

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12作成期 (2019年11月13日から2020年5月12日まで)

第 **23** 期 / 第 **24** 期

第23期：決算日 2020年2月12日

第24期：決算日 2020年5月12日

■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・パミュダ・インカムファンドA クラスJ (USD) ピムコ・パミュダ・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。

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。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<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)

■ 最近5作成期の運用実績

作成期	決 算 期	基 準 価 額			債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率	純 資 産 総 額
		(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰落率			
第8 作成期	15期(2018年2月13日)	円 9,164	円 60	% △4.7	% 0.0	% 98.4	百万円 10,645
	16期(2018年5月14日)	9,160	70	0.7	0.0	93.3	10,845
第9 作成期	17期(2018年8月13日)	9,210	80	1.4	0.0	93.4	10,462
	18期(2018年11月12日)	9,333	90	2.3	0.0	97.1	9,852
第10 作成期	19期(2019年2月12日)	9,165	100	△0.7	0.0	97.6	9,318
	20期(2019年5月13日)	9,218	90	1.6	0.0	92.9	9,113
第11 作成期	21期(2019年8月13日)	8,936	70	△2.3	0.0	96.9	8,094
	22期(2019年11月12日)	9,264	50	4.2	0.0	98.0	7,673
第12 作成期	23期(2020年2月12日)	9,456	60	2.7	0.0	98.6	6,853
	24期(2020年5月12日)	8,632	60	△8.1	0.0	98.5	5,866

※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を記載しておりません。

■ 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		債券組入 比 率	投資信託 証券組入 比 率
			騰 落 率		
第23期	(期 首) 2019年11月12日	円 9,264	% —	% 0.0	% 98.0
	11月末	9,298	0.4	0.0	98.8
	12月末	9,396	1.4	0.0	98.7
	2020年1月末	9,385	1.3	0.0	98.1
	(期 末) 2020年2月12日	9,516	2.7	0.0	98.6
第24期	(期 首) 2020年2月12日	9,456	—	0.0	98.6
	2月末	9,431	△0.3	0.0	99.0
	3月末	8,508	△10.0	0.0	99.5
	4月末	8,607	△9.0	0.0	98.2
	(期 末) 2020年5月12日	8,692	△8.1	0.0	98.5

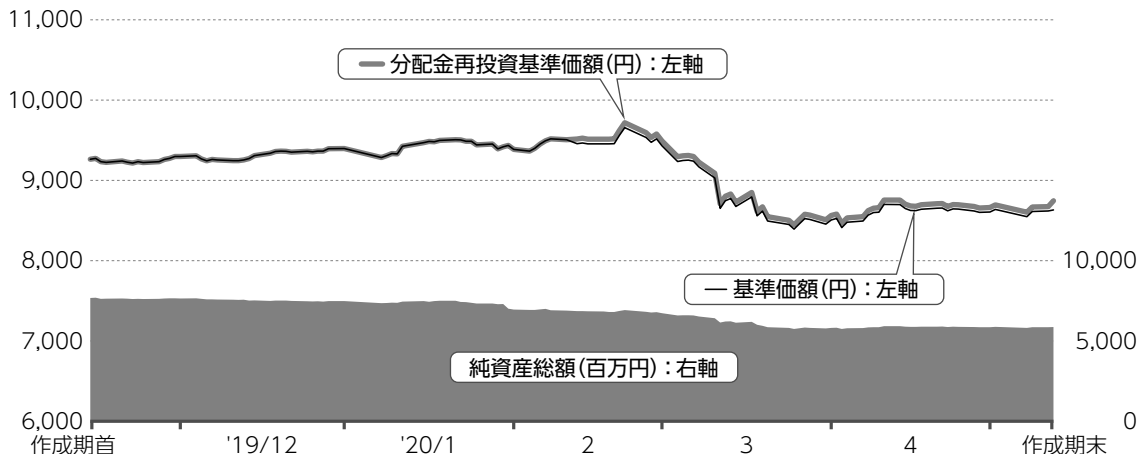
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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（2019年11月13日から2020年5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	9,264円
作成期末	8,752円 (当作成期分配金120円(税引前)込み)
騰落率	-5.6% (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)

基準価額の主な変動要因（2019年11月13日から2020年5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等に投資しました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジは行っていません。

なお、運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託しています。

上昇要因

- 新型コロナウイルスの感染拡大を背景に景気下振れ懸念が強まり、米国の国債金利が急低下（価格は上昇）したこと

下落要因

- 新型コロナウイルスを発端としたリスク・オフ（リスク回避）の動きからスプレッドが急拡大し、非政府系住宅担保証券、新興国債、ハイイールド債などの価格が下落したこと
- 日本の金利が低下し、ショートしていた日本国債の価格が上昇したこと
- 円高・米ドル安が進行したこと

組入れファンドの状況

組入れファンド	投資資産	作成期末組入比率
ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD)	外国債券	98.5%
マネー・マーケット・マザーファンド	短期金融資産	0.0%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について（2019年11月13日から2020年5月12日まで）

米国債券市場は堅調でした。ただし、米ハイイールド社債、非政府系モーゲージ証券市場は下落しました。為替市場では、米ドル安・円高となりました。

債券市場

当作成期の米国債券市場は、作成期初から1月にかけて、米中貿易協議の部分合意などから小幅に下落しました。2月半ば以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に世界経済の先行き懸念が強まり、リスク回避の動きから作成期末まで堅調な動きとなりました。作成期を通してみると、債券市場は堅調な動きとなりました。

当作成期の米国3年国債利回りは、作成期首1.70%から作成期末0.22%へと低下しました。また、ブルームバーグ・バークレイズ米国総合債券・インデックス(米ドルベース、ヘッジなし)は5.1%の上昇となりました。

債券セクター別に見ると、新型コロナウイルス感染拡大を受けての景気後退を懸念したリスク回避の動きからスプレッドが急拡大し、米ハイイールド社債、非政府系モーゲージ証券が下落しました。新興国では新型コロナウイルス要因に加え、米ドル需要の高まりを背景とした米ドル高が進行するなかで、米ドル建て債務の返済能力に対する懸念が高まったことなどから、スプレッドが拡大し、軟調な動きとなりました。

為替市場

当作成期の米ドル・円市場は、作成期初から2月中旬にかけては、米中貿易協議の進展などを背景に米ドルが上昇しました。その後は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景にリスク回避の動きが強まったことを背景に、米ドル安・円高となりました。

当作成期の米ドル・円は、作成期首109円17銭から作成期末107円52銭と1円65銭の米ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて（2019年11月13日から2020年5月12日まで）

当ファンド

「ピムコ・バミュダ・インカムファンド A クラスJ (USD)」を高位に組み入れました。

ピムコ・バミュダ・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)

作成期を通じて1～2.5年程度と相対的に短く設定しました。

●債券セクター配分

金利戦略については、引き続き全体の金利リスク量は抑制しつつ、市場環境に応じて機動的に調整しています。3月に金利が上昇した米国において、イールドカーブ(利回り曲線)の正常化に伴い投資妙味が向上したと考え、中期年限の金利リスク取得を積み増しています。一方で、EU(欧州連合)離脱に関する議論を受けて金利が大きく低下した英国や、相対的に投資妙味に欠けると判断した日本の金利リスクは引き続き売り持ちとしています。そのほか、非政府系住宅ローン担保証券などの変動利付債券をポートフォリオの3～4割程度組み入れることで、金利上昇に対する耐性を強化しています。

セクター戦略については、米国政府関連債や米国政府系住宅ローン担保証券といったリ

スクオフ時に底堅い値動きが期待できる債券を合わせて3～5割程度組み入れポートフォリオの高い安定性を維持しています。一方、景気拡大を捉える資産として、健全性の高い住宅市場の恩恵を受けやすい非政府系住宅ローン担保証券や、スプレッドの拡大により投資妙味の増しているハイイールド社債の組み入れを継続しています。また、利回りが相対的に高い新興国債券については、相対的にファンダメンタルズ(基礎的条件)の健全なメキシコやロシアなどを中心に投資を継続しています。

●通貨別配分

通貨配分に関しては、先進国の金融政策の方向性の違いや、通商政策の動向に着目した戦略を実施しました。具体的には、相対的にファンダメンタルズが良好で割安感がある一方で、安定的な為替推移が見込まれるメキシコペソに対し積極的に投資を行う一方、日本銀行による金融緩和の継続が想定される日本円に加え、国内経済の悪化を受けて更なる金融緩和の可能性が高いニュージーランドドルを消極姿勢としました。

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（2019年11月13日から2020年5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（2019年11月13日から2020年5月12日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第23期	第24期
当期分配金	60	60
（対基準価額比率）	（0.631%）	（0.690%）
当期の収益	60	60
当期の収益以外	-	-
翌期繰越分配対象額	948	994

当作成期の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、それぞれ60円といたしました。

なお、収益分配に充てなかった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

引き続き「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）

PIMCOでは、新型コロナウイルスの感染拡大およびその抑制に向けたロックダウン（都市封鎖）等により、世界の経済成長は2008-09年の金融危機時以上に大きく落ち

込み、2020年通期でみてもマイナス成長に陥るものと予想しています。しかし、過去の危機と異なり、経済に何らかの不均衡が蓄積した結果の景気後退ではなく、各国の金融・財政政策による対応が異例のスピードかつ大規模に実施されているため、感染終息の目処がつけば、比較的短期間（6-12か月）に回復し、本来の成長スピードに収れんするものとみています。

各国当局による迅速な政策対応は实体经济の支えとなることが見込まれる一方、経済活動の停止を背景とした短期的な景気後退は免れないとの見通しが強まっており、金融市場

の先行きに対する見通しは大きく分かれつつあります。かかる環境下、投資においては引き続き慎重なリスク管理が求められると考えており、投資の元本保全を意識しつつ、魅力的な水準のインカム収入を獲得していくことは、中長期的にも引き続き重要なテーマであると考えています。

PIMCOインカム戦略としては、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。質の良い高利回り資産を中

心とする「攻め」の資産と、リスクオフ時にポートフォリオを安定化させる「守り」の資産のバランスを重視し、「良質なインカム」を着実に積み上げることで、引き続き元本の保全と安定的なインカムの提供を目指していきます。

マネー・マーケット・マザーファンド

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

(2020年5月18日現在)

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（2019年11月13日から2020年5月12日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	84円	0.919%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数）
（投信会社）	(47)	(0.520)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(35)	(0.383)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(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) その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.003)	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	84	0.922	

期中の平均基準価額は9,104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。

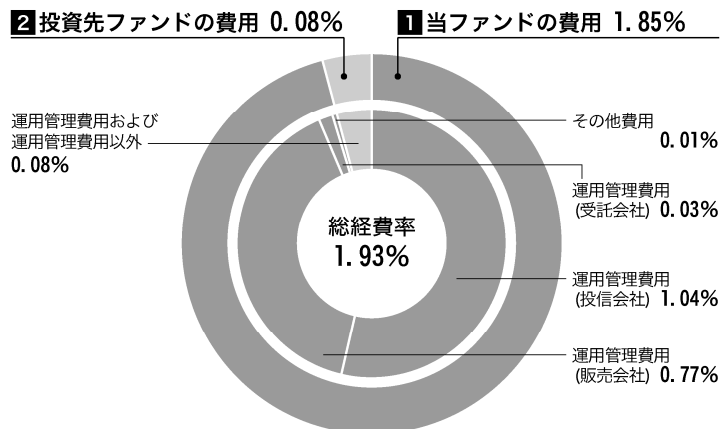
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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。当該投資信託証券の費用は後掲の「損益計算書」をご覧ください。

参考情報 総経費率（年率換算）



総経費率 (① + ②)	1.93%
① 当ファンドの費用の比率	1.85%
② 投資先ファンドの費用の比率	0.08%

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）

※**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1.93%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2019年11月13日から2020年5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
		—	—	122,034	1,238,927
	合 計	—	—	122,034	1,238,927

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等（2019年11月13日から2020年5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（2019年11月13日から2020年5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(2020年5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
ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD)	口 733,098	口 611,064	千円 5,781,276	% 98.5
合計	733,098	611,064	5,781,276	98.5

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(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
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 1,456	千口 1,456	千円 1,458

※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77,141千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

項目	作成期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 5,781,276	% 97.4
マネー・マーケット・マザーファンド	1,458	0.0
コール・ローン等、その他	154,359	2.6
投資信託財産総額	5,937,093	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年2月12日) (2020年5月12日)

項 目	第23期末	第24期末
(A) 資 産	6,948,508,681円	5,937,093,768円
コール・ローン等	190,729,370	154,359,163
投資信託受益証券(評価額)	6,756,320,628	5,781,276,504
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,458,683	1,458,101
(B) 負 債	94,884,598	70,465,567
未払収益分配金	43,485,558	40,778,182
未払解約金	16,750,813	1,657,269
未払信託報酬	34,538,133	27,943,479
未払利息	569	460
その他未払費用	109,525	86,177
(C) 純資産総額(A-B)	6,853,624,083	5,866,628,201
元 本	7,247,593,150	6,796,363,734
次期繰越損益金	△ 393,969,067	△ 929,735,533
(D) 受益権総口数	7,247,593,150口	6,796,363,734口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,456円	8,632円

※当作成期における作成期首元本額8,282,825,029円、作成期中追加設定元本額196,948,001円、作成期中一部解約元本額1,683,409,296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1万円当たり基準価額が、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

1万円当たり分配金(税引前)	第23期	第24期
	60円	60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

(自2019年11月13日) (自2020年2月13日)
(至2020年2月12日) (至2020年5月12日)

項 目	第23期	第24期
(A) 配 当 等 収 益	107,416,269円	99,657,794円
受取配当金	107,439,451	99,672,502
支払利息	△ 23,182	△ 14,708
(B) 有価証券売買損益	109,099,096	△ 590,408,312
売 益	118,909,165	29,477,346
売 買 損	△ 9,810,069	△ 619,885,658
(C) 信 託 報 酬 等	△ 34,649,717	△ 28,035,631
(D) 当期損益金(A+B+C)	181,865,648	△ 518,786,149
(E) 前期繰越損益金	△ 271,542,353	△ 124,463,258
(F) 追加信託差損益金	△ 260,806,804	△ 245,707,944
(配当等相当額)	(272,971,347)	(257,294,996)
(売買損益相当額)	(△533,778,151)	(△ 503,002,940)
(G) 計 (D+E+F)	△ 350,483,509	△ 888,957,351
(H) 収 益 分 配 金	△ 43,485,558	△ 40,778,182
次期繰越損益金(G+H)	△ 393,969,067	△ 929,735,533
追加信託差損益金	△ 260,806,804	△ 245,707,944
(配当等相当額)	(272,971,355)	(257,294,996)
(売買損益相当額)	(△533,778,159)	(△ 503,002,940)
分配準備積立金	414,516,639	418,284,857
繰 越 損 益 金	△ 547,678,902	△ 1,102,312,446

※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。

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※当ファンドの運用の指図にかかる権限の一部委託に要する費用は22,300,544円(消費税等相当額を含む)です。(2019年11月13日～2020年5月12日、当社計算値)

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第23期	第24期
(a) 費用控除後の配当等収益	90,229,720円	71,625,262円
(b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	-	-
(c) 収益調整金	272,971,355	257,294,996
(d) 分配準備積立金	367,772,477	387,437,777
(e) 分配可能額(a+b+c+d)	730,973,552	716,358,035
1万円当たり分配可能額	1,008	1,054
(f) 分配金額	43,485,558	40,778,182
1万円当たり分配金額(税引前)	60	60

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	バミューダ籍外国投資信託（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。
ベンチマーク	ありません。
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。
決算日	年1回決算（原則として、毎年10月31日）
分配方針	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。
運用報酬	ありません。
管理およびその他の費用	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。その他の費用・手数料については、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。
信託財産留保額	ありません。
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（2018年11月1日から2019年10月31日まで）

（単位：千米ドル）

投資収益	
受取利息（外国税控除後）	9,913
総収益	9,913
費用	
顧問費用 - T (JPY)	2,939
顧問費用 - U (USD)	262
顧問費用 - W (USD)	185
管理手数料 - P (JPY)	292
管理手数料 - X (JPY)	55
管理事務代行費用 - T (JPY)	663
管理事務代行費用 - U (USD)	95
管理事務代行費用 - W (USD)	57
販売手数料 - P (JPY)	292
支払利息	1,500
総費用	6,340
投資純利益（損失）	3,573
実現純利益（損失）	
有価証券に対する投資	18
関連ファンドに対する投資	179,161
OTC金融デリバティブ商品	154,511
外国為替	2,579
実現純利益（損失）	336,269
未実現評価益（損）の純変動額	
有価証券に対する投資	6
関連ファンドに対する投資	848,046
OTC金融デリバティブ商品	(32,741)
外貨建資産および負債	792
未実現評価益の純変動額	816,103
純利益	1,152,372
運用の結果による純資産の純増加額	1,155,945

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書 (2018年11月1日から2019年10月31日まで)

(単位：千米ドル)

投資収益	
受取利息(外国税控除後)	547,839
受取配当金(外国税控除後)	609
雑収入	18
総収益	548,466
費用	
支払利息	8,103
総費用	8,103
投資純利益(損失)	540,363
実現純利益(損失)	
有価証券に対する投資	17,634
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	10,902
OTC金融デリバティブ商品	353,605
外国為替	(35,345)
実現純利益(損失)	346,796
未実現評価益(損)の純変動額	
有価証券に対する投資	186,119
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	108,056
OTC金融デリバティブ商品	(125,495)
外貨建資産および負債	8,747
未実現評価益の純変動額	177,427
純利益	524,223
運用の結果による純資産の純増加額	1,064,586
* 外国源泉課税	273

■ 投資明細表(2019年10月31日現在)

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)
投資有価証券 125.6%	銀行ローン債権 5.2%	Advanz Pharma Corp. 7.251% 期日 09/06/2024	USD	4,699	USD	4,417
		Alphabet Holding Co., Inc. 5.286% 期日 09/26/2024		490		449
		Altica France S.A. 5.921% 期日 08/14/2026		5,346		5,279
		American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 3.823% 期日 01/15/2027		1,500		1,500
		Ancestry.com Operations, Inc. 6.040% 期日 08/27/2026		2,067		1,850
		APi Group DE, Inc. 4.541% 期日 10/01/2026		4,600		4,624
		Aramark Intermediate HoldCo Corp. 3.536% 期日 03/11/2025		933		936
		Avantor Funding, Inc. 4.786% 期日 11/21/2024		262		264
		Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC 3.596% 期日 01/15/2025		26,724		26,859
		AWAS Leasing 2011-I Ltd. 4.870% 期日 10/02/2021		572		586
		Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.854% 期日 06/01/2024		463		463
		Azalea TopCo, Inc. 5.286% 期日 07/24/2026		2,315		2,282
		Bausch Health Cos., Inc. 4.671% 期日 11/27/2025		1,540		1,543
		4.921% 期日 06/02/2025		937		942
		Beacon Roofing Supply, Inc. 4.036% 期日 01/02/2025		1,093		1,086
		Bway Holdings Co. 5.234% 期日 04/03/2024		381		372
		Caesars Resort Collection LLC 4.536% 期日 12/23/2024		5,290		5,219
		Camelot U.S. Acquisition 1 Co. 5.073% 期日 10/25/2026		200		201
		Castlelake Aircraft Structured Trust 5.891% 期日 07/15/2042		2,807		2,850
		CenturyLink, Inc. 4.536% 期日 01/31/2025		3,049		3,027
		CEOC LLC 3.786% 期日 10/07/2024		1,893		1,893
		CityCenter Holdings LLC 4.036% 期日 04/18/2024		293		294
		Commscope, Inc. 5.036% 期日 04/06/2026		4,000		3,941
		Core & Main LP 4.761% 期日 08/01/2024		191		188
		4.882% 期日 08/01/2024		123		120
		Crown Holdings, Inc. 3.997% 期日 04/03/2025		429		433
		CSC Holdings LLC				

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価 通貨（単位：千）
		4.327% 期日 04/15/2027	2,864	2,864
		Dell International LLC		
		3.790% 期日 09/19/2025	2,700	2,713
		Diamond Resorts International, Inc.		
		5.536% 期日 09/02/2023	5,482	5,285
		Dubai World		
		2.500% 期日 09/30/2022	20,199	18,836
		Envision Healthcare Corp.		
		5.536% 期日 10/10/2025	12,422	10,093
		Fleet Midco I Ltd.		
		5.235% 期日 10/07/2026	290	291
		Forest City Enterprises LP		
		5.786% 期日 12/07/2025	2,184	2,200
		Frontier Communications Corp.		
		5.540% 期日 06/15/2024	7,350	7,334
		Genworth Holdings, Inc.		
		6.323% 期日 03/07/2023	394	395
		Golden Nugget, Inc.		
		4.536% 期日 10/04/2023	1	1
		4.677% 期日 10/04/2023	14	14
		4.716% 期日 10/04/2023	13	13
		Gray Television, Inc.		
		4.511% 期日 01/02/2026	1,687	1,694
		GreenSky Holdings LLC		
		5.063% 期日 03/31/2025	4,827	4,760
		HCA, Inc.		
		3.536% 期日 03/17/2023	818	822
		3.536% 期日 03/13/2025	2,946	2,962
		Hilton Worldwide Finance LLC		
		3.573% 期日 06/22/2026	9,745	9,796
		iHeartCommunications, Inc.		
		6.032% 期日 05/01/2026	43,445	43,644
		Intelsat Jackson Holdings S. A.		
		5.682% 期日 11/27/2023	12,449	12,442
		6.625% 期日 01/02/2024	10,100	10,363
		Iqvia, Inc.		
		4.104% 期日 01/17/2025	9,996	10,036
		IRB Holding Corp.		
		5.193% 期日 02/05/2025	2	2
		5.216% 期日 02/05/2025	688	683
		Jefferies Finance LLC		
		5.750% 期日 06/03/2026	934	919
		KFC Holding Co.		
		3.628% 期日 04/03/2025	1,067	1,071
		Lake Road Generating Co. LP		
		7.500% 期日 02/22/2049	11,856	11,174
		Marriott Ownership Resorts, Inc.		
		4.036% 期日 08/29/2025	1,290	1,298
		McDermott International, Inc.		
		7.104% 期日 05/09/2025	3,427	2,100
		11.823% 期日 10/21/2021	1,915	1,963
		Meredith Corp.		
		4.536% 期日 01/31/2025	637	639
		Messer Industries GmbH		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		4.604% 期日 03/01/2026	1,373	1,363
		MGM Growth Properties Operating Partnership LP		
		3.786% 期日 03/21/2025	598	601
		MH Sub I LLC		
		5.536% 期日 09/13/2024	990	967
		Mission Broadcasting, Inc.		
		4.282% 期日 01/17/2024	63	63
		Nascar Holdings LLC		
		5.275% 期日 10/19/2026	3,183	3,203
		Neiman Marcus Group Ltd. LLC		
		7.990% 期日 10/25/2023	1,658	1,226
		8.490% 期日 10/25/2023	28,765	21,142
		Nexstar Broadcasting, Inc.		
		4.050% 期日 01/17/2024	316	317
		Nielsen Finance LLC		
		3.940% 期日 10/04/2023	390	389
		Nouryon Finance BV		
		5.190% 期日 10/01/2025	4,223	4,132
		Pacific Gas & Electric Co.		
		2.250% 期日 12/31/2020	11,824	11,868
		4.240% 期日 12/31/2020	34,991	35,123
		5.989% 期日 02/22/2049	500	471
		Parexel International Corp.		
		4.536% 期日 09/27/2024	353	338
		PetSmart, Inc.		
		5.930% 期日 03/11/2022	4,054	3,958
		PG&E Corp.		
		3.801% 期日 04/16/2020	5,859	5,881
		Ply Gem Midco, Inc.		
		5.664% 期日 04/12/2025	4,850	4,703
		Post Holdings, Inc.		
		3.830% 期日 05/24/2024	57	57
		Prestige Brands, Inc.		
		3.786% 期日 01/26/2024	54	54
		Republic of Tanzania		
		8.612% 期日 12/10/2019	1,300	1,313
		Refinitiv U.S. Holdings, Inc.		
		5.536% 期日 10/01/2025	13,270	13,354
		Reynolds Group Holdings, Inc.		
		4.536% 期日 02/05/2023	194	194
		RPI Finance Trust		
		3.786% 期日 03/27/2023	6,784	6,822
		SBA Senior Finance II LLC		
		3.790% 期日 04/11/2025	494	496
		Sequa Mezzanine Holdings LLC		
		7.187% 期日 11/28/2021	12,501	12,365
		10.936% 期日 04/28/2022	650	634
		Serta Simmons Bedding LLC		
		5.346% 期日 11/08/2023	43	25
		5.421% 期日 11/08/2023	152	90
		Sigma Holdco BV		
		3.500% 期日 07/02/2025	EUR 3,670	4,045
		Sinclair Television Group, Inc.		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		4.430% 期日 09/30/2026	USD	1,195		1,198
		Sprint Communications, Inc.				
		4.313% 期日 02/02/2024		4,100		4,061
		SS&C Technologies Holdings, Inc.				
		4.036% 期日 04/16/2025		5,064		5,079
		State of Rio De Janeiro				
		6.024% 期日 12/20/2020		6,716		6,762
		Sunshine Luxembourg VII SARL				
		3.750% 期日 10/01/2026	EUR	1,630		1,824
		6.349% 期日 10/01/2026	USD	4,123		4,131
		Syniverse Holdings, Inc.				
		6.921% 期日 03/09/2023		2,914		2,647
		Tronox Finance LLC				
		4.536% 期日 09/23/2024		271		269
		4.854% 期日 09/23/2024		174		173
		U.S. Renal Care, Inc.				
		6.786% 期日 06/26/2026		2,217		2,054
		Univision Communications, Inc.				
		4.536% 期日 03/15/2024	USD	27,979		27,029
		VFH Parent LLC				
		6.044% 期日 03/01/2026		400		400
		VICI Properties 1 LLC				
		3.850% 期日 12/20/2024		3,627		3,644
		Vistra Operations Co. LLC				
		3.786% 期日 08/04/2023		288		288
		West Corp.				
		5.786% 期日 10/10/2024		1		1
		5.927% 期日 10/10/2024		210		176
		Westmoreland Coal Co.				
		15.000% 期日 03/15/2029		553		419
		Westmoreland Mining Holdings LLC				
		10.389% 期日 03/15/2022		214		216
		Whatabrands LLC				
		5.516% 期日 08/02/2026		482		484
		WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL				
		3.906% 期日 08/01/2023		79,000		79,306
		4.332% 期日 03/30/2021		45,000		45,064
		WHOLE LOAN ST REGIS ASPEN				
		4.184% 期日 07/09/2020		99,000		99,205
		Windstream Services LLC				
		4.750% 期日 03/29/2021		1,800		1,826
		9.000% 期日 02/17/2024		2,700		2,709
		Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				
		3.536% 期日 05/30/2025		2,475		2,487
		銀行貸付債権証券合計				664,671
		(原価：678,036米ドル)				
社債券等	銀行および金融	ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding				
		Issuance PLC				
33.9%	21.0%	2.626% 期日 04/28/2020	EUR	3,028		3,416
		ABN AMRO Bank NV				
		2.450% 期日 06/04/2020	USD	5,900		5,917
		AerCap Ireland Capital DAC				
		3.500% 期日 05/26/2022		150		154

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		4.250% 期日 07/01/2020		1,405	1,424
		4.500% 期日 05/15/2021		650	673
		4.625% 期日 10/30/2020		4,000	4,100
		5.000% 期日 10/01/2021		1,300	1,366
		AGFC Capital Trust I			
		3.751% 期日 01/15/2067		2,200	1,166
		AIB Group PLC			
		4.263% 期日 04/10/2025		12,800	13,489
		Akelius Residential Property AB			
		3.375% 期日 09/23/2020	EUR	2,900	3,332
		Ally Financial, Inc.			
		3.750% 期日 11/18/2019	USD	1,356	1,357
		3.875% 期日 05/21/2024		3,074	3,218
		4.125% 期日 03/30/2020		6,300	6,357
		4.250% 期日 04/15/2021		4,660	4,784
		4.625% 期日 05/19/2022		824	865
		7.500% 期日 09/15/2020		1,293	1,351
		8.000% 期日 03/15/2020		1,150	1,175
		8.000% 期日 11/01/2031		1,889	2,635
		Alpha Bank AE			
		2.500% 期日 02/05/2023	EUR	7,050	8,357
		Altarea S. C. A.			
		1.875% 期日 01/17/2028		7,400	8,302
		Ambac LSNI LLC			
		7.104% 期日 02/12/2023	USD	12,420	12,544
		American International Group, Inc.			
		5.750% 期日 04/01/2048		564	611
		American Tower Corp.			
		3.000% 期日 06/15/2023		1,360	1,398
		Annington Funding PLC			
		1.650% 期日 07/12/2024	EUR	1,600	1,851
		2.646% 期日 07/12/2025	GBP	1,900	2,546
		Ardonagh Midco 3 PLC			
		8.375% 期日 07/15/2023		5,430	6,601
		8.625% 期日 07/15/2023	USD	400	374
		Army Hawaii Family Housing Trust			
		Certificates			
		2.314% 期日 06/15/2050		8,200	6,642
		Aroundtown S. A.			
		5.375% 期日 03/21/2029		11,300	12,732
		Assurant, Inc.			
		4.200% 期日 09/27/2023		1,532	1,602
		Athene Holding Ltd.			
		4.125% 期日 01/12/2028		415	432
		Atriumpean Real Estate Ltd.			
		3.625% 期日 10/17/2022	EUR	350	421
		Avolon Holdings Funding Ltd.			
		5.250% 期日 05/15/2024	USD	6,654	7,273
		5.500% 期日 01/15/2023		3,146	3,403
		AXA Equitable Holdings, Inc.			
		3.900% 期日 04/20/2023		436	457
		4.350% 期日 04/20/2028		801	864
		5.000% 期日 04/20/2048		1,332	1,438
		Axis Bank Ltd.			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		3.250% 期日 05/21/2020		2,200	2,207
		Banca Carige SpA			
		0.982% 期日 02/25/2021	EUR	22,800	25,557
		1.298% 期日 10/25/2021		44,700	50,564
		Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
		0.875% 期日 10/08/2026	USD	7,800	8,754
		2.000% 期日 01/29/2024		6,700	7,909
		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S. A.			
		6.750% 期日 02/18/2020	EUR	16,600	18,803
		8.875% 期日 04/14/2021		11,400	14,024
		Banco de Credito del Peru			
		4.650% 期日 09/17/2024	PEN	16,400	4,964
		Banco Espirito Santo S.A.			
		2.625% 期日 05/08/2049	EUR	3,100	744
		Banco Santander S.A.			
		3.121% 期日 04/12/2023	USD	800	803
		3.848% 期日 04/12/2023		1,200	1,255
		4.750% 期日 03/19/2025	EUR	5,400	6,016
		6.250% 期日 09/11/2021		21,900	25,981
		Bank of America Corp.			
		2.917% 期日 03/05/2024	USD	1,394	1,404
		Bank of China Ltd.			
		0.082% 期日 04/17/2021	EUR	3,020	3,373
		Bank of Ireland			
		7.375% 期日 06/18/2020		11,700	13,547
		Barclays Bank PLC			
		7.625% 期日 11/21/2022	USD	10,340	11,573
		Barclays PLC			
		1.375% 期日 01/24/2026	EUR	4,300	4,984
		1.500% 期日 09/03/2023		300	351
		2.375% 期日 10/06/2023	GBP	7,350	9,652
		3.125% 期日 01/17/2024		27,000	36,703
		3.250% 期日 02/12/2027		17,530	24,202
		3.250% 期日 01/17/2033		3,300	4,528
		3.548% 期日 05/16/2024	USD	8,400	8,474
		3.588% 期日 02/15/2023		8,100	8,165
		3.635% 期日 01/10/2023		1,000	1,010
		3.684% 期日 01/10/2023		1,300	1,330
		4.337% 期日 01/10/2028		700	758
		4.338% 期日 05/16/2024		5,400	5,694
		4.375% 期日 01/12/2026		2,900	3,124
		4.610% 期日 02/15/2023		6,900	7,211
		4.972% 期日 05/16/2029		2,600	2,931
		5.875% 期日 09/15/2024	GBP	4,400	5,745
		6.375% 期日 12/15/2025		1,600	2,164
		7.125% 期日 06/15/2025		4,800	6,811
		7.250% 期日 03/15/2023		16,760	23,301
		7.750% 期日 09/15/2023	USD	14,570	15,527
		7.875% 期日 03/15/2022		1,200	1,283
		7.875% 期日 09/15/2022	GBP	8,053	11,264
		8.000% 期日 12/15/2020	EUR	10,560	12,638
		8.000% 期日 06/15/2024	USD	10,200	11,138
		Bevco Lux Sarl			
		1.750% 期日 02/09/2023	EUR	5,100	5,937

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	（単位：千）	通貨
		BGC Partners, Inc.			
		3.750% 期日 10/01/2024	USD	1,464	1,457
		5.125% 期日 05/27/2021		400	416
		Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl			
		0.500% 期日 09/12/2023	EUR	2,200	2,449
		1.400% 期日 07/06/2022		4,100	4,688
		1.750% 期日 03/12/2029		2,200	2,459
		BNP Paribas S. A.			
		3.375% 期日 01/09/2025	USD	10,401	10,801
		4.400% 期日 08/14/2028		1,200	1,338
		7.000% 期日 08/16/2028		300	338
		7.625% 期日 03/30/2021		600	630
		BOC Aviation Ltd.			
		2.375% 期日 09/15/2021		570	566
		2.952% 期日 05/02/2021		3,380	3,394
		3.238% 期日 09/26/2023		2,300	2,316
		3.500% 期日 01/31/2023		200	205
		3.500% 期日 10/10/2024		600	618
		Brighthouse Financial, Inc.			
		3.700% 期日 06/22/2027		1,966	1,933
		Brookfield Finance, Inc.			
		3.900% 期日 01/25/2028		1,802	1,906
		4.700% 期日 09/20/2047		4,020	4,519
		Cantor Fitzgerald LP			
		4.875% 期日 05/01/2024		501	532
		Capital One Financial Corp.			
		3.450% 期日 04/30/2021		5,291	5,402
		Castellum AB			
		2.125% 期日 11/20/2023	EUR	1,300	1,547
		CBL & Associates LP			
		4.600% 期日 10/15/2024	USD	77	49
		5.950% 期日 12/15/2026		2,416	1,619
		China Construction Bank Corp.			
		0.207% 期日 09/24/2021	EUR	2,000	2,234
		CIT Bank N. A.			
		2.969% 期日 09/27/2025	USD	2,800	2,828
		CIT Group, Inc.			
		4.125% 期日 03/09/2021		1,216	1,246
		5.000% 期日 08/15/2022		8,665	9,233
		5.000% 期日 08/01/2023		3,896	4,213
		Cooperatieve Rabobank UA			
		5.500% 期日 06/29/2020	EUR	18,410	21,161
		6.625% 期日 06/29/2021		12,600	15,336
		Corestate Capital Holding S. A.			
		3.500% 期日 04/15/2023		39,300	41,507
		CPI Property Group S. A.			
		1.450% 期日 04/14/2022		5,500	6,294
		1.625% 期日 04/23/2027		5,700	6,285
		2.125% 期日 10/04/2024		4,800	5,620
		4.750% 期日 03/08/2023	USD	15,100	15,953
		Credit Agricole S. A.			
		2.956% 期日 04/24/2023		1,000	1,006
		3.750% 期日 04/24/2023		1,750	1,830

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		7.875% 期日 01/23/2024		296	334
		Credit Suisse AG			
		4.375% 期日 08/05/2020		750	764
		6.500% 期日 08/08/2023		10,885	12,136
		Credit Suisse Group AG			
		2.593% 期日 09/11/2025		6,100	6,083
		2.997% 期日 12/14/2023		3,600	3,654
		3.372% 期日 06/12/2024		2,250	2,275
		3.869% 期日 01/12/2029		33,900	36,252
		4.207% 期日 06/12/2024		3,000	3,169
		4.282% 期日 01/09/2028		6,700	7,288
		7.250% 期日 09/12/2025		1,100	1,197
		7.500% 期日 07/17/2023		5,300	5,719
		Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
		3.750% 期日 03/26/2025		1,800	1,900
		CTR Partnership LP			
		5.250% 期日 06/01/2025		504	525
		Deutsche Bank AG			
		0.375% 期日 01/18/2021	EUR	74,100	82,411
		1.625% 期日 02/12/2021		12,800	14,454
		1.875% 期日 02/28/2020	GBP	600	776
		1.875% 期日 02/14/2022	EUR	9,500	10,813
		2.700% 期日 07/13/2020	USD	4,272	4,274
		2.768% 期日 01/22/2021		12,700	12,639
		2.971% 期日 07/13/2020		1,774	1,773
		3.150% 期日 01/22/2021		10,000	10,043
		3.192% 期日 02/04/2021		5,310	5,295
		3.300% 期日 11/16/2022		100	100
		3.358% 期日 11/16/2022		200	195
		3.362% 期日 02/27/2023		2,100	2,032
		3.950% 期日 02/27/2023		1,820	1,861
		4.250% 期日 10/14/2021		17,440	17,931
		Digital Euro Finco LLC			
		1.125% 期日 04/09/2028	EUR	1,400	1,541
		2.625% 期日 04/15/2024		1,400	1,703
		Digital Realty Trust LP			
		3.600% 期日 07/01/2029	USD	3,095	3,253
		Discover Bank			
		3.350% 期日 02/06/2023		900	930
		Dream Global Funding I Sarl			
		1.750% 期日 06/28/2026	EUR	1,600	1,812
		Emerald Bay S.A.			
		0.000% 期日 10/08/2020		3,425	3,740
		EPR Properties			
		4.500% 期日 06/01/2027	USD	3,650	3,912
		4.750% 期日 12/15/2026		256	279
		4.950% 期日 04/15/2028		1,132	1,244
		Equinix, Inc.			
		2.875% 期日 03/15/2024	EUR	4,800	5,547
		2.875% 期日 02/01/2026		15,350	17,831
		ESH Hospitality, Inc.			
		4.625% 期日 10/01/2027	USD	924	929
		Eurobank Ergasias S.A.			
		2.750% 期日 11/02/2020	EUR	1,000	1,145

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	（単位：千）	通貨
		Fairfax Financial Holdings Ltd.			
		4.850% 期日 04/17/2028	USD	2,062	2,248
		Fairstone Financial, Inc.			
		7.875% 期日 07/15/2024		600	634
		Fastighets AB Balder			
		1.125% 期日 03/14/2022	EUR	5,745	6,542
		1.875% 期日 03/14/2025		1,100	1,290
		1.875% 期日 01/23/2026		1,470	1,708
		First Abu Dhabi Bank PJSC			
		2.951% 期日 04/16/2022	USD	11,184	11,254
		GE Capital European Funding Unlimited Co.			
		0.000% 期日 01/21/2020	EUR	350	390
		0.000% 期日 05/17/2021		375	417
		0.800% 期日 01/21/2022		4,610	5,199
		2.250% 期日 07/20/2020		732	829
		2.625% 期日 03/15/2023		200	239
		4.350% 期日 11/03/2021		400	483
		GE Capital International Funding Company Unlimited Co.			
		2.342% 期日 11/15/2020	USD	900	900
		4.418% 期日 11/15/2035		2,400	2,537
		GE Capital UK Funding Unlimited			
		4.125% 期日 09/13/2023	GBP	200	279
		5.125% 期日 05/24/2023		600	857
		5.875% 期日 11/04/2020		1,140	1,539
		Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
		2.875% 期日 06/20/2022	EUR	1,100	1,307
		3.000% 期日 03/29/2025		400	487
		GLP Capital LP			
		5.250% 期日 06/01/2025	USD	650	714
		5.300% 期日 01/15/2029		3,142	3,486
		Goldman Sachs Group, Inc.			
		2.898% 期日 02/23/2023		12,900	12,940
		3.200% 期日 02/23/2023		10,300	10,628
		Goodman U.S. Finance Three LLC			
		3.700% 期日 03/15/2028		2,324	2,421
		Grainger PLC			
		3.375% 期日 04/24/2028	GBP	1,300	1,775
		Growthpoint Properties International Pty Ltd.			
		5.872% 期日 05/02/2023	USD	1,600	1,719
		Horse Gallop Finance Ltd.			
		3.250% 期日 05/30/2022		10,200	10,340
		Host Hotels & Resorts LP			
		4.000% 期日 06/15/2025		200	213
		Howard Hughes Corp.			
		5.375% 期日 03/15/2025		2,932	3,060
		HSBC Holdings PLC			
		2.633% 期日 11/07/2025		28,173	28,173
		2.724% 期日 05/18/2021		7,000	7,009
		3.000% 期日 07/22/2028	GBP	8,700	12,085
		3.000% 期日 05/29/2030	USD	3,900	5,390
		3.033% 期日 11/22/2023		4,900	5,012
		3.124% 期日 05/18/2024		2,000	2,015

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		3.262% 期日 03/13/2023		800	818
		3.368% 期日 03/11/2025		18,600	18,737
		3.950% 期日 05/18/2024		200	210
		3.973% 期日 05/22/2030		6,000	6,484
		4.041% 期日 03/13/2028		700	751
		4.300% 期日 03/08/2026		500	546
		4.750% 期日 07/04/2029	EUR	2,800	3,336
		5.875% 期日 09/28/2026	GBP	6,800	9,426
		6.000% 期日 09/29/2023	EUR	9,000	11,436
		6.500% 期日 03/23/2028	USD	10,070	10,671
		Hudson Pacific Properties LP			
		3.950% 期日 11/01/2027		363	383
		Hunt Cos., Inc.			
		6.250% 期日 02/15/2026		462	455
		ICICI Bank Ltd.			
		3.125% 期日 08/12/2020		200	201
		IMMOFINANZ AG			
		2.625% 期日 01/27/2023	EUR	9,600	11,341
		InCaps Funding I Ltd.			
		4.132% 期日 06/01/2033	USD	13,282	12,797
		4.138% 期日 06/01/2033		3,612	3,477
		Industrial & Commercial Bank of China Ltd.			
		2.625% 期日 05/26/2020		1,600	1,602
		2.937% 期日 11/08/2020		2,000	2,003
		ING Groep NV			
		3.085% 期日 10/02/2023		3,500	3,532
		4.100% 期日 10/02/2023		6,000	6,397
		5.750% 期日 11/16/2026		6,600	6,769
		International Lease Finance Corp.			
		5.875% 期日 08/15/2022		500	548
		8.250% 期日 12/15/2020		7,970	8,509
		8.625% 期日 01/15/2022		3,201	3,635
		iStar, Inc.			
		5.250% 期日 09/15/2022		206	211
		JPMorgan Chase Bank N.A.			
		2.276% 期日 04/26/2021		10,700	10,707
		3.086% 期日 04/26/2021		7,800	7,840
		KBC Group NV			
		4.250% 期日 10/24/2025	EUR	600	668
		4.750% 期日 03/05/2024		1,000	1,185
		Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
		3.250% 期日 11/12/2025		1,400	1,646
		3.950% 期日 06/30/2022	GBP	800	1,069
		Kennedy-Wilson, Inc.			
		5.875% 期日 04/01/2024	USD	1,395	1,451
		La Mondiale SAM			
		4.375% 期日 04/24/2029	EUR	1,800	2,074
		LeasePlan Corp. NV			
		0.125% 期日 09/13/2023		6,600	7,283
		Life Storage LP			
		4.000% 期日 06/15/2029	USD	558	599
		LifeStorage LP			
		3.500% 期日 07/01/2026		1,200	1,241
		3.875% 期日 12/15/2027		611	649

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		Lloyds Bank PLC			
		2.699% 期日 05/07/2021		4,000	4,007
		3.300% 期日 05/07/2021		9,600	9,776
		12.000% 期日 12/16/2024		100	122
		Lloyds Banking Group PLC			
		2.250% 期日 10/16/2024	GBP	600	798
		2.858% 期日 03/17/2023	USD	25,200	25,476
		2.907% 期日 11/07/2023		1,700	1,725
		3.574% 期日 11/07/2028		5,600	5,838
		4.000% 期日 03/07/2025	AUD	3,500	2,566
		4.050% 期日 08/16/2023	USD	5,800	6,138
		4.375% 期日 03/22/2028		2,200	2,432
		4.450% 期日 05/08/2025		3,400	3,715
		4.550% 期日 08/16/2028		4,600	5,173
		6.375% 期日 06/27/2020	EUR	2,011	2,315
		7.500% 期日 06/27/2024	USD	2,700	2,963
		7.500% 期日 09/27/2025		7,700	8,478
		7.625% 期日 06/27/2023	GBP	10,711	15,521
		7.875% 期日 06/27/2029		4,600	7,248
		LoanCore Capital Markets LLC			
		6.875% 期日 06/01/2020	USD	1,900	1,901
		Logicor 2019-1 UK PLC			
		1.875% 期日 11/17/2026	GBP	2,140	2,796
		Logicor Financing Sarl			
		0.750% 期日 07/15/2024	EUR	800	898
		1.500% 期日 11/14/2022		3,240	3,736
		1.625% 期日 07/15/2027		800	912
		2.250% 期日 05/13/2025		2,400	2,886
		3.250% 期日 11/13/2028		586	742
		Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.			
		2.652% 期日 09/19/2022	USD	1,100	1,106
		Mizuho Bank Ltd.			
		2.400% 期日 03/26/2020		1,200	1,202
		Mizuho Financial Group, Inc.			
		2.601% 期日 09/11/2022		4,200	4,251
		3.018% 期日 09/11/2022		10,200	10,285
		Morgan Stanley			
		2.731% 期日 02/10/2021		12,900	12,912
		3.125% 期日 01/23/2023		4,020	4,139
		National Australia Bank Ltd.			
		2.625% 期日 07/23/2020		250	251
		National Bank of Greece S.A.			
		2.750% 期日 10/19/2020	EUR	800	915
		Nationwide Building Society			
		3.622% 期日 04/26/2023	USD	4,920	5,060
		3.766% 期日 03/08/2024		5,600	5,823
		3.960% 期日 07/18/2030		5,600	6,019
		4.302% 期日 03/08/2029		12,500	13,701
		5.875% 期日 12/20/2024	GBP	1,600	2,188
		NatWest Markets PLC			
		0.490% 期日 09/27/2021	EUR	5,100	5,740
		0.625% 期日 03/02/2022		300	339
		3.625% 期日 09/29/2022	USD	22,700	23,535
		Navient Corp.			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		5.000% 期日 10/26/2020		5,030	5,135
		5.625% 期日 08/01/2033		1,468	1,285
		5.875% 期日 03/25/2021		14,903	15,518
		6.500% 期日 06/15/2022		4,990	5,352
		6.625% 期日 07/26/2021		3,990	4,224
		7.250% 期日 01/25/2022		6,298	6,855
		8.000% 期日 03/25/2020		32,814	33,593
		NE Property BV			
		1.875% 期日 10/09/2026	EUR	7,600	8,475
		2.625% 期日 05/22/2023		3,100	3,626
		Newmark Group, Inc.			
		6.125% 期日 11/15/2023	USD	2,334	2,547
		Omega Healthcare Investors, Inc.			
		3.625% 期日 10/01/2029		1,682	1,699
		Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust			
		3.125% 期日 03/20/2022		696	712
		Oppenheimer Holdings, Inc.			
		6.750% 期日 07/01/2022		318	330
		Park Aerospace Holdings Ltd.			
		3.625% 期日 03/15/2021		18,709	19,001
		4.500% 期日 03/15/2023		9,522	10,027
		5.250% 期日 08/15/2022		56,975	60,818
		5.500% 期日 02/15/2024		4,384	4,825
		Physicians Realty LP			
		3.950% 期日 01/15/2028		918	967
		Preferred Term Securities XVIII Ltd.			
		2.499% 期日 09/23/2035		384	372
		Preferred Term Securities XXIV Ltd.			
		2.419% 期日 03/22/2037		1,253	1,118
		2.499% 期日 03/22/2037		4,830	3,610
		Preferred Term Securities XXV Ltd.			
		2.409% 期日 06/22/2037		29,752	26,145
		Preferred Term Securities XXVI Ltd.			
		2.419% 期日 09/22/2037		36,456	32,811
		Qatari Diar Finance QSC			
		5.000% 期日 07/21/2020		11,400	11,621
		QNB Finance Ltd.			
		3.500% 期日 03/28/2024		7,200	7,450
		3.531% 期日 02/12/2020		79,800	80,106
		3.559% 期日 02/07/2020		56,200	56,341
		Reckson Operating Partnership LP			
		7.750% 期日 03/15/2020		500	510
		Royal Bank of Scotland Group PLC			
		2.000% 期日 03/08/2023	EUR	4,000	4,643
		2.000% 期日 03/04/2025		23,650	27,955
		2.500% 期日 03/22/2023		28,300	33,911
		3.125% 期日 03/28/2027	GBP	3,200	4,367
		3.498% 期日 05/15/2023	USD	5,114	5,227
		3.628% 期日 05/15/2023		3,674	3,705
		3.656% 期日 06/25/2024		1,400	1,410
		3.875% 期日 09/12/2023		8,100	8,451
		4.269% 期日 03/22/2025		11,500	12,208

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		4.445% 期日 05/08/2030		17,600		19,329
		4.519% 期日 06/25/2024		400		425
		4.800% 期日 04/05/2026		2,300		2,554
		5.076% 期日 01/27/2030		16,500		18,924
		7.500% 期日 08/10/2020		8,300		8,476
		8.000% 期日 08/10/2025		12,260		14,053
		8.625% 期日 08/15/2021		10,400		11,232
		Sabra Health Care LP				
		3.900% 期日 10/15/2029		410		408
		4.800% 期日 06/01/2024		564		595
		Sagax AB				
		2.000% 期日 01/17/2024	EUR	1,600		1,864
		2.250% 期日 03/13/2025		6,800		8,038
		Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
		1.125% 期日 09/04/2026		2,410		2,667
		Santander Holdings USA, Inc.				
		3.244% 期日 10/05/2026	USD	160		161
		3.400% 期日 01/18/2023		14,048		14,450
		3.500% 期日 06/07/2024		2,100		2,161
		4.400% 期日 07/13/2027		1,284		1,383
		4.500% 期日 07/17/2025		3,000		3,235
		Santander UK Group Holdings PLC				
		0.440% 期日 03/27/2024	EUR	2,800		3,131
		2.875% 期日 08/05/2021	USD	3,600		3,639
		2.920% 期日 05/08/2026	GBP	720		970
		3.373% 期日 01/05/2024	USD	55,550		56,750
		3.571% 期日 01/10/2023		1,500		1,533
		3.625% 期日 01/14/2026	GBP	1,900		2,685
		3.823% 期日 11/03/2028	USD	3,400		3,589
		6.750% 期日 06/24/2024	GBP	16,610		23,011
		7.375% 期日 06/24/2022		7,500		10,439
		Santander UK PLC				
		1.625% 期日 05/10/2021		4,200		5,467
		2.758% 期日 06/01/2021	USD	1,200		1,204
		3.400% 期日 06/01/2021		4,800		4,904
		SBA Tower Trust				
		2.877% 期日 07/09/2021		1,500		1,509
		Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
		3.352% 期日 11/15/2019	EUR	8,000		8,936
		5.717% 期日 06/16/2021	USD	900		945
		6.125% 期日 02/07/2022		10,400		11,185
		SELP Finance Sarl				
		1.500% 期日 11/20/2025	EUR	700		813
		SL Green Operating Partnership LP				
		3.250% 期日 10/15/2022	USD	234		240
		SL Green Realty Corp.				
		4.500% 期日 12/01/2022		1,420		1,497
		SMBC Trust Account				
		3.212% 期日 04/09/2021		5,000		4,986
		Societe Generale S.A.				
		6.750% 期日 04/06/2028		1,511		1,595
		7.375% 期日 10/04/2023		8,200		8,770
		Society of Lloyd's				
		4.750% 期日 10/30/2024	GBP	500		720

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		Springleaf Finance Corp.			
		5.625% 期日 03/15/2023	USD	27,700	29,778
		6.125% 期日 05/15/2022		16,277	17,579
		6.125% 期日 03/15/2024		2,294	2,515
		6.625% 期日 01/15/2028		761	845
		6.875% 期日 03/15/2025		3,161	3,588
		7.750% 期日 10/01/2021		2,948	3,224
		8.250% 期日 12/15/2020		23,219	24,757
		Standard Chartered PLC			
		3.116% 期日 01/20/2023		2,470	2,486
		3.334% 期日 09/10/2022		8,100	8,157
		4.247% 期日 01/20/2023		4,700	4,875
		Starwood Property Trust, Inc.			
		3.625% 期日 02/01/2021		8,000	8,080
		4.750% 期日 03/15/2025		691	719
		5.000% 期日 12/15/2021		500	519
		State Bank of India			
		2.993% 期日 04/06/2020		14,500	14,526
		Stearns Holdings LLC			
		9.375% 期日 08/15/2020		1,520	752
		STORE Capital Corp.			
		4.500% 期日 03/15/2028		830	912
		4.625% 期日 03/15/2029		187	207
		Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
		2.352% 期日 01/17/2020		6,300	6,306
		2.514% 期日 01/17/2020		6,300	6,307
		Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
		2.742% 期日 01/17/2023		4,410	4,419
		3.102% 期日 01/17/2023		1,196	1,229
		Summit Properties Ltd.			
		2.000% 期日 01/31/2025	EUR	1,100	1,181
		Tesco Property Finance 2 PLC			
		6.052% 期日 10/13/2039	GBP	4,773	8,105
		Tesco Property Finance 3 PLC			
		5.744% 期日 04/13/2040		165	278
		Tesco Property Finance 4 PLC			
		5.801% 期日 10/13/2040		401	679
		Tesco Property Finance 6 PLC			
		5.411% 期日 07/13/2044		2,605	4,298
		TLG Immobilien AG			
		0.375% 期日 09/23/2022	EUR	2,000	2,243
		1.375% 期日 11/27/2024		1,500	1,741
		1.500% 期日 05/28/2026		6,200	7,145
		TP ICAP PLC			
		5.250% 期日 01/26/2024	GBP	2,100	2,943
		5.250% 期日 05/29/2026		3,300	4,563
		U. S. Capital Funding VI Ltd.			
		2.290% 期日 07/10/2043	USD	27,123	23,834
		UBS AG			
		4.750% 期日 02/12/2026	EUR	6,800	8,001
		5.125% 期日 05/15/2024	USD	900	971
		7.625% 期日 08/17/2022		6,000	6,764
		UBS Group AG			
		2.650% 期日 02/01/2022		2,500	2,531

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		2.859% 期日 08/15/2023		1,000		1,015
		3.491% 期日 05/23/2023		2,000		2,062
		4.125% 期日 09/24/2025		2,870		3,130
		4.125% 期日 04/15/2026		2,500		2,735
		4.253% 期日 03/23/2028		1,800		1,986
		5.750% 期日 02/19/2022	EUR	3,200		3,913
		7.000% 期日 02/19/2025	USD	200		224
		UDR, Inc.				
		3.500% 期日 01/15/2028		410		434
		4.625% 期日 01/10/2022		103		108
		UniCredit SpA				
		7.830% 期日 12/04/2023		72,590		85,634
		Unique Pub Finance Co. PLC				
		5.659% 期日 06/30/2027	GBP	1,981		2,925
		7.395% 期日 03/28/2024		1,886		2,814
		Vesteda Finance BV				
		1.500% 期日 05/24/2027	EUR	1,100		1,300
		VICI Properties 1 LLC				
		8.000% 期日 10/15/2023	USD	3,278		3,585
		Voyager Aviation Holdings LLC				
		8.500% 期日 08/15/2021		3,970		4,125
		Wells Fargo & Co.				
		3.111% 期日 02/11/2022		6,670		6,715
		Wells Fargo Bank N.A.				
		2.434% 期日 07/23/2021		4,700		4,708
		3.325% 期日 07/23/2021		7,650		7,720
		Welltower, Inc.				
		4.250% 期日 04/15/2028		429		475
		WP Carey, Inc.				
		3.850% 期日 07/15/2029		282		301
		WPC Eurobond BV				
		1.350% 期日 04/15/2028	EUR	6,800		7,518
		2.125% 期日 04/15/2027		2,100		2,488
		2.250% 期日 04/09/2026		3,400		4,081
		Yorkshire Building Society				
		3.000% 期日 04/18/2025	GBP	600		799
						2,686,426
	産業	AA Bond Co. Ltd.				
	10.0%	2.750% 期日 07/31/2023		400		483
		2.875% 期日 01/31/2022		2,100		2,632
		4.249% 期日 07/31/2020		506		662
		4.875% 期日 07/31/2024		900		1,160
		AbbVie, Inc.				
		3.375% 期日 11/14/2021	USD	4,219		4,332
		Allergan Funding SCS				
		3.000% 期日 03/12/2020		500		501
		Altice Financing S.A.				
		5.250% 期日 02/15/2023	EUR	16,920		19,425
		6.625% 期日 02/15/2023	USD	24,030		24,744
		7.500% 期日 05/15/2026		4,100		4,366
		Altice France S.A.				
		3.375% 期日 01/15/2028	EUR	2,300		2,576
		5.500% 期日 01/15/2028	USD	4,400		4,493
		7.375% 期日 05/01/2026		20,230		21,714

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		8.125% 期日 02/01/2027	4,300	4,778
		American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust		
		3.350% 期日 10/15/2029	441	458
		Avon International Capital PLC		
		6.500% 期日 08/15/2022	464	483
		Axiata SPV2 Bhd		
		3.466% 期日 11/19/2020	7,800	7,878
		Bacardi Ltd.		
		4.450% 期日 05/15/2025	2,000	2,153
		4.700% 期日 05/15/2028	2,600	2,848
		Baidu, Inc.		
		3.875% 期日 09/29/2023	2,100	2,183
		Bausch Health Cos., Inc.		
		6.500% 期日 03/15/2022	3,835	3,950
		Bayer U.S. Finance II LLC		
		2.736% 期日 06/25/2021	1,600	1,605
		BCPE Cycle Merger Sub II, Inc.		
		10.625% 期日 07/15/2027	1,282	1,202
		BMW Finance NV		
		2.250% 期日 08/12/2022	33,500	33,644
		Bombardier, Inc.		
		7.500% 期日 03/15/2025	274	263
		7.875% 期日 04/15/2027	6,056	5,723
		Boston Scientific Corp.		
		3.375% 期日 05/15/2022	2,260	2,336
		Broadcom Corp.		
		2.200% 期日 01/15/2021	100	100
		2.375% 期日 01/15/2020	100	100
		2.650% 期日 01/15/2023	7,325	7,356
		3.000% 期日 01/15/2022	6,026	6,106
		3.625% 期日 01/15/2024	16,387	16,881
		3.875% 期日 01/15/2027	12,106	12,235
		Camelot Finance S.A.		
		4.500% 期日 11/01/2026	732	741
		Campbell Soup Co.		
		2.619% 期日 03/16/2020	2,490	2,492
		2.749% 期日 03/15/2021	2,030	2,035
		Celgene Corp.		
		2.250% 期日 08/15/2021	3,660	3,679
		Central Nippon Expressway Co. Ltd.		
		2.618% 期日 02/15/2022	8,600	8,588
		2.827% 期日 08/04/2020	7,800	7,814
		Charles River Laboratories International, Inc.		
		4.250% 期日 05/01/2028	568	580
		Charter Communications Operating LLC		
		3.559% 期日 02/01/2024	9,800	10,090
		3.579% 期日 07/23/2020	26,426	26,655
		4.464% 期日 07/23/2022	8,814	9,269
		4.908% 期日 07/23/2025	806	889
		Cigna Corp.		
		2.891% 期日 07/15/2023	6,926	6,955
		CK Hutchison International 17 Ltd.		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨 (単位:千)	時価 (単位:千)
		2.875% 期日 04/05/2022	2,000	2,023
		Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.		
		9.250% 期日 02/15/2024	6,678	7,358
		Cleveland-Cliffs, Inc.		
		4.875% 期日 01/15/2024	1,040	1,071
		CNH Industrial Capital LLC		
		4.375% 期日 11/06/2020	300	307
		4.875% 期日 04/01/2021	80	83
		Community Health Systems, Inc.		
		5.125% 期日 08/01/2021	30,443	30,481
		6.250% 期日 03/31/2023	45,770	44,769
		8.000% 期日 03/15/2026	11,418	11,190
		8.625% 期日 01/15/2024	19,101	19,483
		Conagra Brands, Inc.		
		2.512% 期日 10/09/2020	180	180
		Connect Pinco SARL		
		6.750% 期日 10/01/2026	1,330	1,383
		Constellation Oil Services Holding S.A.		
		9.500% 期日 11/09/2024	754	381
		Core & Main Holdings LP		
		8.625% 期日 09/15/2024	893	892
		CSC Holdings LLC		
		6.500% 期日 02/01/2029	1,000	1,119
		CSCEC Finance Cayman I Ltd.		
		2.950% 期日 11/19/2020	400	402
		CVS Pass-Through Trust		
		7.507% 期日 01/10/2032	677	839
		DAE Funding LLC		
		4.000% 期日 08/01/2020	5,348	5,395
		4.500% 期日 08/01/2022	11,295	11,529
		5.000% 期日 08/01/2024	6,465	6,764
		5.250% 期日 11/15/2021	13,386	13,921
		5.750% 期日 11/15/2023	6,316	6,632
		Daimler Finance North America LLC		
		2.550% 期日 08/15/2022	10,050	10,127
		2.700% 期日 06/14/2024	4,600	4,655
		3.058% 期日 02/15/2022	16,750	16,863
		3.100% 期日 08/15/2029	1,600	1,635
		Danone S.A.		
		2.077% 期日 11/02/2021	408	408
		Davide Campari-Milano SpA		
		2.750% 期日 09/30/2020	EUR 1,410	1,610
		Dell Bank International DAC		
		0.625% 期日 10/17/2022	2,300	2,574
		Dell International LLC		
		4.420% 期日 06/15/2021	USD 12,612	13,028
		Delta Air Lines, Inc.		
		2.875% 期日 03/13/2020	1,720	1,724
		3.625% 期日 03/15/2022	920	944
		Diamond Resorts International, Inc.		
		7.750% 期日 09/01/2023	11,084	11,511
		10.750% 期日 09/01/2024	260	270
		DISH DBS Corp.		
		5.125% 期日 05/01/2020	4,588	4,645

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		5.875% 期日 07/15/2022		270	283
		DP World PLC			
		2.375% 期日 09/25/2026	EUR	990	1,190
		4.250% 期日 09/25/2030	GBP	800	1,147
		DR Horton, Inc.			
		4.000% 期日 02/15/2020	USD	290	292
		DXC Technology Co.			
		3.082% 期日 03/01/2021		4,154	4,154
		4.750% 期日 04/15/2027		254	269
		Eagle Holding Co. II LLC			
		7.750% 期日 05/15/2022		292	297
		Eastern Creation II Investment Holdings Ltd.			
		2.750% 期日 09/26/2020		2,300	2,304
		eBay, Inc.			
		2.875% 期日 08/01/2021		248	252
		3.800% 期日 03/09/2022		3,375	3,490
		EI Group PLC			
		6.375% 期日 02/15/2022	GBP	5,600	7,390
		6.875% 期日 02/15/2021		950	1,260
		EMC Corp.			
		2.650% 期日 06/01/2020	USD	31,268	31,307
		Energy Transfer Operating LP			
		4.150% 期日 10/01/2020		100	101
		Energy Transfer Partners LP			
		5.750% 期日 09/01/2020		2,140	2,184
		5.875% 期日 03/01/2022		450	481
		EQT Corp.			
		2.869% 期日 10/01/2020		1,100	1,098
		4.875% 期日 11/15/2021		150	154
		Equifax, Inc.			
		3.028% 期日 08/15/2021		1,668	1,671
		3.600% 期日 08/15/2021		586	601
		Eurofins Scientific SE			
		2.125% 期日 07/25/2024	EUR	800	910
		Exela Intermediate LLC			
		10.000% 期日 07/15/2023	USD	880	425
		F-Brasile SpA			
		7.375% 期日 08/15/2026		900	945
		Flex Ltd.			
		4.875% 期日 06/15/2029		1,851	2,004
		FMG Resources August 2006 Pty Ltd.			
		4.500% 期日 09/15/2027		1,000	992
		Ford Motor Credit Co. LLC			
		2.597% 期日 11/04/2019		1,300	1,300
		3.550% 期日 10/07/2022		8,355	8,384
		5.875% 期日 08/02/2021		400	420
		8.125% 期日 01/15/2020		1,600	1,617
		Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
		6.500% 期日 10/01/2025		8,426	8,531
		6.750% 期日 03/15/2022		12,084	12,613
		Fresenius Medical Care U.S. Finance II, Inc.			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		4.125% 期日 10/15/2020		16	16
		Fresenius U. S. Finance II, Inc.			
		4.250% 期日 02/01/2021		190	194
		G4S International Finance PLC			
		1.500% 期日 01/09/2023	EUR	1,400	1,600
		GATX Corp.			
		3.007% 期日 11/05/2021	USD	3,900	3,918
		General Electric Co.			
		0.000% 期日 05/28/2020	EUR	200	223
		0.375% 期日 05/17/2022		1,500	1,672
		2.200% 期日 01/09/2020	USD	405	405
		3.100% 期日 01/09/2023		431	439
		3.150% 期日 09/07/2022		126	128
		4.375% 期日 09/16/2020		46	47
		5.500% 期日 01/08/2020		950	956
		5.550% 期日 05/04/2020		567	576
		5.550% 期日 01/05/2026		6,390	7,269
		6.150% 期日 08/07/2037		257	317
		6.875% 期日 01/10/2039		87	115
		General Mills, Inc.			
		2.541% 期日 04/16/2021		2,524	2,532
		General Motors Financial Co., Inc.			
		3.150% 期日 01/15/2020		125	125
		3.200% 期日 07/13/2020		772	777
		Global Payments, Inc.			
		2.650% 期日 02/15/2025		720	730
		Greene King Finance PLC			
		3.593% 期日 03/15/2035	GBP	2,200	3,067
		4.064% 期日 03/15/2035		686	990
		5.106% 期日 03/15/2034		150	232
		5.702% 期日 12/15/2034		4,156	5,001
		Harvest Operations Corp.			
		2.330% 期日 04/14/2021	USD	2,884	2,895
		Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
		4.875% 期日 01/15/2030		572	609
		Horizon Pharma USA, Inc.			
		5.500% 期日 08/01/2027		1,000	1,046
		Hyundai Capital America			
		2.945% 期日 09/18/2020		3,198	3,205
		iHeartCommunications, Inc.			
		6.375% 期日 05/01/2026		11,605	12,504
		8.375% 期日 05/01/2027		21,507	23,173
		IHO Verwaltungs GmbH			
		3.625% 期日 05/15/2025	EUR	2,700	3,086
		3.875% 期日 05/15/2027		1,500	1,687
		6.000% 期日 05/15/2027	USD	3,520	3,648
		6.375% 期日 05/15/2029		3,777	3,886
		IMCD NV			
		2.500% 期日 03/26/2025	EUR	1,700	1,963
		Imperial Brands Finance PLC			
		2.950% 期日 07/21/2020	USD	1,300	1,306
		Incitec Pivot Finance LLC			
		6.000% 期日 12/10/2019		370	371
		Indonesia Asahan Aluminium Persero PT			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		5.230% 期日 11/15/2021		8,350		8,755
		5.710% 期日 11/15/2023		1,550		1,705
		Intelsat Connect Finance S.A.				
		9.500% 期日 02/15/2023		3,960		3,693
		Intelsat Jackson Holdings S.A.				
		5.500% 期日 08/01/2023		1,624		1,527
		8.000% 期日 02/15/2024		4,321		4,449
		8.500% 期日 10/15/2024		12,393		12,519
		9.750% 期日 07/15/2025		5,841		6,090
		Intelsat Luxembourg S.A.				
		7.750% 期日 06/01/2021		20,642		19,662
		International Flavors & Fragrances, Inc.				
		3.400% 期日 09/25/2020		1,750		1,770
		IQVIA, Inc.				
		2.875% 期日 09/15/2025	EUR	400		460
		3.250% 期日 03/15/2025		500		572
		Kinder Morgan, Inc.				
		7.750% 期日 01/15/2032	USD	2,500		3,445
		Kraft Heinz Foods Co.				
		2.751% 期日 02/10/2021		1,690		1,689
		6.500% 期日 02/09/2040		300		370
		7.125% 期日 08/01/2039		4,200		5,417
		L3Harris Technologies, Inc.				
		2.416% 期日 04/30/2020		5,600		5,602
		Lear Corp.				
		5.250% 期日 01/15/2025		16,138		16,641
		Live Nation Entertainment, Inc.				
		4.750% 期日 10/15/2027		140		146
		Martin Marietta Materials, Inc.				
		2.656% 期日 12/20/2019		680		680
		2.800% 期日 05/22/2020		570		571
		MGM Resorts International				
		6.625% 期日 12/15/2021		152		165
		6.750% 期日 10/01/2020		6,108		6,352
		Micron Technology, Inc.				
		4.185% 期日 02/15/2027		1,388		1,451
		4.663% 期日 02/15/2030		3,470		3,649
		5.327% 期日 02/06/2029		2,532		2,806
		5.500% 期日 02/01/2025		794		817
		Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.				
		3.500% 期日 07/30/2020		1,600		1,611
		Mitchells & Butlers Finance PLC				
		2.569% 期日 12/15/2030		606		564
		6.013% 期日 12/15/2028	GBP	1,013		1,496
		Motion Bondco DAC				
		6.625% 期日 11/15/2027	USD	400		408
		NCR Corp.				
		5.750% 期日 09/01/2027		56		58
		Netflix, Inc.				
		3.625% 期日 05/15/2027	EUR	3,900		4,590
		3.625% 期日 06/15/2030		4,200		4,690
		3.875% 期日 11/15/2029		7,478		8,560
		4.625% 期日 05/15/2029		7,600		9,296
		4.875% 期日 06/15/2030	USD	3,100		3,142

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		5.375% 期日 11/15/2029		980		1,034
		New Red Finance, Inc.				
		4.250% 期日 05/15/2024		4,823		4,962
		Noble Holding International Ltd.				
		7.875% 期日 02/01/2026		6,875		4,572
		Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class A				
		Pass-Through Trust				
		4.875% 期日 05/10/2028		441		426
		NXP BV				
		4.300% 期日 06/18/2029		2,200		2,350
		Occidental Petroleum Corp.				
		2.600% 期日 08/13/2021		687		692
		3.137% 期日 02/08/2021		857		863
		3.437% 期日 08/13/2021		412		415
		Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.				
		6.625% 期日 05/15/2022		5,091		4,926
		Pacific Drilling S.A.				
		8.375% 期日 10/01/2023		6,753		5,415
		Pacific National Finance Pty Ltd.				
		4.625% 期日 09/23/2020		530		540
		Pan American Energy LLC				
		56.635% 期日 11/20/2020	ARS	265,660		3,526
		Panasonic Corp.				
		2.536% 期日 07/19/2022	USD	200		202
		Par Pharmaceutical, Inc.				
		7.500% 期日 04/01/2027		2,604		2,480
		Pelabuhan Indonesia III Persero PT				
		4.500% 期日 05/02/2023		1,600		1,692
		Performance Food Group, Inc.				
		5.500% 期日 10/15/2027		508		540
		Petroleos de Venezuela S.A.				
		5.375% 期日 04/12/2027		11,932		805
		5.500% 期日 04/12/2037		10,372		700
		6.000% 期日 05/16/2024		8,283		559
		6.000% 期日 11/15/2026		13,183		890
		9.000% 期日 11/17/2021		400		27
		9.750% 期日 05/17/2035		4,730		319
		Petroleos Mexicanos				
		5.350% 期日 02/12/2028		880		871
		6.490% 期日 01/23/2027		6,170		6,594
		6.500% 期日 03/13/2027		3,970		4,218
		6.750% 期日 09/21/2047		390		389
		6.840% 期日 01/23/2030		4,720		5,047
		7.690% 期日 01/23/2050		2,430		2,647
		PetSmart, Inc.				
		5.875% 期日 06/01/2025		563		557
		Phillips 66				
		2.751% 期日 04/15/2020		900		900
		Prime Security Services Borrower LLC				
		9.250% 期日 05/15/2023		653		688
		QVC, Inc.				
		4.375% 期日 03/15/2023		1,376		1,430
		4.450% 期日 02/15/2025		2,379		2,500
		4.850% 期日 04/01/2024		2,983		3,157

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		5.125% 期日 07/02/2022		4,484		4,731
		5.450% 期日 08/15/2034		39		39
		5.950% 期日 03/15/2043		7,642		7,663
		Radiate Holdco LLC				
		6.875% 期日 02/15/2023		2,806		2,883
		RCI Banque S.A.				
		0.250% 期日 07/12/2021	EUR	1,300		1,455
		0.250% 期日 03/08/2023		2,350		2,591
		Refinitiv U.S. Holdings, Inc.				
		4.500% 期日 05/15/2026		14,530		17,611
		Rite Aid Corp.				
		6.125% 期日 04/01/2023	USD	4,940		4,224
		Roadster Finance DAC				
		1.625% 期日 12/09/2024	EUR	200		229
		2.375% 期日 12/08/2027		1,000		1,170
		Rockwell Collins, Inc.				
		2.800% 期日 03/15/2022	USD	194		198
		Russian Railways Via RZD Capital PLC				
		3.374% 期日 05/20/2021	EUR	7,700		9,037
		7.487% 期日 03/25/2031	GBP	6,300		10,926
		Sands China Ltd.				
		4.600% 期日 08/08/2023	USD	3,100		3,286
		5.125% 期日 08/08/2025		4,000		4,421
		5.400% 期日 08/08/2028		5,200		5,896
		Scotts Miracle-Gro Co.				
		4.500% 期日 10/15/2029		159		160
		Sensata Technologies, Inc.				
		4.375% 期日 02/15/2030		564		569
		Shire Acquisitions Investments Ireland DAC				
		2.400% 期日 09/23/2021		3,750		3,774
		SMBC Aviation Capital Finance DAC				
		2.650% 期日 07/15/2021		400		403
		3.000% 期日 07/15/2022		300		306
		3.550% 期日 04/15/2024		1,000		1,040
		4.125% 期日 07/15/2023		200		211
		SoftBank Group Corp.				
		4.000% 期日 04/20/2023	EUR	12,281		14,657
		Spanish Broadcasting System, Inc.				
		12.500% 期日 04/15/2049	USD	818		849
		Spectra Energy Partners LP				
		2.827% 期日 06/05/2020		500		501
		Spirit Issuer PLC				
		3.458% 期日 12/28/2031	GBP	1,060		1,353
		Sprint Spectrum Co. LLC				
		3.360% 期日 09/20/2021	USD	2,500		2,522
		4.738% 期日 03/20/2025		5,200		5,558
		5.152% 期日 03/20/2028		18,240		19,903
		Staples, Inc.				
		7.500% 期日 04/15/2026		1,275		1,329
		Syngenta Finance NV				
		3.698% 期日 04/24/2020		600		603
		3.933% 期日 04/23/2021		1,600		1,627
		4.441% 期日 04/24/2023		5,300		5,536
		4.892% 期日 04/24/2025		800		848

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		5.182% 期日 04/24/2028		1,800		1,910
		Tech Data Corp.				
		3.700% 期日 02/15/2022		1,572		1,613
		Telefonica Emisiones S.A.				
		5.134% 期日 04/27/2020		230		233
		Telesat Canada				
		6.500% 期日 10/15/2027		884		925
		Tenet Healthcare Corp.				
		4.625% 期日 07/15/2024		447		462
		4.625% 期日 09/01/2024		1,718		1,764
		Teva Pharmaceutical Finance Co. BV				
		3.650% 期日 11/10/2021		900		867
		Teva Pharmaceutical Finance IV BV				
		3.650% 期日 11/10/2021		418		403
		Teva Pharmaceutical Finance IV LLC				
		2.250% 期日 03/18/2020		21,174		20,962
		Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV				
		0.375% 期日 07/25/2020	EUR	19,350		21,270
		1.250% 期日 03/31/2023		1,800		1,769
		3.250% 期日 04/15/2022		12,900		14,266
		Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV				
		2.200% 期日 07/21/2021	USD	25,398		24,173
		2.800% 期日 07/21/2023		208		180
		Textron, Inc.				
		2.731% 期日 11/10/2020		3,770		3,770
		Thermo Fisher Scientific, Inc.				
		1.500% 期日 10/01/2039	EUR	2,000		2,169
		Times Square Hotel Trust				
		8.528% 期日 08/01/2026	USD	1,694		1,987
		T-Mobile USA, Inc.				
		4.750% 期日 02/01/2028		364		0
		Topaz Solar Farms LLC				
		4.875% 期日 09/30/2039		1,111		1,169
		5.750% 期日 09/30/2039		8,516		9,544
		TransDigm, Inc.				
		5.500% 期日 11/15/2027		1,330		1,329
		Transocean, Inc.				
		7.250% 期日 11/01/2025		2,595		2,303
		7.500% 期日 01/15/2026		1,783		1,596
		Trident TPI Holdings, Inc.				
		9.250% 期日 08/01/2024		869		845
		Triumph Group, Inc.				
		5.250% 期日 06/01/2022		486		480
		6.250% 期日 09/15/2024		1,541		1,622
		Trivium Packaging Finance BV				
		5.500% 期日 08/15/2026		1,000		1,050
		8.500% 期日 08/15/2027		600		641
		UCB S.A.				
		3.750% 期日 03/27/2020	EUR	376		426
		4.125% 期日 01/04/2021		150		175
		United Group BV				
		4.375% 期日 07/01/2022		1,500		1,710

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		4.875% 期日 07/01/2024		565	653
		United Rentals North America, Inc.			
		3.875% 期日 11/15/2027	USD	600	608
		United Technologies Corp.			
		2.818% 期日 08/16/2021		983	983
		Univision Communications, Inc.			
		5.125% 期日 05/15/2023		530	533
		5.125% 期日 02/15/2025		14,429	14,158
		Valaris PLC			
		5.750% 期日 10/01/2044		2,116	868
		7.750% 期日 02/01/2026		864	458
		Vale Overseas Ltd.			
		6.250% 期日 08/10/2026		3,616	4,225
		6.875% 期日 11/21/2036		1,207	1,541
		6.875% 期日 11/10/2039		951	1,221
		Vale S.A.			
		3.750% 期日 01/10/2023	EUR	1,500	1,819
		ViaSat, Inc.			
		5.625% 期日 09/15/2025	USD	3,804	3,874
		5.625% 期日 04/15/2027		403	426
		Virgin Media Secured Finance PLC			
		5.000% 期日 04/15/2027	GBP	1,220	1,668
		VMware, Inc.			
		2.300% 期日 08/21/2020	USD	568	569
		2.950% 期日 08/21/2022		5,956	6,055
		3.900% 期日 08/21/2027		540	558
		Volkswagen Bank GmbH			
		0.000% 期日 06/15/2021	EUR	900	1,005
		Volkswagen Financial Services AG			
		0.250% 期日 10/16/2020		5,577	6,243
		0.398% 期日 02/15/2021		7,300	8,189
		0.625% 期日 04/01/2022		5,349	6,038
		Volkswagen Financial Services NV			
		1.625% 期日 11/30/2022	GBP	3,300	4,254
		1.875% 期日 09/07/2021		300	391
		Volkswagen Leasing GmbH			
		0.025% 期日 07/06/2021	EUR	1,000	1,117
		0.250% 期日 02/16/2021		4,688	5,250
		0.500% 期日 06/20/2022		875	985
		Western Digital Corp.			
		4.750% 期日 02/15/2026	USD	5,260	5,385
		Woodside Finance Ltd.			
		4.500% 期日 03/04/2029		3,510	3,830
		Worldline S.A.			
		0.250% 期日 09/18/2024	EUR	3,600	3,981
		Wyndham Destinations, Inc.			
		3.900% 期日 03/01/2023	USD	1,682	1,698
		4.250% 期日 03/01/2022		115	118
		5.400% 期日 04/01/2024		5,058	5,387
		5.750% 期日 04/01/2027		1,464	1,605
		YPF S.A.			
		54.567% 期日 09/24/2020	ARS	169,450	2,177
		Zimmer Biomet Holdings, Inc.			
		3.375% 期日 11/30/2021	USD	124	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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価 (単位：千)
			通貨 (単位：千)	通貨	
					1,274,197
	公共事業	AT&T, Inc.			
	2.9%	2.951% 期日 07/15/2021		1,383	1,398
		China Resources Gas Group Ltd.			
		4.500% 期日 04/05/2022		400	417
		CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.			
		2.625% 期日 05/05/2020		400	401
		Duke Energy Corp.			
		2.675% 期日 05/14/2021		2,064	2,072
		Duquesne Light Holdings, Inc.			
		6.400% 期日 09/15/2020		1,000	1,034
		Edison International			
		2.400% 期日 09/15/2022		3,161	3,090
		2.950% 期日 03/15/2023		118	117
		5.750% 期日 06/15/2027		1,380	1,498
		El Paso Natural Gas Co. LLC			
		8.625% 期日 01/15/2022		1,900	2,148
		Enable Midstream Partners LP			
		4.950% 期日 05/15/2028		424	435
		Enbridge, Inc.			
		2.410% 期日 01/10/2020		8,800	8,805
		2.819% 期日 06/15/2020		4,400	4,407
		Florida Gas Transmission Co. LLC			
		5.450% 期日 07/15/2020		790	807
		Frontier Communications Corp.			
		8.000% 期日 04/01/2027		2,154	2,267
		Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
		4.375% 期日 09/19/2022		11,935	12,392
		6.000% 期日 11/27/2023		28,785	32,009
		Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.			
		2.250% 期日 11/22/2024	EUR	100	119
		2.949% 期日 01/24/2024		450	546
		3.600% 期日 02/26/2021		3,624	4,232
		4.950% 期日 03/23/2027	USD	1,200	1,300
		4.950% 期日 02/06/2028		1,000	1,092
		5.150% 期日 02/11/2026		5,700	6,231
		5.338% 期日 09/25/2020	GBP	1,018	1,364
		5.999% 期日 01/23/2021	USD	2,322	2,426
		6.510% 期日 03/07/2022		6,638	7,222
		7.288% 期日 08/16/2037		500	676
		8.625% 期日 04/28/2034		2,372	3,405
		Global Switch Holdings Ltd.			
		2.250% 期日 05/31/2027	EUR	100	121
		Kinder Morgan Energy Partners LP			
		6.850% 期日 02/15/2020	USD	2,750	2,786
		Korea National Oil Corp.			
		2.125% 期日 04/14/2021		600	600
		Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.			
		6.350% 期日 12/01/2021		331	331
		Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.			
		6.720% 期日 12/01/2022		307	302
		Pacific Gas & Electric Co.			
		2.450% 期日 08/15/2022		4,250	3,953
		2.950% 期日 03/01/2026		7,492	6,986

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)
		3.250% 期日 09/15/2021		3,713		3,509
		3.250% 期日 06/15/2023		7,001		6,546
		3.300% 期日 03/15/2027		3,838		3,598
		3.300% 期日 12/01/2027		11,095		10,471
		3.400% 期日 08/15/2024		5,770		5,467
		3.500% 期日 10/01/2020		9,206		8,769
		3.500% 期日 06/15/2025		4,937		4,690
		3.750% 期日 02/15/2024		3,579		3,391
		3.750% 期日 08/15/2042		418		382
		3.850% 期日 11/15/2023		2,049		1,936
		4.000% 期日 12/01/2046		197		180
		4.250% 期日 05/15/2021		3,093		2,954
		4.250% 期日 08/01/2023		2,300		2,208
		4.250% 期日 03/15/2046		982		906
		4.300% 期日 03/15/2045		1,196		1,106
		4.450% 期日 04/15/2042		2,186		2,038
		4.500% 期日 12/15/2041		743		687
		4.600% 期日 06/15/2043		334		316
		4.650% 期日 08/01/2028		100		97
		4.750% 期日 02/15/2044		1,085		1,047
		5.125% 期日 11/15/2043		3,393		3,289
		5.400% 期日 01/15/2040		8,388		8,304
		5.800% 期日 03/01/2037		6,765		6,765
		6.050% 期日 03/01/2034		19,770		19,918
		6.250% 期日 03/01/2039		3,287		3,361
		6.350% 期日 02/15/2038		5,896		6,014
		Petrobras Global Finance BV				
		5.093% 期日 01/15/2030		28,821		30,579
		5.875% 期日 03/07/2022	EUR	800		1,010
		6.125% 期日 01/17/2022	USD	13,441		14,463
		6.250% 期日 12/14/2026	GBP	6,234		9,568
		6.625% 期日 01/16/2034		2,900		4,480
		6.850% 期日 06/05/2115	USD	316		364
		Plains All American Pipeline LP				
		6.650% 期日 01/15/2037		416		481
		Rio Oil Finance Trust Series 2014-1				
		9.250% 期日 07/06/2024		2,653		2,965
		Rio Oil Finance Trust Series 2014-3				
		9.750% 期日 01/06/2027		830		972
		Rio Oil Finance Trust Series 2018-1				
		8.200% 期日 04/06/2028		2,800		3,213
		Rosneft Finance S.A.				
		7.250% 期日 02/02/2020		750		760
		Sabine Pass Liquefaction LLC				
		5.625% 期日 02/01/2021		664		685
		San Diego Gas & Electric Co.				
		3.750% 期日 06/01/2047		62		65
		Sempra Energy				
		2.569% 期日 03/15/2021		8,200		8,179
		SGSP Australia Assets Pty Ltd.				
		3.300% 期日 04/09/2023		250		257
		Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.				
		2.500% 期日 04/28/2020		200		200

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨 (単位:千)	時価 (単位:千)
		Southern California Edison Co.		
		3.650% 期日 03/01/2028	118	125
		5.750% 期日 04/01/2035	196	235
		6.000% 期日 01/15/2034	54	66
		6.650% 期日 04/01/2029	578	678
		Southern California Gas Co.		
		5.125% 期日 11/15/2040	32	40
		Southern Co.		
		2.750% 期日 06/15/2020	396	398
		Sprint Communications, Inc.		
		6.000% 期日 11/15/2022	2,712	2,875
		7.000% 期日 08/15/2020	17,292	17,857
		Sprint Corp.		
		7.125% 期日 06/15/2024	488	531
		7.250% 期日 09/15/2021	30,046	32,136
		7.625% 期日 03/01/2026	839	930
		7.875% 期日 09/15/2023	6,029	6,670
		State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.		
		2.250% 期日 05/04/2020	200	200
		2.750% 期日 05/04/2022	1,700	1,718
		Talen Energy Supply LLC		
		6.625% 期日 01/15/2028	580	563
		Transocean Phoenix 2 Ltd.		
		7.750% 期日 10/15/2024	1,470	1,525
		Transocean Proteus Ltd.		
		6.250% 期日 12/01/2024	41	41
		Transocean Sentry Ltd.		
		5.375% 期日 05/15/2023	1,200	1,193
		Verizon Communications, Inc.		
		5.250% 期日 03/16/2037	387	488
				<u>371,448</u>
		社債券等合計		<u>4,332,071</u>
		(原価: 4,244,317米ドル)		
転換社債及び短期証券		Caesars Entertainment Corp.		
0.0%		5.000% 期日 10/01/2024	2,906	5,152
		EnSCO Jersey Finance Ltd.		
		3.000% 期日 01/31/2024	262	170
		転換社債及び短期証券合計		<u>5,322</u>
		(原価: 4,540米ドル)		
地方債		Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010		
0.5%		6.630% 期日 02/01/2035	655	771
		6.725% 期日 04/01/2035	280	328
		7.350% 期日 07/01/2035	545	660
		Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003		
		5.100% 期日 06/01/2033	1,740	1,883
		Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015		
		7.750% 期日 01/01/2042	130	149
		Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017		
		7.045% 期日 01/01/2029	370	411

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨 (単位:千)	時価 (単位:千)
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2001 5.125% 期日 07/01/2031	17,360	13,345
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006 5.000% 期日 07/01/2031	420	323
		5.250% 期日 07/01/2023	500	385
		5.250% 期日 07/01/2026	1,000	770
		5.250% 期日 07/01/2049	610	462
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007 5.000% 期日 07/01/2027	700	538
		5.000% 期日 07/01/2028	75	58
		5.250% 期日 07/01/2032	400	308
		5.250% 期日 07/01/2034	400	308
		5.250% 期日 07/01/2037	410	316
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008 5.000% 期日 07/01/2023	300	230
		5.125% 期日 07/01/2028	130	100
		5.500% 期日 07/01/2032	10,780	8,274
		5.700% 期日 07/01/2023	685	512
		6.000% 期日 07/01/2038	4,070	3,164
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009 5.750% 期日 07/01/2038	550	415
		6.000% 期日 07/01/2039	215	164
		6.500% 期日 07/01/2037	400	313
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011 5.375% 期日 07/01/2030	685	494
		5.750% 期日 07/01/2041	1,900	1,377
		6.500% 期日 07/01/2040	120	91
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012 4.125% 期日 07/01/2022	500	327
		5.000% 期日 07/01/2021	1,010	677
		5.000% 期日 07/01/2041	3,660	2,351
		5.125% 期日 07/01/2037	800	528
		5.500% 期日 07/01/2026	1,900	1,278
		5.500% 期日 07/01/2039	4,215	2,835
		Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014 8.000% 期日 07/01/2035	13,450	8,171
		Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 6.050% 期日 07/01/2032	800	609
		6.125% 期日 07/01/2040	3,000	2,284
		Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016 2.573% 期日 09/25/2056	1,025	1,023
		Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017 2.573% 期日 01/25/2057	9,489	9,472

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014 8.250% 期日 07/01/2024		700		706
		地方債合計 (原価：47,609米ドル)				66,410
米国政府機関債 34.7%		Fannie Mae				
		2.123% 期日 05/25/2048		5,318		5,272
		2.500% 期日 10/01/2022		233		236
		3.000% 期日 08/01/2049		16,240		16,522
		3.000% 期日 09/01/2049		81,801		83,235
		3.500% 期日 08/01/2042		55		58
		3.500% 期日 09/01/2047		850		881
		3.500% 期日 03/01/2048		222		229
		3.500% 期日 04/01/2048		451		466
		3.500% 期日 06/01/2049		3,328		3,415
		4.000% 期日 07/01/2040		132		137
		4.000% 期日 12/01/2041		164		170
		4.000% 期日 07/01/2042		272		281
		4.000% 期日 08/01/2042		56		58
		4.000% 期日 09/01/2042		312		323
		4.000% 期日 11/01/2045		412		436
		4.000% 期日 03/01/2047		231		242
		4.000% 期日 04/01/2047		880		943
		4.000% 期日 08/01/2047		20,382		21,394
		4.000% 期日 10/01/2047		954		1,001
		4.000% 期日 12/01/2047		137		142
		4.000% 期日 01/01/2048		204		215
		4.000% 期日 02/01/2048		2,465		2,587
		4.000% 期日 07/01/2048		43,468		45,239
		4.000% 期日 08/01/2048		29,483		30,595
		4.000% 期日 09/01/2048		24,883		25,944
		4.000% 期日 11/01/2048		94,859		98,521
		4.000% 期日 12/01/2048		3,515		3,648
		4.000% 期日 03/01/2049		39,914		41,422
		4.000% 期日 08/01/2049		614		638
		4.377% 期日 05/25/2048		5,318		1,203
		4.500% 期日 05/01/2033		18		19
		4.500% 期日 07/01/2033		35		37
		4.500% 期日 05/01/2034		1		1
		4.500% 期日 05/01/2035		7		7
		4.500% 期日 02/01/2038		2		2
		4.500% 期日 01/01/2041		476		494
		4.750% 期日 06/01/2033		206		213
		5.000% 期日 10/01/2035		75		77
		5.000% 期日 12/01/2035		241		253
		5.000% 期日 10/01/2036		7		7
		5.000% 期日 05/01/2038		4		4
		5.000% 期日 11/01/2039		8		8
		5.000% 期日 10/01/2051		453		477
		5.500% 期日 07/01/2033		41		45
		5.500% 期日 06/01/2035		814		860
		5.500% 期日 04/01/2036		2		2
		5.500% 期日 11/01/2036		7		8
		5.500% 期日 03/01/2037		16		17

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)	通貨 (単位:千)
		5.500% 期日 09/01/2037	10		11	
		5.500% 期日 02/01/2038	4		4	
		5.500% 期日 04/01/2038	26		28	
		6.000% 期日 08/01/2031	29		30	
		6.000% 期日 06/01/2032	6		6	
		6.000% 期日 09/01/2039	413		447	
		6.000% 期日 10/01/2047	28		30	
		6.500% 期日 01/01/2037	4		5	
		6.500% 期日 10/01/2037	9		10	
		7.000% 期日 09/01/2031	36		36	
		7.000% 期日 05/01/2037	2		2	
		7.500% 期日 09/01/2032	11		11	
		Fannie Mae, TBA				
		2.500% 期日 12/01/2034	3,000		3,031	
		3.000% 期日 12/01/2033	9,500		9,725	
		3.000% 期日 12/01/2049	134,200		136,236	
		3.500% 期日 12/01/2048	570,200		585,546	
		4.000% 期日 11/01/2048	101,825		105,675	
		4.000% 期日 12/01/2048	221,500		230,049	
		Freddie Mac				
		3.000% 期日 11/01/2046	202		207	
		3.000% 期日 12/01/2047	7,858		8,037	
		3.000% 期日 03/01/2048	459		469	
		3.000% 期日 06/01/2048	24,993		25,523	
		3.000% 期日 07/01/2048	55,061		56,209	
		3.000% 期日 09/01/2048	343		350	
		3.000% 期日 09/01/2049	41,768		42,499	
		3.500% 期日 10/01/2047	8,069		8,362	
		3.500% 期日 12/01/2047	3,343		3,462	
		3.500% 期日 03/01/2048	9,878		10,209	
		3.500% 期日 04/01/2048	4,101		4,240	
		3.500% 期日 10/01/2048	8,076		8,311	
		3.500% 期日 12/01/2048	16,820		17,304	
		3.500% 期日 03/01/2049	12,292		12,630	
		3.500% 期日 05/01/2049	109,290		112,309	
		3.500% 期日 08/01/2049	22,634		23,259	
		3.500% 期日 09/01/2049	109,625		112,629	
		4.000% 期日 09/01/2033	5		5	
		4.000% 期日 04/01/2047	1,500		1,575	
		4.000% 期日 05/01/2047	1,505		1,580	
		4.000% 期日 08/01/2047	2,391		2,512	
		4.000% 期日 08/01/2048	4,950		5,144	
		4.000% 期日 09/01/2048	2,077		2,158	
		4.000% 期日 10/01/2048	2,151		2,236	
		4.000% 期日 12/01/2048	55,577		58,484	
		4.000% 期日 01/01/2049	5,322		5,520	
		4.000% 期日 02/01/2049	24,943		26,183	
		4.000% 期日 03/01/2049	1,783		1,881	
		4.000% 期日 08/01/2049	363		377	
		4.500% 期日 05/01/2036	6		6	
		4.629% 期日 06/15/2042	77		15	
		5.000% 期日 06/01/2034	451		480	
		5.000% 期日 08/01/2035	72		75	
		5.000% 期日 01/01/2037	4		4	

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨 (単位:千)	時価 (単位:千)
		5.000% 期日 01/01/2038	2	2
		5.500% 期日 01/01/2035	1,488	1,624
		5.500% 期日 05/01/2037	5	6
		5.500% 期日 06/01/2037	209	218
		5.500% 期日 07/01/2037	38	40
		5.750% 期日 05/01/2037	427	476
		6.000% 期日 07/01/2037	50	53
		Ginnie Mae		
		4.000% 期日 04/20/2047	7,290	7,671
		4.000% 期日 05/20/2047	134,889	141,603
		4.000% 期日 06/20/2047	63,229	66,366
		4.000% 期日 07/20/2047	57,397	60,253
		4.000% 期日 02/20/2048	43,247	45,312
		4.000% 期日 09/20/2049	127,814	133,887
		4.500% 期日 01/20/2040	242	256
		4.500% 期日 03/20/2040	36	38
		5.000% 期日 08/20/2030	785	837
		5.000% 期日 05/20/2040	599	633
		5.000% 期日 11/20/2040	20	21
		5.000% 期日 04/20/2041	26	27
		5.500% 期日 05/20/2038	8	9
		5.500% 期日 06/20/2038	208	223
		5.500% 期日 07/20/2038	83	86
		5.500% 期日 08/20/2038	598	639
		5.500% 期日 09/20/2038	312	333
		5.500% 期日 10/20/2038	30	31
		5.500% 期日 01/20/2039	12	12
		5.500% 期日 02/20/2039	64	68
		5.500% 期日 07/20/2039	64	67
		5.500% 期日 09/20/2039	149	159
		5.500% 期日 10/20/2039	12	13
		5.500% 期日 11/20/2039	423	451
		5.500% 期日 12/20/2039	27	29
		5.500% 期日 01/20/2040	355	372
		5.500% 期日 06/20/2040	507	563
		5.500% 期日 07/20/2040	530	555
		Ginnie Mae, TBA		
		4.000% 期日 11/01/2048	648,250	674,129
		4.000% 期日 12/15/2049	1,232,550	1,281,178
		米国政府機関債合計		4,431,350
		(原価: 4,419,133米ドル)		
		Treasury Inflation Protected Securities		
		0.125% 期日 04/15/2020	1,205	1,199
		0.250% 期日 07/15/2029	153,357	155,098
		0.375% 期日 01/15/2027	5	5
		0.375% 期日 07/15/2027	1,322	1,346
		0.625% 期日 07/15/2021	80	80
		0.625% 期日 02/15/2043	781	801
		0.750% 期日 07/15/2028	95,765	100,851
		0.875% 期日 01/15/2029	59,419	63,228
		1.000% 期日 02/15/2048	1,977	2,213
		1.000% 期日 02/15/2049	31,300	35,255
		2.375% 期日 01/15/2025	26,976	30,026
		U. S. Treasury Bonds		
米国財務省証券 4.7%				

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		2.250% 期日 08/15/2046	100	101
		2.375% 期日 05/15/2029	134,400	142,538
		2.625% 期日 02/15/2029	5,000	5,407
		2.750% 期日 08/15/2047	2,830	3,167
		3.000% 期日 08/15/2048	155	182
		3.000% 期日 02/15/2049	77	91
		3.125% 期日 05/15/2048	180	216
		U. S. Treasury Notes		
		1.625% 期日 02/15/2026	2,200	2,204
		2.000% 期日 02/15/2025	11,021	11,270
		2.000% 期日 08/15/2025	1,400	1,433
		2.000% 期日 11/15/2026	800	821
		2.250% 期日 11/15/2024	12,300	12,719
		2.250% 期日 02/15/2027	28,000	29,241
		米国財務省証券合計		599,492
		(原価：579,629米ドル)		
モーゲージ証券		Accredited Mortgage Loan Trust		
34.5%		2.768% 期日 07/25/2035	9,806	9,779
		3.518% 期日 07/25/2035	715	632
		ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
		1.978% 期日 08/25/2036	7,210	7,087
		2.618% 期日 01/25/2035	1,168	1,173
		2.648% 期日 02/25/2034	6,677	6,648
		2.723% 期日 08/25/2035	5,023	5,012
		Adjustable Rate Mortgage Trust		
		2.773% 期日 08/25/2035	5,961	5,957
		AFC Home Equity Loan Trust		
		2.633% 期日 06/25/2029	2,323	2,020
		Alternative Loan Trust		
		1.993% 期日 01/25/2037	6,182	6,084
		1.993% 期日 07/25/2046	5,587	5,588
		2.003% 期日 07/25/2036	11,852	11,403
		2.013% 期日 08/25/2046	16,392	13,481
		2.023% 期日 05/25/2036	21,089	19,177
		2.036% 期日 09/20/2046	1,867	1,646
		2.056% 期日 03/20/2046	9,783	9,176
		2.073% 期日 12/25/2046	25,897	24,355
		2.093% 期日 07/25/2036	22,690	19,143
		2.423% 期日 01/25/2036	3,342	3,298
		3.740% 期日 08/25/2035	665	611
		3.766% 期日 08/25/2035	757	734
		4.277% 期日 09/25/2034	1,405	1,391
		5.500% 期日 06/25/2035	8,125	8,158
		5.500% 期日 08/25/2035	97	98
		5.500% 期日 02/25/2036	24	21
		6.000% 期日 07/25/2037	31,280	23,024
		7.000% 期日 10/25/2037	37,167	22,542
		Ameriquist Mortgage Securities Trust		
		2.163% 期日 04/25/2036	9,785	9,770
		2.233% 期日 03/25/2036	27,500	27,159
		Ameriquist Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
		3.089% 期日 09/25/2032	515	529

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		3.578% 期日 10/25/2034	9,000	8,825
		Argent Mortgage Loan Trust		
		2.303% 期日 05/25/2035	31,701	30,599
		Argent Securities Trust		
		2.003% 期日 04/25/2036	8,656	3,715
		Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
		2.333% 期日 10/25/2035	36,400	35,553
		4.353% 期日 09/25/2033	1,933	1,946
		Asset-Backed Funding Certificates Trust		
		2.483% 期日 03/25/2035	9,929	9,863
		2.558% 期日 06/25/2035	12,354	12,201
		Asset-Backed Pass-Through Certificates		
		2.873% 期日 04/25/2035	7,004	7,011
		Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
		2.133% 期日 05/25/2036	27,532	25,324
		Atrium Hotel Portfolio Trust		
		3.344% 期日 06/15/2035	18,395	18,436
		Banc of America Alternative Loan Trust		
		5.326% 期日 04/25/2022	182	182
		6.000% 期日 07/25/2046	2,811	2,747
		Bayview Opportunity Master Fund IVa Trust		
		3.475% 期日 06/28/2034	4,273	4,284
		BCAP LLC Trust		
		2.244% 期日 07/26/2036	317	311
		5.876% 期日 04/26/2037	4,621	3,830
		6.000% 期日 04/26/2036	8,686	7,281
		Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
		3.963% 期日 11/25/2034	314	314
		Bear Stearns Alternative-A Trust		
		1.993% 期日 04/25/2037	10,054	8,110
		2.243% 期日 11/25/2046	7,840	8,534
		Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
		2.023% 期日 04/25/2037	2,274	3,819
		2.063% 期日 02/25/2037	7,304	8,405
		2.183% 期日 04/25/2036	12,325	12,293
		2.223% 期日 02/25/2036	7,436	7,431
		2.223% 期日 05/25/2036	12,848	6,590
		2.253% 期日 12/25/2035	8,426	8,458
		2.323% 期日 12/25/2035	2,088	2,086
		2.523% 期日 11/25/2035	4,919	4,588
		2.543% 期日 12/25/2035	9,463	7,838
		2.843% 期日 06/25/2034	7,780	7,828
		2.873% 期日 08/25/2037	25,563	22,510
		4.777% 期日 05/25/2036	12,848	573
		Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
		2.083% 期日 10/25/2036	1,919	1,922
		4.043% 期日 06/25/2035	3,853	3,811
		Bear Stearns Mortgage Funding Trust		
		2.023% 期日 02/25/2037	9,164	10,087
		Business Loan Express Business Loan Trust		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		2.113% 期日 09/25/2038	2,284	2,142
		2.373% 期日 09/25/2038	1,107	1,025
		2.923% 期日 09/25/2038	80	75
		BX Trust		
		3.064% 期日 07/15/2034	1,685	1,688
		Caesars Palace Las Vegas Trust		
		4.354% 期日 10/15/2034	9,700	10,129
		Canada Square Funding PLC		
		0.000% 期日 10/17/2051 GBP	49,957	64,774
		CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage		
		5.540% 期日 01/25/2039	1,442	1,197
		Centex Home Equity Loan Trust		
		2.468% 期日 03/25/2035	5,514	5,495
		CGGS Commercial Mortgage Trust		
		2.821% 期日 02/15/2037	23,290	23,257
		3.271% 期日 02/15/2037	9,280	9,273
		4.221% 期日 02/15/2037	22,780	22,913
		CGMS Commercial Mortgage Trust		
		3.014% 期日 07/15/2030	12,796	12,707
		ChaseFlex Trust		
		2.123% 期日 07/25/2037	1,450	1,295
		Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates		
		2.183% 期日 03/25/2035	703	705
		CIT Mortgage Loan Trust		
		3.173% 期日 10/25/2037	17,085	17,313
		Citigroup Commercial Mortgage Trust		
		0.287% 期日 03/10/2047	25,400	347
		Citigroup Mortgage Loan Trust		
		1.963% 期日 12/25/2036	5,791	5,670
		2.083% 期日 01/25/2037	1,860	1,858
		2.158% 期日 08/25/2036	15,784	7,789
		2.223% 期日 03/25/2037	15,986	16,010
		2.443% 期日 12/25/2035	1,166	1,170
		2.643% 期日 09/25/2037	28,262	25,764
		4.212% 期日 08/25/2036	8,659	8,734
		4.442% 期日 07/25/2037	6,129	5,976
		4.524% 期日 11/25/2038	963	982
		6.750% 期日 05/25/2036	12,920	9,451
		Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
		2.403% 期日 07/25/2035	2,330	2,346
		2.858% 期日 05/25/2035	6,300	6,290
		Civic Mortgage LLC		
		4.349% 期日 11/25/2022	737	739
		Commercial Mortgage Trust		
		0.170% 期日 04/10/2047	33,000	260
		Conseco Finance Corp.		
		6.870% 期日 04/01/2030	3,332	3,483
		6.920% 期日 12/01/2030	2,584	2,847
		7.500% 期日 03/01/2030	56,572	38,307
		7.600% 期日 04/15/2026	5,661	3,416
		7.700% 期日 09/15/2026	1,470	1,552
		Countrywide Asset-Backed Certificates		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価 （単位：千）
		1.963% 期日 06/25/2035	2,486	2,277
		1.963% 期日 06/25/2037	21,218	20,185
		1.963% 期日 07/25/2037	2,605	2,387
		1.973% 期日 04/25/2047	6,842	6,612
		1.983% 期日 05/25/2037	16,734	16,613
		1.993% 期日 06/25/2047	1,529	1,526
		2.003% 期日 11/25/2047	13,343	12,727
		2.043% 期日 08/25/2037	25,800	23,483
		2.053% 期日 05/25/2037	12,783	12,021
		2.053% 期日 10/25/2047	25,934	25,131
		2.063% 期日 05/25/2036	10,447	8,318
		2.073% 期日 02/25/2036	1,500	1,429
		2.173% 期日 03/25/2036	1,857	1,716
		2.223% 期日 06/25/2036	6,300	6,269
		2.243% 期日 01/25/2045	5,681	5,683
		2.263% 期日 04/25/2036	10,000	10,056
		2.304% 期日 08/26/2033	386	373
		2.553% 期日 06/25/2035	7,000	6,565
		2.573% 期日 02/25/2034	8,405	8,418
		2.978% 期日 06/25/2033	831	822
		3.428% 期日 01/25/2034	189	191
		Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
		3.955% 期日 11/25/2034	16	16
		4.590% 期日 06/25/2034	2	2
		5.500% 期日 11/25/2035	9,226	7,849
		6.000% 期日 07/25/2036	33,648	28,193
		6.000% 期日 11/25/2037	6,752	5,761
		Credit Suisse Mortgage Capital		
		1.571% 期日 06/27/2037	6,036	6,134
		2.188% 期日 11/27/2036	7,567	8,247
		3.000% 期日 01/29/2036	2,321	2,337
		3.000% 期日 07/25/2037	226	226
		5.874% 期日 10/26/2036	308	297
		Credit Suisse Mortgage Capital Trust		
		0.000% 期日 01/25/2058	49	49
		0.000% 期日 04/25/2058	1	1
		2.664% 期日 07/15/2032	5,200	5,195
		2.914% 期日 07/15/2032	4,000	3,997
		3.114% 期日 07/15/2032	2,400	2,399
		3.550% 期日 01/25/2058	26,693	26,492
		3.864% 期日 04/25/2058	68,022	69,391
		3.904% 期日 06/25/2050	47,273	38,791
		4.517% 期日 06/01/2050	122,065	126,153
		Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
		6.980% 期日 03/25/2046	4,266	4,504
		Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust		
		1.973% 期日 07/25/2036	4,096	4,068
		CS First Boston Mortgage Securities Corp.		
		4.273% 期日 01/25/2033	2,047	2,035
		CWABS Asset-Backed Certificates Trust		
		2.063% 期日 03/25/2037	33,000	31,614

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		2.063% 期日 03/25/2047		26,535		24,398
		2.083% 期日 09/25/2046		5,600		5,393
		2.543% 期日 05/25/2036		2,232		860
		2.873% 期日 03/25/2035		5,500		5,622
		2.948% 期日 12/25/2034		1,786		1,803
		5.633% 期日 06/25/2035		8,644		9,217
		CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust				
		2.164% 期日 03/15/2030		4,868		4,749
		Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust				
		1.983% 期日 03/25/2037		13,510		8,232
		2.153% 期日 08/25/2037		36,916		31,279
		2.323% 期日 09/25/2047		24,235		22,856
		Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				
		4.156% 期日 10/25/2035		15,061		14,910
		Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp. 2.117% 期日 11/27/2036		4,206		4,150
		Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
		2.036% 期日 10/19/2036		12,476		11,299
		2.146% 期日 10/19/2045		3,153		3,168
		2.176% 期日 09/19/2045		7,541		6,265
		Dragon Finance BV				
		1.794% 期日 07/13/2023	GBP	180		226
		Dutch Property Finance BV				
		0.276% 期日 01/28/2048	EUR	19,587		21,921
		Ellington Loan Acquisition Trust				
		2.923% 期日 05/25/2037	USD	1,813		1,820
		EMC Mortgage Loan Trust				
		2.873% 期日 04/25/2042		10,016		9,293
		3.323% 期日 04/25/2042		67		67
		Encore Credit Receivables Trust				
		2.753% 期日 11/25/2035		6,510		6,539
		European Residential Loan Securitisation DAC				
		0.399% 期日 03/24/2063	EUR	21,700		24,140
		Eurosail PLC				
		0.942% 期日 09/10/2044	GBP	458		591
		Eurosail-UK PLC				
		1.555% 期日 09/13/2045		5,947		7,335
		1.735% 期日 06/13/2045		14,134		18,182
		FBR Securitization Trust				
		2.498% 期日 10/25/2035	USD	20,968		15,614
		2.503% 期日 10/25/2035		13,229		13,223
		2.588% 期日 09/25/2035		7,500		7,306
		Finsbury Square PLC				
		1.430% 期日 09/12/2065	GBP	31,959		41,282
		First Franklin Mortgage Loan Trust				
		1.973% 期日 07/25/2036	USD	650		650
		1.983% 期日 04/25/2036		6,248		6,112
		2.283% 期日 01/25/2036		10,000		9,678
		2.528% 期日 05/25/2036		6,259		6,254

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		2.678% 期日 04/25/2035		5,000		5,031
		First Horizon Alternative Securities Trust				
		2.323% 期日 05/25/2035		2,257		1,789
		3.177% 期日 05/25/2035		2,256		298
		Fremont Home Loan Trust				
		1.963% 期日 02/25/2037		10,272		7,824
		2.843% 期日 01/25/2035		6,493		6,367
		GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.				
		5.456% 期日 03/10/2051		12,423		13,521
		Great Wolf Trust				
		0.000% 期日 09/15/2034		104,500		1
		2.764% 期日 09/15/2034		8,400		8,403
		3.014% 期日 09/15/2034		13,900		13,906
		GreenPoint Mortgage Funding Trust				
		2.383% 期日 11/25/2045		78		65
		Grifonas Finance PLC				
		0.000% 期日 08/28/2039	EUR	993		1,023
		GS Mortgage Securities Corporation Trust				
		3.419% 期日 10/10/2032	USD	3,300		3,412
		4.591% 期日 10/10/2032		7,600		7,720
		GSAA Home Equity Trust				
		6.500% 期日 11/25/2037		24		17
		GSAMP Trust				
		1.963% 期日 03/25/2047		5,809		5,618
		1.973% 期日 06/25/2036		2,550		2,546
		1.983% 期日 01/25/2037		23,210		15,892
		1.983% 期日 05/25/2046		1,052		1,044
		2.083% 期日 06/25/2036		20,000		19,568
		2.468% 期日 11/25/2035		7,684		6,259
		GSMSC Resecuritization Trust				
		2.198% 期日 09/26/2036		5,613		4,336
		6.359% 期日 04/26/2037		40,011		14,610
		GSR Mortgage Loan Trust				
		2.123% 期日 03/25/2037		10,177		3,363
		4.877% 期日 03/25/2037		10,177		2,789
		HarborView Mortgage Loan Trust				
		2.086% 期日 12/19/2036		1,477		1,423
		2.406% 期日 02/19/2036		17,021		15,802
		2.486% 期日 08/19/2045		12,297		12,380
		Hawksmoor Mortgages				
		0.000% 期日 05/25/2053	GBP	80,500		104,416
		Home Equity Asset Trust				
		2.063% 期日 10/25/2036	USD	23,475		9,575
		2.133% 期日 07/25/2036		238		239
		Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
		1.963% 期日 11/25/2036		20,014		19,206
		2.003% 期日 06/25/2036		4,562		4,476
		2.063% 期日 04/25/2037		17,152		12,965
		2.813% 期日 08/25/2035		5,750		5,795
		HSI Asset Securitization Corp. Trust				
		2.073% 期日 05/25/2037		7,197		6,829
		Impac CMB Trust				
		2.503% 期日 01/25/2035		19,049		19,320

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		Impac Secured Assets Corp.				
		2.103% 期日 03/25/2036		19,475		17,028
		Impac Secured Assets Trust				
		2.013% 期日 01/25/2037		4,352		3,973
		IMT Trust				
		2.614% 期日 06/15/2034		2,400		2,397
		2.864% 期日 06/15/2034		1,800		1,799
		3.014% 期日 06/15/2034		1,100		1,100
		IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust				
		6.500% 期日 10/25/2037		10,987		9,748
		IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust				
		3.692% 期日 06/25/2037		12,125		10,386
		IndyMac INDX Mortgage Loan Trust				
		2.003% 期日 02/25/2037		37,062		35,781
		2.013% 期日 10/25/2036		7,317		4,584
		3.459% 期日 07/25/2037		28,148		26,940
		3.618% 期日 04/25/2037		21,083		19,884
		3.799% 期日 04/25/2037		10,975		10,497
		3.871% 期日 03/25/2036		6,762		6,240
		3.998% 期日 11/25/2036		19,512		17,005
		IXIS Real Estate Capital Trust				
		2.588% 期日 12/25/2035		7,393		7,441
		Jefferies Resecuritization Trust				
		7.366% 期日 06/25/2047		918		847
		JPMorgan Alternative Loan Trust				
		2.103% 期日 04/25/2047		4,045		3,908
		4.267% 期日 03/25/2036		593		543
		5.730% 期日 03/25/2036		309		309
		JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
		2.764% 期日 10/15/2032		11,125		11,114
		3.014% 期日 10/15/2032		7,000		6,993
		3.314% 期日 10/15/2032		7,200		7,195
		4.054% 期日 10/15/2032		11,000		11,025
		5.337% 期日 05/15/2047		263		246
		JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
		2.003% 期日 03/25/2036		14,768		14,649
		JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
		2.023% 期日 05/25/2036		4,202		4,210
		2.073% 期日 07/25/2036		9,839		9,800
		2.093% 期日 05/25/2036		12,851		12,456
		2.093% 期日 08/25/2036		8,600		7,977
		2.093% 期日 06/25/2037		34,606		33,004
		2.103% 期日 06/25/2037		22,826		19,304
		JPMorgan Mortgage Trust				
		2.123% 期日 10/25/2035		7,089		5,984
		4.288% 期日 01/25/2037		917		887
		JPMorgan Resecuritization Trust				
		3.216% 期日 05/26/2037		11,175		10,913
		4.359% 期日 02/26/2037		4,428		4,391
		Kentmere No.2 PLC				
		0.000% 期日 01/28/2042	GBP	159,405		206,536
		0.000% 期日 01/28/2042		15,191		19,856
		Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC				

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		0.000% 期日 06/15/2045	EUR	5,314	5,584
		Legacy Mortgage Asset Trust			
		3.000% 期日 06/25/2059	USD	295	296
		3.438% 期日 05/25/2059		96	97
		3.794% 期日 01/28/2070		148,874	151,815
		Lehman XS Trust			
		2.013% 期日 12/25/2036		11,431	8,743
		2.023% 期日 02/25/2037		21,012	20,586
		2.083% 期日 02/25/2047		25,236	24,315
		2.203% 期日 09/25/2036		9,916	8,830
		6.500% 期日 06/25/2046		7,246	7,268
		Liberty			
		2.140% 期日 10/10/2049	AUD	10,056	6,927
		Long Beach Mortgage Loan Trust			
		2.013% 期日 02/25/2036	USD	7,035	6,299
		2.013% 期日 03/25/2046		38,279	17,942
		3.923% 期日 06/25/2034		827	826
		Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
		5.073% 期日 03/25/2032		3,162	3,221
		MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
		3.926% 期日 04/25/2034		2	2
		MASTR Asset-Backed Securities Trust			
		2.043% 期日 11/25/2036		34	24
		2.193% 期日 01/25/2036		7,500	7,104
		2.973% 期日 08/25/2037		17,208	15,389
		MASTR Specialized Loan Trust			
		2.303% 期日 02/25/2036		5,708	4,594
		Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
		2.823% 期日 10/25/2037		13,841	14,087
		3.323% 期日 10/25/2037		26,000	26,379
		Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
		1.963% 期日 05/25/2037		23,895	14,225
		2.203% 期日 08/25/2035		17	18
		2.543% 期日 07/25/2034		5,581	5,512
		2.618% 期日 09/25/2035		4,283	4,285
		2.903% 期日 10/25/2035		1,849	1,846
		4.437% 期日 02/25/2033		17	17
		Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			
		1.948% 期日 07/25/2036		7,734	6,787
		1.973% 期日 07/25/2036		56,241	28,099
		2.063% 期日 06/25/2036		30,463	26,691
		2.073% 期日 07/25/2036		55,965	28,821
		2.093% 期日 03/25/2036		8,388	8,371
		2.528% 期日 07/25/2035		2,009	2,021
		2.558% 期日 07/25/2035		6,912	6,897
		2.823% 期日 03/25/2033		122	122
		2.823% 期日 07/25/2037		488	486
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			
		0.817% 期日 11/15/2052		137,608	7,059
		Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		2.183% 期日 02/25/2036		18,272		16,224
		Morgan Stanley Dean Witter Capital I Trust				
		7.635% 期日 07/15/2033		3,163		3,302
		Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
		2.163% 期日 02/25/2036		13,790		13,248
		Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				
		2.053% 期日 07/25/2036		12,554		6,700
		Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
		3.622% 期日 11/25/2037		2,063		1,854
		6.000% 期日 12/25/2035		838		660
		Morgan Stanley Reremic Trust				
		2.178% 期日 11/26/2036		9,745		8,730
		Mortgage Loan Trust				
		4.870% 期日 03/25/2034		3,310		3,372
		Motel 6 Trust				
		2.834% 期日 08/15/2034		25,492		25,533
		3.104% 期日 08/15/2034		22,568		22,605
		4.064% 期日 08/15/2034		2,332		2,341
		Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				
		2.664% 期日 02/15/2033		9,300		9,267
		3.014% 期日 02/15/2033		8,265		8,235
		3.790% 期日 11/15/2032		1,400		1,430
		3.821% 期日 02/15/2039		2,900		3,189
		3.964% 期日 02/15/2033		3,600		3,590
		New York Mortgage Trust				
		2.363% 期日 04/25/2035		1,245		1,239
		Newgate Funding PLC				
		0.941% 期日 12/15/2050	GBP	22,200		26,471
		Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust				
		5.034% 期日 05/25/2035	USD	4,648		3,572
		Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
		2.333% 期日 05/25/2035		7,400		7,214
		5.745% 期日 10/25/2036		24,442		9,537
		Nomura Resecuritization Trust				
		2.146% 期日 03/26/2037		8,026		5,135
		4.225% 期日 11/26/2036		1,686		1,704
		NovaStar Mortgage Funding Trust				
		1.983% 期日 10/25/2036		6,830		4,002
		2.023% 期日 09/25/2037		37,872		37,020
		2.143% 期日 05/25/2036		14,381		14,220
		2.543% 期日 10/25/2035		2,500		2,484
		Oncilla Mortgage Funding PLC				
		2.180% 期日 12/12/2043	GBP	8,708		11,325
		Option One Mortgage Loan Trust				
		1.923% 期日 02/25/2037	USD	6,110		4,019
		1.943% 期日 03/25/2037		17,082		15,589
		1.963% 期日 03/25/2037		48,494		44,607
		Paragon Mortgages No.13 PLC				
		1.007% 期日 01/15/2039	GBP	3,715		4,578
		Paragon Mortgages No.26 PLC				

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		0.000% 期日 05/15/2045		22,700		29,331
		Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
		2.313% 期日 09/25/2035	USD	4,713		4,721
		2.343% 期日 09/25/2035		25,075		22,718
		People's Financial Realty Mortgage Securities Trust				
		1.983% 期日 09/25/2036		28,208		7,936
		PFP Ltd.				
		3.164% 期日 07/14/2035		281		282
		Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust				
		2.133% 期日 11/25/2036		14,843		11,487
		5.250% 期日 07/25/2035		9,601		8,373
		Precise Mortgage Funding PLC				
		0.000% 期日 12/12/2055	GBP	0		1,896
		1.430% 期日 12/12/2054		4,801		6,183
		Quest Trust				
		3.248% 期日 03/25/2035	USD	6,060		5,849
		RAAC Trust				
		2.293% 期日 02/25/2036		6,250		6,087
		2.573% 期日 06/25/2047		22,817		17,640
		RBSGC Mortgage Loan Trust				
		6.000% 期日 01/25/2037		6		5
		RBSSP Resecuritization Trust				
		2.546% 期日 04/26/2037		127		127
		Real Estate Asset Liquidity Trust				
		2.419% 期日 06/12/2054	CAD	9,254		7,027
		Renaissance Home Equity Loan Trust				
		2.183% 期日 11/25/2034	USD	60		57
		2.823% 期日 09/25/2037		49		40
		5.612% 期日 04/25/2037		10,135		4,601
		5.675% 期日 06/25/2037		3,910		1,684
		Residential Accredited Securities Corporation Trust				
		1.973% 期日 01/25/2037		1,700		1,694
		1.983% 期日 11/25/2036		5,115		4,948
		2.043% 期日 02/25/2037		14,000		13,417
		2.123% 期日 01/25/2037		36,488		23,343
		2.153% 期日 04/25/2036		17,500		17,514
		2.473% 期日 09/25/2035		7,400		7,449
		3.398% 期日 04/25/2034		1,548		1,484
		Residential Asset Mortgage Products Trust				
		2.223% 期日 02/25/2036		5,490		5,463
		2.323% 期日 09/25/2035		12,591		12,410
		2.483% 期日 10/25/2035		2,873		2,890
		2.498% 期日 11/25/2035		13,000		12,846
		2.503% 期日 12/25/2035		16,946		15,483
		Residential Asset Securitization Trust				
		5.500% 期日 10/25/2035		4,000		3,869
		Residential Mortgage Securities 29 PLC				
		1.726% 期日 12/20/2046	GBP	8,558		11,083
		Residential Mortgage Securities 30 PLC				
		1.576% 期日 03/20/2050		10,750		13,877

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		RESIMAC Bastille Trust			
		2.773% 期日 09/05/2057	USD	10,100	10,103
		Ripon Mortgages PLC			
		1.561% 期日 08/20/2056	GBP	18,737	24,257
		Rochester Financing No.2 PLC			
		2.076% 期日 06/18/2045		6,782	8,806
		Saxon Asset Securities Trust			
		2.618% 期日 03/25/2035	USD	1,734	1,698
		3.573% 期日 12/25/2037		5,725	5,762
		Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
		2.093% 期日 03/25/2036		8,239	7,759
		2.373% 期日 10/25/2035		10,136	9,959
		2.873% 期日 03/25/2035		9,450	8,896
		Sequoia Mortgage Trust			
		2.046% 期日 05/20/2035		2,977	2,985
		2.366% 期日 06/20/2034		46	45
		Sestante Finance Srl			
		0.000% 期日 07/23/2046	EUR	12,546	12,724
		SG Mortgage Securities Trust			
		2.003% 期日 02/25/2036	USD	5,947	3,931
		Shamrock Residential DAC			
		5.056% 期日 11/24/2057	EUR	7,410	8,283
		6.500% 期日 11/24/2057		6,290	7,019
		12.000% 期日 11/24/2057		18,970	14,723
		Soundview Home Loan Trust			
		2.063% 期日 07/25/2036	USD	24,020	22,713
		2.103% 期日 06/25/2036		4,109	3,153
		2.133% 期日 06/25/2036		43,418	34,010
		2.473% 期日 03/25/2036		8,102	4,749
		Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
		2.798% 期日 12/25/2035		2,154	2,163
		2.803% 期日 10/25/2035		3,053	3,067
		Stonemont Portfolio Trust			
		2.696% 期日 08/20/2030		22,995	23,001
		2.946% 期日 08/20/2030		9,880	9,883
		Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
		2.143% 期日 10/25/2035		8,004	7,834
		2.473% 期日 08/25/2035		14,580	13,244
		3.790% 期日 05/25/2035		102	90
		4.414% 期日 06/25/2037		6,566	6,533
		5.170% 期日 07/25/2035		3,340	2,556
		Structured Asset Investment Loan Trust			
		1.973% 期日 06/25/2036		10,720	10,516
		2.543% 期日 04/25/2035		4,440	4,473
		2.623% 期日 02/25/2034		28,755	28,974
		3.023% 期日 12/25/2034		9,152	9,209
		Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
		2.033% 期日 09/25/2047		33,302	34,907
		2.521% 期日 04/19/2035		3,414	3,417
		Structured Asset Mortgage Investments			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		Trust			
		2.506% 期日 09/19/2032		43	43
		Structured Asset Securities Corporation			
		Mortgage Loan Trust			
		1.953% 期日 05/25/2036		13,624	13,136
		2.073% 期日 05/25/2036		5,426	4,735
		2.083% 期日 04/25/2036		808	807
		2.133% 期日 07/25/2036		35,849	35,620
		2.323% 期日 04/25/2031		8,945	8,896
		2.753% 期日 11/25/2035		19,865	19,998
		Sutherland Commercial Mortgage Loans			
		3.192% 期日 05/25/2037		1,202	1,195
		Taurus UK DAC			
		0.000% 期日 06/22/2029	GBP	5,500	7,122
		Terwin Mortgage Trust			
		3.203% 期日 03/25/2035	USD	2,943	2,783
		Theatre Hospitals No.1 PLC			
		3.785% 期日 10/15/2031	GBP	1,382	1,667
		Theatre Hospitals No.2 PLC			
		3.785% 期日 10/15/2031		651	788
		Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC			
		1.820% 期日 10/20/2051		30,624	39,812
		Towd Point Mortgage Funding PLC			
		1.820% 期日 10/20/2051		7,423	9,650
		Trinidad Mortgage Securities PLC			
		1.599% 期日 01/24/2059		26,020	33,489
		Trinity Square PLC			
		1.935% 期日 07/15/2051		487	633
		Truman Capital Mortgage Loan Trust			
		2.083% 期日 03/25/2036	USD	2,650	2,626
		Twin Bridges PLC			
		1.560% 期日 09/12/2044	GBP	14,319	18,458
		VOLT LXIV LLC			
		3.375% 期日 10/25/2047	USD	1,783	1,791
		WaMu Mortgage Pass-Through Certificates			
		Trust			
		2.543% 期日 01/25/2045		130	129
		Warwick Finance Residential Mortgages			
		Number Three PLC			
		0.000% 期日 12/21/2049	GBP	0	684
		0.000% 期日 12/21/2049		0	2,681
		1.565% 期日 12/21/2049		44,345	57,384
		2.265% 期日 12/21/2049		4,921	6,378
		2.765% 期日 12/21/2049		2,460	3,203
		3.265% 期日 12/21/2049		1,406	1,836
		3.765% 期日 12/21/2049		1,406	1,811
		Washington Mutual Mortgage Pass-Through			
		Certificates WMLT Trust			
		3.240% 期日 10/25/2046	USD	16,759	12,215
		5.500% 期日 11/25/2035		111	111
		Wells Fargo Home Equity Asset-Backed			
		Securities Trust			
		2.033% 期日 03/25/2037		2,100	2,011
		2.093% 期日 07/25/2036		10,000	9,963

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	（単位：千）	通貨	（単位：千）
		Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates 2.123% 期日 04/25/2034		6,375		6,284
		Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 4.563% 期日 10/25/2036		381		384
		WFRBS Commercial Mortgage Trust 0.416% 期日 03/15/2047		8,800		170
		モーゲージ証券合計 (原価4,352,148米ドル)				4,414,075
資産担保証券 7.1%		AASET Trust 3.967% 期日 05/16/2042		232		235
		Aircraft Certificate Owner Trust 7.001% 期日 09/20/2022		177		185
		ALESCO Preferred Funding XI Ltd. 2.609% 期日 12/23/2036		5,000		3,925
		American Homes 4 Rent Trust 6.231% 期日 10/17/2036		1,150		1,283
		Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd. 2.904% 期日 08/15/2027		7,960		7,966
		Avery Point III CLO Ltd. 3.123% 期日 01/18/2025		903		903
		B&M CLO Ltd. 2.731% 期日 04/16/2026		5,824		5,820
		BFNS 3.994% 期日 01/25/2029		55,050		55,033
		Black Diamond CLO Ltd. 3.052% 期日 02/06/2026		2,305		2,306
		BSPRT Issuer Ltd. 2.964% 期日 03/15/2028		17,350		17,366
		4.464% 期日 03/15/2028		8,960		8,987
		5.364% 期日 03/15/2028		4,050		4,068
		Cairn CLO III BV 0.650% 期日 10/20/2028	EUR	9,400		10,496
		Cairn CLO VI BV 0.790% 期日 07/25/2029		5,520		6,160
		Capitalsource Real Estate Loan Trust 2.668% 期日 01/20/2037	USD	3,907		3,818
		2.928% 期日 01/20/2037		13,400		12,709
		3.028% 期日 01/20/2037		4,800		4,432
		3.128% 期日 01/20/2037		2,700		2,092
		Castlelake Aircraft Securitization Trust 4.125% 期日 06/15/2043		3,244		3,320
		Catamaran CLO Ltd. 2.786% 期日 01/27/2028		7,200		7,161
		Cavendish Square Funding PLC 0.202% 期日 02/11/2055	EUR	549		613
		0.542% 期日 02/11/2055		1,500		1,677
		Compartment VCL 28 0.000% 期日 01/21/2025		4,841		5,423
		Crecera Americas LLC 0.000% 期日 07/31/2022	COP	62,570,000		18,512
		7.078% 期日 11/30/2021	CLP	23,414,122		31,597

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		Crown Point CLO 5 Ltd.			
		2.942% 期日 07/17/2028	USD	6,300	6,284
		Denali Capital CLO X LLC			
		2.986% 期日 10/26/2027		11,000	10,996
		Dryden 350 CLO BV			
		0.718% 期日 05/17/2027	EUR	17,244	19,227
		Euromax VI ABS Ltd.			
		0.000% 期日 04/18/2097		1	1
		FAB CBO BV			
		0.573% 期日 08/20/2080		342	310
		FAB UK Ltd.			
		1.365% 期日 12/06/2045	GBP	1,622	1,971
		Figueroa CLO Ltd.			
		3.006% 期日 06/20/2027	USD	18,508	18,514
		Gateway Casinos & Entertainment Ltd.			
		5.000% 期日 03/12/2038	CAD	9,082	7,369
		GLS Auto Receivables Issuer Trust			
		2.580% 期日 07/17/2023	USD	20,066	20,110
		Goodgreen			
		3.930% 期日 10/15/2053		9,003	9,522
		Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.			
		3.053% 期日 10/22/2025		2,524	2,524
		3.453% 期日 08/01/2025		18	18
		Harley Marine Financing LLC			
		5.682% 期日 05/15/2043		5,617	4,739
		JMP Credit Advisors CLO IIIR Ltd.			
		2.852% 期日 01/17/2028		32,994	32,868
		Jubilee CLO BV			
		0.422% 期日 07/12/2028	EUR	2,120	2,365
		LP Credit Card Asset-Backed Securities			
		Master Trust			
		3.822% 期日 08/20/2024	USD	7,428	7,392
		Marlette Funding Trust			
		3.710% 期日 12/15/2028		1,129	1,141
		METAL LLC			
		4.581% 期日 10/15/2042		16,085	16,345
		MMcapS Funding XVII Ltd.			
		2.488% 期日 12/01/2035		586	556
		Monarch Grove CLO			
		2.820% 期日 01/25/2028		20,900	20,824
		National Collegiate Student Loan Trust			
		2.063% 期日 07/25/2030		997	991
		2.093% 期日 03/26/2029		1,391	1,390
		2.435% 期日 10/25/2033		15,035	14,380
		2.486% 期日 06/25/2029		2,264	2,246
		Navient Private Education Loan Trust			
		4.071% 期日 12/15/2045		6,518	6,748
		Nelnet Student Loan Trust			
		2.423% 期日 03/25/2030		5,955	5,955
		2.623% 期日 09/25/2065		4,714	4,730
		OCP CLO Ltd.			
		2.756% 期日 10/26/2027		25,200	25,144
		2.852% 期日 04/17/2027		12,191	12,181
		Octagon Investment Partners XXIII Ltd.			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		2.851% 期日 07/15/2027		25,300		25,258
		Pangaea ABS SPV				
		0.057% 期日 12/28/2096	EUR	2,438		2,702
		Penta CLO 2 BV				
		0.790% 期日 08/04/2028		16,600		18,554
		Renoir CDO BV				
		0.425% 期日 10/07/2095		2,196		2,451
		1.475% 期日 10/07/2095		5,568		6,239
		5.184% 期日 10/07/2095		5,405		6,079
		RMF Buyout Issuance Trust				
		3.436% 期日 11/25/2028	USD	1,864		1,867
		Sapphire Aviation Finance				
		4.250% 期日 03/15/2040		29,514		30,283
		Saranac CLO III Ltd.				
		3.259% 期日 06/22/2030		27,300		27,285
		SCF RC Funding II LLC				
		4.100% 期日 06/25/2047		4,531		4,620
		Silver Arrow Canada				
		2.129% 期日 03/15/2021	CAD	8,700		6,628
		SLM Private Credit Student Loan Trust				
		2.319% 期日 06/15/2023	USD	2,194		2,191
		SoFi Consumer Loan Program LLC				
		2.770% 期日 05/25/2026		1,115		1,120
		SoFi Professional Loan Program LLC				
		2.650% 期日 09/25/2040		3,173		3,202
		Sorrento Park CLO DAC				
		0.544% 期日 11/16/2027	EUR	18,365		20,500
		SpringCastle Funding Asset-Backed Notes				
		3.200% 期日 05/27/2036	USD	21,705		21,978
		Springleaf Funding Trust				
		2.680% 期日 07/15/2030		22,700		22,783
		St Paul's CLO VI DAC				
		0.850% 期日 08/20/2030	EUR	3,600		4,002
		Starwood Waypoint Homes Trust				
		2.864% 期日 01/17/2035	USD	11,279		11,277
		3.084% 期日 01/17/2035		1,400		1,400
		3.314% 期日 01/17/2035		4,727		4,727
		3.864% 期日 01/17/2035		8,600		8,613
		Taberna Preferred Funding I Ltd.				
		2.513% 期日 07/05/2035		5,320		4,842
		2.807% 期日 07/05/2035		2,147		1,953
		Telos CLO Ltd.				
		2.952% 期日 04/17/2028		24,100		24,063
		3.272% 期日 01/17/2027		14,727		14,769
		Theatre Hospitals PLC				
		4.190% 期日 12/15/2024	GBP	43		0
		Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.				
		4.212% 期日 05/17/2032	USD	632		648
		TICP CLO III-2 Ltd.				
		2.806% 期日 04/20/2028		33,600		33,599
		Tikehau CLO BV				
		0.600% 期日 08/04/2028	EUR	1,600		1,783
		Tralee CLO V Ltd.				
		3.076% 期日 10/20/2028	USD	5,250		5,217

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		Tropic CDO V Ltd.			
		2.321% 期日 07/15/2036		13,346	11,928
		TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
		3.274% 期日 03/30/2039		23,134	22,555
		3.726% 期日 09/20/2039		5,634	5,578
		Venture XVII CLO Ltd.			
		2.881% 期日 04/15/2027		36,720	36,596
		Vertical Bridge CC LLC			
		5.193% 期日 10/15/2046		387	398
		Z Capital Credit Partners CLO Ltd.			
		2.951% 期日 07/16/2027		35,115	35,035
		資産担保証券合計			905,651
		(原価：909,149米ドル)			
ソブリン債		Abu Dhabi Government International Bond			
3.9%		2.500% 期日 10/11/2022		2,300	2,328
		3.125% 期日 10/11/2027		16,500	17,254
		Argentina Bocon			
		59.928% 期日 10/04/2022	ARS	1,017	9
		Argentina Government International Bond			
		3.375% 期日 01/15/2023	EUR	8,600	3,705
		3.380% 期日 12/31/2038		10,385	4,570
		3.750% 期日 12/31/2038	USD	22,274	8,971
		3.875% 期日 01/15/2022	EUR	10,500	4,658
		4.625% 期日 01/11/2023	USD	16,261	6,586
		5.000% 期日 01/15/2027	EUR	1,100	469
		5.250% 期日 01/15/2028		2,500	1,065
		5.625% 期日 01/26/2022	USD	15,410	6,549
		5.875% 期日 01/11/2028		12,190	4,678
		6.250% 期日 11/09/2047	EUR	500	216
		6.625% 期日 07/06/2028	USD	150	59
		6.875% 期日 01/26/2027		5,000	1,988
		6.875% 期日 01/11/2048		670	264
		7.125% 期日 07/06/2036		9,180	3,626
		7.500% 期日 04/22/2026		3,350	1,437
		7.820% 期日 12/31/2033	EUR	21,712	11,719
		56.700% 期日 04/03/2022	ARS	836,910	4,926
		60.517% 期日 03/01/2020		62,336	511
		Argentina POM Politica Monetaria			
		72.606% 期日 06/21/2020		4,233,891	28,530
		Argentina Treasury Bills			
		0.000% 期日 04/28/2020		45,067	482
		0.000% 期日 10/29/2020		85,900	608
		Argentina Treasury Bond BONCER			
		2.500% 期日 07/22/2021		29,700	375
		Autonomous Community of Catalonia			
		4.900% 期日 09/15/2021	EUR	1,350	1,628
		4.950% 期日 02/11/2020		250	283
		6.350% 期日 11/30/2041		250	441
		Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER			
		4.000% 期日 03/06/2020	ARS	68,350	675
		Corp. Andina de Fomento			
		3.950% 期日 10/15/2021	MXN	758	39
		Croatia Government International Bond			

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価
			通貨	(単位：千)	通貨
		6.750% 期日 11/05/2019	USD	12,900	12,914
		Export Credit Bank of Turkey			
		8.250% 期日 01/24/2024		3,000	3,210
		Export-Import Bank of India			
		2.750% 期日 08/12/2020		630	632
		KSA Sukuk Ltd.			
		2.894% 期日 04/20/2022		5,200	5,287
		Kuwait International Government Bond			
		2.750% 期日 03/20/2022		2,460	2,500
		3.500% 期日 03/20/2027		6,500	7,009
		Peru Government International Bond			
		5.400% 期日 08/12/2034	PEN	74	24
		5.700% 期日 08/12/2024		6,797	2,262
		5.940% 期日 02/12/2029		56,722	19,134
		6.150% 期日 08/12/2032		98,515	33,573
		6.350% 期日 08/12/2028		50,656	17,531
		6.950% 期日 08/12/2031		28,967	10,508
		8.200% 期日 08/12/2026		1,866	704
		8.200% 期日 08/12/2026		81,838	30,876
		Provincia de Buenos Aires			
		57.612% 期日 04/12/2025	ARS	373,969	1,750
		61.097% 期日 05/31/2022		60,600	319
		Qatar Government International Bond			
		3.875% 期日 04/23/2023	USD	10,300	10,878
		5.103% 期日 04/23/2048		2,400	3,065
		Russia Government International Bond			
		5.000% 期日 04/29/2020		700	711
		Saudi Government International Bond			
		2.375% 期日 10/26/2021		3,500	3,511
		2.875% 期日 03/04/2023		6,800	6,952
		3.250% 期日 10/26/2026		9,800	10,151
		3.625% 期日 03/04/2028		2,200	2,319
		4.000% 期日 04/17/2025		61,900	66,590
		4.375% 期日 04/16/2029		3,600	4,027
		4.500% 期日 10/26/2046		1,300	1,433
		4.625% 期日 10/04/2047		2,100	2,357
		5.000% 期日 04/17/2049		7,300	8,666
		Serbia Government International Bond			
		7.250% 期日 09/28/2021		2,103	2,298
		South Africa Government International Bond			
		4.850% 期日 09/30/2029		8,200	8,143
		5.750% 期日 09/30/2049		8,200	7,956
		Tanzania Government International Bond			
		7.989% 期日 03/09/2020		111	113
		Turkey Government International Bond			
		4.625% 期日 03/31/2025	EUR	21,500	24,814
		5.200% 期日 02/16/2026		2,982	3,500
		5.625% 期日 03/30/2021	USD	4,600	4,710
		5.750% 期日 03/22/2024		2,000	2,020
		6.350% 期日 08/10/2024		5,869	6,059
		7.500% 期日 11/07/2019		900	901
		7.625% 期日 04/26/2029		43,400	46,655
		Ukraine Government International Bond			
		7.750% 期日 09/01/2023		4,390	4,705

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）

種類	業種	銘柄	額面金額	
			通貨（単位：千）	時価（単位：千）
		Venezuela Government International Bond		
		6.000% 期日 12/09/2020	3,367	362
		7.000% 期日 03/31/2038	1,883	205
		7.650% 期日 04/21/2025	5,349	582
		7.750% 期日 04/13/2020	1,200	130
		8.250% 期日 10/13/2024	5,991	652
		9.000% 期日 05/07/2023	3,161	344
		9.250% 期日 09/15/2027	4,274	465
		9.250% 期日 05/07/2028	6,512	708
		11.750% 期日 10/21/2026	680	74
		11.950% 期日 08/05/2031	6,000	653
		ソブリン債合計		503,591
		(原価：694,662米ドル)		
			株式数	
普通株式		Caesars Entertainment Corp.	1,078,632	13,246
0.3%		Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,292,182	12,331
		Eurobank Ergasias S.A.	10,169,333	10,312
		iHeartMedia, Inc. Class A	294,195	4,219
		iHeartMedia, Inc. Class B	3,948	57
		National Bank of Greece S.A.	102,570	348
		Westmoreland Mining Holdings LLC	8,912	111
		普通株式合計		40,624
		(原価：50,317米ドル)		
商業不動産株式		VICI Properties, Inc.	760,482	17,909
0.1%		商業不動産株式合計		17,909
		(原価：5,574米ドル)		
新株予約権		iHeart Media, Inc.		
0.2%		12/31/2049	1,916,029	27,476
		Sequa Corp.		
		04/28/2024	42,000	51
		新株予約権合計		27,527
		(原価：39,333米ドル)		
優先証券		Nationwide Building Society		
0.2%		10.250%	74,050	15,571
		Sequa Corp.		
		9.000%	955	995
		Stichting AK Rabobank Certificaten		
		6.500%	21,310	3,042
		優先証券合計		19,608
		(原価：19,400米ドル)		
短期証券	定期性預金	Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	元本金額	
0.3%	0.2%	0.350% 期日 11/01/2019	AUD 796	549
		Bank of Nova Scotia		
		0.920% 期日 11/01/2019	CAD 13	10
		1.330% 期日 11/01/2019	USD 434	434
		BNP Paribas Bank		
		1.330% 期日 11/01/2019	218	218
		5.290% 期日 11/01/2019	ZAR 6,289	417
		Brown Brothers Harriman & Co.		

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）

種類	業種	銘柄	額面金額		時価	
			通貨	(単位：千)	通貨	(単位：千)
		(1.570%) 期日 11/01/2019	CHF	2		2
		(0.950%) 期日 11/01/2019	DKK	237		35
		(0.670%) 期日 11/01/2019	EUR	10		12
		(0.370%) 期日 11/01/2019	SEK	457		47
		(0.270%) 期日 11/01/2019	JPY	273		3
		0.350% 期日 11/01/2019	AUD	21		15
		0.380% 期日 11/01/2019	GBP	66		85
		0.920% 期日 11/01/2019	CAD	1		1
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	2		2
		5.290% 期日 11/01/2019	ZAR	575		38
		Citibank N.A.				
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	1,200		1,200
		Credit Suisse AG				
		(1.570%) 期日 11/01/2019	CHF	9		9
		DBS Bank Ltd.				
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	2,399		2,399
		HSBC Bank PLC				
		(0.670%) 期日 11/01/2019	EUR	929		1,036
		0.380% 期日 11/01/2019	GBP	274		354
		JPMorgan Chase Bank N.A.				
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	2,399		2,399
		MUFG Bank Ltd.				
		(0.270%) 期日 11/01/2019	JPY	554,262		5,127
		National Australia Bank Ltd.				
		0.350% 期日 11/01/2019	AUD	211		145
		Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
		(0.670%) 期日 11/01/2019	EUR	525		586
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	36		36
		Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
		(0.670%) 期日 11/01/2019	EUR	135		150
		(0.270%) 期日 11/01/2019	JPY	254,036		2,350
		0.380% 期日 11/01/2019	GBP	6,855		8,871
		1.330% 期日 11/01/2019	USD	2,743		2,743
						29,273
		アルゼンチン短期 国債				
		61.136% 期日 05/29/2020	ARS	78,409		553
		0.1%				
		81.834% 期日 05/15/2020		224,010		2,244
						2,797
						32,070
		短期証券合計				
		(原価：35,317米ドル)				
		投資有価証券合計 125.6%			USD	16,060,371
		(原価：16,079,164米ドル)				
		金融デリバティブ商品 (0.3%)				(46,349)
		(原価またはプレミアム(純額) (35,984)米ドル)				
		その他の資産および負債 (純額) (25.3%)				(3,229,810)
		純資産 100.0%			USD	12,784,212

マネー・マーケット・マザーファンド

第9期 (2019年3月2日から2020年3月2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。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	純資産総額
	円	期中騰落率 %		
5期 (2016年3月1日)	10,039	0.0	84.3	93
6期 (2017年3月1日)	10,033	△0.1	66.0	137
7期 (2018年3月1日)	10,025	△0.1	76.9	90
8期 (2019年3月1日)	10,019	△0.1	74.1	89
9期 (2020年3月2日)	10,013	△0.1	80.6	77

※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を記載しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

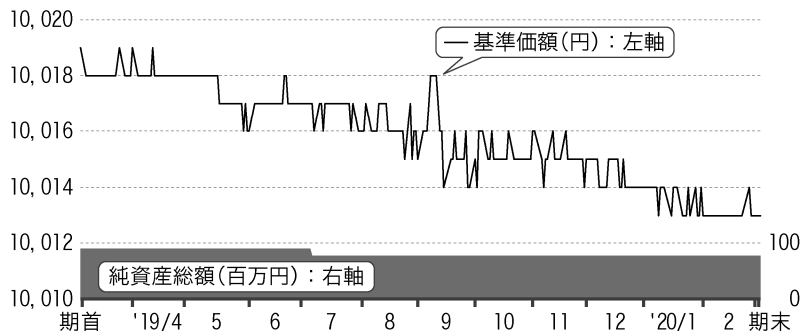
年月日	基準価額		債券組入率比
	円	騰落率 %	
(期首) 2019年3月1日	10,019	-	74.1
3月末	10,019	0.0	74.1
4月末	10,018	△0.0	74.0
5月末	10,016	△0.0	75.3
6月末	10,017	△0.0	75.2
7月末	10,016	△0.0	87.2
8月末	10,015	△0.0	84.8
9月末	10,015	△0.0	84.7
10月末	10,016	△0.0	84.6
11月末	10,015	△0.0	84.5
12月末	10,014	△0.0	80.8
2020年1月末	10,013	△0.1	80.7
2月末	10,013	△0.1	80.7
(期末) 2020年3月2日	10,013	△0.1	80.6

※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 (2019年3月2日から2020年3月2日まで)

基準価額等の推移



期首	10,019円
期末	10,013円
騰落率	-0.1%

▶ 基準価額の主な変動要因 (2019年3月2日から2020年3月2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 (2019年3月2日から2020年3月2日まで)

当期の短期金利は小幅に低下しました。

物価上昇率の伸びが徐々に鈍化したことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利の付利を継続しました。短期国債利回りは、一時的な需給要因から上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案しながら短期国債の買入れ額を調整したことから、概ねレンジ推移となりました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日銀当座預金付利金利である-0.10%程度を上限に、マイナ

ス圏で推移しました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.180%に対し、期末は-0.199%と小幅に低下しました。

▶ **ポートフォリオについて(2019年3月2日から2020年3月2日まで)**

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、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継続しました。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(2019年3月2日から2020年3月2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

2%の物価安定目標が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、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は引き続きマイナス圏での推移を想定します。

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。

■ 1万口当たりの費用明細(2019年3月2日から2020年3月2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)	0.007% (0.007)	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	0.007	

期中の平均基準価額は10,015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(2019年3月2日から2020年3月2日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	特殊債券	千円 45,559	千円 － (49,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()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(2019年3月2日から2020年3月2日まで)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
			%			%
公社債	百万円 45	百万円 17	% 37.8	百万円 －	百万円 －	% －

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMBC日興証券株式会社です。

■ 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
(2019年3月2日から2020年3月2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 (2020年3月2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	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	62,000 (62,000)	62,289 (62,289)	80.6 (80.6)	— (—)	— (—)	— (—)	80.6 (80.6)
合 計	62,000 (62,000)	62,289 (62,289)	80.6 (80.6)	— (—)	— (—)	— (—)	80.6 (80.6)

※()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。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

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
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第5回 政府保証阪神高速道路債券	1.3	17,000	17,010	2020/3/18
	第107回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	17,000	17,056	2020/5/29
	第115回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	14,000	14,075	2020/8/31
	第124回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	14,000	14,147	2020/12/28
	合 計	—	62,000	62,289	—

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2020年3月2日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	62,289	80.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,950	19.4
投 資 信 託 財 産 総 額	77,239	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年3月2日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	77,239,206円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,699,258
公 社 債 (評 価 額)	62,289,630
未 収 利 息	213,957
前 払 費 用	36,361
(B) 負 債	195
そ の 他 未 払 費 用	195
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	77,239,011
元 本	77,141,454
次 期 繰 越 損 益 金	97,557
(D) 受 益 権 総 口 数	77,141,454口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,013円

※当期における期首元本額89,650,363円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額12,508,909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。

インド内需関連株式ファンド	119,759円
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(原定為替ヘッジ)	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(原定為替ヘッジ/年2回決算型)	389,132円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジあり)	209,527円
日興フィデリティ世界企業債券ファンド(為替ヘッジなし)	179,593円
日興エドモン・ドゥ・ロスタヤルド・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・ロスタヤルド・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。

■ 損益の状況

(自2019年3月2日 至2020年3月2日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	810,106円
受 取 利 息	820,497
支 払 利 息	△ 10,391
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 851,460
売	△ 851,460
買	
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,757
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 47,111
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	165,922
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 21,254
(G) 計 (D + E + F)	97,557
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	97,557

※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。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

■ お知らせ

<約款変更について>

- ・委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、所要の変更を行いました。(適用日：2019年4月1日)