

## ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

# 三井住友・ 豪ドル債ファンド

## 【運用報告書(全体版)】

第41作成期（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

第 239 期 / 第 240 期 / 第 241 期  
決算日2023年6月5日 決算日2023年7月5日 決算日2023年8月7日

第 242 期 / 第 243 期 / 第 244 期  
決算日2023年9月5日 決算日2023年10月5日 決算日2023年11月6日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

### ■ 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合) インデックス (円換算ベース)		投資信託 証券組入 率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率		
	円	円	%	円	%	%	百万円
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
221期(2021年12月6日)	4,097	5	△4.8	251.20	△4.6	98.9	52,466
222期(2022年1月5日)	4,321	5	5.6	264.91	5.5	98.1	54,779
223期(2022年2月7日)	4,132	5	△4.3	253.38	△4.3	99.3	51,712
224期(2022年3月7日)	4,219	5	2.2	260.17	2.7	99.1	52,284
225期(2022年4月5日)	4,451	5	5.6	275.21	5.8	99.4	54,190
226期(2022年5月6日)	4,330	5	△2.6	268.31	△2.5	99.0	51,593
227期(2022年6月6日)	4,379	5	1.2	272.17	1.4	98.9	51,654
228期(2022年7月5日)	4,210	5	△3.7	267.78	△1.6	98.9	49,020
229期(2022年8月5日)	4,354	5	3.5	272.27	1.7	98.8	49,888
230期(2022年9月5日)	4,401	5	1.2	275.49	1.2	98.9	49,938
231期(2022年10月5日)	4,289	5	△2.4	269.63	△2.1	99.0	47,996
232期(2022年11月7日)	4,288	5	0.1	270.54	0.3	99.1	47,594
233期(2022年12月5日)	4,263	5	△0.5	269.06	△0.6	98.9	47,034
234期(2023年1月5日)	4,115	5	△3.4	259.70	△3.5	98.8	45,146
235期(2023年2月6日)	4,288	5	4.3	270.33	4.1	99.0	46,692
236期(2023年3月6日)	4,201	5	△1.9	265.43	△1.8	99.0	45,418
237期(2023年4月5日)	4,202	5	0.1	266.08	0.2	99.0	44,910
238期(2023年5月8日)	4,293	5	2.3	272.13	2.3	98.8	45,502
239期(2023年6月5日)	4,290	5	0.0	272.05	△0.0	99.0	45,117
240期(2023年7月5日)	4,413	5	3.0	280.45	3.1	99.0	45,572
241期(2023年8月7日)	4,267	5	△3.2	270.76	△3.5	99.3	43,674
242期(2023年9月5日)	4,350	5	2.1	276.46	2.1	99.0	44,126
243期(2023年10月5日)	4,232	5	△2.6	269.48	△2.5	98.9	42,605
244期(2023年11月6日)	4,357	5	3.1	278.04	3.2	98.9	43,382

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

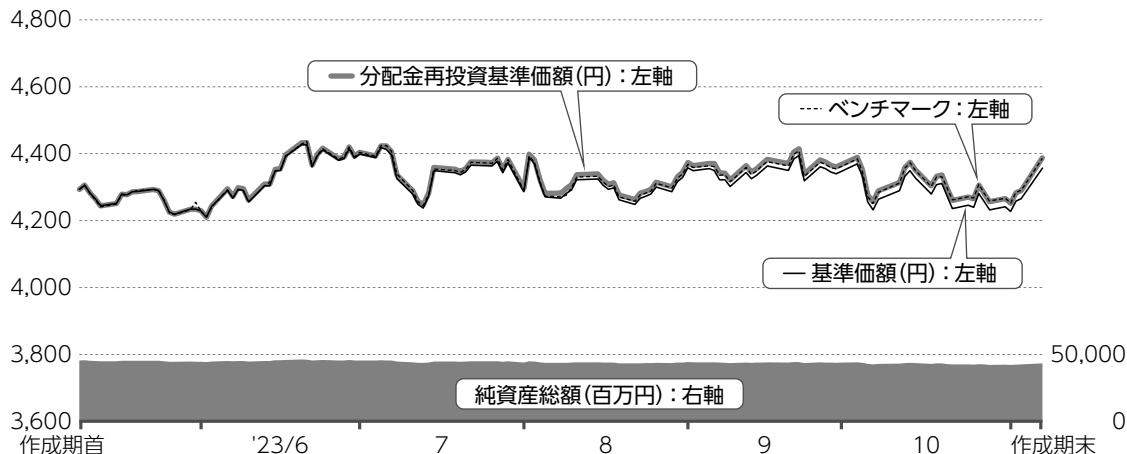
決算期	年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円換算ベース)		投資信託 証券組入 比 率
			騰 落 率		騰 落 率	
第239期	(期 首) 2023年5月8日	円	%		%	%
	5月末	4,293	—	272.13	—	98.8
		4,229	△1.5	268.01	△1.5	99.0
第240期	(期 末) 2023年6月5日	4,295	0.0	272.05	△0.0	99.0
	(期 首) 2023年6月5日	4,290	—	272.05	—	99.0
	6月末	4,399	2.5	279.17	2.6	98.6
第241期	(期 末) 2023年7月5日	4,418	3.0	280.45	3.1	99.0
	(期 首) 2023年7月5日	4,413	—	280.45	—	99.0
	7月末	4,286	△2.9	271.93	△3.0	99.0
第242期	(期 末) 2023年8月7日	4,272	△3.2	270.76	△3.5	99.3
	(期 首) 2023年8月7日	4,267	—	270.76	—	99.3
	8月末	4,358	2.1	276.88	2.3	98.7
第243期	(期 末) 2023年9月5日	4,355	2.1	276.46	2.1	99.0
	(期 首) 2023年9月5日	4,350	—	276.46	—	99.0
	9月末	4,347	△0.1	276.50	0.0	98.7
第244期	(期 末) 2023年10月5日	4,237	△2.6	269.48	△2.5	98.9
	(期 首) 2023年10月5日	4,232	—	269.48	—	98.9
	10月末	4,227	△0.1	269.59	0.0	98.6
	(期 末) 2023年11月6日	4,362	3.1	278.04	3.2	98.9

※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(2023年5月9日から2023年11月6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	4,293円
作成期末 (当作成期既払分配金30円(税引前))	4,357円
騰落率 (分配金再投資ベース)	+2.2%

## 分配金再投資基準価額について

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

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

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

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

**基準価額の主な変動要因(2023年5月9日から2023年11月6日まで)**

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

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

**上昇要因**

- 債券利子収入を享受したこと
- 為替市場において、豪ドル高・円安が進行したこと

**下落要因**

- オーストラリアの金利が上昇(債券価格は下落)したこと

投資環境について(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

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

## 債券市場

期の前半は、RBA(オーストラリア準備銀行)による連続利上げなどがオーストラリア国債利回りの上昇要因となったことに加え、米インフレの高止まりを受けてパウエルFRB(米連邦準備制度理事会)が7月、9月に連続利上げを行う可能性を示唆したことを背景に世界的に金利が上昇基調となるなか、オーストラリア国債利回りも上昇しました。

期の後半は、豪労働市場の緩和やインフレ率の鈍化が確認されたことを受けて、景気やリスクを評価するためにRBAが4会合連続で政策金利を据え置いたことが、オーストラリア国債利回りの低下要因となったものの、ブロック新RBA総裁による追加利上げへの言及やインフレ率の上振れなどにより、オーストラリア国債利回りは上昇しました。

## 為替市場

期の前半は、RBAの連続利上げが豪ドル高要因となったものの、予想を下回る中国経済指標が嫌気され、対米ドルで豪ドル安が進行しました。対円では、FRBによる利上げ再開期待が高まるなか米ドル高・円安が進行したことから、上昇基調となりました。

期の後半は、RBAが4会合連続で政策金利の据え置きを決定したことや、中東情勢の緊迫化を受けたリスク回避姿勢の高まりが豪ドル安要因となり、豪ドルは対円で下落した局面もありました。

期を通じては、豪ドル高・円安となりました。

ポートフォリオについて(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

## 当ファンド

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

## 組入れファンド

### ●デュレーション(投資資金の平均回収期間: 金利の変動による債券価格の感応度)戦略

オーストラリアのデュレーション戦略では、当作成期はニュートラルから小幅オーバーウェイトで調整しました。また、米国やニュージーランドをオーバーウェイトとする一方、日本をアンダーウェイトとし、ポートフォリオ全体のデュレーションをアンダーウェイトとしました。

### ●イールドカーブ(利回り曲線)戦略

イールドカーブ戦略では、利上げ最終局面であるとの見方から、今後、金利低下が見込まれる短～中期ゾーンを中心にオーバーウェイトとする一方、長期ゾーンについてはアンダーウェイトとしました。

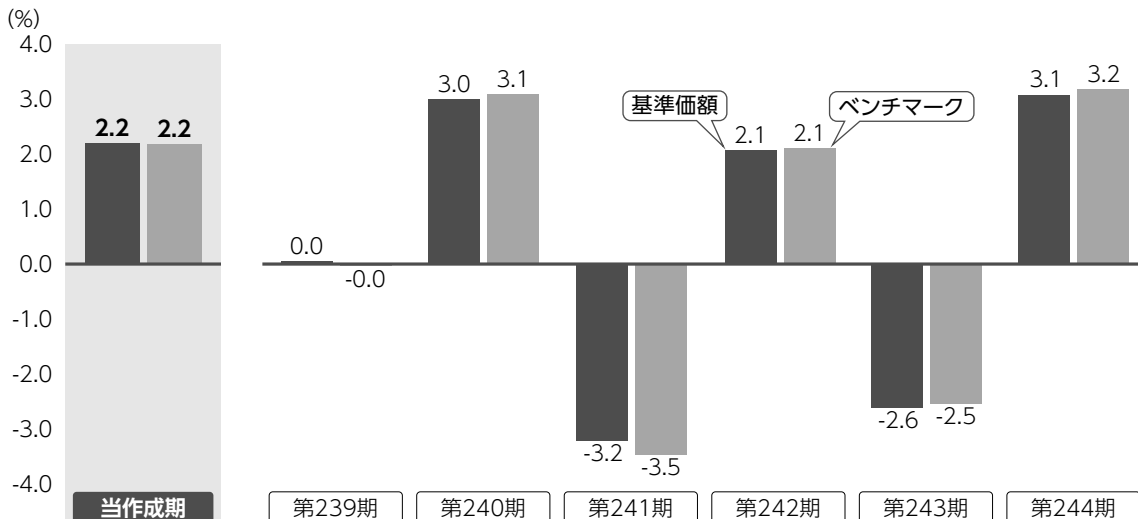
### ●種別配分

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

ベンチマークとの差異について(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

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

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※当作成期の基準価額は分配金再投資ベース、各期は分配金(税引前)込み。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+2.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+2.2%と概ね同水準となりました。

プラス要因

- 日本や米国長期ゾーンの金利リスクを売持ちとしていたこと

マイナス要因

- 通貨戦略で米ドルを保有していたこと



## 分配金について(2023年5月9日から2023年11月6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239期	第240期	第241期	第242期	第243期	第244期
当期分配金	5	5	5	5	5	5
(対基準価額比率)	(0.12%)	(0.11%)	(0.12%)	(0.11%)	(0.12%)	(0.11%)
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	228	234	236	242	243	249

※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

先進国では足元の景気に底堅さがみられるものの、これまでの金融引き締めによる影響が徐々に波及することで、2024年の景気は減速する可能性が高いとみております。足元における景気の底堅さの背景としては、特に米国では過去の低金利時において長期固定金

利で住宅ローンの借り入れを行った世帯が大半を占めており、これまでの急速な金利上昇が消費に与えるマイナスの影響が限定的となっていることが挙げられます。ただし、政策金利が高水準にとどまる期間が長期化することに伴い、金融引き締めの影響が蓄積され個人消費や投資を圧迫するとみています。なお、欧米の中央銀行による金融引き締めは最終局面に近いとみていますが、インフレ率が中央銀行の目標水準まで低下するには時間を要すると想定されることから、利下げは慎重に進められるものと考えられます。ただし、オーストラリア、ニュージーランド、カナダといった変動金利型の住宅ローンの割合が大きい国々は、想定よりも早いペースで利下げ

が進む可能性があるかとみています。

オーストラリアについては、国内の労働市場のひっ迫を背景とした高水準の賃金インフレや政策目標を上回るCPI(消費者物価指数)などを踏まえ、これまでRBAが積極的な利上げを行ってきた点はオーストラリア債券の下押し要因となっております。一方で、利上げによってオーストラリア債券利回りの上昇は中長期的なパフォーマンスの下支えになると期待されます。

かかる環境下、「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も小幅に多めとしています。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 (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
<b>(a) 信託報酬</b>	29円	0.670%	<b>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)</b> <span style="border: 1px solid black; padding: 2px;">期中の平均基準価額は4,312円です。</span>
（投信会社）	(15)	(0.344)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(13)	(0.311)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.016)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
<b>(b) 売買委託手数料</b>	-	-	<b>売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数</b>
（株式）	(-)	(-)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
<b>(c) 有価証券取引税</b>	-	-	<b>有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数</b>
（株式）	(-)	(-)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
<b>(d) その他費用</b>	0	0.001	<b>その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数</b>
（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
<b>合計</b>	<b>29</b>	<b>0.672</b>	

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

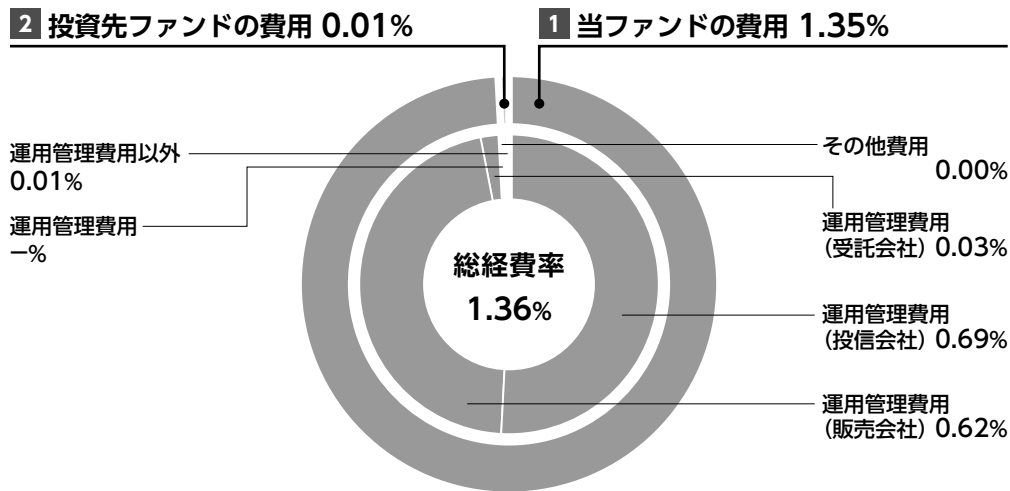
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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



## 参考情報 総経費率(年率換算)



<b>総経費率(1 + 2)</b>	<b>1.36%</b>
<b>1 当ファンドの費用の比率</b>	<b>1.35%</b>
<b>2 投資先ファンドの運用管理費用の比率</b>	<b>-%</b>
<b>投資先ファンドの運用管理費用以外の比率</b>	<b>0.01%</b>

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

※ **2**の投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く))の費用は、運用管理費用と運用管理費用以外の費用を、目論見書に記載している料率にもとづき区別しています。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。ただし、投資先ファンドでの運用管理費用は、当ファンドの運用委託報酬の中から負担しているため、開示すべき運用管理費用はありません。

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

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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.36%です。

■ ■ 当作成期中の売買及び取引の状況(2023年5月9日から2023年11月6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	—	—	215,103	2,058,837
	PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	—	—	73,105	514,690

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

■ ■ 利害関係人との取引状況等(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2023年5月9日から2023年11月6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(2023年11月6日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	作成期首	作 成 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
	口	口	千円	%
PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド	3,770,168	3,555,065	34,157,064	78.7
PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド	1,297,722	1,224,617	8,768,257	20.2
合 計	5,067,890	4,779,682	42,925,322	98.9

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### ■ 投資信託財産の構成

(2023年11月6日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	42,925,322	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	607,009	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	43,532,331	100.0

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月5日) (2023年7月5日) (2023年8月7日) (2023年9月5日) (2023年10月5日) (2023年11月6日)

項 目	第239期末	第240期末	第241期末	第242期末	第243期末	第244期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>45,248,062,219円</b>	<b>45,759,827,485円</b>	<b>43,824,518,309円</b>	<b>44,285,846,672円</b>	<b>42,742,646,281円</b>	<b>43,532,331,358円</b>
コール・ローン等	586,783,105	641,115,921	453,036,030	610,895,501	595,776,936	607,009,118
投資信託受益証券(評価額)	44,661,279,114	45,118,711,564	43,371,482,279	43,674,951,171	42,146,869,345	42,925,322,240
<b>(B) 負 債</b>	<b>131,004,608</b>	<b>187,214,068</b>	<b>150,468,070</b>	<b>158,883,976</b>	<b>136,771,078</b>	<b>149,866,336</b>
未払収益分配金	52,580,708	51,631,901	51,174,542	50,716,627	50,342,173	49,780,406
未払解約金	31,745,013	84,982,099	44,751,596	60,996,565	37,610,613	49,321,352
未払信託報酬	46,515,928	50,436,364	54,377,640	47,006,298	48,654,821	50,601,720
その他未払費用	162,959	163,704	164,292	164,486	163,471	162,858
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>45,117,057,611</b>	<b>45,572,613,417</b>	<b>43,674,050,239</b>	<b>44,126,962,696</b>	<b>42,605,875,203</b>	<b>43,382,465,022</b>
元 本	105,161,416,814	103,263,803,595	102,349,084,330	101,433,255,999	100,684,347,158	99,560,812,987
次期繰越損益金	△ 60,044,359,203	△ 57,691,190,178	△ 58,675,034,091	△ 57,306,293,303	△ 58,078,471,955	△ 56,178,347,965
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>105,161,416,814口</b>	<b>103,263,803,595口</b>	<b>102,349,084,330口</b>	<b>101,433,255,999口</b>	<b>100,684,347,158口</b>	<b>99,560,812,987口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>4,290円</b>	<b>4,413円</b>	<b>4,267円</b>	<b>4,350円</b>	<b>4,232円</b>	<b>4,357円</b>

※当作成期における作成期首元本額105,986,647,261円、作成期中追加設定元本額391,101,715円、作成期中一部解約元本額6,816,935,989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2023年5月9日) (自2023年6月6日) (自2023年7月6日) (自2023年8月8日) (自2023年9月6日) (自2023年10月6日)  
 至2023年6月5日 至2023年7月5日 至2023年8月7日 至2023年9月5日 至2023年10月5日 至2023年11月6日

項 目	第239期	第240期	第241期	第242期	第243期	第244期
(A) 配 当 等 取 益	119,514,943円	117,768,827円	116,731,188円	115,283,305円	114,506,977円	113,233,185円
受 取 配 当 金	119,539,411	117,802,835	116,753,338	115,310,782	114,532,726	113,241,852
受 取 利 息	73	2,167	631	2,474	1,473	42
支 払 利 息	△ 24,541	△ 36,175	△ 22,781	△ 29,951	△ 27,222	△ 8,709
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 52,310,460	1,252,138,261	△ 1,506,953,490	824,556,477	△ 1,211,602,386	1,237,932,835
売 買 損 益	54,346,283	1,266,585,572	8,210,985	828,338,794	2,582,777	1,241,704,866
売 買 損 益	△ 106,656,743	△ 14,447,311	△ 1,515,164,475	△ 3,782,317	△ 1,214,185,163	△ 3,772,031
(C) 信 託 報 酬 等	△ 46,678,479	△ 50,599,839	△ 54,540,769	△ 47,169,888	△ 48,817,621	△ 50,764,097
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	20,526,004	1,319,307,249	△ 1,444,763,071	892,669,894	△ 1,145,913,030	1,300,401,923
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△11,365,483,437	△11,184,470,709	△ 9,822,816,714	△11,200,886,511	△10,276,509,838	△11,337,873,295
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△48,646,821,062	△47,774,394,817	△47,356,279,764	△46,947,360,059	△46,605,706,914	△46,091,096,187
( 配 当 等 相 当 額 )	( 340,393,252)	( 335,269,155)	( 333,336,445)	( 333,217,905)	( 331,775,421)	( 329,104,950)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△48,987,214,314)	(△48,109,663,972)	(△47,689,616,209)	(△47,280,577,964)	(△46,937,482,335)	(△46,420,201,137)
(G) 合 計 ( D + E + F )	△59,991,778,495	△57,639,558,277	△58,623,859,549	△57,255,576,676	△58,028,129,782	△56,128,567,559
(H) 収 益 分 配 金	△ 52,580,708	△ 51,631,901	△ 51,174,542	△ 50,716,627	△ 50,342,173	△ 49,780,406
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△60,044,359,203	△57,691,190,178	△58,675,034,091	△57,306,293,303	△58,078,471,955	△56,178,347,965
追 加 信 託 差 損 益 金	△48,646,821,062	△47,774,394,817	△47,356,279,764	△46,947,360,059	△46,605,706,914	△46,091,096,187
( 配 当 等 相 当 額 )	( 340,393,252)	( 335,269,155)	( 333,336,445)	( 333,217,905)	( 331,775,421)	( 329,104,950)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△48,987,214,314)	(△48,109,663,972)	(△47,689,616,209)	(△47,280,577,964)	(△46,937,482,335)	(△46,420,201,137)
分 配 準 備 積 立 金	2,065,639,972	2,090,955,328	2,083,652,741	2,122,096,759	2,121,755,926	2,157,554,963
繰 越 損 益 金	△13,463,178,113	△12,007,750,689	△13,402,407,068	△12,481,030,003	△13,594,520,967	△12,244,806,741

※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110,106,994円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第239期	第240期	第241期	第242期	第243期	第244期
(a) 経費控除後の配当等収益	72,836,464円	113,417,241円	62,190,419円	109,495,560円	65,689,356円	108,979,154円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	340,393,252	335,269,155	333,336,445	333,217,905	331,775,421	329,104,950
(d) 分配準備積立金	2,045,384,216	2,029,169,988	2,072,636,864	2,063,317,826	2,106,408,743	2,098,356,215
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,458,613,932	2,477,856,384	2,468,163,728	2,506,031,291	2,503,873,520	2,536,440,319
1万口当たり当期分配対象額	233.79	239.95	241.15	247.06	248.69	254.76
(f) 分配金	52,580,708	51,631,901	51,174,542	50,716,627	50,342,173	49,780,406
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239期	第240期	第241期	第242期	第243期	第244期
	5円	5円	5円	5円	5円	5円

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

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

## ■ 組入れ投資信託証券の内容

## 投資信託証券の概要

ファンド名	・ PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	オーストラリアドル建て・ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等
運用の基本方針	ベンチマークを上回ることを目指して運用を行います。 PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。 PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。また、通常、資産の60%を社債等に投資します。 ・ 投資する債券は、原則として、取得時において、BBB－格相当以上とし、ポートフォリオの平均格付けはA－格以上とします。 ※格付けは、主要格付機関のいずれかからの格付けによるものとし、いずれの主要格付機関からの格付けもないものについては、PIMCOが同等の信用度を認めたものに投資することができるとします。 ※保有する債券が、格下げにより、上記の最低格付けを下回った場合は、当該銘柄を継続して保有することがあります。 ・ オーストラリアドル建て以外の資産については、少なくともその85%を対オーストラリアドルでヘッジします（外貨建資産の対円でのヘッジは行いません。）。
ベンチマーク	PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド ・ ブルームバークオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円ベース) PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド ・ ブルームバークオーストラリア債券 (Credit) インデックス (円ベース)
主な投資制限	・ 株式関連証券への投資は、転換社債、優先株を除き行いません。 ・ 同一銘柄または同一発行者にかかる証券への投資割合は、政府系証券を除き、取得時において、純資産額の10%以下とします。 ・ エマージングマーケットへの投資割合は、取得時において、純資産額の10%以下とします。 ・ 非流動性資産への投資割合は、純資産総額の15%以下とします。
分配方針	毎月、分配を行う方針です。
運用管理費用	ありません。
その他の費用	ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。 これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
投資顧問会社	PIMCO (パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

以下には、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」の情報を委託会社において抜粋、要約して翻訳したものを記載しています。



## ■ 損益計算書(2022年3月1日から2023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	11,674
総収益		11,674
費用：		
支払利息		43
総費用		43
投資純損益		11,631
実現純損益：		
投資有価証券		(9,759)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(7,182)
金融派生商品（OTC）		(277)
外国通貨		141
実現純損益		(17,077)
未実現評価損益の純変動額：		
投資有価証券		(23,780)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		452
金融派生商品（OTC）		(5,025)
外貨建資産および負債		298
未実現評価損益の純変動額		(28,055)
純損益		(45,132)
運用の結果による純資産の純増減額	AUD	(33,501)

# 三井住友・豪ドル債ファンド

## ■ 投資明細表(2023年2月28日現在)

### PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

額面金額		時価		額面金額		時価		額面金額		時価	
(単位:千)		(単位:千)		(単位:千)		(単位:千)		(単位:千)		(単位:千)	
<b>投資有価証券 97.7%</b>											
<b>社債券等 12.3%</b>											
<b>銀行および金融 9.2%</b>											
<b>APPF Commercial Finance Pty Ltd.</b>											
3.600% due 11/11/2031	AUD	1,400	AUD	1,138							
<b>Barclays PLC</b>											
4.725% due 05/20/2027		3,500		3,429							
<b>Commonwealth Bank of Australia</b>											
3.784% due 03/14/2032	\$	800		997							
4.795% due 08/20/2031	AUD	700		684							
<b>Credit Agricole S.A.</b>											
4.400% due 07/06/2027		700		653							
<b>Credit Suisse Group AG</b>											
3.091% due 05/14/2032	\$	1,000		1,044							
3.500% due 03/08/2024	AUD	700		700							
6.373% due 07/15/2026	\$	1,700		2,372							
<b>DBS Bank Ltd.</b>											
4.678% due 02/24/2026	AUD	600		600							
<b>HSBC Holdings PLC</b>											
2.251% due 11/22/2027	\$	900		1,175							
2.633% due 11/07/2025		1,500		2,108							
<b>ICPF Finance Pty Ltd.</b>											
2.725% due 10/11/2030	AUD	1,300		1,036							
<b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>											
4.000% due 02/27/2025		4,300		4,284							
<b>Landwirtschaftliche Rentenbank</b>											
4.250% due 01/09/2025		3,500		3,503							
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>											
4.582% due 12/10/2025	\$	200		285							
<b>Macquarie Bank Ltd.</b>											
6.082% due 06/07/2032	AUD	1,100		1,086							
<b>NatWest Group PLC</b>											
2.875% due 03/19/2026	GBP	100		168							
4.269% due 03/22/2025	\$	400		583							
<b>NatWest Markets PLC</b>											
5.055% due 08/12/2025	AUD	1,600		1,582							
<b>QBE Insurance Group Ltd.</b>											
7.500% due 11/24/2043	\$	1,800		2,680							
<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>											
2.920% due 05/08/2026	GBP	200		336							
<b>Standard Chartered PLC</b>											
2.900% due 06/28/2025	AUD	2,500		2,408							
<b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>											
4.436% due 04/02/2024	\$	1,600		2,337							
<b>Westpac Banking Corp.</b>											
4.800% due 02/18/2028	AUD	1,100		1,094							
				<b>36,282</b>							
<b>一般事業 2.1%</b>											
<b>Incitec Pivot Finance LLC</b>											
3.950% due 08/03/2027	\$	2,200		2,988							
<b>Pacific National Finance Pty Ltd.</b>											
4.750% due 03/22/2028		2,400		3,279							
<b>Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.</b>											
3.375% due 04/30/2025		200		283							
3.625% due 04/28/2026		300		419							
3.900% due 03/22/2023		480		711							
<b>WestConnex Finance Co. Pty Ltd.</b>											
3.150% due 03/31/2031	AUD	500		404							
				<b>8,094</b>							
<b>公共事業 1.0%</b>											
<b>AT&amp;T, Inc.</b>											
4.451% due 09/19/2023		500		501							
<b>Santos Finance Ltd.</b>											
4.125% due 09/14/2027	\$	1,800		2,447							
<b>Woodside Finance Ltd.</b>											
3.700% due 09/15/2026		610		850							
				<b>3,798</b>							
<b>社債券等合計</b>											
<b>(取得原価 AUD 48,039)</b>											
<b>米政府機関債 0.0%</b>											
<b>Fannie Mae</b>											
3.628% due 09/01/2044	\$	42		59							
6.000% due 08/01/2026		20		30							
6.000% due 04/25/2043		16		25							
6.000% due 02/25/2044		12		18							
6.000% due 07/25/2044		62		92							
<b>Freddie Mac</b>											
3.981% due 08/01/2035		4		6							
4.021% due 09/01/2035		1		2							
<b>Small Business Administration</b>											
5.090% due 10/01/2025		8		11							
<b>米政府機関債合計</b>											
				<b>243</b>							
<b>(取得原価 AUD 218)</b>											
<b>米政府→社債 13.9%</b>											
<b>Alternative Loan Trust</b>											
5.037% due 07/25/2046		16		21							
5.251% due 11/20/2035		35		47							
<b>Atlas Funding PLC</b>											
4.835% due 07/25/2058	GBP	160		286							
<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>											
3.958% due 01/25/2035	\$	2		3							
<b>Bluestone Prime Trust</b>											
4.072% due 06/21/2053	AUD	1,466		1,452							
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>											
3.906% due 08/25/2035	\$	33		47							
4.323% due 03/25/2034		3		4							
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>											
3.792% due 10/25/2034		17		23							
<b>Credit Suisse Mortgage Capital</b>											
1.756% due 10/25/2066		1,296		1,594							
<b>Equity One Mortgage Pass-Through Trust</b>											
4.356% due 07/25/2034		6,977		10,055							
<b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>											
4.777% due 11/25/2036		100		145							
<b>Firstmac Mortgage Funding Trust No.4</b>											
4.060% due 10/24/2052	AUD	992		980							
4.310% due 03/08/2049		166		166							
4.505% due 01/17/2051		1,422		1,419							
4.560% due 03/08/2049		1,300		1,300							
<b>Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates</b>											
3.422% due 02/25/2045	\$	117		174							
3.983% due 10/25/2044		68		95							
4.193% due 07/25/2044		26		37							
<b>FWD Securitization Trust</b>											
2.240% due 01/25/2050		417		560							
<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>											
5.157% due 11/25/2045		15		20							
<b>GSR Mortgage Loan Trust</b>											
4.040% due 09/25/2035		69		95							
<b>IDOL Trust</b>											
4.790% due 03/24/2047	AUD	385		385							
<b>IndyMac INDX Mortgage Loan Trust</b>											
4.997% due 09/25/2046	\$	37		48							
5.037% due 05/25/2046		9		12							
5.097% due 07/25/2035		9		13							
<b>Interstar Millennium Trust</b>											
3.779% due 03/27/2038	AUD	30		28							
<b>Kingfisher Trust</b>											
4.404% due 11/24/2048		1,218		1,217							
<b>La Trobe Financial Capital Markets Trust</b>											
4.065% due 01/14/2053		873		866							
4.602% due 02/11/2051		888		888							
<b>Liberty PRIME</b>											
4.108% due 11/25/2052		467		464							
<b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>											
5.177% due 10/25/2034	\$	145	AUD	199							
5.237% due 08/25/2033		1,711		2,433							
<b>Luminant Mortgage Trust</b>											
4.957% due 12/25/2036		26		33							
5.017% due 10/25/2046		14		18							
<b>Medallion Trust</b>											
4.626% due 01/21/2052	AUD	1,299		1,299							
4.710% due 02/18/2048		1,420		1,429							
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>											
2.969% due 05/25/2033	\$	9		12							
3.957% due 02/25/2033		6		9							
<b>Mill City Mortgage Loan Trust</b>											
2.750% due 08/25/2059		589		825							
<b>Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust</b>											
4.727% due 10/25/2036		554		408							
<b>National RMBS Trust</b>											
4.590% due 12/20/2047	AUD	566		568							
<b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>											
2.750% due 07/25/2058	\$	1,039		1,441							
2.750% due 11/25/2058		1,215		1,681							
3.500% due 10/25/2058		320		435							
4.500% due 05/25/2058		1,153		1,581							
<b>Namura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust</b>											
3.519% due 10/25/2035		71		64							
<b>OBX Trust</b>											
5.267% due 08/25/2057		55		77							
<b>Pepper Residential Securities Trust No.20</b>											
4.544% due 09/18/2050	AUD	697		696							
<b>Pepper Residential Securities Trust No.22</b>											
5.591% due 08/20/2060	\$	155		229							
<b>Pepper Residential Securities Trust No.23</b>											
5.541% due 08/18/2060		187		277							
<b>Pepper Residential Securities Trust No.24</b>											
5.491% due 11/18/2060		52		77							
<b>Pepper Residential Securities Trust No.25</b>											
4.532% due 03/12/2061	AUD	521		520							
5.503% due 03/12/2061	\$	75		111							
<b>Polaris PLC</b>											
4.723% due 12/23/2058	GBP	581		1,036							
<b>Progress Trust</b>											
4.110% due 07/20/2046	AUD	670		669							
4.280% due 07/22/2045		375		375							
4.552% due 02/21/2048		1,015		1,014							
<b>RedZed Trust</b>											
4.060% due 08/09/2053		798		792							
<b>RESIMAC Bastille Trust</b>											
5.430% due 12/05/2059	\$	55		82							
5.510% due 09/05/2057		122		181							
<b>RESIMAC Premier</b>											
4.414% due 02/10/2051	AUD	455		455							
4.545% due 02/07/2052		583		583							
5.275% due 07/10/2052	\$	534		786							
<b>Sapphire XXIII Trust</b>											
4.972% due 05/21/2052	AUD	574		575							
<b>Securitized Australian Mortgage Trust</b>											
4.090% due 02/20/2046		639		638							
<b>Structured Asset Mortgage Investments II Trust</b>											
5.057% due 05/25/2046	\$	24		12							
<b>Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust</b>											
5.622% due 11/25/2035		1,800		2,623							
6.066% due 04/25/2035		25		36							
<b>TORRENS Trust</b>											
4.640% due 02/18/2048	AUD	547		548							
<b>Towd Point Mortgage Trust</b>											
2.900% due 10/25/2059	\$	1,252		1,734							
3.651% due 05/25/2058		916		1,358							
5.617% due 10/25/2059		690		1,025							
<b>Triton Bond Trust</b>											
3.945% due 02/09/2053	AUD	1,725		1,707							

# 三井住友・豪ドル債ファンド

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>		
3.233% due 06/25/2033	\$ 4	6
3.553% due 04/25/2047	22	28
5.137% due 11/25/2045	34	46
5.157% due 12/25/2045	110	152
<b>Westpac Securitisation Trust</b>		
4.102% due 07/21/2045	AUD 270	269
4.110% due 01/18/2047	859	855
<b>モーゲージ証券合計</b>		<b>54,461</b>
<b>取得原価 AUD 53,615)</b>		
<b>資産担保証券 4.8%</b>		
<b>Avoca CLO XV DAC</b>		
2.988% due 04/15/2031	EUR 420	650
<b>Avoca CLO XVII DAC</b>		
3.108% due 10/15/2032	300	461
<b>Bastille Euro CLO DAC</b>		
3.438% due 01/15/2034	500	770
<b>Cairn CLO III DAC</b>		
2.688% due 10/20/2028	145	225
<b>Capital Four U.S. CLO II Ltd.</b>		
5.814% due 10/20/2030	\$ 500	744
<b>Carlyle Euro CLO DAC</b>		
3.284% due 08/15/2030	EUR 485	751
<b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.</b>		
3.404% due 11/15/2031	400	616
<b>Driver Australia Six Trust</b>		
4.222% due 12/21/2027	AUD 291	291
<b>Dryden 35 Euro CLO DAC</b>		
3.308% due 01/17/2033	EUR 500	766
<b>Dryden 44 Euro CLO DAC</b>		
3.168% due 04/15/2034	500	768
<b>Fidelity Grand Harbour CLO DAC</b>		
3.246% due 03/15/2032	500	773
<b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>		
3.072% due 10/20/2030	499	772
<b>Grosvenor Place CLO BV</b>		
3.188% due 10/30/2029	341	534
<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>		
3.018% due 07/15/2031	446	686
3.983% due 04/12/2032	1,400	2,194
<b>Pepper SPARKZ Trust No.3</b>		
4.355% due 08/17/2028	AUD 522	521
<b>Regatta XI Funding Ltd.</b>		
5.862% due 07/17/2031	\$ 700	1,030
<b>TCW CLO Ltd.</b>		
5.788% due 04/25/2031	700	1,029
<b>Toro European CLO DAC</b>		
3.484% due 02/15/2034	EUR 100	153
<b>Venture XXIX CLO Ltd.</b>		
5.854% due 09/07/2030	\$ 743	1,081
<b>VOYA CLO</b>		
5.772% due 06/07/2030	1,164	1,714
<b>Voya Euro CLO I DAC</b>		
3.038% due 10/15/2030	EUR 1,498	2,322
<b>資産担保証券合計</b>		<b>18,861</b>
<b>取得原価 AUD 17,971)</b>		
<b>ソブリン債 60.5%</b>		
<b>Asian Development Bank</b>		
3.750% due 03/12/2025	AUD 4,200	4,159
<b>Australia Government Bond</b>		
0.500% due 09/21/2026	100	90
2.750% due 06/21/2035	5,500	4,848
2.750% due 05/21/2041	14,300	11,708
3.000% due 03/21/2047	4,400	3,603
3.250% due 04/21/2025	100	99
3.250% due 06/21/2039	12,700	11,377
<b>Australian Capital Territory</b>		
1.750% due 05/17/2030	1,500	1,261

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
1.750% due 10/23/2031	AUD 6,900	5,571
4.500% due 10/23/2034	2,200	2,166
<b>Australian Postal Corp.</b>		
4.992% due 12/08/2027	1,000	1,002
<b>BNG Bank NV</b>		
1.600% due 11/27/2030	3,900	3,056
1.900% due 11/26/2025	2,500	2,337
3.250% due 07/15/2025	3,900	3,794
3.300% due 04/26/2029	1,700	1,575
3.500% due 07/19/2027	5,500	5,273
<b>CPPIB Capital, Inc.</b>		
1.500% due 06/23/2028	1,500	1,260
<b>European Investment Bank</b>		
2.900% due 10/17/2025	7,600	7,352
<b>International Bank for Reconstruction &amp; Development</b>		
4.250% due 06/24/2025	8,200	8,206
<b>International Finance Corp.</b>		
1.250% due 02/06/2031	3,700	2,836
4.450% due 05/14/2027	4,700	4,720
<b>Kommunalbanken A/S</b>		
3.000% due 12/09/2026	4,800	4,560
4.250% due 07/16/2025	2,000	1,892
5.250% due 07/15/2024	8,900	8,999
<b>Nederlandse Waterschapsbank NV</b>		
5.250% due 04/18/2024	7,000	7,064
<b>New South Wales Treasury Corp.</b>		
1.500% due 02/20/2032	3,100	2,419
2.000% due 03/08/2033	12,300	9,755
2.500% due 11/22/2032	2,700	2,272
2.750% due 11/20/2025	5,000	7,753
3.000% due 03/20/2028	700	666
3.000% due 02/20/2030	9,800	9,075
<b>Northern Territory Treasury Corp.</b>		
2.000% due 05/21/2029	4,600	4,042
3.500% due 05/21/2030	9,500	9,001
4.100% due 11/21/2042	700	597
<b>Province of Alberta</b>		
3.600% due 04/11/2028	1,200	1,130
<b>Province of British Columbia Canada</b>		
4.250% due 11/27/2024	3,200	3,186
<b>Province of Ontario</b>		
3.100% due 08/26/2025	4,900	4,739
<b>Queensland Treasury Corp.</b>		
1.500% due 08/20/2032	6,000	4,639
2.750% due 08/20/2027	20,200	19,163
4.200% due 02/20/2047	4,200	3,698
<b>South Australian Government Financing Authority</b>		
1.750% due 05/24/2034	12,100	9,000
3.000% due 05/24/2028	3,200	3,035
<b>Tasmanian Public Finance Corp.</b>		
2.250% due 01/22/2032	1,100	919
<b>Treasury Corp. of Victoria</b>		
1.500% due 09/10/2031	9,900	7,860
2.250% due 09/15/2033	11,900	9,546
4.250% due 12/20/2032	5,000	4,887
4.750% due 09/15/2036	2,800	2,770
<b>Western Australian Treasury Corp.</b>		
3.000% due 10/21/2027	8,900	8,525
<b>ソブリン債合計</b>		<b>237,585</b>
<b>取得原価AUD 264,649)</b>		
<b>短期証券 6.2%</b>		
<b>固定性定期預金 3.5%</b>		
<b>Cooperatieve Rabobank UA</b>		
3.340% due 04/24/2023	1,000	995
3.440% due 04/28/2023	4,000	3,978
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
3.468% due 04/11/2023	1,000	996

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
3.400% due 04/24/2023	AUD 8,000	AUD 7,958
		<b>13,927</b>
<b>ノーマンシャルペーパー 1.0%</b>		
<b>NBN Co Ltd.</b>		
3.413% due 03/09/2023	4,000	3,996
<b>定期預金 1.7%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
2.240% due 03/01/2023	2,411	2,411
4.070% due 03/01/2023	\$ 4	5
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
4.070% due 03/01/2023	17	25
<b>BNP Paribas Bank</b>		
2.240% due 03/01/2023	AUD 774	774
3.100% due 03/01/2023	NZD 51	47
6.400% due 03/01/2023	ZAR 260	21
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
1.260% due 03/01/2023	DKK 5	1
4.070% due 03/01/2023	\$ 0	1
<b>Citibank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	176	261
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	58	87
<b>DnB Bank ASA</b>		
2.010% due 03/01/2023	SEK 2	0
<b>HSBC Bank PLC</b>		
1.630% due 03/01/2023	EUR 45	70
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 654	969
<b>MUFG Bank Ltd.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	¥ 86	1
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
1.630% due 03/01/2023	EUR 6	9
3.170% due 03/01/2023	GBP 9	16
4.070% due 03/01/2023	\$ 1	2
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
(0.520%) due 03/01/2023	¥ 14	0
1.630% due 03/01/2023	EUR 1	2
3.170% due 03/01/2023	GBP 5	9
4.070% due 03/01/2023	\$ 1,264	1,875
		<b>6,586</b>
<b>短期証券合計</b>		<b>24,509</b>
<b>取得原価AUD 24,512)</b>		
<b>投資有価証券合計97.7%</b>		<b>AUD 383,833</b>
<b>取得原価AUD 409,004)</b>		
<b>金融派生商品(1.1%)</b>		<b>(4,406)</b>
<b>取得原価またはプレミアム、純額AUD(2,530)</b>		
<b>その他の資産および負債(純額) 3.4%</b>		<b>13,442</b>
<b>純資産 100.0%</b>		<b>AUD 392,889</b>

## ■ 損益計算書(2022年3月1日から2023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	3,148
総収益		3,148
費用：		
支払利息		0
総費用		0
投資純損益		<u>3,148</u>
実現純損益：		
投資有価証券		(3,095)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(671)
金融派生商品（OTC）		(358)
外国通貨		(20)
実現純損益		(4,144)
未実現評価損益の純変動額：		
投資有価証券		(3,611)
金融派生商品（市場または中央清算機関取引）		(27)
金融派生商品（OTC）		9
外貨建資産および負債		32
未実現評価損益の純変動額		(3,597)
純損益		(7,741)
運用の結果による純資産の純増減額	AUD	<u>(4,593)</u>

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

# 三井住友・豪ドル債ファンド

## ■ 投資明細表(2023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)
<b>投資有価証券97.4%</b>		
<b>社債券等 84.4%</b>		
<b>銀行および金融 13.0%</b>		
<b>Barclays PLC</b>		
3.250% due 06/26/2024	AUD 3,000	AUD 2,911
5.396% due 06/26/2024	750	758
<b>BNP Paribas S.A.</b>		
1.795% due 09/03/2027	3,800	3,245
<b>Citigroup, Inc.</b>		
3.750% due 10/27/2023	3,500	3,475
<b>Commonwealth Bank of Australia</b>		
4.942% due 09/10/2030	2,800	2,798
<b>Credit Agricole S.A.</b>		
4.400% due 07/05/2027	3,000	2,798
<b>Credit Suisse AG</b>		
4.700% due 05/28/2023	3,200	3,186
4.725% due 11/20/2023	800	794
<b>DBS Group Holdings Ltd.</b>		
4.769% due 03/16/2028	2,400	2,400
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>		
3.600% due 05/16/2023	3,000	2,987
4.901% due 05/02/2024	4,000	4,016
<b>Lloyds Banking Group PLC</b>		
4.250% due 11/22/2027	6,800	6,189
		<b>35,547</b>
<b>一般事業 15.0%</b>		
<b>Aurizon Network Pty Ltd.</b>		
2.900% due 09/02/2030	1,500	1,157
4.000% due 06/21/2024	3,100	3,060
<b>CNH Industrial Capital Australia Pty Ltd.</b>		
1.750% due 07/08/2024	500	478
<b>Qantas Airways Ltd.</b>		
4.400% due 10/10/2023	1,500	1,496
<b>Transurban Queensland Finance Pty Ltd.</b>		
3.250% due 08/05/2031	800	652
<b>Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.</b>		
1.200% due 04/08/2024	1,700	1,637
1.400% due 08/25/2025	900	823
3.100% due 04/17/2023	3,600	3,596
<b>WestConnex Finance Co. Pty Ltd.</b>		
3.150% due 03/31/2031	2,400	1,941
		<b>14,840</b>
<b>公共事業 3.4%</b>		
<b>DBNGP Finance Co. Pty Ltd.</b>		
4.225% due 05/28/2025	2,700	2,644
<b>Network Finance Co. Pty Ltd.</b>		
2.579% due 10/03/2028	800	684
		<b>3,328</b>
<b>社債券等合計</b>		<b>53,715</b>
<b>取得原価 AUD 56,793)</b>		
<b>米国政府機関債 0.0%</b>		
<b>Fannie Mae</b>		
5.017% due 06/25/2029	\$ 1	1
<b>米国政府機関債合計</b>		<b>1</b>
<b>取得原価 AUD 1)</b>		
<b>モーゲージ証券 0.5%</b>		
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>		
5.277% due 02/25/2035	9	12
5.297% due 02/25/2035	10	12
<b>CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates</b>		
3.355% due 07/25/2033	7	10
<b>Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates</b>		
4.193% due 07/25/2044	6	9
<b>Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates</b>		
3.921% due 10/25/2033	5	7
<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>		
3.957% due 02/25/2033	2	3

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>Pepper I-Prime Trust</b>		
4.130% due 01/22/2053	AUD 464	AUD 461
<b>モーゲージ証券合計</b>		<b>514</b>
<b>取得原価 AUD 514)</b>		
<b>ソブリン債 26.4%</b>		
<b>BNK Bank NV</b>		
3.500% due 07/19/2027	5,100	4,889
<b>Kommunalbanken AIS</b>		
3.000% due 12/09/2026	3,600	3,420
<b>Nederlandse Waterschapsbank NV</b>		
3.300% due 05/02/2029	1,600	1,481
3.450% due 07/17/2028	3,100	2,929
<b>New South Wales Treasury Corp.</b>		
2.000% due 03/08/2033	6,900	5,472
<b>Queensland Treasury Corp.</b>		
2.750% due 08/20/2027	5,300	5,028
<b>Treasury Corp. of Victoria</b>		
4.250% due 12/20/2032	2,000	1,955
<b>Western Australian Treasury Corp.</b>		
3.000% due 10/21/2026	800	775
3.250% due 07/20/2028	200	192
<b>ソブリン債合計</b>		<b>26,141</b>
<b>取得原価 AUD 26,749)</b>		
<b>短期証券 16.1%</b>		
<b>譲渡性定期預金 5.1%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
0.000% due 04/17/2023	1,000	995
<b>Cooperative Rabobank UA</b>		
3.340% due 04/24/2023	2,000	1,990
<b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>		
3.469% due 04/11/2023	1,000	996
<b>Westpac Banking Corp.</b>		
3.294% due 04/17/2023	1,000	995
		<b>4,976</b>
<b>コモディティ 3.0%</b>		
<b>Daimlerchrysler Capital Services Debis Australia Pty Ltd.</b>		
3.669% due 03/23/2023	1,000	998
<b>Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.</b>		
3.748% due 03/16/2023	2,000	1,997
		<b>2,995</b>
<b>定期性預金 1.9%</b>		
<b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>		
2.240% due 03/01/2023	1,097	1,097
4.070% due 03/01/2023	\$ 1	1
<b>Bank of Nova Scotia</b>		
4.070% due 03/01/2023	2	4
<b>BNP Paribas Bank</b>		
2.240% due 03/01/2023	AUD 353	353
<b>Brown Brothers Harriman &amp; Co.</b>		
1.260% due 03/01/2023	DKK 5	1
<b>Citibank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 25	37
<b>DBS Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	8	12
<b>HSBC Bank PLC</b>		
1.630% due 03/01/2023	EUR 2	4
<b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>		
4.070% due 03/01/2023	\$ 93	139
<b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>		
4.070% due 03/01/2023	181	268
		<b>1,916</b>

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
<b>日本短期国債 6.1%</b>		
(0.165%) due 05/15/2023	¥ 460,000	AUD 5,010
(0.154%) due 06/05/2023	90,000	980
		<b>5,990</b>
<b>短期証券合計</b>		<b>15,877</b>
<b>取得原価 AUD 15,905)</b>		
<b>投資有価証券合計 97.4%</b>		<b>AUD 96,248</b>
<b>取得原価 AUD 99,962)</b>		
<b>金融派生商品 0.0%</b>		
取得原価またはプレミアム、純額(AUD 0)		48
<b>その他の資産および負債 (純額) 2.6%</b>		<b>2,496</b>
<b>純資産 100.0%</b>		<b>AUD 98,792</b>