

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	無期限（設定日：2003年6月16日）
運用方針	外国投資信託証券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して安定運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等。 PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等。また、通常、資産の60%以上を社債等に投資します。
当ファンドの運用方法	■主としてオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはその関連派生商品（先物取引、オプション取引、各種スワップ取引等）で運用します。 ■外貨建資産については、原則として円に対しての為替ヘッジを行いません。 ■ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ■運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■毎月5日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は委託会社が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

三井住友・ 豪ドル債ファンド

【運用報告書(全体版)】

第37作成期（2021年5月7日から2021年11月5日まで）

第 215 期 / 第 216 期 / 第 217 期
決算日2021年6月7日 決算日2021年7月5日 決算日2021年8月5日

第 218 期 / 第 219 期 / 第 220 期
決算日2021年9月6日 決算日2021年10月5日 決算日2021年11月5日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

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・豪ドル債ファンド

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

■ 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス		投資信託 証券組入 率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(円ベース)	期中 騰落率		
191期(2019年6月5日)	円 4,196	円 25	% △ 1.5	230.89	% △ 1.4	% 98.8	百万円 86,194
192期(2019年7月5日)	4,237	25	1.6	234.28	1.5	98.8	86,580
193期(2019年8月5日)	4,071	25	△ 3.3	227.04	△ 3.1	98.6	82,810
194期(2019年9月5日)	4,045	25	△ 0.0	227.92	0.4	99.0	82,184
195期(2019年10月7日)	4,051	25	0.8	229.50	0.7	98.6	81,781
196期(2019年11月5日)	4,112	25	2.1	234.57	2.2	99.0	82,354
197期(2019年12月5日)	4,105	25	0.4	235.47	0.4	98.8	81,311
198期(2020年1月6日)	4,095	10	0.0	235.25	△ 0.1	97.3	80,088
199期(2020年2月5日)	4,075	10	△ 0.2	234.48	△ 0.3	99.3	77,055
200期(2020年3月5日)	3,960	10	△ 2.6	229.15	△ 2.3	98.8	73,678
201期(2020年4月6日)	3,536	10	△ 10.5	209.10	△ 8.8	99.0	64,840
202期(2020年5月7日)	3,686	10	4.5	218.36	4.4	98.4	67,252
203期(2020年6月5日)	4,101	10	11.5	242.95	11.3	98.9	74,533
204期(2020年7月6日)	4,031	10	△ 1.5	239.99	△ 1.2	99.2	72,250
205期(2020年8月5日)	4,129	10	2.7	244.81	2.0	99.3	72,926
206期(2020年9月7日)	4,200	10	2.0	249.07	1.7	98.9	72,597
207期(2020年10月5日)	4,127	10	△ 1.5	245.52	△ 1.4	99.2	69,923
208期(2020年11月5日)	4,105	10	△ 0.3	244.72	△ 0.3	99.0	68,588
209期(2020年12月7日)	4,218	10	3.0	251.40	2.7	99.2	69,191
210期(2021年1月5日)	4,320	10	2.7	257.46	2.4	98.0	69,143
211期(2021年2月5日)	4,326	10	0.4	258.21	0.3	98.9	67,409
212期(2021年3月5日)	4,401	10	2.0	263.59	2.1	98.8	67,058
213期(2021年4月5日)	4,399	10	0.2	264.65	0.4	97.6	65,648
214期(2021年5月6日)	4,447	10	1.3	267.96	1.3	98.6	65,385
215期(2021年6月7日)	4,456	5	0.3	268.88	0.3	99.2	64,377
216期(2021年7月5日)	4,409	5	△ 0.9	266.89	△ 0.7	98.9	61,855
217期(2021年8月5日)	4,335	5	△ 1.6	263.15	△ 1.4	99.2	59,878
218期(2021年9月6日)	4,351	5	0.5	264.58	0.5	99.2	59,125
219期(2021年10月5日)	4,247	5	△ 2.3	258.56	△ 2.3	99.0	56,764
220期(2021年11月5日)	4,309	5	1.6	263.43	1.9	99.0	56,202

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

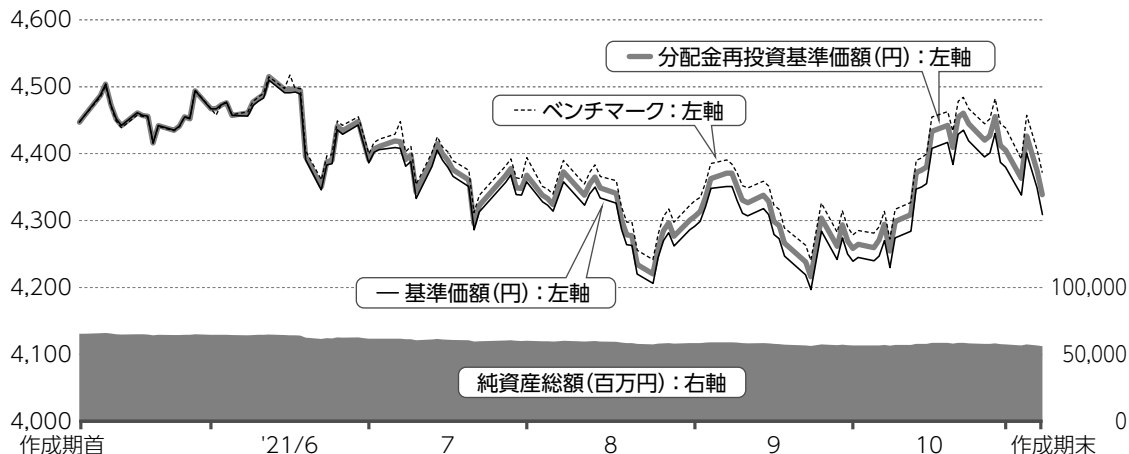
決算期	年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円ベース)		投資信託 証券組入 比 率
			騰 落 率		騰 落 率	
第215期	(期 首) 2021年5月6日	円 4,447	% -		% -	% 98.6
	5月末	4,467	0.4	269.20	0.5	98.7
	(期 末) 2021年6月7日	4,461	0.3	268.88	0.3	99.2
第216期	(期 首) 2021年6月7日	4,456	-	268.88	-	99.2
	6月末	4,386	△1.6	265.11	△1.4	98.5
	(期 末) 2021年7月5日	4,414	△0.9	266.89	△0.7	98.9
第217期	(期 首) 2021年7月5日	4,409	-	266.89	-	98.9
	7月末	4,358	△1.2	264.78	△0.8	98.9
	(期 末) 2021年8月5日	4,340	△1.6	263.15	△1.4	99.2
第218期	(期 首) 2021年8月5日	4,335	-	263.15	-	99.2
	8月末	4,292	△1.0	260.91	△0.9	98.8
	(期 末) 2021年9月6日	4,356	0.5	264.58	0.5	99.2
第219期	(期 首) 2021年9月6日	4,351	-	264.58	-	99.2
	9月末	4,239	△2.6	257.82	△2.6	98.8
	(期 末) 2021年10月5日	4,252	△2.3	258.56	△2.3	99.0
第220期	(期 首) 2021年10月5日	4,247	-	258.56	-	99.0
	10月末	4,380	3.1	267.44	3.4	98.4
	(期 末) 2021年11月5日	4,314	1.6	263.43	1.9	99.0

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

作成期首	4,447円
作成期末 (当作成期既払分配金30円(税引前))	4,309円
騰落率	-2.4% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

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

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

基準価額の主な変動要因(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

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

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- 債券利子収入

下落要因

- オーストラリアの金利が上昇(価格は下落)したこと
- 為替市場において、小幅な豪ドル安・円高が進行したこと

投資環境について(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

オーストラリア債券市場は下落しました。為替市場は豪ドル安・円高となりました。

債券市場

期の前半、オーストラリア国債利回りは低下しました。RBA(オーストラリア準備銀行)が緩和的な金融政策を維持したことや世界的なデルタ型ウイルスの感染拡大に加え、シドニーなど国内の主要都市でのロックダウン(都市封鎖)が延長されたことなどが、利回りの低下要因となりました。

期の後半は、RBAが国債買入額の減額を開始したこと、FRB(米連邦準備制度理事会)をはじめ主要国の中央銀行が金融政策の正常化に向かい始めたことなどにより、オーストラリア国債利回りは上昇しました。期を通して見れば、オーストラリア国債利回りは上昇しました。

為替市場

期の前半、デルタ型ウイルスの世界的な感染拡大や国内でも、シドニーなど主要都市でのロックダウンの延長を受けたリスク・オフ(リスク回避)の動きなどから、豪ドルは対円で下落基調となりました。

期の後半には、ロックダウンの段階的な解除、資源/エネルギー価格が堅調に推移したこと、RBAの早期利上げ観測が高まったことなどにより、豪ドルは対円で上昇基調となりました。

期を通して見れば、豪ドルは円に対して小幅に下落しました。

ポートフォリオについて(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

当ファンド

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

組入れファンド

●デュレーション(投資資金の平均回収期間)戦略

オーストラリアのデュレーション戦略では、期を通して金利リスクをアンダーウェイトとしました。また、米国、欧州も売り持ちとし、ポートフォリオ全体のデュレーションはアンダーウェイトとしました。

●イールドカーブ(利回り曲線)戦略

イールドカーブ戦略では、キャリーやロールダウン(時間の経過とともに保有する債券の利回りが低下し、債券価格が上昇すること)の観点から優れていると判断した中期ゾーンをオーバーウェイトとしました。

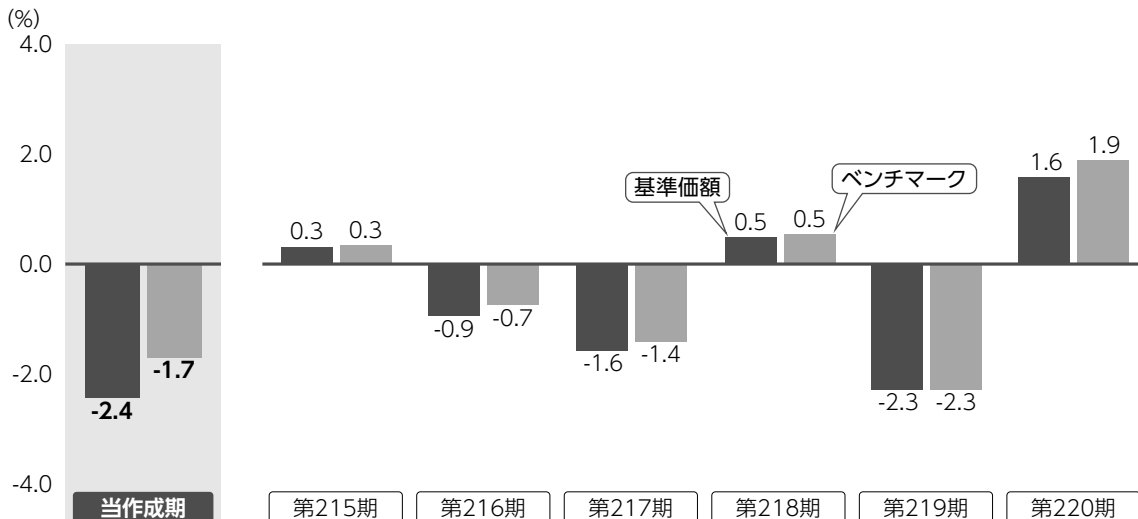
●種別配分

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

ベンチマークとの差異について(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

当ファンドは、ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円ベース)をベンチマークとしています。以下のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※当作成期の基準価額は分配金再投資ベース、各期は分配金(税引前)込み。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は-2.4%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率-1.7%を0.7%下回りました。

プラス要因

- 投資適格社債やモーゲージ債へ投資したこと

マイナス要因

- ニュージーランドドル建て資産への投資を一部行ったこと

分配金について(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

期間の1万口当たりの分配金(税引前)は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。
なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第215期	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期
当期分配金	5	5	5	5	5	5
(対基準価額比率)	(0.11%)	(0.11%)	(0.12%)	(0.11%)	(0.12%)	(0.12%)
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	148	149	151	155	157	163

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
※「対基準価額比率」は、「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

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

組入れファンド

PIMCOでは、財政による景気の底上げ効果が剥落することから、2022年における先進国の実質GDP(国内総生産)成長率は3%弱まで低下するとみています。金融政策については、11月のFOMC(米連邦公開市場委員会)でテーパリング(量的緩和の段階的

縮小)の開始が決定されるなど先進国で金融政策の正常化に向けた動きがみられています。ただし、利上げ開始までには時間を要するとみています。ただし、インフレ率の上昇が持続する場合には利上げ開始時期が早まる可能性もあると考えています。

オーストラリアについては、RBAと政府による金融・財政政策によって国内経済がコロナショック前の水準を回復しており、労働市場や企業の景況感などの国内経済指標も堅調に推移しています。一方、最大の貿易相手国である中国との関係悪化の懸念や、変異型ウイルスの感染拡大を受けた度重なる行動規制による経済活動への影響には、引き続き注意が必要です。

かかる環境下、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」の合算ベースで、オーストラリアの金利リスクはベンチマークよりやや少なめとしています。年限別では、

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

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・豪ドル債ファンド

1万口当たりの費用明細 (2021年5月7日から2021年11月5日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	30円	0.676%	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4,364円です。
（投信会社）	(15)	(0.347)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(14)	(0.314)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.016)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 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	0.001	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)	(0.001)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(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	30	0.678	

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

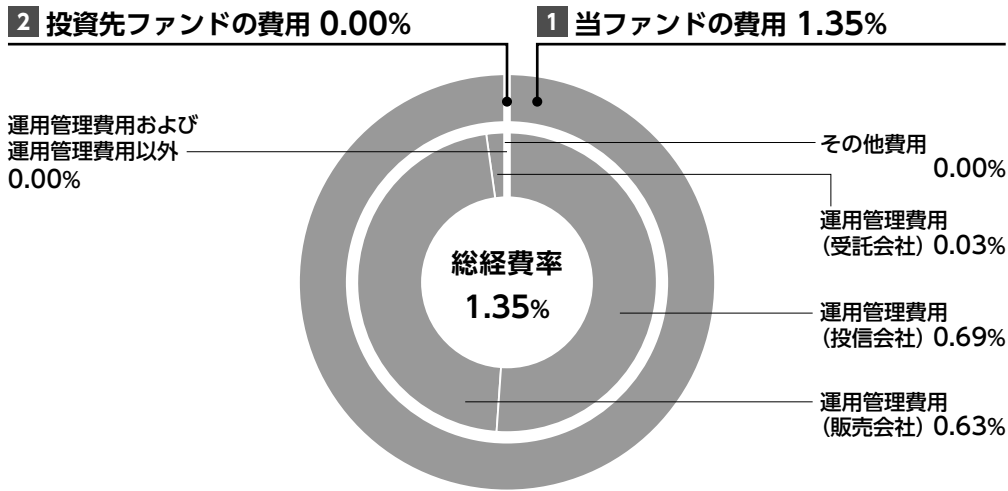
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	1.35%
1 当ファンドの費用の比率	1.35%
2 投資先ファンドの費用の比率	0.00%

※ **1**の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **2**の投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンド、マネーファンドを除く))の運用管理費用は、当ファンドの運用委託報酬として負担していることから、原則として、開示すべき運用管理費用はありません。ただし、投資先ファンドには運用管理費用以外の費用(概算)がかかります。

※ **1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.35%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2021年5月7日から2021年11月5日まで)

投資信託証券

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
		口	千円	口	千円
国内	PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド	—	—	553,973	5,460,157
	PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	—	—	196,642	1,364,990

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年5月7日から2021年11月5日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2021年5月7日から2021年11月5日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2021年11月5日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	作成期首		作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド	5,171,083	4,617,110	44,693,624	79.5
PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	1,787,998	1,591,356	10,937,389	19.5
合 計	6,959,081	6,208,466	55,631,014	99.0

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

三井住友・豪ドル債ファンド

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月5日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	55,631,014	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	819,254	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	56,450,269	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年6月7日) (2021年7月5日) (2021年8月5日) (2021年9月6日) (2021年10月5日) (2021年11月5日)

項 目	第215期末	第216期末	第217期末	第218期末	第219期末	第220期末
(A) 資 産	64,602,851,290円	62,096,777,346円	60,067,944,836円	59,343,055,660円	56,918,125,233円	56,450,269,325円
コール・ローン等	756,417,538	923,642,003	667,126,157	709,124,776	718,112,741	819,254,737
投資信託受益証券(評価額)	63,846,433,752	61,173,135,343	59,400,818,679	58,633,930,884	56,200,012,492	55,631,014,588
(B) 負 債	225,807,963	241,455,687	189,323,842	217,576,029	154,100,732	247,740,584
未払収益分配金	72,238,119	70,152,224	69,058,741	67,942,693	66,832,768	65,219,216
未払解約金	76,335,653	105,601,712	50,524,584	79,521,783	25,247,113	116,004,651
未払信託報酬	77,066,662	65,533,451	69,575,613	69,935,035	61,848,738	66,353,282
未払利息	1,771	2,229	1,597	1,614	—	—
その他未払費用	165,758	166,071	163,307	174,904	172,113	163,435
(C) 純資産総額(A-B)	64,377,043,327	61,855,321,659	59,878,620,994	59,125,479,631	56,764,024,501	56,202,528,741
元 本	144,476,238,622	140,304,449,289	138,117,482,392	135,885,387,833	133,665,537,974	130,438,433,462
次期繰越損益金	△ 80,099,195,295	△ 78,449,127,630	△ 78,238,861,398	△ 76,759,908,202	△ 76,901,513,473	△ 74,235,904,721
(D) 受益権総口数	144,476,238,622口	140,304,449,289口	138,117,482,392口	135,885,387,833口	133,665,537,974口	130,438,433,462口
1万口当たり基準価額(C/D)	4,456円	4,409円	4,335円	4,351円	4,247円	4,309円

※当作成期における作成期首元本額147,037,943,161円、作成期中追加設定元本額652,333,961円、作成期中一部解約元本額17,251,843,660円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

三井住友・豪ドル債ファンド

■ 損益の状況

(自2021年5月7日) (自2021年6月8日) (自2021年7月6日) (自2021年8月6日) (自2021年9月7日) (自2021年10月6日)
 至2021年6月7日 至2021年7月5日 至2021年8月5日 至2021年9月6日 至2021年10月5日 至2021年11月5日

項 目	第215期	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期
(A) 配 当 等 取 益	162,739,658円	158,649,118円	155,842,104円	153,307,915円	150,729,377円	147,772,470円
受 取 配 当 金	162,797,332	158,694,384	155,888,069	153,342,577	150,754,456	147,802,333
受 取 利 息	-	-	-	-	455	389
支 払 利 息	△ 57,674	△ 45,266	△ 45,965	△ 34,662	△ 25,534	△ 30,252
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	114,173,633	△ 690,317,602	△ 1,032,196,441	196,733,990	△ 1,419,274,505	790,117,105
売 買 損 益	117,303,587	18,313,069	11,020,977	209,199,094	18,417,922	829,497,908
売 買 損 益	△ 3,129,954	△ 708,630,671	△ 1,043,217,418	△ 12,465,104	△ 1,437,692,427	△ 39,380,803
(C) 信 託 報 酬 等	△ 77,230,302	△ 65,699,522	△ 69,738,920	△ 70,108,704	△ 62,020,851	△ 66,516,407
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	199,682,989	△ 597,368,006	△ 946,093,257	279,933,201	△ 1,330,565,979	871,373,168
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△13,659,354,780	△13,129,518,318	△13,571,805,698	△14,341,196,485	△13,875,923,757	△14,893,392,370
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△66,567,285,385	△64,652,089,082	△63,651,903,702	△62,630,702,225	△61,628,190,969	△60,148,666,303
(配 当 等 相 当 額)	(430,344,346)	(418,795,438)	(413,170,927)	(407,341,646)	(403,056,758)	(394,329,216)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△66,997,629,731)	(△65,070,884,520)	(△64,065,074,629)	(△63,038,043,871)	(△62,031,247,727)	(△60,542,995,519)
(G) 合 計 (D + E + F)	△80,026,957,176	△78,378,975,406	△78,169,802,657	△76,691,965,509	△76,834,680,705	△74,170,685,505
(H) 収 益 分 配 金	△ 72,238,119	△ 70,152,224	△ 69,058,741	△ 67,942,693	△ 66,832,768	△ 65,219,216
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△80,099,195,295	△78,449,127,630	△78,238,861,398	△76,759,908,202	△76,901,513,473	△74,235,904,721
追 加 信 託 差 損 益 金	△66,567,285,385	△64,652,089,082	△63,651,903,702	△62,630,702,225	△61,628,190,969	△60,148,666,303
(配 当 等 相 当 額)	(430,344,346)	(418,795,438)	(413,170,927)	(407,341,646)	(403,056,758)	(394,329,216)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△66,997,629,731)	(△65,070,884,520)	(△64,065,074,629)	(△63,038,043,871)	(△62,031,247,727)	(△60,542,995,519)
分 配 準 備 積 立 金	1,708,455,962	1,685,833,495	1,678,534,537	1,707,935,278	1,702,475,822	1,734,675,755
繰 越 損 益 金	△15,240,365,872	△15,482,872,043	△16,265,492,233	△15,837,141,255	△16,975,798,326	△15,821,914,173

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は146,139,036円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第215期	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期
(a) 経費控除後の配当等収益	117,351,410円	92,949,596円	86,103,184円	122,600,303円	88,708,526円	137,289,484円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	-	-	-	-	-	-
(c) 収益調整金	430,344,346	418,795,438	413,170,927	407,341,646	403,056,758	394,329,216
(d) 分配準備積立金	1,663,342,671	1,663,036,123	1,661,490,094	1,653,277,668	1,680,600,064	1,662,605,487
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,211,038,427	2,174,781,157	2,160,764,205	2,183,219,617	2,172,365,348	2,194,224,187
1万口当たり当期分配対象額	153.02	154.98	156.42	160.65	162.52	168.22
(f) 分配金	72,238,119	70,152,224	69,058,741	67,942,693	66,832,768	65,219,216
1万口当たり分配金	5	5	5	5	5	5

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第215期	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期
	5円	5円	5円	5円	5円	5円

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金(特別分配金)」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 組入れ投資信託証券の内容

投資信託証券の概要

ファンド名	・ P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	外国債券
運用の基本方針	ベンチマークを上回ることを目指して運用を行います。 P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。 P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。また、通常、資産の60%を社債等に投資します。 ・ 投資する債券は、原則として、取得時において、B B B - 1格相当以上とし、ポートフォリオの平均格付けはA - 1格以上とします。 ※格付けは、主要格付機関のいずれかからの格付けによるものとし、いずれの主要格付機関からの格付けもないものについては、P I M C O が同等の信用度を認めたものに投資することができるものとします。 ※保有する債券が、格下げにより、上記の最低格付けを下回った場合は、当該銘柄を継続して保有することがあります。 ・ オーストラリアドル建て以外の資産については、少なくともその85%を対オーストラリアドルでヘッジします（外貨建資産の対円でのヘッジは行いません。）。
決算日	年1回、原則として毎年2月末
分配方針	毎月、分配を行う方針です。
ベンチマーク	P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円ベース) P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・ ブルームバーグオーストラリア債券 (Credit) インデックス (円ベース)
主な投資制限	・ 株式関連証券への投資は、転換社債、優先株を除き行いません。 ・ 同一銘柄または同一発行者にかかる証券への投資は、政府系証券を除き、取得時において、純資産総額の10%以下とします。 ・ エマージングマーケットへの投資は、取得時において、純資産総額の10%以下とします。
運用管理費用	ありません。
その他の費用	ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。 これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資顧問会社	P I M C O (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、「P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」の情報を委託会社において抜粋・要約して翻訳したものを記載しています。

■ 損益計算書(2020年3月1日から2021年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

(単位：千)

投資収益：		
受取利息	AUD	15,993
総収益		15,993
費用：		
支払利息		18
弁護士費用		1
総費用		19
投資純利益		15,974
実現純利益（損失）：		
投資有価証券（外国税控除後）＊		25,346
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(9,154)
金融派生商品（OTC）		19,680
外国通貨		(4,531)
実現純利益		31,341
未実現評価益（評価損）の純変動額：		
投資有価証券		(79,916)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(3,069)
金融派生商品（OTC）		10,577
外貨建資産および負債		9,909
未実現評価損の純変動額		(62,499)
純損失		(31,158)
運用の結果による純資産の純減少額	AUD	(15,184)
*外国税	AUD	55

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

三井住友・豪ドル債ファンド

■ 投資明細表(2021年2月28日現在)

P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

		額面金額		時価				額面金額		時価	
		(単位:千)		(単位:千)				(単位:千)		(単位:千)	
投資有価証券	100.3%					6.625%	期日 04/07/2021	987		1,283	
							National Australia Bank Ltd.				
社債券等	18.5%					1.710%	期日 11/18/2030	AUD	500		507
銀行および金融	11.1%						Natwest Group PLC				
AAI Ltd.						2.000%	期日 03/08/2023	EUR	100		160
3.219%	期日 10/06/2042	AUD	1,000	AUD	1,026	2.500%	期日 03/22/2023		100		165
Barclays Bank PLC						2.875%	期日 09/19/2026	GBP	100		192
10.000%	期日 05/21/2021	GBP	4,100		7,556	4.269%	期日 03/22/2025	USD	400		566
BNG Bank NV							Nykredit Realkredit A/S				
3.250%	期日 07/15/2025	AUD	3,900		4,294	1.000%	期日 10/01/2050	DKK	48,573		9,962
BNP Paribas S. A.							QBE Insurance Group Ltd.				
1.795%	期日 09/03/2027		3,800		3,777	7.500%	期日 11/24/2043	USD	1,800		2,610
China Resources Land Ltd.							Santander UK Group Holdings PLC				
4.125%	期日 02/26/2029	USD	200		281	2.920%	期日 05/08/2026	GBP	200		383
Credit Agricole S. A.						3.571%	期日 01/10/2023	USD	200		265
4.400%	期日 07/06/2027	AUD	700		784		Standard Chartered PLC				
DBS Group Holdings Ltd.						2.900%	期日 06/28/2025	AUD	2,500		2,625
1.594%	期日 03/16/2028		2,400		2,421		Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
Deutsche Bank AG						4.436%	期日 04/02/2024	USD	1,600		2,268
3.750%	期日 01/30/2023		3,100		3,242		Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
4.250%	期日 10/14/2021	USD	1,300		1,717	3.150%	期日 05/12/2025		700		945
GAIF Bond Issuer Pty Ltd.											70,804
1.900%	期日 12/14/2028	AUD	2,300		2,204	一般事業	7.2%				
Goldman Sachs Group, Inc.							BlueScope Finance Americas LLC				
3.600%	期日 05/16/2023		1,000		1,061	4.625%	期日 05/25/2023		2,000		2,760
HSBC Holdings PLC							Boral Finance Pty Ltd.				
2.633%	期日 11/07/2025	USD	1,500		2,048	3.000%	期日 11/01/2022		200		266
3.950%	期日 05/18/2024		900		1,249		Incitec Pivot Finance LLC				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau						3.950%	期日 08/03/2027		4,400		6,208
4.000%	期日 02/27/2025	AUD	11,200		12,644		Pacific National Finance Pty Ltd.				
Landwirtschaftliche Rentenbank						4.750%	期日 03/22/2028		2,400		3,301
4.250%	期日 01/09/2025		3,000		3,402		Perth Airport Pty Ltd.				
Lloyds Banking Group PLC						5.500%	期日 03/25/2021	AUD	1,300		1,304
4.000%	期日 03/07/2025		800		875		Sands China Ltd.				
4.582%	期日 12/10/2025	USD	200		292	4.600%	期日 08/08/2023	USD	800		1,109
Macquarie Bank Ltd.											

三井住友・豪ドル債ファンド

		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)			額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Santos Finance Ltd.				Small Business Administration			
4.125% 期日 09/14/2027		6,500	8,975	5.090% 期日 10/01/2025		19	26
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.				米国政府機関債合計			
3.375% 期日 04/30/2025		200	278	379			
3.625% 期日 04/28/2026		300	421	(取得原価 AUD 345)			
3.900% 期日 03/22/2023		480	658	モーゲージ証券 15.6%			
Transurban Finance Co. Pty Ltd.				AFG Trust			
2.000% 期日 08/28/2025 EUR		400	675	0.910% 期日 04/10/2052 AUD	1,773		1,775
4.125% 期日 02/02/2026 USD		5,100	7,428	0.960% 期日 01/10/2052		1,191	1,194
Transurban Queensland Finance Pty Ltd.				Alternative Loan Trust			
4.900% 期日 12/08/2021 AUD		2,900	2,964	0.538% 期日 07/25/2046 USD		23	28
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.				0.771% 期日 11/20/2035			
1.320% 期日 09/14/2022		500	505			52	64
3.250% 期日 04/13/2021		3,200	3,210	American Home Mortgage Investment Trust			
Woodside Finance Ltd.				1.720% 期日 09/25/2045			
3.650% 期日 03/05/2025 USD		2,400	3,316			5	7
3.700% 期日 09/15/2026		610	851	Apollo Trust			
4.500% 期日 03/04/2029		980	1,405	1.360% 期日 02/08/2043 AUD		352	352
			45,634	1.560% 期日 07/13/2043		609	615
公共事業 0.2%				Atlas Funding			
APT Pipelines Ltd.				0.000% 期日 07/25/2058 GBP			
1.375% 期日 03/22/2022 EUR		600	956			200	362
AT&T, Inc.				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
1.264% 期日 09/19/2023 AUD		500	507	2.757% 期日 01/25/2035 USD		4	6
			1,463	CIT Mortgage Loan Trust			
社債券等合計			117,901	1.568% 期日 10/25/2037		88	114
(取得原価 AUD 113,197)				Citigroup Mortgage Loan Trust			
				2.400% 期日 03/25/2034		4	5
				3.042% 期日 08/25/2035		69	92
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
				2.762% 期日 11/25/2034		24	31
米国政府機関債 0.1%				Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
Fannie Mae				3.014% 期日 10/27/2059			
1.700% 期日 09/01/2044 USD		59	78			1,867	2,437
6.000% 期日 08/01/2026		50	72	Equity One Mortgage Pass-Through Trust			
6.000% 期日 04/25/2043		22	32	0.758% 期日 07/25/2034		7,678	9,381
6.000% 期日 02/25/2044		16	24	First Franklin Mortgage Loan Trust			
6.000% 期日 07/25/2044		90	134	0.278% 期日 11/25/2036		270	342
Freddie Mac				Firstmac Mortgage Funding Trust			
2.365% 期日 09/01/2035		4	5	1.490% 期日 12/10/2044 AUD		2,629	2,663
2.429% 期日 08/01/2035		6	8	Firstmac Mortgage Funding Trust No.4			
				1.060% 期日 03/08/2049		459	462

三井住友・豪ドル債ファンド

		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)			額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
1.205% 期日 01/17/2051		3,356	3,393	1.280% 期日 01/21/2052	AUD	2,510	2,538
1.255% 期日 01/16/2052		2,448	2,462	1.405% 期日 02/18/2048		2,233	2,295
1.310% 期日 03/08/2049		1,300	1,313	1.405% 期日 11/22/2042		1,139	1,143
Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
1.578% 期日 10/25/2044	USD	102	133	1.932% 期日 02/25/2033	USD	11	14
1.700% 期日 02/25/2045		174	225	3.868% 期日 05/25/2033		14	18
1.778% 期日 07/25/2044		41	52	Mill City Mortgage Loan Trust			
FWD Securitization Trust				2.750% 期日 08/25/2059		1,057	1,414
2.240% 期日 01/25/2050		1,203	1,600	Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			
GreenPoint Mortgage Funding Trust				0.228% 期日 10/25/2036		650	562
0.658% 期日 11/25/2045		20	23	National RMBS Trust			
GSR Mortgage Loan Trust				1.275% 期日 12/20/2047	AUD	962	980
2.928% 期日 09/25/2035		114	155	New Residential Mortgage Loan Trust			
HarborView Mortgage Loan Trust				2.750% 期日 07/25/2059	USD	1,746	2,372
0.301% 期日 07/21/2036		2	3	2.750% 期日 11/25/2059		2,056	2,796
IDOL Trust				3.500% 期日 10/25/2059		542	753
0.835% 期日 06/17/2045	AUD	267	267	4.500% 期日 05/25/2058		1,889	2,653
1.465% 期日 03/24/2047		733	743	Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust			
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust				2.391% 期日 10/25/2035		90	116
0.308% 期日 09/25/2046	USD	51	61	OBX Trust			
0.538% 期日 05/25/2046		13	16	0.768% 期日 06/25/2057		105	135
0.598% 期日 07/25/2035		13	16	Pepper I-Prime Trust			
Interstar Millennium Trust				0.905% 期日 03/18/2052	AUD	917	918
0.425% 期日 03/27/2038	AUD	44	43	1.205% 期日 11/23/2049		2,039	2,047
Kingfisher Trust				Pepper Residential Securities Trust No.20			
1.075% 期日 11/24/2048		1,965	1,993	1.205% 期日 09/16/2059	USD	1,499	1,502
Liberty				Pepper Residential Securities Trust No.22			
1.010% 期日 12/25/2051		1,944	1,946	1.111% 期日 06/20/2060		799	1,031
1.260% 期日 10/10/2049		1,963	1,966	Pepper Residential Securities Trust No.23			
Light Trust No.4				1.058% 期日 08/18/2060		795	1,028
1.405% 期日 03/22/2044		351	353	Pepper Residential Securities Trust No.24			
Long Beach Mortgage Loan Trust				1.008% 期日 11/18/2060		260	336
0.678% 期日 10/25/2034	USD	145	182	Pepper Residential Securities Trust No.25			
0.738% 期日 08/25/2033		2,318	2,949	1.040% 期日 03/12/2061		399	514
Luminent Mortgage Trust				1.290% 期日 03/12/2061	AUD	1,351	1,355
0.288% 期日 12/25/2036		37	47	Pepper Residential Securities Trust No.27			
0.518% 期日 10/25/2046		19	24	0.955% 期日 06/13/2062		706	707
Medallion Trust				Pepper Residential Securities Trust No.28			

三井住友・豪ドル債ファンド

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
0.905% 期日 04/17/2062	AUD	1,210		2,173	2,944
Progress Trust			WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
0.805% 期日 07/20/2046		1,152	0.638% 期日 11/25/2045	48	62
0.955% 期日 07/22/2045		639	0.658% 期日 12/25/2045	168	220
1.235% 期日 02/21/2048		1,804	1.138% 期日 04/25/2047	35	44
REDS Trust			3.710% 期日 06/25/2033	7	9
1.355% 期日 05/24/2044		272	Westpac Securitisation Trust		
Residential Asset Mortgage Products Trust			0.785% 期日 07/21/2045	AUD	463
0.678% 期日 06/25/2032	USD	3	0.805% 期日 01/18/2047	1,414	1,422
Resimac Bastille Trust			モーゲージ証券合計		99,139
0.960% 期日 12/05/2051	AUD	1,197	(取得原価 AUD 102,046)		
RESIMAC Bastille Trust			資産担保証券 1.6%		
0.963% 期日 12/05/2059	USD	719	Cairn CLO III BV		
1.043% 期日 09/05/2057		525	0.650% 期日 10/20/2028	EUR	505
RESIMAC Premier			Cairn CLO IV BV		
1.010% 期日 06/07/2051	AUD	968	0.930% 期日 04/30/2031		200
1.160% 期日 02/10/2051		2,338	Driver Australia Five Trust		313
1.310% 期日 02/07/2052		1,797	0.935% 期日 07/21/2026	AUD	410
Sapphire XXIII Trust			Driver Australia Four Trust		
0.905% 期日 06/21/2052		1,367	0.955% 期日 08/21/2025		57
0.955% 期日 05/21/2052		219	Driver Australia Six Trust		
1.655% 期日 05/21/2052		1,500	0.905% 期日 12/21/2027	1,343	1,346
Securitised Australian Mortgage Trust			Flexi Asset-Backed Securities Trust		
0.785% 期日 02/20/2046		1,041	0.910% 期日 04/14/2025	1,874	1,877
Silverstone Master Issuer PLC			Grosvenor Place CLO BV		
0.794% 期日 01/21/2070	USD	572	0.720% 期日 10/30/2029	EUR	1,066
Structured Asset Mortgage Investments II Trust			Monarch Grove CLO		
0.558% 期日 05/25/2046		31	1.098% 期日 01/25/2028	USD	977
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			Pepper SPARKZ Trust No.3		
1.123% 期日 11/25/2035		1,800	1.055% 期日 08/17/2028	AUD	2,116
1.623% 期日 04/25/2035		46	TICP CLO I Ltd.		
Superannuation Members Home Loan Securitisation Fund			1.024% 期日 07/20/2027	USD	447
1.185% 期日 04/27/2048	AUD	1,320	資産担保証券合計		10,438
TORRENS Trust			(取得原価 AUD 10,376)		
1.335% 期日 02/18/2048		873	ソブリン債 62.5%		
Towd Point Mortgage Trust			Asian Development Bank		
1.118% 期日 05/25/2058	USD	1,890			
1.118% 期日 10/25/2059		1,404			

三井住友・豪ドル債ファンド

		額面金額	時価			額面金額	時価
		(単位：千)	(単位：千)			(単位：千)	(単位：千)
3.750% 期日 03/12/2025	AUD	4,200	4,697	2.750% 期日 11/20/2025		15,000	23,567
Australia Government Bond				3.000% 期日 03/20/2028		700	767
0.250% 期日 11/21/2025		1,300	1,269	3.000% 期日 02/20/2030		9,800	10,666
0.500% 期日 09/21/2026		7,600	7,390	4.000% 期日 05/20/2026		20,700	23,842
1.750% 期日 06/21/2051		3,600	2,766	Northern Territory Treasury Corp.			
2.750% 期日 11/21/2028		10,600	11,546	2.000% 期日 05/21/2029		4,600	4,622
2.750% 期日 11/21/2029		6,800	7,379	3.500% 期日 05/21/2030		13,500	15,051
2.750% 期日 06/21/2035		5,500	5,819	4.100% 期日 11/21/2042		700	746
2.750% 期日 05/21/2041		14,300	14,458	Province of Alberta			
3.000% 期日 03/21/2047		4,800	4,951	3.600% 期日 04/11/2028		2,000	2,221
3.250% 期日 04/21/2029		3,600	4,055	Province of Ontario			
3.250% 期日 06/21/2039		12,700	13,966	3.100% 期日 08/26/2025		4,900	5,329
4.250% 期日 04/21/2026		12,200	14,276	3.500% 期日 01/27/2027		900	995
4.750% 期日 04/21/2027		13,800	16,740	Queensland Treasury Corp.			
Australian Capital Territory				3.250% 期日 07/21/2026		38,500	42,939
1.750% 期日 10/23/2031		6,900	6,623	4.200% 期日 02/20/2047		4,200	4,911
BNG Bank NV				4.750% 期日 07/21/2025		12,700	14,890
1.900% 期日 11/26/2025		2,500	2,610	South Australian Government Financing Authority			
3.500% 期日 07/19/2027		5,500	6,162	1.750% 期日 05/24/2034		12,100	11,032
EUROFIMA				3.000% 期日 05/24/2028		3,200	3,500
3.350% 期日 05/21/2029		4,500	4,937	Treasury Corp. of Victoria			
European Investment Bank				1.500% 期日 09/10/2031		9,900	9,249
2.900% 期日 10/17/2025		6,500	7,092	4.250% 期日 12/20/2032		2,500	3,012
4.750% 期日 08/07/2024		9,100	10,397	Western Australian Treasury Corp.			
International Bank for Reconstruction & Development				3.000% 期日 10/21/2026		2,000	2,208
2.200% 期日 02/27/2024		3,400	3,576	3.000% 期日 10/21/2027		10,000	11,005
4.250% 期日 06/24/2025		10,200	11,698	ソブリン債合計			
International Finance Corp.				(取得原価 AUD 388,244)			
1.250% 期日 02/06/2031		3,700	3,378	短期証券 2.0%			
4.000% 期日 04/03/2025		4,100	4,635	定期性預金 1.6%			
Kommunalbanken A/S				Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.000% 期日 12/09/2026		14,800	16,169	(0.060%) 期日 03/01/2021	AUD	478	478
4.250% 期日 07/16/2025		2,000	2,289	0.000% 期日 03/01/2021	USD	1,452	1,876
5.250% 期日 07/15/2024		8,900	10,274	0.010% 期日 03/01/2021	NZD	469	441
Nederlandse Waterschapsbank NV				Bank of Nova Scotia			
5.250% 期日 04/18/2024		7,000	8,007	0.000% 期日 03/01/2021	USD	184	238
New South Wales Treasury Corp.				BNP Paribas Bank			
2.000% 期日 03/08/2033		500	481				

三井住友・豪ドル債ファンド

			額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)				額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)			
(0.710%)	期日	03/01/2021	EUR	15	23	Royal Bank of Canada						
(0.060%)	期日	03/01/2021	AUD	1,286	1,286	0.000%	期日	03/01/2021	USD	43	56	
0.000%	期日	03/01/2021	USD	96	124	0.010%	期日	03/01/2021	CAD	6	6	
Brown Brothers Harriman & Co.					Sumitomo Mitsui Banking Corp.							
(0.710%)	期日	03/01/2021	EUR	1	1	(0.710%)	期日	03/01/2021	EUR	19	30	
(0.520%)	期日	03/01/2021	DKK	1	0	0.000%	期日	03/01/2021	USD	2,926	3,779	
(0.320%)	期日	03/01/2021	JPY	1	0	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.						
(0.290%)	期日	03/01/2021	SEK	1	0	(0.320%)	期日	03/01/2021	JPY	223	3	
(0.080%)	期日	03/01/2021	NOK	4	1	0.000%	期日	03/01/2021	GBP	1	1	
(0.060%)	期日	03/01/2021	AUD	20	20	0.000%	期日	03/01/2021	USD	161	207	
0.000%	期日	03/01/2021	USD	1	1	<hr/>						
0.010%	期日	03/01/2021	NZD	30	28	10,300						
3.050%	期日	03/01/2021	ZAR	240	21	日本国庫短期証券 0.4%						
Citibank N.A.					(0.087%) 期日 04/12/2021 JPY 190,000 USD					2,304		
(0.710%)	期日	03/01/2021	EUR	28	44	短期証券合計					12,604	
0.000%	期日	03/01/2021	USD	343	442	(取得原価 AUD 12,660)						
DBS Bank Ltd.					投資有価証券合計 100.3%					AUD	638,653	
0.000%	期日	03/01/2021		48	62	(取得原価 AUD 626,868)						
HSBC Bank PLC					金融派生商品 (1.2%)					(7,641)		
(0.710%)	期日	03/01/2021	EUR	55	86	(取得原価またはプレミアム、純額 AUD (2,876))						
JPMorgan Chase Bank N.A.					その他の資産および負債 (純額) 0.9%					5,771		
0.000%	期日	03/01/2021	USD	795	1,027	純資産 100.0%					AUD	636,783
MUFU Bank Ltd.												
(0.320%)	期日	03/01/2021	JPY	1,594	19							

■ 損益計算書(2020年3月1日から2021年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

(単位：千)

投資収益：		
受取利息	AUD	4,066
総収益		4,066
費用：		
支払利息		0
弁護士費用		1
総費用		1
投資純利益		4,065
実現純利益（損失）：		
投資有価証券（外国税控除後）＊		6,656
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		48
金融派生商品（OTC）		391
外国通貨		13
実現純利益		7,108
未実現評価益（評価損）の純変動額：		
投資有価証券		(9,585)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(470)
金融派生商品（OTC）		(186)
外貨建資産および負債		(52)
未実現評価損の純変動額		(10,293)
純損失		(3,185)
運用の結果による純資産の純増加額	AUD	880
*外国税	AUD	0

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

三井住友・豪ドル債ファンド

■ 投資明細表(2021年2月28日現在)

PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
投資有価証券 99.2%			4.250% 期日 11/22/2027	6,600	7,264
			National Australia Bank Ltd.		
社債券等 73.3%			1.710% 期日 11/18/2030	500	507
銀行および金融 46.9%			Scentre Group Trust 1		
Banco Santander S.A.			4.500% 期日 09/08/2021	2,300	2,325
1.662% 期日 01/19/2023	AUD 1,400	AUD 1,416	Wells Fargo & Co.		
Barclays PLC			1.331% 期日 07/27/2021	1,400	1,406
2.170% 期日 06/26/2024	750	778	Westpac Banking Corp.		
3.250% 期日 06/26/2024	3,000	3,178	3.120% 期日 03/10/2026	8,000	8,005
Citigroup, Inc.					73,885
1.560% 期日 05/04/2021	6,300	6,314	一般事業 18.7%		
3.750% 期日 10/27/2023	3,500	3,758	Aurizon Network Pty Ltd.		
Commonwealth Bank of Australia			2.900% 期日 09/02/2030	1,500	1,461
1.820% 期日 09/10/2030	2,800	2,850	4.000% 期日 06/21/2024	3,100	3,364
2.670% 期日 06/03/2026	1,900	1,910	Brisbane Airport Corp. Pty Ltd.		
Credit Agricole S.A.			3.900% 期日 04/24/2025	500	540
4.400% 期日 07/06/2027	3,000	3,360	Downer Group Finance Pty Ltd.		
Credit Suisse AG			3.700% 期日 04/29/2026	2,900	3,078
1.180% 期日 05/26/2023	3,200	3,256	Holcim Finance Australia Pty Ltd.		
Deutsche Bank AG			3.500% 期日 06/16/2022	3,700	3,802
1.410% 期日 01/30/2023	6,700	6,714	Incitec Pivot Ltd.		
GE Capital Australia Funding Pty Ltd.			4.300% 期日 03/18/2026	2,500	2,735
5.500% 期日 08/08/2022	1,900	2,027	Pacific National Finance Pty Ltd.		
Goldman Sachs Group, Inc.			3.700% 期日 09/24/2029	3,100	3,088
1.560% 期日 05/02/2024	7,500	7,691	Qantas Airways Ltd.		
3.600% 期日 05/16/2023	5,500	5,833	4.400% 期日 10/10/2023	1,500	1,591
HSBC Holdings PLC			7.750% 期日 05/19/2022	500	537
1.110% 期日 02/16/2024	2,000	2,004	Toyota Motor Credit Corp.		
Landwirtschaftliche Rentenbank			2.750% 期日 07/26/2021	4,000	4,040
4.250% 期日 01/09/2025	500	567	Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.		
Lendlease Finance Ltd.			3.100% 期日 04/17/2023	3,600	3,760
3.400% 期日 10/27/2027	1,900	1,956	WSO Finance Pty Ltd.		
Lloyds Banking Group PLC			4.500% 期日 03/31/2027	1,200	1,365
4.000% 期日 03/07/2025	700	766			29,361

三井住友・豪ドル債ファンド

		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)			額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
公共事業	7.7%			1.932% 期日 02/25/2033	USD	3	4
	AGL Energy Ltd.			Pepper Residential Securities Trust No.27			
	5.000% 期日 11/05/2021	2,700	2,722	0.955% 期日 06/13/2062	AUD	1,513	1,515
	AT&T, Inc.			Progress Trust			
	4.600% 期日 09/19/2028	3,400	3,894	1.555% 期日 06/18/2044		1,696	1,712
	DBNGP Finance Co. Pty Ltd.			モーゲージ証券合計			6,476
	4.225% 期日 05/28/2025	2,700	2,982	(取得原価 AUD 6,431)			
	Origin Energy Finance Ltd.						
	2.650% 期日 11/11/2027	2,500	2,517	ソブリン債 20.8%			
			12,115	Australia Government Bond			
社債券等合計			115,361	0.250% 期日 11/21/2025		500	488
(取得原価 AUD 113,071)				1.750% 期日 06/21/2051		3,500	2,689
				3.000% 期日 03/21/2047		2,600	2,682
米国政府機関債	0.0%			3.250% 期日 04/21/2029		1,200	1,352
	Fannie Mae			BNG Bank NV			
	0.518% 期日 06/25/2029	USD	1	3.500% 期日 07/19/2027		3,100	3,473
米国政府機関債合計			2	European Investment Bank			
(取得原価 AUD 2)				2.900% 期日 10/17/2025		1,100	1,200
				4.750% 期日 08/07/2024		2,500	2,857
モーゲージ証券	4.1%			Kommunalbanken A/S			
	AFG Trust			3.000% 期日 12/09/2026		3,600	3,933
	0.960% 期日 01/10/2052	AUD	893	895	Northern Territory Treasury Corp.		
	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			2.000% 期日 05/21/2029		4,000	4,019
	0.778% 期日 02/25/2035	USD	13	16	Treasury Corp. of Victoria		
	0.798% 期日 02/25/2035		14	17	4.250% 期日 12/20/2032		2,000
	CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			Western Australian Treasury Corp.			
	2.595% 期日 07/25/2033		13	17	3.000% 期日 10/21/2026		6,800
	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates			223	3.250% 期日 07/20/2028		200
	1.778% 期日 07/25/2044		10	13	ソブリン債合計		32,832
	Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates				(取得原価 AUD 31,904)		
	3.170% 期日 10/25/2033		9	13			
	Liberty				短期証券 1.0%		
	1.010% 期日 12/25/2051	AUD	498	499	定期性預金 1.0%		
	Medallion Trust				Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
	1.405% 期日 03/21/2044		1,751	1,775	(0.060%) 期日 03/01/2021	USD	182
	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0.000% 期日 03/01/2021		156
							202

三井住友・豪ドル債ファンド

		額面金額			時価		
		(単位：千)			(単位：千)		
		(単位：千)			(単位：千)		
Bank of Nova Scotia					Royal Bank of Canada		
0.000% 期日 03/01/2021		20		26	0.000% 期日 03/01/2021	USD 5	6
BNP Paribas Bank					Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.710%) 期日 03/01/2021	EUR	0		1	(0.710%) 期日 03/01/2021	EUR 0	1
(0.060%) 期日 03/01/2021	AUD	490		490	0.000% 期日 03/01/2021	USD 315	407
0.000% 期日 03/01/2021	USD	10		13	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
Brown Brothers Harriman & Co.					(0.320%) 期日 03/01/2021	JPY 1	0
(0.060%) 期日 03/01/2021	AUD	8		8	0.000% 期日 03/01/2021	USD 17	22
Citibank N.A.							<u>1,526</u>
(0.710%) 期日 03/01/2021	EUR	1		1	短期証券合計		<u>1,526</u>
0.000% 期日 03/01/2021	USD	37		48	(取得原価 AUD 1,526)		
DBS Bank Ltd.					投資有価証券合計 99.2%	AUD	156,197
0.000% 期日 03/01/2021		5		7	(取得原価 AUD 152,934)		
HSBC Bank PLC					金融派生商品 (0.1%)		(141)
(0.710%) 期日 03/01/2021	EUR	1		2	(取得原価またはプレミアム、純額 AUD 0)		
JPMorgan Chase Bank N.A.					その他の資産および負債 (純額) 0.9%		<u>1,351</u>
0.000% 期日 03/01/2021	USD	86		110	純資産 100.0%	AUD	<u>157,407</u>
MUFG Bank Ltd.							
(0.320%) 期日 03/01/2021	JPY	5		0			