

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21作成期(2024年5月14日から2024年11月12日まで)

第 41 期 / 第 42 期

第41期: 決算日 2024年8月13日

第42期: 決算日 2024年11月12日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券
信託期間	2014年5月30日から2029年5月14日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD) ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M) (米ドル建ての債券等に投資) マネー・マーケット・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 ■運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。 ■外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■年4回(原則として毎年2月、5月、8月、11月の12日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

三井住友DSアセットマネジメント

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間:午前9時~午後5時(土、日、祝・休日を除く)

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

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

■ 最近10期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		公 社 比 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 込 金	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	百万円	
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	
41期(2024年8月13日)	9,667	130	△2.1	0.0	93.8	5,060	
42期(2024年11月12日)	9,995	110	4.5	0.0	95.3	5,136	

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		公 社 比 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率
		騰 落 率	率			
第41期	(期 首) 2024年5月13日	円 10,008	% -	% 0.0	% 97.0	
	5月末	10,044	0.4	0.0	98.6	
	6月末	10,382	3.7	0.0	98.7	
	7月末	10,156	1.5	0.0	93.1	
	(期 末) 2024年8月13日	9,797	△2.1	0.0	93.8	
第42期	(期 首) 2024年8月13日	9,667	-	0.0	93.8	
	8月末	9,568	△1.0	0.0	98.8	
	9月末	9,509	△1.6	0.0	98.8	
	10月末	9,991	3.4	0.0	94.5	
	(期 末) 2024年11月12日	10,105	4.5	0.0	95.3	

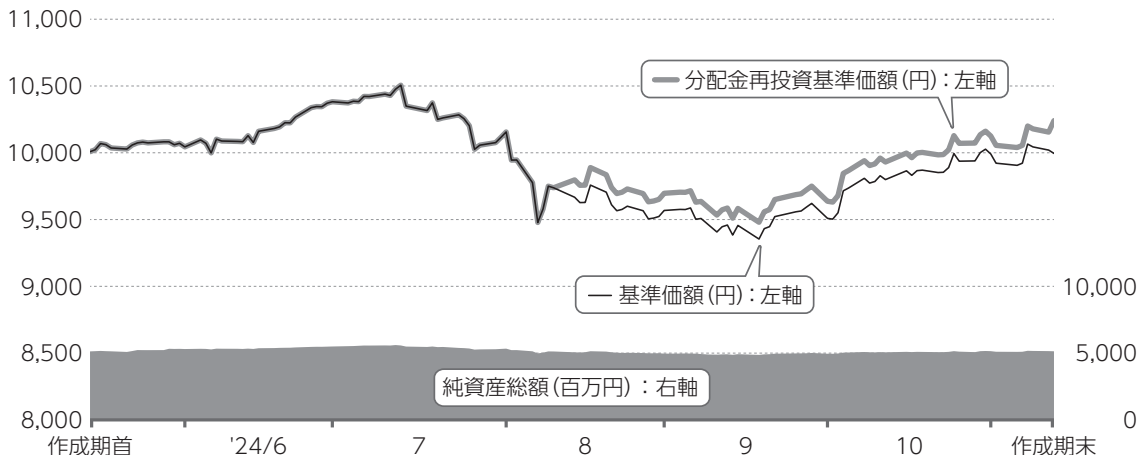
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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（2024年5月14日から2024年11月12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	10,008円
作成期末	9,995円 (当作成期既払分配金240円(税引前))
騰落率	+2.3% (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（2024年5月14日から2024年11月12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。実質組入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
- 米国の金利が低下（債券価格は上昇）したこと
- 金融政策の緩和を背景に、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと
- 米ドル高・円安が進行したこと

下落要因

- 戦略的に買い持ちポジションとしていたメキシコペソやブラジルレアルに対して米ドル高が進行したこと

投資環境について（2024年5月14日から2024年11月12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、米ドル安・円高となりました。

債券市場

期の前半、インフレが鎮静化してきたことに加え、米国の雇用統計が市場予想を下回ったことなどを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）の早期の利下げ観測が高まり、世界的に金利は低下しました。

期の後半、FRBが利下げを開始したものの、堅調な経済指標などを背景に利下げペースが緩やかなものにとどまるとの見方が広がり金利は上昇しました。ただし、期を通じて見ると、金利が低下し、米国債券市場は上昇しました。金融政策の緩和を背景に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

市場予想を下回る米経済指標を受け、期の半ばには大きく米ドル高の修正が図られる局面がありましたが、期の後半は堅調な経済指標や米国の次期政権による景気浮揚策への期待から金利が上昇するなか、米ドルが買い戻される展開となりました。期を通じては若干の米ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて（2024年5月14日から2024年11月12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価格変動の影響を和らげる適切な金利リスク量を見極め、市場環境に応じて機動的に調整しました。主に利下げ観測が高まる米国や欧州の金利リスクを維持しました。一方、相対的な投資妙味の低さや追加利上げの可能性などから日本の金利リスクは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、リスクオフ(リスク回避)時に底堅い値動きが期待され、かつ魅力的な上乘せ利回りを提供する米政府系住宅ローン担保証券を 선호しました。一方、金利リスクの調整等を目的とした債券の売り建てにより、米政府関連債は組入比率がマイナスを継続しました。また、米国の家計のバランスシートが概して健全さを保っており、今後も安定的な元利払いが期待される非政府系住宅ローン担保証券への投資を継続しました。新興国については、インフレ抑制が進む一方で、利回りが相対的に高いメキシコやブラジル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（2024年5月14日から2024年11月12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（2024年5月14日から2024年11月12日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第41期	第42期
当期分配金	130	110
（対基準価額比率）	（1.33%）	（1.09%）
当期の収益	95	110
当期の収益以外	34	－
翌期繰越分配対象額	961	1,021

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まいります。

マネー・マーケット・マザーファンド

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

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2024年5月14日から2024年11月12日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	92円	0.926%	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9,919円です。
（投信会社）	(52)	(0.524)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(38)	(0.386)	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
（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）	(－)	(－)	
(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
（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）	(－)	(－)	
(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）	(－)	(－)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	92	0.929	

※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。

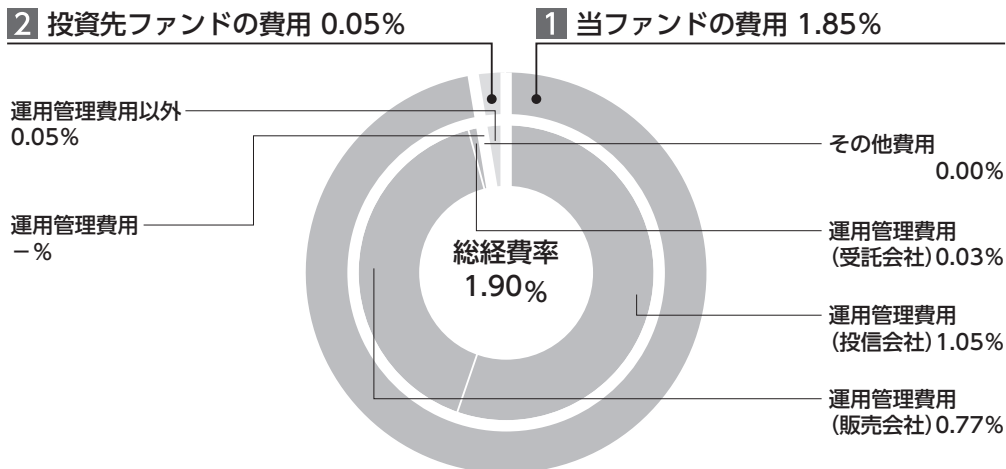
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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	ー%
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（2024年5月14日から2024年11月12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
		52,600	660,950	57,300	727,955

※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14日から2024年11月12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14日から2024年11月12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12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)	390,792	386,092	4,895,646	95.3
合計	390,792	386,092	4,895,646	95.3

※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1,208,161,753口です。

■ 投資信託財産の構成

(2024年11月12日現在)

項目	作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	4,895,646	93.8
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	320,415	6.1
投資信託財産総額	5,217,516	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2024年8月13日) (2024年11月12日)	
	第41期末	第42期末
(A) 資 産	5,183,126,471円	5,217,516,138円
コール・ローン等	432,591,128	320,415,119
投資信託受益証券(評価額)	4,749,081,030	4,895,646,560
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,454,313	1,454,459
(B) 負 債	122,328,758	80,617,914
未払収益分配金	68,058,551	56,535,407
未払解約金	29,342,004	836,774
未払信託報酬	24,861,658	23,183,675
その他未払費用	66,545	62,058
(C) 純資産総額(A - B)	5,060,797,713	5,136,898,224
元 本	5,235,273,160	5,139,582,464
次期繰越損益金	△ 174,475,447	△ 2,684,240
(D) 受益権総口数	5,235,273,160口	5,139,582,464口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,667円	9,995円

※当作成期における作成期首元本額5,124,461,660円、作成期中追加設定元本額615,454,571円、作成期中一部解約元本額600,333,767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41期	第42期
		130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2024年5月14日 至2024年8月13日		自2024年8月14日 至2024年11月12日	
	第41期	第42期	第41期	第42期
(A) 配 当 等 収 益	74,720,026円	95,820,020円		
受 取 配 当 金	74,679,803	95,761,146		
受 取 利 息	40,223	58,874		
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△165,955,769	152,129,249		
売 買 益	7,088,620	154,542,672		
売 買 損	△173,044,389	△ 2,413,423		
(C) 信 託 報 酬 等	△ 24,928,203	△ 23,245,733		
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△116,163,946	224,703,536		
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	101,211,972	△ 79,022,449		
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 91,464,922	△ 91,829,920		
(配 当 等 相 当 額)	(420,414,857)	(415,847,267)		
(売 買 損 益 相 当 額)	(△511,879,779)	(△507,677,187)		
(G) 合 計 (D + E + F)	△106,416,896	53,851,167		
(H) 収 益 分 配 金	△ 68,058,551	△ 56,535,407		
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△174,475,447	△ 2,684,240		
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 91,464,922	△ 91,829,920		
(配 当 等 相 当 額)	(420,414,862)	(415,847,267)		
(売 買 損 益 相 当 額)	(△511,879,784)	(△507,677,187)		
分 配 準 備 積 立 金	82,945,670	109,261,094		
繰 越 損 益 金	△165,956,195	△ 20,115,414		

※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17,112,252円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第41期	第42期
(a) 経費控除後の配当等収益	49,792,249円	86,835,795円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0
(c) 収益調整金	420,414,862	415,847,267
(d) 分配準備積立金	101,211,972	78,960,706
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	571,419,083	581,643,768
1万口当たり当期分配対象額	1,091.48	1,131.69
(f) 分配金	68,058,551	56,535,407
1万口当たり分配金	130	110

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）

		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)						
7.482% due 08/29/2029	GBP	4,800	\$ 5,976						
Seazen Group Ltd.									
6.000% due 08/12/2024		\$ 700	301						
Societe Generale S.A.									
6.446% due 01/10/2029		8,050	7,868						
6.691% due 01/10/2034		15,100	14,150						
Suncac China Holdings Ltd.									
7.000% due 07/09/2025		800	128						
SVB Financial Group									
3.125% due 06/05/2030 (b)		100	57						
U.S. Capital Funding VI Ltd.									
5.948% due 07/10/2043		23,084	17,602						
UBS Group AG									
3.091% due 05/14/2032		2,850	2,193						
3.750% due 03/28/2025		6,200	5,972						
3.869% due 01/12/2029		31,650	28,346						
4.194% due 04/01/2031		9,150	7,826						
5.959% due 01/12/2034		15,800	14,830						
6.301% due 09/22/2034		4,900	4,643						
6.327% due 12/22/2027		10,000	9,902						
6.442% due 08/11/2028		3,360	3,326						
6.537% due 08/12/2033		22,110	21,257						
7.750% due 03/01/2029	EUR	3,540	4,151						
9.018% due 11/15/2033	\$	4,350	4,875						
Unicredit SpA									
7.830% due 12/04/2023		72,590	72,690						
Unique Pub Finance Co. PLC									
7.395% due 03/28/2024	GBP	344	414						
Unit Group LP									
6.500% due 02/15/2029 (m)		\$ 2,280	1,483						
10.500% due 02/15/2028		6,545	6,307						
WCI Properties LP									
3.500% due 02/15/2025		4,784	4,567						
3.750% due 02/15/2027		4,300	3,873						
4.125% due 08/15/2030		5,684	4,694						
4.250% due 12/01/2026		3,600	3,326						
4.625% due 12/01/2029		3,600	3,117						
Voyager Aviation Holdings LLC									
8.500% due 05/09/2026 (b)		4,421	2,404						
		757,304							
INDUSTRIALS 3.2%									
Air Canada 2020-2 Class A Pass-Through Trust									
5.250% due 04/01/2029		1,869	1,791						
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust									
4.800% due 08/15/2027		3,270	3,119						
Amdocs Ltd.									
2.538% due 06/15/2030		4,000	3,150						
American Airlines 2013-1 Class A Pass-Through Trust									
4.000% due 07/15/2025		78	73						
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust									
3.700% due 10/01/2026		1,849	1,672						
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust									
3.375% due 05/01/2027		1,381	1,221						
American Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust									
3.575% due 01/15/2028		1,467	1,340						
American Airlines 2016-2 Class AA Pass-Through Trust									
3.200% due 06/15/2028		767	678						
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust									
3.350% due 10/15/2029		337	297						
BAT Capital Corp.									
6.343% due 08/02/2030		1,200	1,165						
6.421% due 08/02/2033		1,000	943						
7.081% due 08/02/2053		1,100	982						
Boeing Co.									
5.705% due 05/01/2040		5,728	5,071						
5.805% due 05/01/2050		4,500	3,878						
5.930% due 05/01/2060		9,900	8,338						
British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust									
3.300% due 12/15/2032		85	72						
Broadcom, Inc.									
2.450% due 02/15/2031		\$ 7,900	\$ 6,065						
3.137% due 11/15/2035		4,435	3,130						
3.469% due 04/15/2034		4,513	3,440						
Carvana Co. (g)									
12.000% due 12/01/2028		11,453	8,536						
13.000% due 06/01/2030		17,180	12,729						
14.000% due 06/01/2031		20,329	15,161						
Community Health Systems, Inc.									
6.625% due 03/15/2027		21,336	17,351						
6.000% due 03/15/2026		8,401	7,681						
CoStar Group, Inc.									
2.800% due 07/15/2030		2,000	1,554						
CVS Pass-Through Trust									
5.773% due 01/18/2033		129	125						
7.507% due 01/10/2032		515	525						
8.353% due 07/10/2031		514	532						
Energy Transfer LP									
4.950% due 05/15/2028		424	401						
Exela Intermediate LLC									
11.600% due 04/15/2026 (g)		541	92						
Ford Foundation									
2.815% due 08/01/2070		1,940	989						
Greene King Finance PLC									
3.583% due 03/15/2035	GBP	1,956	2,016						
4.084% due 03/15/2035		532	556						
5.106% due 03/15/2034		131	147						
7.139% due 12/15/2034		4,156	3,915						
GTCR W 2 Merger Sub LLC									
7.500% due 01/15/2031		\$ 900	889						
Imperial Brands Finance PLC									
3.500% due 07/26/2026		1,900	1,771						
JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust									
4.000% due 11/15/2032 (m)		6,106	5,408						
Market Bidco Finco PLC									
4.750% due 11/04/2027	EUR	17,800	16,152						
Massachusetts Institute of Technology									
4.678% due 07/01/2114		\$ 65	50						
5.600% due 07/01/2111		103	96						
Mitchells & Butlers Finance PLC									
6.013% due 12/15/2028	GBP	820	922						
6.022% due 12/15/2030		\$ 373	346						
Nissan Motor Co. Ltd.									
3.522% due 09/17/2025		8,300	7,852						
4.345% due 09/17/2027		8,700	7,869						
4.810% due 09/17/2030		2,250	1,912						
NMG Holding Co., Inc.									
7.125% due 04/01/2026		11,900	11,142						
ONEOK, Inc.									
5.800% due 11/01/2030		800	770						
6.050% due 09/01/2033		3,500	3,356						
6.625% due 09/01/2053		2,900	2,713						
Oracle Corp.									
3.850% due 04/01/2060		899	540						
PeaceHealth Obligated Group									
3.218% due 11/15/2050		3,100	1,735						
Roadster Finance DAC									
2.375% due 12/08/2027	EUR	1,000	889						
Rolls-Royce PLC									
4.625% due 02/16/2026		3,514	3,672						
5.750% due 10/15/2027	GBP	3,199	3,672						
Royal Caribbean Cruises Ltd.									
11.500% due 06/01/2025		\$ 2,410	2,549						
Russian Railways Via RZD Capital PLC									
7.487% due 03/25/2049 (b)	GBP	6,300	4,969						
Sands China Ltd.									
4.300% due 01/08/2026		\$ 1,800	1,671						
5.375% due 08/08/2025		2,300	2,228						
5.650% due 08/08/2028		2,400	2,222						
Syngenta Finance NV									
4.892% due 04/24/2025		\$ 800	\$ 782						
Times Square Hotel Trust									
6.528% due 08/01/2026		823	813						
U.S. Rental Care, Inc.									
10.625% due 06/28/2028		2,342	1,446						
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust									
2.700% due 05/01/2032		1,288	1,049						
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust									
5.875% due 10/15/2027		20,509	20,217						
Venture Global Calceasieu Pass LLC									
3.875% due 08/15/2029		7,400	6,165						
3.875% due 11/01/2033		16,500	12,486						
4.125% due 08/15/2031		5,000	4,025						
Venture Global LNG, Inc.									
8.125% due 06/01/2028		7,800	7,384						
8.375% due 06/01/2031		8,400	8,022						
9.500% due 02/01/2029		46,750	47,524						
9.875% due 02/01/2032		15,550	15,777						
Veritas U.S., Inc.									
7.500% due 09/01/2025		1,950	1,598						
		331,428							
UTILITIES 6.0%									
Altice Financing S.A.									
5.750% due 08/15/2029		11,389	8,820						
Altice France S.A.									
8.125% due 02/01/2027		2,744	2,316						
Charter Communications Operating LLC									
3.900% due 06/01/2052		9,800	5,536						
3.950% due 06/30/2062		2,600	1,389						
4.400% due 12/01/2061		7,100	4,137						
Constellation Oil Services Holding S.A.									
3.000% due 12/31/2026 (g)		387	273						
DISH DBS Corp.									
5.250% due 12/01/2026		11,110	8,983						
5.750% due 12/01/2028		11,110	8,089						
Enel Finance America LLC									
7.100% due 10/14/2027		1,000	1,023						
Enel Finance International NV									
7.500% due 10/14/2032		600	621						
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.									
2.250% due 11/22/2024	EUR	100	82						
2.949% due 01/24/2024		450	381						
4.950% due 03/23/2027		\$ 1,800	1,251						
4.950% due 02/06/2028		1,000	695						
5.150% due 02/11/2026		5,700	4,275						
7.288% due 08/16/2037		500	390						
8.625% due									

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				
3,400% due 08/15/2024	6,570	6,421	7.750% due 08/15/2028	\$ 13,507	\$ 10,723		
3,450% due 07/01/2025	12,102	11,478			517,242		
3,500% due 06/15/2025	8,068	7,678	Total Corporate Bonds & Notes				
3,500% due 08/01/2050	4,660	2,597	(Cost \$1,896,675)				
3,750% due 02/15/2024	10,188	10,121	CONVERTIBLE BONDS & NOTES 0.4%				
3,750% due 07/01/2028	13,613	11,944	Multiplan Corp.				
3,750% due 08/15/2042	418	258	6.000% due 10/15/2027	5,700	3,802	4,000% due 01/01/2043	\$ 5 \$ 4
3,850% due 11/15/2043	1,830	1,828	Nationwide Building Society			4,000% due 11/01/2045	86 76
3,950% due 12/01/2047	2,200	1,315	10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	10,221	4,000% due 03/01/2047	27 24
4,000% due 12/01/2046	3,144	1,904	Stichting AK Rabobank Certificaten			4,000% due 04/01/2047	230 204
4,200% due 03/01/2049	8,635	8,635	6.500% due 03/29/2170 (f)	EUR 30,963	29,586	4,000% due 08/01/2047	3,707 3,278
4,250% due 03/15/2046	5,219	3,298	Total Convertible Bonds & Notes		43,609	4,000% due 10/01/2047	205 181
4,300% due 03/15/2045	3,000	1,944	(Cost \$67,905)			4,000% due 12/01/2047	80 71
4,400% due 03/01/2032	7,300	6,003	MUNICIPAL BONDS & NOTES 0.1%			4,000% due 01/01/2048	46 40
4,450% due 04/15/2042	4,333	2,933	Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			4,000% due 02/01/2048	514 454
4,500% due 07/01/2040	36,242	25,754	6.630% due 02/01/2035	\$ 605	589	4,000% due 01/01/2048	6,176 5,430
4,500% due 12/15/2041	743	490	6.725% due 04/01/2035	286	283	4,000% due 08/01/2048	3,627 3,190
4,550% due 07/01/2030	50,195	43,469	7.350% due 07/01/2035	467	476	4,000% due 09/01/2048	1,049 927
4,600% due 06/15/2043	1,794	1,230	Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022			4,500% due 05/01/2033	13 12
4,650% due 08/01/2028	100	90	0.000% due 11/01/2043	12,731	6,350	4,500% due 02/01/2038	1 1
4,750% due 02/15/2044	2,707	1,888	Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			4,500% due 01/01/2041	156 138
4,950% due 07/01/2050	25,950	18,136	2.246% due 06/01/2029	1,600	1,332	4,750% due 06/01/2033	160 145
5,250% due 03/01/2052	7,300	5,292	3.000% due 06/01/2046	635	560	5,000% due 10/01/2035	60 59
Petroleos de Venezuela S.A. (b)			Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (b)			5,000% due 12/01/2035	134 125
5,375% due 04/12/2027	11,932	1,647	6.050% due 07/01/2032	800	202	5,000% due 01/01/2036	5 5
5,500% due 04/12/2037	10,372	1,365	6.125% due 07/01/2040	3,000	757	5,000% due 05/01/2038	2 2
6,000% due 05/16/2043	8,283	1,093	Total Municipal Bonds & Notes		10,559	5,000% due 11/01/2039	6 6
6,000% due 11/15/2026	13,183	1,691	(Cost \$12,128)			5,500% due 07/01/2033	18 18
9,000% due 11/17/2023	400	53	U.S. GOVERNMENT AGENCIES 52.4%			5,500% due 06/01/2035	657 624
9,750% due 05/17/2035	4,730	700	Fannie Mae			5,500% due 04/01/2036	1 1
Petroleos Mexicanos			0.765% due 05/25/2048 (h)	2,065	207	5,500% due 03/01/2037	11 11
5,950% due 01/28/2031	5,319	3,809	6.11% due 04/01/2037	611	546	5,500% due 09/01/2037	4 4
6,700% due 02/16/2032	58,087	42,867	3.000% due 09/01/2049	188	152	5,500% due 02/01/2038	3 3
6,950% due 01/28/2060	6,116	3,468	3.000% due 03/01/2050	16,878	13,664	5,500% due 04/01/2038	11 11
7,690% due 01/23/2050	1,570	971	3.000% due 10/01/2051	1,350	1,084	6,000% due 08/01/2031	20 19
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			3.000% due 12/01/2051	204	164	6,000% due 06/01/2032	1 1
4,263% due 06/01/2036	3,600	3,148	3.000% due 01/01/2052	194	156	6,000% due 09/01/2039	358 345
4,377% due 06/01/2039	3,990	3,407	3.000% due 02/01/2052	10,310	8,273	6,000% due 10/01/2047	8 7
4,451% due 12/01/2047	7,700	6,063	3.000% due 03/01/2052	23,085	18,518	6,000% due 01/01/2053	26,626 26,056
Prosus NV			3.000% due 04/01/2052	25,731	20,639	6,500% due 01/01/2037	1 1
1,985% due 07/13/2033	EUR 5,600	3,873	3.000% due 05/01/2052	8,343	6,695	6,500% due 10/01/2037	3 3
2,085% due 01/19/2030	4,200	3,382	3.000% due 06/01/2052	9,332	7,485	6,500% due 10/01/2053	6,847 6,815
3,061% due 07/13/2031	\$ 9,600	6,919	3.000% due 07/01/2052	6,806	5,459	7,000% due 09/01/2031	27 27
4,193% due 01/19/2032	4,000	3,074	3.000% due 08/01/2052	10,442	8,379	Fannie Mae, TBA (d)	
4,987% due 01/19/2052	1,300	803	3.000% due 09/01/2052	164	132	2,500% due 12/01/2053	146,000 112,203
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			3.000% due 05/01/2053	111	89	3.000% due 11/01/2038	1,800 1,609
9,250% due 07/06/2024	499	504	3.500% due 08/01/2042	18	16	3.000% due 11/01/2053	0 0
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			3.500% due 09/01/2047	166	142	3.000% due 12/01/2053	199,150 159,563
9,750% due 01/06/2027	443	459	3.500% due 03/01/2048	49	42	3,500% due 12/01/2053	652,683 544,157
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			3.500% due 04/01/2051	676	578	4,000% due 12/01/2053	155,150 134,132
8,200% due 04/06/2028	2,101	2,121	3.500% due 02/01/2052	977	816	4,500% due 12/01/2053	101,800 90,950
Sprint Capital Corp.			3.500% due 03/01/2052	1,500	1,330	5,000% due 12/01/2053	3,500 3,226
8,750% due 03/15/2032	2,200	2,479	3.500% due 04/01/2052	2,751	2,301	5,500% due 12/01/2053	286,200 271,420
Sprint LLC			3.500% due 05/01/2052	2,950	2,467	6,000% due 12/01/2053	30,800 29,962
7,125% due 06/15/2024	3,892	4,017	3.500% due 07/01/2052	3,348	2,783	6,500% due 12/01/2053	35,100 34,867
7,625% due 03/01/2026	839	862	3,500% due 09/01/2052	981	819	Freddie Mac	
Sprint Spectrum Co. LLC			4,000% due 07/01/2040	5	5	1,115% due 06/15/2042 (h)	30 3
5,152% due 03/20/2028	2,482	2,443	4,000% due 12/01/2041	46	40	3,000% due 11/01/2046	57 47
System Energy Resources, Inc.			4,000% due 07/01/2042	36	31	3,000% due 12/01/2047	1,779 1,469
2,140% due 12/09/2025	6,100	5,555	4,000% due 08/01/2042	541	476	3,000% due 03/01/2048	101 84
Topaz Solar Farms LLC			4,000% due 09/01/2042	125	109	3,000% due 12/01/2051	187 151
4,875% due 09/30/2039	5,109	4,602	4,000% due 10/01/2042	20	18	3,000% due 03/01/2052	89 71
5,750% due 09/30/2039	7,292	6,633	Velaris Ltd.			3,000% due 02/01/2052	538 432
Viatsat, Inc.			8,375% due 04/30/2030	1,666	1,636	3,000% due 05/01/2052	7,575 6,075
6,500% due 07/15/2028	2,700	3,917	Viatsat, Inc.			3,000% due 06/01/2052	203 163
			6,500% due 07/15/2028	2,700	3,917	3,000% due 07/01/2052	158 127
						3,000% due 09/01/2052	99 79
						3,000% due 10/01/2052	396 317
						3,000% due 01/01/2053	242 194
						3,000% due 03/01/2053	260 209
						3,500% due 10/01/2039	108 94
						3,500% due 10/01/2047	1,837 1,657
						3,500% due 12/01/2047	601 513

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	U.S. Treasury Bonds		
3,500.00 due 12/01/2048	2,300	1,866	5,000.00 due 08/20/2030	170	160	2,250% due 08/15/2046	100	60
3,500.00 due 03/01/2049	1,432	1,221	5,000.00 due 05/20/2040	262	246	2,750% due 08/15/2047 (m)	2,630	1,865
3,500.00 due 05/01/2051	75	63	5,000.00 due 04/20/2041	7	6	3,000% due 08/15/2048	155	107
3,500.00 due 04/01/2052	2,952	2,463	5,500.00 due 05/20/2038	7	7	3,000% due 02/15/2049	77	53
3,500.00 due 06/01/2052	2,323	1,939	5,500.00 due 06/20/2038	35	34	3,125% due 05/15/2048	180	127
3,500.00 due 07/01/2052	983	828	5,500.00 due 07/20/2038	34	32	4,375% due 08/15/2043 (m)	33,800	30,151
3,500.00 due 09/01/2052	33	27	5,500.00 due 08/20/2038	233	225	U.S. Treasury Notes		
3,500.00 due 11/01/2052	836	700	5,500.00 due 09/20/2038	72	69	1.625% due 02/15/2026 (o)	2,200	2,040
4,000.00 due 09/01/2033	1	1	5,500.00 due 10/20/2038	15	14	2.000% due 02/15/2025 (m)lo	11,021	10,572
4,000.00 due 08/01/2042	465	410	5,500.00 due 01/20/2039	10	10	2.000% due 08/15/2025 (o)	1,400	1,326
4,000.00 due 09/01/2042	656	578	5,500.00 due 02/20/2039	26	25	2.000% due 11/15/2026 (o)	800	735
4,000.00 due 12/01/2042	7	6	5,500.00 due 09/20/2039	50	48	2,250% due 11/15/2024 (m)lo	12,300	11,906
4,000.00 due 04/01/2047	296	262	5,500.00 due 10/20/2039	8	7	2,250% due 02/15/2027 (m)lo	28,000	25,789
4,000.00 due 05/01/2047	287	254	5,500.00 due 11/20/2039	212	204	2,375% due 05/15/2028 (m)lo	32,200	28,297
4,000.00 due 08/01/2047	522	462	5,500.00 due 12/20/2039	24	22	2,625% due 02/15/2029 (m)lo	5,000	4,478
4,000.00 due 08/01/2048	602	530	5,500.00 due 01/20/2040	187	176	2,750% due 08/15/2032 (m)	150,100	126,999
4,000.00 due 09/01/2048	245	216	5,500.00 due 06/20/2040	208	203	2,875% due 05/15/2032	290	249
4,000.00 due 12/01/2048	9,227	8,119	5,500.00 due 07/20/2040	470	443	Total U.S. Treasury Obligations		
4,000.00 due 02/01/2049	3,684	3,241	5,500.00 due 07/20/2053	21,057	20,155	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	Ginnie Mae, TBA (d)			MORTGAGE-BACKED SECURITIES 40.8%		
5,000.00 due 08/01/2035	39	38	2,000.00 due 11/01/2053	19,000	14,653	Accreted Mortgage Loan Trust		
5,000.00 due 01/01/2037	2	2	2,500.00 due 12/01/2053	46,200	36,816	6,384% due 07/25/2035	7,714	7,468
5,000.00 due 01/01/2038	1	1	3,000.00 due 11/01/2053	147,100	121,256	7,134% due 07/25/2035 (b)	2,206	1,765
5,500.00 due 01/01/2035	257	252	3,000.00 due 12/01/2053	494,900	408,181	ACE Securities Structured Home Equity Loan Trust		
5,500.00 due 05/01/2037	2	2	3,500.00 due 10/01/2053	182,700	155,733	5,749% due 08/25/2036	3,308	3,105
5,500.00 due 06/01/2037	90	88	3,500.00 due 12/01/2053	99,000	84,418	6,234% due 01/25/2035	941	763
5,750.00 due 05/01/2037	83	82	4,000.00 due 11/01/2053	513,000	450,979	6,264% due 02/25/2034	1,389	1,402
6,000.00 due 07/01/2037	40	40	4,000.00 due 12/01/2053	944,000	830,204	6,339% due 08/25/2035	4,516	4,289
6,000.00 due 01/01/2053	8,304	8,121	4,500.00 due 11/01/2053	177,660	160,530	6,369% due 11/25/2034	1,120	1,090
Ginnie Mae			4,500.00 due 12/01/2053	496,000	448,368	6,609% due 02/25/2035	6,632	6,153
4,000.00 due 06/20/2041	1	1	5,000.00 due 11/01/2041	277,000	257,751	Adjustable Rate Mortgage Trust		
4,000.00 due 04/20/2047	1,441	1,290	5,500.00 due 11/01/2053	22,000	21,039	6,389% due 08/25/2035	3,175	2,764
4,000.00 due 05/20/2047	26,857	23,925	5,500.00 due 12/01/2053	247,000	236,155	AFC Home Equity Loan Trust		
4,000.00 due 06/20/2047	12,851	11,325	Total U.S. Government Agencies			6,249% due 06/25/2029		
4,000.00 due 07/20/2047	10,939	9,792	(Cost \$5,497,999)			Alternative Loan Trust		
4,000.00 due 02/20/2048	7,567	6,768	U.S. TREASURY OBLIGATIONS 15.1%			4,140% due 08/25/2035 (b)		
4,000.00 due 05/20/2049	26,126	23,437	Treasury Inflation Protected Securities (i)			4,158% due 08/25/2036		
4,000.00 due 02/20/2050	318	287	0.125% due 07/15/2024 (m)			4,268% due 09/25/2034		
4,000.00 due 07/20/2050	156	140	0.125% due 10/15/2024 (o)			5,500% due 04/25/2034		
4,000.00 due 08/20/2050	24	22	0.125% due 04/15/2025 (o)			5,500% due 06/25/2035		
4,000.00 due 09/20/2050	1,893	1,698	0.125% due 07/15/2030			5,500% due 08/25/2035 (b)		
4,000.00 due 10/20/2050	59,971	53,798	0.125% due 01/15/2031			5,500% due 09/25/2035		
4,000.00 due 11/20/2052	252	222	0.125% due 07/15/2031			5,500% due 02/25/2036 (b)		
4,500.00 due 10/20/2035	416	380	0.250% due 01/15/2025			5,644% due 09/20/2046		
4,500.00 due 01/20/2040	76	69	0.250% due 07/15/2029 (m)			5,799% due 07/25/2036		
4,500.00 due 03/20/2040	7	7	0.250% due 01/15/2025			5,819% due 08/25/2046 (b)		
4,500.00 due 07/15/2040	1,105	1,032	0.375% due 01/15/2027 (o)			5,839% due 05/25/2036		
4,500.00 due 07/20/2040	1,207	1,122	0.375% due 07/15/2027 (o)			5,874% due 03/20/2046		
4,500.00 due 08/15/2040	1,317	1,239	0.500% due 04/15/2024 (o)			5,939% due 12/25/2046		
4,500.00 due 08/20/2040	871	810	0.625% due 01/15/2024 (m)			5,979% due 07/25/2036		
4,500.00 due 09/20/2040	3,628	3,170	0.625% due 07/15/2032			6,000% due 11/25/2036		
4,500.00 due 10/20/2040	987	918	0.625% due 02/15/2043			6,000% due 07/25/2037 (b)		
4,500.00 due 01/20/2041	4,678	4,348	0.750% due 07/15/2028 (o)			6,039% due 01/25/2036		
4,500.00 due 02/20/2041	2,268	2,096	0.750% due 02/15/2042			6,094% due 12/20/2035		
4,500.00 due 03/20/2041	8,736	8,093	0.750% due 02/15/2045			6,150% due 08/25/2035 (b)		
4,500.00 due 04/15/2041	1,054	991	0.875% due 01/15/2029 (o)			7,000% due 10/25/2037		
4,500.00 due 04/20/2041	926	861	0.875% due 02/15/2047			7,089% due 10/25/2034		
4,500.00 due 06/20/2041	7,991	7,428	1.000% due 02/15/2046			Ameritrust Mortgage Securities Trust		
4,500.00 due 07/20/2041	2,066	1,920	1.000% due 02/15/2048			5,949% due 04/25/2036		
4,500.00 due 09/20/2041	206	191	1.000% due 02/15/2049 (o)			6,054% due 03/25/2036		
4,500.00 due 10/20/2041	1,179	1,083	1.375% due 07/15/2033			6,655		
4,500.00 due 12/20/2041	1,847	1,718	1.375% due 02/15/2044			6,054% due 03/25/2036		
4,500.00 due 05/20/2043	438	407	1.500% due 02/15/2053			26,883		
4,500.00 due 07/20/2043	292	272				24,379		

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 12/25/2037	4,058	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							
5.659% 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)							
3.985% 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					
6.299% due 04/25/2037	7,934	6,646					
BCAP LLC Trust							
4.223% due 04/26/2036	4,613	2,335					
5.876% due 04/26/2037	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						
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 03/15/2042	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 03/25/2033	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					
Chewy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates							
5.789% due 03/25/2035	298	281					
CIM Trust							
3.250% due 10/25/2058	17,962	15,283					
6.639% due 12/25/2067	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)	4,097	3,698					
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	1,939	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	17,606	13,588					
4.390% due 06/25/2050	41,375	33,819					
4.454% due 04/25/2058	27,855	24,088					
5.566% 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					
5.579% due 06/25/2035 (b)	1,473	1,240					
5.579% due 06/25/2037	12,462	11,213					
5.579% due 07/25/2037 (b)	3,130	3,072					
5.619% due 11/25/2047	2,027	2,223					
5.633% due 06/25/2035	8,644	6,664					
5.659% due 08/25/2037	25,800	22,270					
5.669% due 10/25/2047	5,333	5,203					
5.689% due 02/25/2036	1,031	952					
5.859% due 01/25/2045	765	759					
5.899% due 05/25/2037 (b)	10,937	10,133					

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)								
Encore Credit Receivables Trust										
6.365% due 11/25/2035	\$ 6,510	\$ 5,821								
Euroasia 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										
6.958% due 11/25/2035	2,069	1,654								
First Franklin Mortgage Loan Trust										
4.330% due 04/25/2035	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								
6.098% due 01/25/2036	6,000	5,597								
6.458% 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 08/28/2039	EUR 513	518								
GS Mortgage Securities Corporation Trust										
4.591% due 10/10/2032	\$ 8,215	7,823								
GSAA Home Equity Trust (b)										
6.182% due 11/25/2036	2,934	662								
6.500% due 11/25/2037	20	8								
GSAMP Trust										
5.578% due 03/25/2047	3,675	3,184								
5.589% due 01/25/2037	16,585	9,373								
5.958% 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 Securitization Trust										
2.122% due 04/26/2037	44,351	11,193								
5.614% due 09/26/2036	3,694	2,285								
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 05/25/2036	16,717	11,388								
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 06/25/2037 (b)	8,206	4,916								
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust										
3.285% 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								
5.789% 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 Resecuritization 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	18,699								
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 Resecuritization Trust										
3.986% due 02/28/2037	1,850	1,657								
Kentmere No. 2 PLC										
0.000% due 01/28/2042	GBP 11,939	\$ 4,273								
5.987% due 01/28/2042	40,807	49,412								
6.587% due 01/28/2042	5,993	6,702								

三井住友・ピコム・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 02/25/2036 (b)		18,224						
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust								
5.948% 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 REMERIC Trust								
5.754% due 11/25/2036		5,003						
Mortgage Loan Trust								
5.370% due 03/25/2034		3,310						
MortgageIT Trust								
7.014% due 08/25/2035		299						
NTN Commercial Mortgage Trust								
6.737% due 03/15/2038		1,120						
Netixis Commercial Mortgage Securities Trust								
3.790% due 11/15/2032		1,700						
3.821% due 02/15/2038		2,900						
New Century Home Equity Loan Trust								
6.564% 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						
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust								
5.034% due 05/25/2036 (b)	\$	2,780						
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 Resecuritization Trust								
1.952% due 03/28/2037		5,464						
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 10/25/2036		948						
NYO Commercial Mortgage Trust								
7.444% due 11/15/2038		30,130						
7.984% due 11/15/2038		14,400						
OBX Trust								
6.319% due 01/25/2062		10,517						
6.520% due 07/25/2063		7,550						
Optium 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						
Opwin Mortgage Loan Trust								
5.698% due 10/25/2037		3,641						
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						
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								
6.964% due 03/25/2035		1,327						
RAAC Trust								
6.144% due 02/25/2036 (b)		8,360						
6.189% 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 06/12/2054	CAD	1,194						
Renaissance Home Equity Loan Trust								
5.612% due 04/25/2037	\$	10,124						
5.675% due 08/25/2037 (b)		3,910						
6.159% due 11/25/2034		167						
6.439% due 09/25/2037		33						
Residential Accredited 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		9,964						
6.189% due 09/25/2035		7,021						
Residential Mortgage Acceptance Corporation No.3 PLC								
0.000% due 02/15/2047	GBP	26,100						
RESIMAC Bastille Trust								
6.372% due 09/05/2057	\$	598						
RMAC Securities No.1 PLC								
4.230% due 06/12/2044	EUR	3,720						
Saxon Asset Securities Trust								
1.922% due 03/25/2035 (b)	\$	367						
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						
SFO Commercial Mortgage Trust								
7.848% due 05/15/2036	\$	885	\$	687				
8.348% 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						
5.113% due 02/24/2071		24,604						
Soundview Home Loan Trust								
4.154% due 04/25/2033	\$	2,319						
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						
SRET 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						
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust								
4.097% due 06/25/2037	\$	1,507						
5.041% due 07/25/2035 (b)		1,993						
5.759% due 10/25/2035		5,328						
6.200% due 05/25/2035 (b)		53						
6.414% due 08/25/2035		8,667						
Structured Asset Investment Loan Trust								
5.739% due 06/25/2036		5,118						
5.939% due 06/25/2036		25,000						
6.159% due 04/25/2035		3,571						
6.239% due 02/25/2034		12,178						
6.639% due 12/25/2034		2,200						
Structured Asset Mortgage Investments II Trust								
5.859% due 09/25/2047 (b)		18,876						
5.879% due 05/25/2036		9,371						
6.123% due 04/19/2035		1,318						
Structured Asset Mortgage Investments Trust								
6.108% due 09/19/2032		12						
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust								
5.569% due 05/25/2036		5,123						
5.689% due 05/25/2036		3,418						
5.729% due 07/25/2036 (b)		9,526						
5.749% due 07/25/2036		14,180						
5.759% due 10/25/2036		8,263						
5.939% due 04/25/2031		5,841						
6.369% due 11/25/2035		3,185						
Summerhill Residential								
0.000% due 03/24/2059	EUR	5						
4.713% due 03/24/2059		121,196						
5.113% due 03/24/2059		22,011						
5.663% due 03/24/2059		17,746						
6.263% due 03/24/2059		14,202						
6.500% due 03/24/2059		6,568						
7.000% due 03/24/2059		35,506						
7.513% due 03/24/2059		8,521						
8.863% due 03/24/2059		4,256						
9.863% due 03/24/2059		4,256						
Temple Quay No.1 PLC								
6.689% due 07/24/2085	GBP	58,277						
7.189% due 07/13/2085		15,904						
8.189% due 07/24/2085		14,681						

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

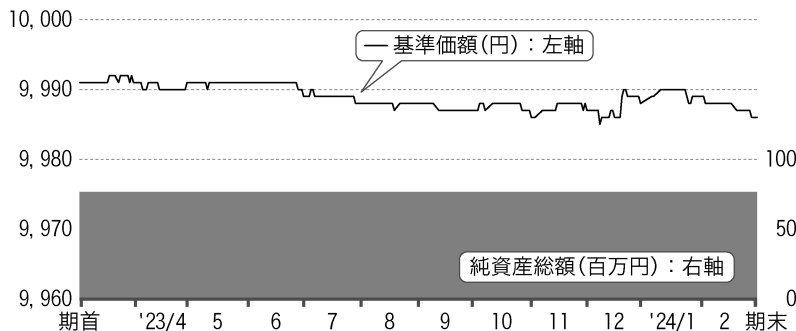
年月日	基準価額		公社債 組入比率
		騰落率	
(期首) 2023年3月1日	円 9,991	% -	% 74.7
3月末	9,991	0.0	74.7
4月末	9,991	0.0	74.8
5月末	9,991	0.0	74.7
6月末	9,989	△0.0	74.8
7月末	9,988	△0.0	74.8
8月末	9,988	△0.0	74.7
9月末	9,987	△0.0	74.8
10月末	9,986	△0.1	74.7
11月末	9,987	△0.0	74.7
12月末	9,988	△0.0	74.7
2024年1月末	9,989	△0.0	74.7
2月末	9,986	△0.1	74.7
(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
コーポレート債	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。