corp. Trust									
5.539% due 01/25/2036	2,197	913							
5.739% due 07/25/2036	6,971	3,744							
5.814% due 05/25/2037	7,197	6,772							
Impac CMB Trust									
6.119% due 01/25/2035	7,756	7,130							
Impac Secured Assets Corp.									
5.999% due 03/25/2036 (b)	8,132	6,351							
Impac Secured Assets Trust									
5.629% due 01/25/2037	1,986	1,567							
IndyMac IMA Mortgage Loan Trust									
6.500% due 10/25/2037	8,467	4,234							
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust									
3.894% due 08/25/2037 (b)	8,206	4,916							
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust									
3.265% due 07/25/2037	17,978	15,515							
3.342% due 04/25/2037	13,319	11,321							
3.473% due 04/25/2037 (b)	6,519	5,701							
3.546% due 03/25/2036 (b)	3,949	2,796							
4.157% due 11/25/2036 (b)	10,927	7,428							
5.799% due 02/25/2037 (b)	20,856	19,365							
5.819% due 10/25/2036	4,825	1,963							
6.039% due 07/25/2035	5,676	4,413							
INTOWN Mortgage Trust									
8.019% due 08/15/2039	11,495	11,506							
IXIS Real Estate Capital Trust									
6.204% due 12/25/2035	686	721							
Jefferies Re securitization Trust									
8.746% due 06/25/2047 (b)	431	348							
JPMorgan Alternative Loan Trust									
3.896% due 03/25/2036 (b)	270	192							
4.036% due 09/25/2036	8,788	7,263							
5.730% due 03/25/2036 (b)	56	52							
5.999% due 04/25/2047	1,536	1,445							
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust									
4.128% due 07/05/2031	2,500	2,241							
6.548% due 12/15/2036	3,700	2,794							
7.235% due 10/05/2040	6,900	6,774							
7.789% due 09/15/2029	1,740	1,193							
7.964% due 11/15/2038	16,193	15,571							
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.									
6.369% due 12/25/2035	12,010	11,443							
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust									
4.573% due 11/25/2036	1,976	1,824							
5.589% due 12/25/2036	13,723	7,088							
5.709% due 08/25/2036	8,600	7,511							
5.709% due 06/25/2037	34,606	32,318							
5.719% due 06/25/2037 (b)	22,826	18,689							
5.844% due 05/25/2036	8,051	7,712							
5.874% due 05/25/2036	16,179	14,897							
JPMorgan Mortgage Trust									
4.686% due 01/25/2037 (b)	375	319							
5.250% due 11/25/2063	987	913							
5.739% due 10/25/2035 (b)	3,510	2,473							
6.000% due 08/25/2037 (b)	3,266	1,298							
JPMorgan Re securitization Trust									
3.968% due 02/28/2037	1,850	1,657							
Kentmere No. 2 PLC									
0.000% due 01/28/2042	GBP 11,839	\$ 4,273							
5.987% due 01/28/2042	40,807	49,412							
6.587% due 01/28/2042	5,993	6,702							
6.937% due 01/28/2042	4,066	4,778							
7.387% due 01/28/2042	2,439	2,862							
8.167% due 01/28/2042	1,626	1,908							
10.187% due 01/28/2042	3,252	3,729							
Kimbone DAC									
4.711% due 09/25/2062	EUR 53,317	55,976							
Lansdowne Mortgage Securities No. 1 PLC									
4.145% due 06/15/2045	2,557	2,557							

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)							
Morgan Stanley Capital I Trust									
2.428% due 04/05/2042	\$ 13,500	\$ 9,709							
7.032% due 08/15/2033		2,619							
7.827% due 12/15/2038		21,942							
8.526% due 12/15/2038		40,574							
Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust									
5.978% due 02/25/2038 (b)		18,224							
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust									
5.949% due 02/25/2036		14,415							
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust									
5.899% due 07/25/2036		9,969							
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust									
3.275% due 11/25/2037		1,208							
6.000% due 12/25/2035 (b)		480							
Morgan Stanley Seremic Trust									
5.754% due 11/29/2036		5,003							
Mortgage Loan Trust									
5.370% due 03/25/2034		3,310							
MortgageI Trust									
7.014% due 08/25/2035		299							
NTN Commercial Mortgage Trust									
6.737% due 03/15/2036		1,120							
Netixis Commercial Mortgage Securities Trust									
3.790% due 11/15/2032		1,700							
3.821% due 02/15/2039		2,900							
New Century Home Equity Loan Trust									
6.584% due 10/25/2033		157							
New York Mortgage Trust									
5.978% due 04/25/2036		565							
Newgate Funding PLC									
5.741% due 12/15/2050	GBP 15,345	17,740							
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust									
5.034% due 05/25/2036 (b)	\$ 2,780	1,356							
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust									
6.204% due 05/25/2036		6,038							
6.245% due 10/25/2036 (b)		21,460							
Nomura Reinsurance Trust									
1.952% due 03/28/2037		5,484							
NovoStar Mortgage Funding Trust									
5.638% due 09/25/2037		15,625							
5.759% due 05/25/2036		4,708							
5.759% due 10/25/2036		5,312							
6.159% due 10/25/2035		948							
NYO Commercial Mortgage Trust									
7.444% due 11/15/2038		30,130							
7.994% due 11/15/2038		14,400							
OBX Trust									
6.319% due 01/25/2062		10,517							
6.520% due 07/25/2063		7,550							
Optimum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates									
6.189% due 07/25/2035		5,051							
Option One Mortgage Loan Trust									
5.536% due 02/25/2037		17,611							
5.559% due 03/25/2037		7,079							
5.579% due 03/25/2037		33,857							
5.719% due 07/25/2036		1,970							
6.249% due 02/25/2036		3,416							
Owint Mortgage Loan Trust									
5.698% due 10/25/2037		3,841							
5.759% due 10/25/2037		2,501							
5.819% due 07/25/2037		2,795							
5.979% due 03/25/2037		6,225							
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates									
6.174% due 09/25/2035		3,376							
6.219% due 09/25/2035 (b)		25,075							
6.909% due 01/25/2035 (b)		2,000							
7.464% due 12/25/2034		25,974							
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust									
5.599% due 09/25/2036	\$ 26,232	\$ 4,993							
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust									
3.437% due 11/25/2035		17,970							
3.556% due 07/25/2035 (b)		9,601							
5.749% due 11/25/2036 (b)		15,325							
Precise Mortgage Funding PLC									
0.000% due 12/12/2055	GBP 0	250							
PRET LLC									
1.843% due 09/25/2051	\$ 36,709	33,071							
8.232% due 09/25/2053		17,191							
Pretium Mortgage Credit Partners LLC									
8.497% due 10/25/2053 (d)		16,040							
Prime Mortgage Trust									
6.000% due 04/25/2037		3,713							
PRCM Trust									
6.584% due 09/25/2058		9,307							
PRPM LLC									
1.753% due 07/25/2026		8,562							
PRPM Trust									
6.250% due 08/25/2068		8,200							
Quest Trust									
6.864% due 03/25/2035		1,327							
RAAC Trust									
6.144% due 02/25/2036 (b)		8,360							
6.180% due 08/25/2047		21,346							
RBSG Mortgage Loan Trust									
6.000% due 01/25/2037 (b)		2							
Real Estate Asset Liquidity Trust									
2.419% due 08/12/2054	CAD 1,194	854							
Renaissance Home Equity Loan Trust									
5.612% due 04/25/2037	\$ 10,124	2,724							
5.675% due 08/25/2037 (b)		3,910							
6.159% due 11/25/2034		167							
6.439% due 09/25/2037		33							
Residential Accredit Securities Corporation Trust									
5.268% due 04/25/2034		1,162							
5.659% due 02/25/2037		20,256							
5.739% due 01/25/2037		30,046							
5.934% due 04/25/2036		5,478							
6.054% due 03/25/2036		6,180							
6.414% due 09/25/2035		5,649							
6.474% due 08/25/2035		2,060							
Residential Asset Mortgage Products Trust									
5.789% due 10/25/2036		14,675							
6.039% due 02/25/2036		1,063							
6.114% due 11/25/2035		8,981							
6.119% due 12/25/2035		9,984							
6.189% due 09/25/2035		7,021							
Residential Mortgage Acceptance Corporation No.3 PLC									
0.000% due 02/15/2047	GBP 26,100	31,720							
RESIMAC Bastille Trust									
6.372% due 09/05/2057	\$ 598	598							
RMAC Securities No.1 PLC									
4.230% due 06/12/2044	EUR 3,720	3,674							
Saxon Asset Securities Trust									
1.922% due 03/25/2035 (b)	\$ 367	347							
7.189% due 12/25/2037		2,648							
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust									
5.979% due 03/25/2036		4,673							
6.264% due 10/25/2035		10,136							
6.489% due 03/25/2035		5,127							
Sequoia Mortgage Trust									
5.854% due 05/20/2035		1,008							
5.974% due 06/20/2034		19							
Sestante Finance Srl									
4.222% due 07/23/2046	EUR 7,845	7,837							
SFO Commercial Mortgage Trust									
7.849% due 05/15/2036	\$ 885	\$ 687							
8.349% due 05/15/2038		22,000							
SG Mortgage Securities Trust									
5.795% due 02/25/2036		4,682							
5.899% due 07/25/2036		8,095							
Shamrock Residential DAC									
4.713% due 01/24/2061	EUR 19,491	20,446							
5.113% due 02/24/2071		24,604							
Soundview Home Loan Trust									
4.154% due 04/25/2033	\$ 2,319	2,127							
5.859% due 06/25/2036 (b)		7,815							
5.904% due 06/25/2036 (b)		49,916							
5.919% due 07/25/2036		24,020							
6.414% due 03/25/2036		8,102							
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust									
6.414% due 12/25/2035		567							
SREIT Trust									
6.893% due 10/15/2038		24,605							
7.241% due 10/15/2038		20,425							
Stratton Mortgage Funding PLC									
7.299% due 09/25/2051	GBP 2,000	2,406							

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)
Upstart Pass-Through Trust		
3.800% due 04/20/2030	\$ 15,609	\$ 15,014
Upstart Securitization Trust		
5.500% due 06/20/2022	6,632	6,469
Ventura 39 CLO Ltd.		
6.935% due 04/15/2033	4,600	4,569
Ventura XVII CLO Ltd.		
6.535% due 04/15/2027	10,245	10,197
Total Asset-Backed Securities (Cost \$785,820)	766,915	
SOVEREIGN ISSUES 6.6%		
Argentina Government International Bond		
0.750% due 07/09/2030	66,427	17,871
1.000% due 07/09/2029	4,943	1,330
3.500% due 07/09/2041	58,125	15,285
3.625% due 07/09/2035	51,459	12,427
3.625% due 07/09/2046	1,035	258
4.250% due 01/09/2038	25,740	7,786
Argentine Bonos del Tesoro		
15.500% due 10/17/2026	ARS 49,200	12
Asian Development Bank		
4.700% due 03/12/2024	MXN 18,100	976
Australia Government Bond		
1.750% due 06/21/2051	AUD 38,100	11,753
Autonomous City of Buenos Aires Argentina		
119.035% due 02/22/2028	ARS 76,810	103
126.571% due 03/29/2024	62,559	79
Israel Government International Bond		
3.800% due 05/13/2060	\$ 17,000	10,475
4.500% due 04/03/2120	3,800	2,513
5.000% due 10/30/2026	EUR 119,500	126,171
Mexico Government International Bond (i)		
2.750% due 11/27/2031	MXN 1,229,193	56,573
3.000% due 12/03/2026	119,106	5,976
4.000% due 11/30/2028	685,870	35,408
Peru Government International Bond		
5.400% due 08/12/2034	PEN 862	188
6.150% due 08/12/2032	674	161
6.950% due 08/12/2031	150	38
Provincia de Buenos Aires		
128.738% due 04/12/2025	ARS 399,853	424
Romania Government International Bond		
1.750% due 07/13/2030	EUR 12,200	9,855
2.125% due 03/07/2028	1,100	1,012
2.875% due 04/13/2042	7,300	4,552
5.500% due 09/18/2028	7,400	7,793
6.375% due 09/18/2033	14,800	15,436
Russia Government International Bond		
4.250% due 06/23/2027	\$ 28,400	15,336
4.375% due 03/21/2029	200	100
4.750% due 05/27/2026	23,800	16,145
5.100% due 03/28/2035	3,200	1,136
5.250% due 06/23/2047	82,400	30,076
5.625% due 04/04/2042	37,000	24,884
5.875% due 09/16/2043	13,200	8,307
7.150% due 11/12/2025	RUB 4,002,466	17,537
7.500% due 03/31/2030	\$ 4,748	3,111
7.950% due 10/07/2026	RUB 1,564,954	6,146
South Africa Government International Bond		
10.500% due 12/21/2026	ZAR 2,032,400	111,719
State Agency of Roads of Ukraine		
6.250% due 06/24/2030	\$ 1,200	312
Turkey Government International Bond		
4.250% due 03/13/2025	17,980	17,229
5.250% due 03/13/2030	29,000	24,021
6.125% due 10/24/2028	10,100	9,169
7.625% due 04/28/2029	30,900	29,481
Türkiye İhrecat Kredi Bankası AJS		
8.250% due 01/24/2024	3,000	3,009

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Ukraine Government International Bond		
4.375% due 01/27/2032	EUR 1,658	\$ 402
7.750% due 08/01/2025	\$ 4,380	1,358
Venezuela Government International Bond (i)		
6.000% due 12/08/2040	3,367	523
7.000% due 03/31/2038	1,883	324
7.650% due 04/21/2025	5,349	947
7.750% due 04/13/2024	1,200	187
8.250% due 10/13/2024	5,991	1,053
9.000% due 05/07/2049	3,161	586
9.250% due 09/15/2027	4,274	813
9.250% due 05/07/2028	6,512	1,224
11.750% due 10/21/2026	680	134
11.950% due 08/05/2031	6,000	1,176
Total Sovereign Issues (Cost \$486,448)	670,880	
	株式数	時価 (単位：千)
COMMON STOCKS 0.7%		
Cairo Mezz PLC	847,444	94
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	5,821
Constellation Oil Services Holding S.A. (i)	421,249	46
Corestate Capital Holding S.A. (i)	2,742,788	0
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.	5,318,911	6,885
iHeartMedia, Inc. Class A	1,246,745	2,930
iHeartMedia, Inc. Class B	967,427	2,046
Intelsat S.A. (i)	966,065	26,837
National Bank of Greece S.A.	102,570	587
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (i)	151,112	19,868
Serta Simmons Bedding LLC (i)	56	1
SSB Manufacturing Co. (i)	56	1
Stearns Holdings LLC	110,747	0
UBS Group AG	26,741	628
Voyager Aviation Holdings LLC	616	0
WestMet Group Holdings LLC (i)	8,915	42
Westmoreland Mining Holdings LLC (i)	8,837	53
Windstream Holdings II LLC	226,019	4,705
Total Common Stocks (Cost \$163,628)	72,344	
COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY 0.2%		
CBL & Associates Properties, Inc.	6	124
Uniti Group, Inc.	81	374
VICI Properties, Inc.	760	21,217
Total Commercial Real Estate Equity (Cost \$6,172)	21,715	
EQUITY-LINKED SECURITIES 0.0%		
Intelsat Jackson Holdings S.A.		
12/31/2049	211	1,963
Total Equity-Linked Securities (Cost \$0)	1,963	

WARRANTS 0.0%		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Intelsat S.A.			
02/17/2027	26	\$	72
Stearns Holdings LLC			
12/31/2049	1		0
Total Warrants (Cost \$20,656)			72
PREFERRED SECURITIES 0.0%			
Cayenne Aviation LLC			
9.500%	3,693		0
Total Preferred Securities (Cost \$1,210)			0
SHORT-TERM INSTRUMENTS 5.0%			
TIME DEPOSITS 0.5%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.000% due 11/01/2023	AUD	764	484
3.850% due 11/01/2023	NZD	2	1
4.830% due 11/01/2023	\$	1	1
Bank of Nova Scotia			
4.080% due 11/01/2023	CAD	543	391
4.830% due 11/01/2023	\$	593	593
BNP Paribas Bank			
0.370% due 11/01/2023	¥	68	1
0.550% due 11/01/2023	CHF	16	17
3.000% due 11/01/2023	AUD	501	317
3.330% due 11/01/2023	NOK	12	1
3.850% due 11/01/2023	NZD	1	0
4.420% due 11/01/2023	GBP	1	1
6.430% due 11/01/2023	ZAR	10,398	555
Brown Brothers Harriman & Co.			
0.370% due 11/01/2023	¥	3,630	24
2.750% due 11/01/2023	DKK	3	1
3.100% due 11/01/2023	EUR	1	1
4.420% due 11/01/2023	GBP	23	28
4.830% due 11/01/2023	\$	42	42
Citibank N.A.			
4.830% due 11/01/2023		2,499	2,499
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 11/01/2023		2,137	2,137
DnB Bank ASA			
2.980% due 11/01/2023	SEK	4	0
HSBC Bank PLC			
3.100% due 11/01/2023	EUR	1,087	1,159
4.420% due 11/01/2023	GBP	66	80
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 11/01/2023	\$	4,550	4,550
MUFG Bank Ltd.			
0.370% due 11/01/2023	¥	38,019	251
Royal Bank of Canada			
4.830% due 11/01/2023	\$	1	1
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
0.370% due 11/01/2023	¥	234,359	1,548
3.100% due 11/01/2023	EUR	10,789	11,404
4.830% due 11/01/2023	\$	253	253
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
0.370% due 11/01/2023	¥	927,721	6,126
3.100% due 11/01/2023	EUR	4,002	4,230
4.420% due 11/01/2023	GBP	3,526	4,279
4.830% due 11/01/2023	\$	5,810	5,810
Total			46,785

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)
ARGENTINA TREASURY BILLS 0.1%		
(32.511%) due 05/20/2024 (k)	ARS 551,156	\$ 797
(17.783%) due 11/23/2023 (j)	4,688,282	8,139
		<u>8,936</u>
JAPAN TREASURY BILLS (j) 4.4%		
(0.234%) due 01/15/2024	¥34,900,000	231,136
(0.216%) due 01/22/2024	34,000,000	224,605
		<u>455,741</u>
Total Short-Term Instruments		511,462
(Cost \$518,529)		
Total Investments in Securities (a) 148.7%	\$ 15,268,043	
(Cost \$16,679,350)		
Financial Derivative		
Instruments (n)(p) 0.0%		1,772
(Cost or Premiums, net \$19,837)		
Other Assets and Liabilities, net (48.7%)		(5,000,688)
Net Assets 100.0%		\$ 10,269,127

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）

【英語表記変換表】

資産名一覧	
INVESTMENTS IN SECURITIES	有価証券に対する投資
BANK LOAN OBLIGATIONS	銀行貸付債権
CORPORATE BONDS & NOTES	社債券等
BANKING & FINANCE	銀行および金融
INDUSTRIALS	産業
UTILITIES	公共事業
CONVERTIBLE BONDS & NOTES	転換社債等
MUNICIPAL BONDS & NOTES	地方債等
U. S. GOVERNMENT AGENCIES	米国政府機関債
U. S. TREASURY BILLS	米国短期証券
U. S. TREASURY OBLIGATIONS	米国財務省証券
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
COMMON STOCKS	普通株式
COMMERCIAL REAL ESTATE EQUITY	商業不動産株式
EQUITY - LINKED SECURITIES	新株予約権
WARRANTS	ワラント
PREFFERD SECURITIES	優先証券
SHORT - TERM INSTRUMENTS	短期証券
TIME DEPOSITS	定期性預金
ARGENTINA TREASURY BILLS	アルゼンチン財務省短期証券
JAPAN TREASURY BILLS	国庫短期証券
INVESTMENTS IN AFFILIATES	関連ファンドに対する投資
OTHER INVESTMENT COMPANIES	その他投資
FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS	金融デリバティブ商品
OTHER ASSETS AND LIABILITIES	その他資産および負債
NET ASSETS	純資産

通貨略称一覧	
ARS	アルゼンチンペソ
AUD	オーストラリアドル
CAD	カナダドル
CHF	スイスフラン
COP	コロンビアペソ
DKK	デンマーククローネ
EUR	ユーロ
GBP	イギリスポンド
¥	日本円
MXN	メキシコペソ
NOK	ノルウェークローネ
NZD	ニュージーランドドル
PEN	ペルーヌエボソル
RUB	ロシアルーブル
SEK	スウェーデンクローナ
\$	アメリカドル
ZAR	南アフリカランド

マネー・マーケット・マザーファンド

第13期 (2023年3月2日から2024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
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
13期 (2024年3月1日)	9,986	△0.1	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

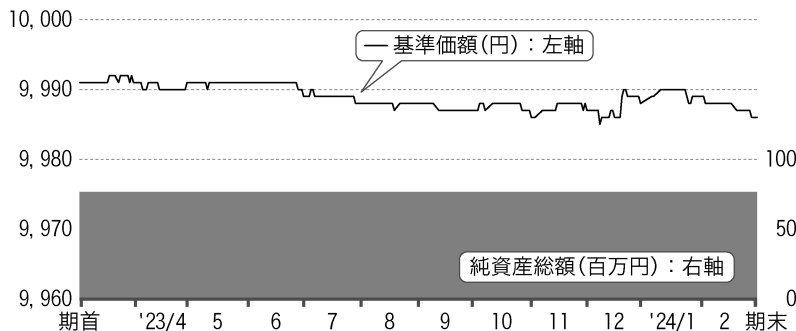
年月日	基準価額		公社債 組入比率
		騰落率	
(期首) 2023年3月1日	円 9,991	% -	% 74.7
3月末	9,991	0.0	74.7
4月末	9,991	0.0	74.8
5月末	9,991	0.0	74.7
6月末	9,989	△0.0	74.8
7月末	9,988	△0.0	74.8
8月末	9,988	△0.0	74.7
9月末	9,987	△0.0	74.8
10月末	9,986	△0.1	74.7
11月末	9,987	△0.0	74.7
12月末	9,988	△0.0	74.7
2024年1月末	9,989	△0.0	74.7
2月末	9,986	△0.1	74.7
(期末) 2024年3月1日	9,986	△0.1	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 (2023年3月2日から2024年3月1日まで)

基準価額等の推移



期首	9,991円
期末	9,986円
騰落率	-0.1%

▶ 基準価額の変動要因 (2023年3月2日から2024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 (2023年3月2日から2024年3月1日まで)

短期金利は上昇しました。

世界的に高水準のインフレが続いたことや、欧米中央銀行による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高止まりし、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は前年比+2%以上での推移となりました。この間、日銀は市場機能への配慮や物価上振れリスクへの対応として、長期金利（10年国債利回り）の許容変動幅の事実上の上限引き上げを行うなど、イールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の運用を柔軟化しました。しかし、日

銀は賃金上昇を伴う形での物価目標の達成を目指すために、イールドカーブ・コントロールの枠組みは維持し、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、欧米での金融不安の影響でリスク回避の動きが強まった2023年3月や、年末越え運用ニーズが高まった10月に、一時的に大きく低下する局面もありましたが、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 (2023年3月2日から2024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 (2023年3月2日から2024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

国内景気は足踏みしているものの、先行きはインフレ鈍化や賃金上昇が内需のサポートとなり、緩やかな回復基調に戻る見通しです。CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）の前年比伸び率は、政策効果によって+2%台に低下しており、先行きも輸入物価を起点とするコストプッシュ圧力の弱まりにより緩やかに減速基調が続く見通しです。日銀は賃金、物価上昇の好循環への確度が高まったタイミングでの政策変更を示唆しており、春闘の大勢が判明する春先に、マイナス金利解除を中心とした政策変更を実施する見込みです。

マイナス金利政策が解除されれば、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がプラスに転じると予想します。

マイナス利回りが継続する間は、引き続き、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。また、プラス利回りに転じた際には、利子等の安定した収益の確保を目指して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細(2023年3月2日から2024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)	0.006% (0.006)	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	0.006	

期中の平均基準価額は9,989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(2023年3月2日から2024年3月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 29,128	千円 － (14,000)
	特殊債証券	28,193	－ (43,000)

※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(2023年3月2日から2024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
(2023年3月2日から2024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 (2024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	29,000 (-)	29,077 (-)	38.0 (-)	- (-)	- (-)	- (-)	38.0 (-)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	28,000 (28,000)	28,058 (28,058)	36.7 (36.7)	- (-)	- (-)	- (-)	36.7 (36.7)
合 計	57,000 (28,000)	57,135 (28,058)	74.7 (36.7)	- (-)	- (-)	- (-)	74.7 (36.7)

※()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	335 10年国債	%	千円	千円	
	337 10年国債	0.5000	15,000	15,045	2024/09/20
		0.3000	14,000	14,031	2024/12/20
	小 計	-	29,000	29,077	-
特 殊 債 券 (除く金融債券)	215 政保道路機構	0.6690	14,000	14,020	2024/04/30
	3 政保新関西空港	0.6440	14,000	14,038	2024/06/26
	小 計	-	28,000	28,058	-
	合 計	-	57,000	57,135	-

■ 投資信託財産の構成

(2024年3月1日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	57,135	74.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,387	25.3
投 資 信 託 財 産 総 額	76,523	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年3月1日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	76,523,750円
コール・ローン等	19,326,840
公社債(評価額)	57,135,822
未収利息	58,508
前払費用	2,580
(B) 負 債	258
その他未払費用	258
(C) 純資産総額(A-B)	76,523,492
元 本	76,632,575
次期繰越損益金	△ 109,083
(D) 受益権総口数	76,632,575口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,986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>

・デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(適用日：2023年11月22日)

■ 損益の状況

(自2023年3月2日 至2024年3月1日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	359,798円
受 取 利 息	368,517
支 払 利 息	△ 8,719
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△393,040
売 買 損 益	△393,040
(C) そ の 他 費 用 等	△ 4,707
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 37,949
(E) 前期繰越損益金	△ 71,134
(F) 合 計 (D+E)	△109,083
次期繰越損益金(F)	△109,083

※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。