

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16作成期 (2021年11月13日から2022年5月12日まで)

第 **31** 期 / 第 **32** 期

第31期：決算日 2022年2月14日

第32期：決算日 2022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・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD) ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M) (米ドル建ての債券等に投資) マネー・マーケット・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■世界の幅広い債券等のうち、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品等に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 ■運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。 ■外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■年4回(原則として毎年2月、5月、8月、11月の12日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間:午前9時~午後5時(土、日、祝・休日を除く)

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

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

■ 最近10期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			公 社 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 込 金	騰 落 率	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	百万円		
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		
25期(2020年8月12日)	8,977	70	4.8	0.0	98.3	5,776		
26期(2020年11月12日)	9,045	50	1.3	0.0	98.4	5,146		
27期(2021年2月12日)	9,218	40	2.4	0.0	98.3	4,650		
28期(2021年5月12日)	9,464	50	3.2	0.0	98.7	4,525		
29期(2021年8月12日)	9,657	40	2.5	0.0	98.5	4,508		
30期(2021年11月12日)	9,958	40	3.5	0.0	98.9	4,543		
31期(2022年2月14日)	9,860	50	△0.5	0.0	95.3	4,339		
32期(2022年5月12日)	10,000	310	4.6	0.0	95.9	3,925		

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準	価 額		公 社 組 入 比	債 率 投 証 比	資 信 託 券 組 入 率
			騰 落 率	騰 落 率			
		円	%	%	%	百万円	
第31期	(期首) 2021年11月12日	9,958	—	0.0	98.9		
	11月末	9,811	△1.5	0.0	99.0		
	12月末	10,005	0.5	0.0	99.2		
	2022年1月末	9,901	△0.6	0.0	98.7		
	(期末) 2022年2月14日	9,910	△0.5	0.0	95.3		
第32期	(期首) 2022年2月14日	9,860	—	0.0	95.3		
	2月末	9,750	△1.1	0.0	99.2		
	3月末	10,006	1.5	0.0	98.7		
	4月末	10,250	4.0	0.0	93.1		
	(期末) 2022年5月12日	10,310	4.6	0.0	95.9		

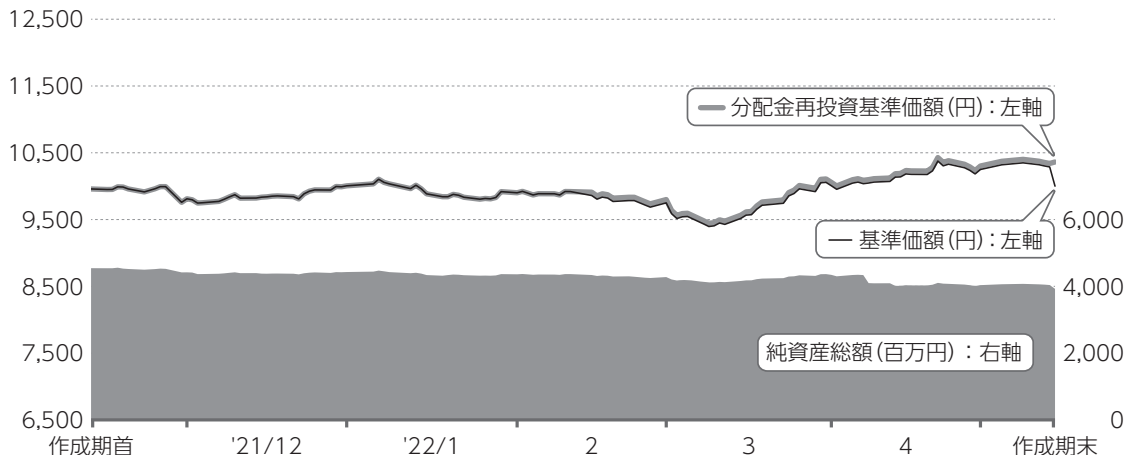
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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（2021年11月13日から2022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	9,958円
作成期末	10,000円 (当作成期既払分配金360円(税引前))
騰落率	+4.1% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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

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

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

基準価額の主な変動要因（2021年11月13日から2022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などに投資しました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジは行っていません。

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

上昇要因

- 債券利子収入を得たこと
- 米ドル高・円安となったこと

下落要因

- 米国の金利が上昇（債券価格は下落）したこと
- 新興国関連資産の一部が下落したこと
- スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大したこと

投資環境について（2021年11月13日から2022年5月12日まで）

米国債券市場は下落しました。米国ハイイールド社債と新興国債券も下落しました。
為替市場では、米ドル高・円安となりました。

債券市場

米国債券市場は、期初、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念等がプラス要因となる一方、F R B（米連邦準備制度理事会）のテーパリング（量的緩和の縮小）開始、早期利上げ等への警戒感がマイナス要因となり、横ばいの推移となりました。

2022年に入ると、インフレの高止まりを背景に前回よりも早いペースでの利上げやバランスシートの縮小が意識されたことから、下落基調となりました。期を通じて見ると、米国債券市場は下落しました。

米国ハイイールド社債と新興国債券も、リスク回避などにより下落しました。

為替市場

為替市場では、米ドル高・円安となりました。

3月以降、米国のインフレ高進などを背景に、F R Bは2022年内に複数回の利上げを示唆するなどタカ派（インフレ抑制を重視する立場）姿勢を見せました。一方で日銀が金融緩和継続の姿勢示したこともあり、米ドル高・円安が進行しました。

ポートフォリオについて（2021年11月13日から2022年5月12日まで）

当ファンド

期初より「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（USD）」および「マネー・オープン・マザーファンド」に投資し、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（USD）」の投資比率を高位に保ちました。

ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（USD）

●デュレーション（投資資金の平均回収期間）

金利戦略については、ポートフォリオ全体の金利リスクを抑制姿勢としました。2022年初以降、利上げ、インフレ懸念によって急速に金利上昇が進むなか、米国において利回り面での妙味が高まっている中期年限を中心にリスク量を積み増しました。一方、相対的に投資妙味に欠けると判断した日本や英国の金利リスクは売り持ちとしました。そのほか、変動利付債券を3～4割程度ポートフォリオに組入れることで、金利上昇に対する耐性を確保しました。

●債券セクター配分

セクター戦略については、リスク回避の動きが強まった時に底堅い値動きが期待できる米国政府系モーゲージ証券を積み増しました。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モーゲージ証券も継続しました。また、利回りが相対的に高い新興国債券については、メキシコなどを中心に投資しました。

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（2021年11月13日から2022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（2021年11月13日から2022年5月12日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第31期	第32期
当期分配金	50	310
（対基準価額比率）	（0.50%）	（3.01%）
当期の収益	50	138
当期の収益以外	－	171
翌期繰越分配対象額	1,515	1,344

※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。

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、左記の通りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

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

ピムコ・バミューダ・インカムファンド A クラス J (USD)

当ファンドでは、リスク取得に過度に傾斜しない投資指針を通じ、市場が軟調となる局面において下値を抑制すると共に、確信度の

高いボトムアップの投資アイデアに基づく魅力的な投資機会の発掘に取り組んでいます。また、質の良い高利回り資産を中心とする「攻め」の資産と、リスク回避の動きが強まった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。

ロシアへのエクスポージャーについては、状況を精査しながら保有継続か売却かの検討を進めています。

マネー・マーケット・マザーファンド

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

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2021年11月13日から2022年5月12日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	91円	0.916%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は9,909円です。
（投信会社）	(51)	(0.518)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(38)	(0.382)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.016)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保管費用）	(－)	(－)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	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	91	0.919	

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

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

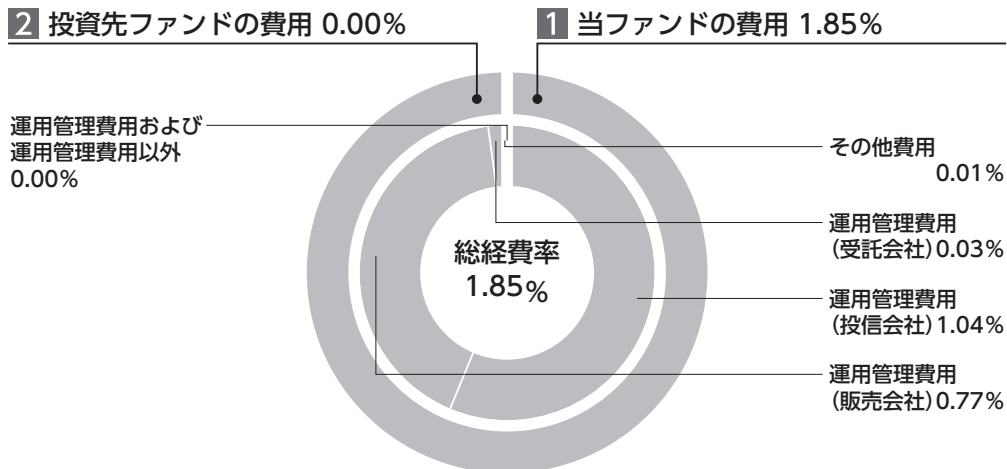
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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



参考情報 総経費率（年率換算）



総経費率(1+2)	1.85%
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	0.00%

- ※**1**の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。
- ※**2**の投資先ファンド(当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンド、マネーファンドを除く))の運用管理費用は、当ファンドの運用委託報酬として負担していることから、原則として、開示すべき運用管理費用はありません。ただし、投資先ファンドには運用管理費用以外の費用(概算)がかかります。
- ※**1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。
- ※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.85%です。

■ ■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2021年11月13日から2022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)	□ 14,884	千円 153,989	□ 90,480	千円 952,957

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

■ ■ 利害関係人との取引状況等（2021年11月13日から2022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

（2021年11月13日から2022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（2022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
	口	口	千円	%
ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ (USD)	426,349	350,753	3,764,631	95.9
合計	426,349	350,753	3,764,631	95.9

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 親投資信託残高

種類	作成期首	作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
マネー・マーケット・マザーファンド	1,456	1,456	1,455

※マネー・マーケット・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は76,632,575口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項目	作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	3,764,631	92.4
マネー・マーケット・マザーファンド	1,455	0.0
コール・ローン等、その他	306,877	7.5
投資信託財産総額	4,072,965	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2022年2月14日)	(2022年5月12日)
	第31期末	第32期末
(A) 資 産	4,383,254,808円	4,072,965,292円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	245,766,825	306,877,428
投資信託受益証券(評価額)	4,136,032,068	3,764,631,949
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,455,915	1,455,915
(B) 負 債	44,128,194	147,628,778
未払収益分配金	22,003,417	121,679,729
未払解約金	1,082,095	7,508,162
未払信託報酬	20,978,674	18,383,164
その他未払費用	64,008	57,723
(C) 純資産総額(A - B)	4,339,126,614	3,925,336,514
元 本	4,400,683,458	3,925,152,575
次期繰越損益金	△ 61,556,844	183,939
(D) 受益権総口数	4,400,683,458口	3,925,152,575口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,860円	10,000円

※当作成期における作成期首元本額4,562,669,286円、作成期中追加設定元本額69,701,995円、作成期中一部解約元本額707,218,706円です。

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

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

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第31期	第32期
	50円	310円

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

■ 損益の状況

項 目	自2021年11月13日 至2022年2月14日	自2022年2月15日 至2022年5月12日
	第31期	第32期
(A) 配 当 等 収 益	67,001,169円	59,911,389円
受 取 配 当 金	67,009,702	59,918,232
受 取 利 息	389	94
支 払 利 息	△ 8,922	△ 6,937
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 66,958,833	135,027,256
売 買 益	1,804,835	141,781,853
売 買 損	△ 68,763,668	△ 6,754,597
(C) 信 託 報 酬 等	△ 21,044,581	△ 18,441,951
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 21,002,245	176,496,694
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	144,420,959	89,920,348
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 162,972,141	△ 144,553,374
(配 当 等 相 当 額)	(200,083,177)	(181,009,546)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 363,055,318)	(△ 325,562,920)
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 39,553,427	121,863,668
(H) 収 益 分 配 金	△ 22,003,417	△ 121,679,729
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 61,556,844	183,939
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 162,972,141	△ 144,553,374
(配 当 等 相 当 額)	(200,083,180)	(181,009,546)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 363,055,321)	(△ 325,562,920)
分 配 準 備 積 立 金	466,957,759	346,596,642
繰 越 損 益 金	△ 365,542,462	△ 201,859,329

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

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

※投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は14,046,545円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第31期	第32期
(a) 経費控除後の配当等収益	45,958,962円	54,246,083円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0
(c) 収益調整金	200,083,180	181,009,546
(d) 分配準備積立金	443,002,214	414,030,288
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	689,044,356	649,285,917
1万口当たり当期分配対象額	1,565.77	1,654.17
(f) 分配金	22,003,417	121,679,729
1万口当たり分配金	50	310

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

■ 組入れ投資信託証券の内容

投資信託証券の概要

ファンド名	ピムコ・バミューダ・インカムファンドA クラスJ（USD）
形態	バミューダ籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	「ピムコ・バミューダ・インカムファンド（M）」受益証券
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。 ・原則として対円での為替ヘッジを行いません。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・米ドル建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・デリバティブおよび外国為替予約取引の利用は、原則としてヘッジ目的および資産の効率的な運用に資することを目的とします。
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。
運用管理費用	ありません。
その他の費用	<p>ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。</p> <p>これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>
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（2020年11月1日から2021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）	59
総収益	59
費用	
顧問費用 - W (USD)	171
管理手数料 - M (JPY助言)	308
管理手数料 - M (USD助言)	114
管理手数料 - P (JPY)	305
管理手数料 - T (JPY)	6,511
管理手数料 - U (USD)	592
管理手数料 - X (JPY)	36
管理事務代行費用 - W (USD)	53
販売手数料 - M (JPY助言)	267
販売手数料 - M (USD助言)	99
販売手数料 - P (JPY)	305
代行手数料- M (JPY助言)	20
代行手数料- M (USD助言)	8
支払利息	6
その他費用	1
総費用	8,796
投資純利益（損失）	(8,737)
実現純利益（損失）	
関連ファンドに対する投資	379,171
OTC金融デリバティブ商品	(518,405)
外国為替	(331)
実現純利益（損失）	(139,565)
未実現評価益（損）の純変動額	
有価証券に対する投資	(2)
関連ファンドに対する投資	518,884
OTC金融デリバティブ商品	(279,682)
外貨建資産および負債	(57)
未実現評価益の純変動額	239,143
純利益	99,578
運用の結果による純資産の純増加額	90,841

■ 投資明細表（2021年10月31日現在）

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
有価証券に対する投資 4.3%		
短期証券 4.3%		
定期性預金 4.0%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.005% due 11/01/2021	\$ 8,088	\$ 8,088
Bank of Nova Scotia		
0.005% due 11/01/2021	708	708
BNP Paribas Bank		
0.005% due 11/01/2021	55,641	55,641
Brown Brothers Harriman & Co.		
0.005% due 11/01/2021	33	33
Citibank N.A.		
0.005% due 11/01/2021	54,147	54,147
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 11/01/2021	22,743	22,743
DnB Bank ASA		
0.005% due 11/01/2021	381	381
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 11/01/2021	108,295	108,295
National Australia Bank Ltd.		
0.005% due 11/01/2021	2,679	2,679
Royal Bank of Canada		
0.005% due 11/01/2021	11,140	11,140
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.005% due 11/01/2021	213,939	213,939
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.005% due 11/01/2021	37,946	37,946
		515,740
米国短期証券 0.1%		
0.050% due 02/24/2022	2,400	2,400
0.050% due 03/31/2022	7,200	7,198
		9,598
米国短期証券(CMB) 0.2%		
0.045% due 01/04/2022	24,700	24,697
短期証券合計 (原価 550,036米ドル)		550,035
有価証券に対する投資合計 (原価 550,036米ドル)		550,035
	口数 (単位:千)	
関連ファンドに対する投資 96.2%		
その他投資 96.2%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M) (原価 10,775,944米ドル)	793,189	12,389,610
関連ファンドに対する投資合計 (原価 10,775,944米ドル)		12,389,610
投資合計 100.5% (原価 11,325,980米ドル)		\$ 12,939,645
金融デリバティブ商品 (1.5%) (原価またはプレミアム(純額) 0米ドル)		(192,496)
その他の資産および負債 (純額) 1.0%		128,450
純資産 100.0%		\$ 12,875,599

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書(2020年11月1日から2021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)	350,782
受取配当金(外国税控除後)	743
総収益	351,525
費用	
支払利息	138
雑費用	1
総費用	139
投資純利益(損失)	351,386
実現純利益(損失)	
有価証券に対する投資	73,734
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	91,472
OTC金融デリバティブ商品	58,029
外国為替	21,105
実現純利益(損失)	244,340
未実現評価益(損)の純変動額	
有価証券に対する投資	383,009
市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引	(39,664)
OTC金融デリバティブ商品	(9,312)
外貨建資産および負債	(5,601)
未実現評価益(損)の純変動額	328,432
純利益(損失)	572,772
運用の結果による純資産の純増加額	924,158
* 外国源泉課税	351

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

■ 投資明細表(2021年10月31日現在)

有価証券に対する投資 118.5%		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	LifePoint Health, Inc.		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	債券等 27.1%		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		
銀行貸付債権 4.8%								銀行および金融 10.7%					
AAdvantage Loyalty IP Ltd.				3.837% due 11/16/2025				AGFC Capital Trust I					
5,500%	due 04/20/2028	\$ 7,103	\$ 7,400	2.337% due 03/15/2027				1.874% due 01/15/2067					
Air Canada				2.353% due 03/15/2027				2,200				\$ 2,299	
4,250%	due 08/11/2028	4,800	4,856	Marriott Ownership Resorts, Inc.				AIB Group PLC					
Altea France S.A.				1.837% due 08/29/2025				2.875% due 05/30/2031				EUR 6,600	8,063
4,125%	due 08/14/2026	4,669	4,660	2.837% due 04/03/2024				4.263% due 04/10/2025				\$ 1,960	2,085
Aramark Intermediate HoldCo Corp.				3.337% due 04/03/2024				6.250% due 06/23/2025				EUR 2,461	3,183
1.837%	due 03/11/2025	833	911	Nielsen Finance LLC				Ally Financial, Inc.					
Avantor Funding, Inc.				2.086% due 10/04/2023				8.000% due 11/01/2031				\$ 2,889	4,135
2,500%	due 11/21/2024	126	126	Nouryon Finance BV				Alpha Bank S.A.					
Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC				2.839% due 10/01/2025				2.500% due 02/05/2023				EUR 3,450	4,109
2,250%	due 02/12/2027	7,056	7,004	Pacific Gas & Electric Co.				Army Hawaii Family Housing Trust Certificates					
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV				2.375% due 01/03/2022				0.490% due 06/15/2050				\$ 8,100	5,939
1.882%	due 06/01/2024	396	395	Paraxel International Corp.				Aroundtown S.A.					
Azalea TopCo, Inc.				2.837% due 09/27/2024				5.375% due 03/21/2029				11,300	13,108
3,587-3,629%	due 07/24/2026	2,269	2,255	PetSmart Inc.				Atrium European Real Estate Ltd.					
Bausch Health Cos., Inc.				4,500% due 02/11/2028				3.000% due 09/11/2025				EUR 3,300	3,948
2.837%	due 11/27/2025	1,164	1,163	Pug LLC				3.625% due 10/17/2022				350	414
3.087%	due 06/02/2025	673	672	3,587% due 02/12/2027				Avolon Holdings Funding Ltd.					
Boeing Co.				2.837% due 08/14/2024				2.528% due 11/18/2027				\$ 47,992	47,146
1,366%	due 02/07/2022	2,315	2,315	2.837% due 08/14/2024				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
Caesars Resort Collection LLC				2.837% due 08/14/2024				1.875% due 01/09/2026				EUR 1,400	1,605
2,837%	due 12/23/2024	14,482	14,430	2.837% due 08/14/2024				2.625% due 04/28/2025				400	469
3,587%	due 07/21/2025	9,837	9,860	7,750% due 11/28/2023				3.625% due 09/24/2024				700	834
Camelot U.S. Acquisition 1 Co.				10.000% due 07/23/2025				4.000% due 07/10/2022				200	234
3.087%	due 10/30/2026	197	196	Serta Simmons Bedding LLC				Banco Bradesco S.A.					
Carnival Corp.				4,500% due 11/08/2023				2.850% due 01/27/2023				\$ 4,714	4,773
3,750%	due 06/30/2025	EUR 10,866	12,685	Sigma Holdco BV				Banco BTG Pactual S.A.					
3,750%	due 06/30/2025	\$ 22,626	22,605	3,500% due 07/02/2025				4,500% due 01/10/2025				4,400	4,477
4,000%	due 10/18/2028	8,009	8,010	Sinclair Television Group, Inc.				Banco de Credito del Peru					
Cengage Learning, Inc.				2,590% due 09/30/2026				\$ 1,171				1,157	1,157
5,750%	due 06/29/2026	18,461	18,581	SkyMiles IP Ltd.				Banco Espirito Santo S.A.					
Charter Communications Operating LLC				4,750% due 10/20/2027				2.625% due 05/08/2049				EUR 3,100	628
1.840%	due 02/01/2027	5,443	5,411	Sotera Health Holdings LLC				Banco Santander S.A.					
Commscope, Inc.				3,250% due 12/11/2026				4,750% due 03/19/2025				4,200	5,031
3,337%	due 04/06/2026	3,820	3,874	SS&C Technologies Holdings, Inc.				Bank of Ireland Group PLC					
Cornerstone Building Brands, Inc.				1.837% due 04/16/2025				7,500% due 05/19/2025				15,057	20,326
3,750%	due 04/12/2028	2,801	2,802	Sunshine Luxembourg VII Sarl				Bank of Nova Scotia					
Dell International LLC				4,500% due 10/01/2026				4,900% due 06/04/2025				\$ 1,681	1,798
2,000%	due 09/19/2025	1,773	1,774	Syniverse Holdings, Inc.				Barclays Bank PLC					
DIRECTV Financing LLC				6,000% due 03/09/2023				7.625% due 11/21/2022				5,281	5,629
5,750%	due 07/22/2027	7,500	7,514	TransDigm, Inc.				Barclays PLC					
Envision Healthcare Corp.				2,337% due 08/22/2024				3,250% due 02/12/2027				GBP 13,583	19,170
3,837%	due 10/10/2025	16,422	13,630	2,337% due 05/30/2025				4.375% due 03/15/2028				\$ 3,400	3,353
Forest City Enterprises LP				2,337% due 12/09/2025				4.972% due 05/16/2029				2,600	3,006
3,587%	due 12/08/2025	1,460	1,444	U.S. Renal Care, Inc.				5.875% due 09/15/2024				GBP 4,000	5,729
Golden Nugget, Inc.				5.125% due 06/26/2026				6.125% due 12/15/2025				\$ 7,700	8,468
3,250%	due 10/04/2023	27	27	3,587% due 04/04/2025				6.375% due 12/15/2025				GBP 2,150	3,199
GreenSky Holdings LLC				3,587% due 02/25/2027				7.125% due 06/15/2025				5,200	7,888
3,375%	due 03/31/2025	4,729	4,717	9,948				7.250% due 03/15/2023				16,760	24,237
Hertz Corp.				United Airlines, Inc.				7,750% due 09/15/2022				\$ 14,570	15,860
4,000%	due 06/30/2028	1,711	1,715	4,500% due 04/21/2028				7.875% due 03/15/2023				1,200	1,228
Hilton Worldwide Finance LLC				Univision Communications, Inc.				7.875% due 09/15/2022				GBP 8,053	11,611
1.839%	due 06/22/2026	9,745	9,682	3,750% due 03/15/2024				8.000% due 06/15/2024				\$ 9,800	10,933
Icon PLC				Westmoreland Coal Co.				BGC Partners, Inc.					
3,000%	due 07/03/2028	9,377	9,387	15,000% due 03/15/2029				3,750% due 10/01/2024				1,464	1,545
iHeartCommunications, Inc.				WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL				4.375% due 12/15/2025				1,700	1,826
3.087%	due 05/01/2026	132,910	132,103	2,504% due 02/09/2022				BDC Aviation Ltd.					
Intelsat Jackson Holdings S.A.				Windstream Services II LLC				1.257% due 09/28/2023				1,900	1,907
3,600-5,750%	due 10/13/2022	23,345	23,601	7,250% due 09/21/2027				CA Immobilien Anlagen AG					
8.000%	due 11/27/2023	14,449	14,607	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				1.000% due 10/27/2025				EUR 3,800	4,462
8.625%	due 01/02/2024	10,100	10,247	1.837% due 05/30/2025				CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan					
Iqvia, Inc.				Zayo Group Holdings, Inc.				European Core Fund					
1.837%	due 01/17/2025	3,641	3,642	3,087% due 03/09/2027				0.800% due 10/12/2029				13,300	15,125
Lealand Finance Co. BV				銀行貸付債権合計				CIFI Holdings Group Co. Ltd.					
1,087-3,00%	due 06/30/2025	578	272	原簿 603,943米ドル				4,450% due 08/17/2026				\$ 300	278
3,087%	due 06/30/2024	261	157					CIT Bank N.A.					
								2,969% due 09/27/2025				2,800	2,888
												611,550	

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

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
CIT Group, Inc.			6.500% due 03/23/2028	\$ 10,070	\$ 11,254	Sabra Health Care LP		
5.000% due 08/15/2022	\$ 8,006	\$ 8,266	Huarong Finance 2017 Co. Ltd.			3.900% due 10/15/2029	\$ 410	\$ 430
5.000% due 08/01/2023	3,627	3,854	4.750% due 04/27/2027	600	586	Santander Holdings USA, Inc.		
Cooperative Rabobank UA			4.950% due 11/07/2047	700	606	4.400% due 07/13/2027	1,284	1,429
3.250% due 12/29/2026	EUR 600	708	Huarong Finance 2019 Co. Ltd.			4.500% due 07/17/2025	3,000	3,286
Corestate Capital Holding S.A.			3.375% due 02/24/2030	700	623	Santander UK Group Holdings PLC		
3.500% due 04/15/2023	39,300	38,486	3.625% due 09/30/2030	500	444	3.823% due 11/03/2028	3,400	3,671
Country Garden Holdings Co. Ltd.			3.875% due 11/13/2029	500	464	6.750% due 06/24/2024	GBP 16,610	24,787
3.125% due 10/22/2025	\$ 1,800	1,679	IMMDFINANZ AG			7.375% due 06/24/2022	7,500	10,588
3.875% due 10/22/2030	1,000	920	2.500% due 10/15/2027	EUR 28,500	34,501	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
CPI Property Group S.A.			2.625% due 01/27/2023	9,600	11,376	6.125% due 02/07/2022	\$ 10,400	10,547
1.500% due 01/27/2031	EUR 7,900	8,770	InCaps Funding I Ltd.			Sitka Holdings LLC		
2.750% due 05/12/2026	4,800	5,993	2.120% due 06/01/2033	\$ 11,315	10,636	5.250% due 07/06/2026	16,995	17,292
4.750% due 03/08/2023	\$ 15,100	15,838	ING Groep NV			SL Green Realty Corp.		
Credit Agricole S.A.			5.750% due 11/16/2026	7,600	8,257	4.500% due 12/01/2022	1,350	1,390
7.875% due 01/23/2024	296	328	International Lease Finance Corp.			Societe Generale S.A.		
Credit Suisse AG			8.625% due 01/15/2022	3,201	3,252	6.750% due 04/06/2028	1,511	1,689
6.500% due 08/08/2023	10,885	11,873	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			7.375% due 10/04/2023	8,200	8,831
Credit Suisse Group AG			3.250% due 11/12/2025	EUR 1,400	1,724	Starwood Property Trust, Inc.		
3.091% due 05/14/2032	250	255	Legal & General Group PLC			5.000% due 12/15/2021	214	214
3.869% due 01/12/2029	31,650	34,258	5.625% due 03/24/2031	GBP 1,910	2,877	Summit Properties Ltd.		
4.194% due 04/01/2031	250	277	Lloyds Banking Group PLC			2.000% due 01/31/2025	EUR 1,100	1,247
4.282% due 01/09/2028	1,500	1,645	4.947% due 06/27/2025	EUR 2,011	2,539	Sunac China Holdings Ltd.		
6.375% due 08/21/2026	546	596	5.125% due 12/27/2024	GBP 1,400	1,996	7.000% due 07/09/2025	\$ 800	575
2.750% due 09/12/2025	1,100	1,221	7.500% due 06/27/2024	\$ 2,700	2,990	Svenska Handelsbanken AB		
7.500% due 07/17/2023	6,700	7,139	7.500% due 09/27/2025	7,700	8,841	4.375% due 03/01/2027	4,200	4,400
7.500% due 12/11/2023	400	437	7.625% due 06/27/2023	GBP 10,711	15,728	4.750% due 03/01/2031	6,600	6,917
Cromwell Exec Lux Finco Sarl			7.875% due 06/27/2029	4,600	7,933	Tesco Property Finance 2 PLC		
2.125% due 11/19/2025	EUR 7,366	8,788	MDGH GMTN RSC Ltd.			6.052% due 10/13/2039	GBP 4,511	8,067
CTP NV			3.950% due 05/21/2050	\$ 3,500	3,990	Tesco Property Finance 3 PLC		
1.250% due 06/21/2029	7,500	8,592	MPT Operating Partnership LP			5.744% due 04/13/2040	161	288
1.500% due 09/27/2031	8,200	9,285	3.692% due 06/05/2028	GBP 2,400	3,483	Tesco Property Finance 4 PLC		
CyrusOne LP			Nationwide Building Society			5.801% due 10/13/2040	392	706
1.450% due 01/22/2027	1,500	1,746	3.960% due 07/18/2030	\$ 5,600	6,189	Tesco Property Finance 6 PLC		
Deutsche Bank AG			4.302% due 03/08/2029	12,500	13,954	5.411% due 07/13/2044	2,535	4,480
0.750% due 02/17/2027	12,100	13,996	5.750% due 06/20/2027	GBP 6,850	10,254	TP ICAP Ltd.		
1.375% due 02/17/2032	20,300	23,469	5.875% due 12/20/2024	1,600	2,374	5.250% due 05/29/2026	3,300	5,138
1.750% due 11/19/2030	20,100	24,213	NatWest Group PLC			U.S. Capital Funding VI Ltd.		
3.035% due 05/28/2032	\$ 700	708	4.445% due 05/08/2030	\$ 17,600	19,988	0.401% due 07/10/2043	\$ 26,621	22,674
3.547% due 09/18/2031	7,400	7,836	4.600% due 06/29/2031	4,600	4,543	UBS Group AG		
3.991% due 11/26/2025	13,460	14,399	5.076% due 01/27/2030	16,500	19,327	5.750% due 02/19/2022	EUR 3,200	3,761
EPR Properties			6.000% due 12/29/2025	17,700	19,610	7.000% due 02/19/2025	\$ 200	225
4.500% due 06/01/2027	3,650	3,928	8.000% due 08/10/2025	12,660	14,860	UniCredit SpA		
4.750% due 12/15/2026	256	278	Nevient Corp.			7.830% due 12/04/2022	72,590	82,389
4.950% due 04/15/2028	1,132	1,240	5.625% due 08/01/2033	1,468	1,395	9.250% due 06/03/2023	EUR 900	1,094
Fairfax Financial Holdings Ltd.			6.500% due 06/15/2022	4,990	5,140	Unique Pub Finance Co. PLC		
4.250% due 12/06/2027	CAD 4,500	3,855	Newmark Group, Inc.			7.395% due 03/28/2024	GBP 1,599	2,319
4.625% due 04/29/2030	\$ 1,556	1,746	6.125% due 11/15/2023	2,334	2,524	Uniti Group LP		
4.850% due 04/17/2028	1,456	1,651	Omega Healthcare Investors, Inc.			6.500% due 02/15/2029	\$ 2,280	2,310
GE Capital Funding LLC			3.625% due 10/01/2029	1,682	1,760	7.875% due 02/15/2025	19,582	20,619
4.400% due 05/15/2030	16,400	19,179	OneMain Finance Corp.			VICI Properties LP		
GLP Capital LP			5.625% due 03/15/2023	29,772	31,349	3.500% due 02/15/2025	4,784	4,874
5.250% due 06/01/2025	650	722	6.125% due 05/15/2022	15,903	16,281	3.750% due 02/15/2027	4,866	5,006
5.300% due 01/15/2029	3,142	3,599	6.125% due 03/15/2024	2,832	3,016	4.125% due 08/15/2030	5,684	5,975
Goodman U.S. Finance Three LLC			6.875% due 03/15/2025	3,019	3,374	4.250% due 12/01/2026	3,600	3,733
3.700% due 03/15/2028	2,324	2,503	Park Aerospace Holdings Ltd.			4.625% due 12/01/2029	3,600	3,845
Growthpoint Properties International Pty Ltd.			4.500% due 03/15/2023	9,522	9,921	Voyager Aviation Holdings LLC		
5.872% due 05/02/2023	1,800	1,689	5.500% due 02/15/2024	575	623	8.500% due 05/09/2026	4,421	4,063
Horse Gallop Finance Ltd.			Preferred Term Securities XVIII Ltd.					
3.250% due 05/30/2022	10,200	10,321	0.496% due 09/23/2035	145	141			
Host Hotels & Resorts LP			Preferred Term Securities XXIV Ltd.					
4.000% due 06/15/2025	200	213	0.416% due 03/22/2037	917	825			
HSBC Holdings PLC			0.496% due 03/22/2037	4,830	4,154			
2.848% due 06/04/2031	3,300	3,355	Preferred Term Securities XXV Ltd.					
3.000% due 05/29/2030	GBP 3,700	5,316	0.406% due 06/22/2037	25,155	22,262			
3.973% due 05/22/2030	\$ 14,100	15,431	Preferred Term Securities XXVI Ltd.					
4.750% due 07/04/2029	EUR 2,800	3,537	0.416% due 09/22/2037	28,337	26,070			
5.875% due 09/28/2026	GBP 6,800	10,088	ONB Finance Ltd.					
6.000% due 09/29/2023	EUR 6,800	8,261	1.274% due 02/12/2022	66,400	66,586			
6.000% due 05/22/2027	\$ 700	762						

産業 7.6%

AA Bond Co. Ltd.		
2.875% due 01/31/2022	GBP 745	1,021
5.500% due 07/31/2027	855	1,325
Air Canada		
3.875% due 08/15/2026	\$ 2,500	2,534
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
4.800% due 08/15/2027	3,940	4,383
Amdocs Ltd.		
2.538% due 06/15/2030	5,300	5,296

1,359,246

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)	
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust			Ford Foundation			5,500	due 06/01/2050	\$ 2,100	\$ 2,817
3,350	due 10/15/2029	\$ 389	\$ 399	2,415	due 06/01/2050	\$ 1,285	\$ 1,262		
American Airlines, Inc.						2,815	due 06/01/2070	2,070	2,113
5,750	due 04/20/2029	2,712	2,922	Ford Motor Credit Co. LLC					
Arcenic Corp.									
6,000	due 05/15/2025	1,017	1,065	0.177%	due 11/15/2023	EUR 200	230		
Atlanta SpA									
1,875	due 02/12/2028	EUR 10,200	12,236	1.198%	due 08/03/2022	\$ 200	200		
Boeing Co.									
3,600	due 05/01/2034	\$ 100	105	1.360%	due 02/15/2023	600	601		
5,040	due 05/01/2027	6,299	7,155	1.744%	due 07/19/2024	EUR 10,300	12,128		
5,150	due 05/01/2030	9,825	11,468	2.330%	due 11/25/2025	2,950	3,531		
5,705	due 05/01/2040	19,971	19,971	2.386%	due 02/17/2026	1,000	1,200		
5,805	due 05/01/2050	12,129	16,651	2.700%	due 08/10/2026	\$ 1,600	1,600		
5,930	due 05/01/2060	18,195	25,389	2.979%	due 08/03/2022	5,600	5,650		
Bombardier, Inc.									
7,500	due 12/01/2024	6,008	6,263	3.021%	due 03/06/2024	EUR 9,400	11,372		
7,500	due 03/15/2025	274	282	3.067%	due 01/09/2023	\$ 11,400	11,610		
7,875	due 04/15/2027	6,256	6,512	3.096%	due 05/04/2023	4,900	4,986		
British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust									
3,300	due 12/15/2032	95	98	3.250%	due 09/15/2025	EUR 29,099	35,994		
Broadcom, Inc.									
2,450	due 02/15/2031	10,500	10,165	3.264%	due 01/07/2022	\$ 4,920	4,932		
2,600	due 02/15/2033	300	289	3.330%	due 03/28/2022	800	806		
3,137	due 11/15/2035	8,450	8,314	3.350%	due 11/01/2022	12,100	12,299		
3,187	due 11/15/2036	1,183	1,164	3.370%	due 11/17/2023	600	617		
3,419	due 04/15/2033	1,667	1,723	3.375%	due 11/13/2025	4,100	4,218		
3,469	due 04/15/2034	8,092	8,355	3.550%	due 10/07/2022	8,555	8,694		
4,110	due 09/15/2028	13,865	14,741	3.684%	due 09/08/2024	1,500	1,554		
4,150	due 11/15/2030	12,521	13,773	3.810%	due 01/09/2024	5,700	5,907		
4,300	due 11/15/2032	12,473	13,900	3.815%	due 11/02/2027	2,800	2,701		
Caesars Entertainment, Inc.									
8,250	due 07/01/2025	17,006	17,909	4.063%	due 11/01/2024	2,200	2,310		
Caesars Resort Collection LLC									
5,750	due 07/01/2025	2,700	2,840	4.125%	due 08/17/2027	700	744		
Carnival Corp.									
4,000	due 08/01/2028	14,100	14,118	4.140%	due 02/15/2023	5,700	5,861		
Centene Corp.									
4,250	due 12/15/2027	1,462	1,533	4.250%	due 09/20/2022	4,200	4,301		
4,625	due 12/15/2029	1,880	2,030	4.389%	due 01/08/2026	2,600	2,785		
Citrix Systems, Inc.									
3,300	due 03/01/2030	1,586	1,610	4.535%	due 03/06/2025	GBP 18,765	27,140		
Clear Channel International BV									
6,625	due 08/01/2025	4,250	4,432	4.542%	due 08/01/2026	\$ 1,400	1,509		
Community Health Systems, Inc.									
4,750	due 02/15/2031	30,800	30,640	4.687%	due 06/09/2025	1,100	1,177		
5,625	due 03/15/2027	37,147	38,919	5.125%	due 06/16/2025	4,100	4,454		
6,000	due 01/15/2029	5,830	6,143	5.584%	due 03/18/2024	2,700	2,913		
6,625	due 02/15/2025	28,950	30,144	5.596%	due 01/07/2022	7,400	7,463		
8,000	due 03/15/2026	11,418	12,080	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC					
CoStar Group, Inc.									
2,800	due 07/15/2030	2,000	2,028	6.500%	due 10/01/2025	7,563	7,792		
CVS Pass-Through Trust									
5,773	due 01/10/2033	148	177	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
7,507	due 01/10/2032	602	751	1.875%	due 03/31/2028	EUR 9,788	11,733		
CVS Pass-Through Trust Series 2009									
8,353	due 07/10/2031	602	775	General Electric Co.					
Delta Air Lines, Inc.									
3,625	due 03/15/2022	920	927	6.875%	due 01/10/2039	\$ 12	18		
4,750	due 10/20/2028	100	111	Greene King Finance PLC					
7,000	due 05/01/2025	8,926	10,419	1.870%	due 12/15/2034	GBP 4,156	4,813		
Enable Midstream Partners LP									
4,950	due 05/15/2028	424	474	3.593%	due 03/15/2035	2,125	3,061		
Energy Transfer LP									
5,875	due 03/01/2022	450	452	4.064%	due 03/15/2035	611	907		
Exela Intermediate LLC									
10,000	due 07/15/2023	880	738	5.106%	due 03/15/2034	149	233		
Expedia Group, Inc.									
4,625	due 08/01/2027	3,700	4,144	Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
6,250	due 05/01/2025	2,939	3,358	3.625%	due 02/15/2032	\$ 6,800	6,448		
				4.000%	due 05/01/2031	1,100	1,107		
				IHO Verwaltungs GmbH					
				3.625%	due 05/15/2025	EUR 2,700	3,175		
				6.000%	due 05/15/2027	\$ 3,520	3,656		
				6.375%	due 05/15/2029	2,159	2,337		
				IMCO NV					
				2.500%	due 03/26/2025	EUR 1,500	1,823		
				Imperial Brands Finance PLC					
				3.500%	due 07/26/2026	\$ 2,400	2,549		
				Indian Railway Finance Corp. Ltd.					
				3.249%	due 02/13/2030	1,900	1,921		
				InterContinental Hotels Group PLC					
				3.375%	due 10/08/2028	GBP 5,500	7,953		
				IOVIA, Inc.					
				2.875%	due 09/15/2025	EUR 400	467		
				JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust					
				4.000%	due 11/15/2032	\$ 7,061	7,773		
				Kraft Heinz Foods Co.					
				3.875%	due 05/15/2027	5,592	6,066		
				4.250%	due 03/01/2031	4,862	5,495		
				Marriott International, Inc.					
				5.000%	due 06/01/2050				
				4.625%	due 06/15/2030			516	588
				Marriott Ownership Resorts, Inc.					
				6.125%	due 09/15/2025			650	683
				Massachusetts Institute of Technology					
				4.678%	due 07/01/2114			65	98
				5.800%	due 07/01/2111			103	185
				Melco Resorts Finance Ltd.					
				4.875%	due 06/06/2025			400	396
				5.375%	due 12/04/2029			5,200	5,122
				Memorial Sloan-Kettering Cancer Center					
				2.955%	due 01/01/2050			1,700	1,756
				MGM China Holdings Ltd.					
				5.250%	due 06/18/2025			4,500	4,456
				Micron Technology, Inc.					
				4.663%	due 02/15/2030			3,365	3,845
				5.327%	due 02/06/2029			2,532	2,990
				Mitchells & Butlers Finance PLC					
				0.566%	due 12/15/2030			494	466
				6.013%	due 12/15/2028			GBP 923	1,376
				Nissan Motor Acceptance Co. LLC					
				1.012%	due 01/13/2022			\$ 200	200
				Nissan Motor Co. Ltd.					
				2.652%	due 03/17/2026	EUR 13,100	16,275		
				3.522%	due 09/17/2025	\$ 8,300	8,735		
				4.345%	due 09/17/2027	\$ 8,700	9,440		
				4.810%	due 09/17/2030	450	500		
				NMG Holding Co., Inc.					
				7.125%	due 04/01/2026	11,900	12,513		
				Oracle Corp.					
				3.850%	due 04/01/2060	1,835	1,920		
				4.000%	due 07/15/2046	514	556		
				Ortho Clinical Diagnostics, Inc.					
				7.250%	due 02/01/2028	934	996		
				7.375%	due 06/01/2025	382	402		
				PeaceHealth Obligated Group					
				3.218%	due 11/15/2050	3,100	3,304		
				PetSmart, Inc.					
				4.750%	due 02/15/2028	2,800	2,881		
				QVC, Inc.					
				5.950%	due 03/15/2043	5,293	5,511		
				Roadster Finance DAC					
				2.375%	due 12/08/2027	EUR 1,000	1,223		

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
4.441% due 04/24/2023	\$ 5,300	5,521	Charter Communications Operating LLC			3.300% due 03/15/2027	\$ 3,838	\$ 3,946
4.892% due 04/24/2025	800	867	3.900% due 06/01/2052	\$ 10,000	10,133	3.300% due 12/01/2027	14,666	15,024
5.182% due 04/24/2028	1,800	2,013	3.950% due 06/30/2062	3,500	3,433	3.300% due 08/01/2040	1,542	1,457
Tenet Healthcare Corp.			4.400% due 12/01/2061	9,500	10,102	3.400% due 08/15/2024	6,570	6,803
4.625% due 07/15/2024	69	70	4.800% due 03/01/2050	3,818	4,345	3.450% due 07/01/2025	12,102	12,620
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV			China Resources Gas Group Ltd.			3.500% due 06/15/2025	8,068	8,455
3.650% due 11/10/2021	900	901	4.500% due 04/05/2022	400	406	3.500% due 08/01/2024	7,200	6,854
Teva Pharmaceutical Finance IV BV			Constellation Oil Services Holding			3.750% due 02/15/2024	10,188	10,614
3.650% due 11/10/2021	418	419	S.A. 10.000% due 11/09/2024	951	277	3.750% due 07/01/2028	13,613	14,280
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV			Corning, Inc.			3.750% due 08/15/2042	418	397
1.250% due 03/31/2023	EUR 1,800	2,078	5.450% due 11/15/2079	1,291	1,736	3.850% due 11/15/2023	1,830	1,896
3.250% due 04/15/2022	12,900	15,004	DIRECTV Holdings LLC			3.950% due 12/01/2047	1,900	1,879
6.000% due 01/31/2025	2,700	3,364	5.875% due 08/15/2027	6,000	6,227	4.000% due 12/01/2046	3,144	3,129
Times Square Hotel Trust			FirstEnergy Corp.			4.250% due 08/01/2023	3,735	3,891
8.528% due 08/01/2026	\$ 1,296	1,393	3.400% due 03/01/2050	300	298	4.250% due 03/15/2046	5,219	5,316
Travel + Leisure Co.			Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			4.300% due 03/15/2045	2,800	2,838
4.250% due 03/01/2022	115	115	4.375% due 09/19/2022	11,935	12,285	4.450% due 04/15/2042	4,333	4,419
6.000% due 04/01/2027	1,464	1,594	6.000% due 11/27/2023	28,785	31,395	4.500% due 07/01/2040	39,210	40,863
Triumph Group, Inc.			Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			4.500% due 12/15/2041	743	745
6.250% due 09/15/2024	1,541	1,541	2.250% due 11/22/2024	EUR 100	120	4.550% due 07/01/2030	49,585	54,066
U.S. Renal Care, Inc.			2.948% due 01/24/2024	450	548	4.600% due 06/15/2043	1,794	1,839
10.625% due 07/15/2027	1,282	1,331	4.950% due 03/23/2027	\$ 1,800	1,983	4.650% due 08/01/2028	100	109
Uber Technologies, Inc.			4.950% due 02/06/2028	1,000	1,102	4.750% due 02/15/2044	2,707	2,803
4.500% due 08/15/2029	3,365	3,383	5.150% due 02/11/2026	5,700	6,274	4.950% due 07/01/2050	29,590	28,758
7.500% due 05/15/2025	571	609	6.510% due 03/07/2022	6,638	6,770	Petrobras Global Finance BV		
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			7.288% due 08/16/2037	500	676	6.250% due 12/14/2026	GBP 6,234	9,528
5.875% due 10/15/2027	18,969	21,261	8.625% due 04/28/2034	2,372	3,420	6.625% due 01/16/2034	2,900	4,494
United Airlines, Inc.			Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC			Petroleos de Venezuela S.A.		
4.375% due 04/15/2026	1,200	1,243	1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	36,674	5.375% due 04/12/2027	\$ 11,932	626
Vale Overseas Ltd.			2.950% due 04/15/2025	5,000	6,128	5.500% due 04/12/2037	10,372	545
3.750% due 07/08/2030	2,200	2,241	2.950% due 01/27/2029	\$ 23,200	22,716	6.000% due 05/16/2024	8,283	435
6.250% due 08/10/2026	3,616	4,198	Helmerich & Payne, Inc.			6.000% due 11/15/2026	13,183	692
6.875% due 11/21/2036	1,207	1,580	2.900% due 09/29/2031	9,500	9,467	9.000% due 11/17/2021	400	21
6.875% due 11/10/2039	951	1,255	iHeartCommunications, Inc.			9.750% due 05/17/2035	4,730	248
Venture Global Calcasieu Pass LLC			4.750% due 01/15/2028	60,140	60,596	Petroleos Mexicanos		
3.875% due 08/15/2029	3,800	3,668	6.375% due 05/01/2026	9,272	9,655	2.750% due 04/21/2027	EUR 1,200	1,303
4.125% due 08/15/2031	3,500	3,627	8.375% due 05/01/2027	8,256	8,803	5.350% due 02/12/2028	\$ 880	880
VOC Escrow Ltd.			Intelsat Connect Finance S.A.			5.950% due 01/28/2031	23,330	22,999
5.000% due 02/15/2028	1,100	1,093	9.500% due 02/15/2023	3,960	997	6.490% due 01/23/2027	6,170	6,567
Western Midstream Operating LP			Intelsat Jackson Holdings S.A.			6.500% due 03/13/2027	9,282	9,807
2.22% due 01/13/2023	1,048	1,040	5.500% due 08/01/2023	12,486	6,290	6.500% due 01/23/2029	21,284	22,207
Wynn Las Vegas LLC			8.000% due 02/15/2024	7,115	7,284	6.750% due 09/21/2047	390	346
5.250% due 05/15/2027	1,700	1,726	8.500% due 10/15/2024	57,550	29,710	6.840% due 01/23/2030	31,836	33,346
Wynn Macau Ltd.			9.750% due 07/15/2025	29,732	14,978	6.950% due 01/28/2060	7,790	6,925
5.125% due 12/15/2029	2,800	2,528	Intelsat Luxembourg S.A.			7.690% due 01/23/2050	2,430	2,326
5.500% due 01/15/2026	6,500	6,122	7.750% due 06/01/2049	20,642	310	Prosus NV		
5.500% due 10/01/2027	1,000	933	Level 3 Financing, Inc.			1.985% due 07/13/2033	EUR 5,600	6,273
5.625% due 08/26/2028	1,198	1,120	3.875% due 11/15/2029	2,218	2,332	3.061% due 07/13/2031	\$ 12,400	12,046
		957,893	Lumen Technologies, Inc.			Qatar Petroleum		
公共事業 8.8%			4.000% due 02/15/2027	1,238	1,246	3.125% due 07/12/2041	2,450	2,478
Aker BP ASA 3.750%			Netflix, Inc.			Rio Oil Finance Trust Series 2014-1		
due 01/15/2030	1,300	1,390	3.625% due 05/15/2027	EUR 3,900	5,196	9.250% due 07/09/2024	1,763	1,927
Altice Financing S.A.			3.625% due 06/15/2030	18,776	26,021	Rio Oil Finance Trust Series 2014-3		
2.250% due 01/15/2025	EUR 1,340	1,498	3.875% due 11/15/2029	8,217	11,512	9.750% due 01/09/2027	656	768
3.000% due 01/15/2028	2,700	2,971	4.625% due 05/15/2029	7,800	11,051	Rio Oil Finance Trust Series 2018-1		
4.250% due 08/15/2029	3,510	3,993	4.875% due 06/15/2030	\$ 3,100	3,646	8.200% due 04/09/2028	2,588	2,962
5.750% due 08/15/2029	\$ 12,389	12,203	5.375% due 11/15/2029	980	1,183	Southern California Edison Co.		
Altice France S.A.			Noble Finance Co.			4.875% due 03/01/2049	346	436
8.125% due 02/01/2027	2,744	2,953	11.000% due 02/15/2028	2,086	2,318	Sprint Communications, Inc.		
AT&T, Inc.			Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.			6.000% due 11/15/2022	3,934	4,132
2.250% due 02/01/2032	1,475	1,420	6.720% due 12/01/2022	106	105	Sprint Corp.		
3.100% due 02/01/2043	12,371	11,966	Oi Movel S.A.			7.125% due 06/15/2024	7,766	8,785
3.300% due 02/01/2052	13,551	13,322	8.750% due 07/30/2026	33,044	34,300	7.625% due 02/15/2025	1,000	1,164
3.500% due 06/01/2041	14,644	15,028	Pacific Gas & Electric Co.			7.625% due 03/01/2026	839	1,078
3.500% due 02/01/2061	13,084	12,776	2.100% due 08/01/2027	1,910	1,854	7.875% due 09/15/2023	25,749	28,581
3.650% due 06/01/2051	13,724	14,296	2.500% due 02/01/2031	2,800	2,486	Sprint Spectrum Co. LLC		
3.850% due 06/01/2060	10,556	11,162	2.950% due 03/01/2026	8,630	8,829	4.738% due 03/20/2025	4,200	4,436
CCO Holdings LLC			3.000% due 06/15/2028	11,288	11,383	5.152% due 03/20/2028	3,163	3,574
4.500% due 09/15/2030	1,549	1,579	3.150% due 01/01/2026	15,753	16,227			
			3.250% due 06/15/2023	8,640	8,821			

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.								
2.750% due 05/04/2022	\$ 1,700	\$ 1,716						
Systems Energy Resources, Inc.								
2.140% due 12/09/2025	6,100	6,245						
Tencent Holdings Ltd.								
3.680% due 04/22/2041	6,100	6,380						
T-Mobile USA, Inc.								
2.250% due 02/15/2026	6,600	6,641						
3.375% due 04/15/2029	7,400	7,613						
3.500% due 04/15/2031	7,400	7,668						
Topaz Solar Farms LLC								
4.875% due 09/30/2039	5,791	6,545						
5.750% due 09/30/2039	8,164	9,927						
Transocean Guardian Ltd.								
5.875% due 01/15/2024	202	198						
Transocean Phoenix 2 Ltd.								
7.750% due 10/15/2024	1,050	1,069						
Transocean Proteus Ltd.								
6.250% due 12/01/2024	30	30						
Transocean, Inc.								
7.250% due 11/01/2025	2,585	2,146						
7.500% due 01/15/2026	1,783	1,438						
8.000% due 02/01/2027	3,062	2,343						
United Group BV								
3.125% due 02/15/2026	EUR 1,842	2,055						
4.875% due 07/01/2024	565	662						
Univision Communications, Inc.								
5.125% due 02/15/2025	\$ 14,429	14,663						
6.625% due 06/01/2027	2,048	2,218						
9.500% due 05/01/2025	1,646	1,784						
Valaris Ltd.								
8.250% due 04/30/2028	519	541						
Verizon Communications, Inc.								
3.400% due 03/22/2041	6,750	7,090						
Viasat, Inc.								
5.625% due 09/15/2025	3,363	3,416						
6.500% due 07/15/2028	3,300	3,469						
Windstream Escrow LLC								
7.750% due 08/15/2028	11,607	12,292						
Zayo Group Holdings, Inc.								
4.000% due 03/01/2027 6.125% due 03/01/2028	4,942	4,806						
	1,762	1,722						
	1,119,848							
社債券等合計	3,436,987							
(原価 3,364,296米ドル)								
国債								
国債 0.3%								
CBL & Associates HoldCo II LLC								
7.000% due 11/15/2028	82	82						
Multipian Corp.								
6.000% due 10/15/2027	5,700	4,552						
Nationwide Building Society								
10.250% due 09/20/2166	GBP 7,405	19,792						
Stichting AK Rabobank Certificaten								
19.436% due 01/01/0001	EUR 2,946	4,744						
転換社債型新株予約権付社債等合計	29,170							
(原価 25,232米ドル)								
地方債等 0.6%								
Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010								
6.630% due 02/01/2035	\$ 655	811						
6.725% due 04/01/2035	310	384						
7.350% due 07/01/2035	545	693						
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003								
5.100% due 06/01/2033	1,110	1,179						
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015								
7.750% due 01/01/2042	130	148						
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017								
7.045% due 01/01/2029	315	360						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2001								
5.125% due 07/01/2031	\$ 17,360	\$ 17,143						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006								
5.000% due 07/01/2031	420	409						
5.250% due 07/01/2023	500	496						
5.250% due 07/01/2026	1,000	990						
5.250% due 07/01/2049	610	601						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007								
5.000% due 07/01/2027	700	691						
5.000% due 07/01/2028	75	74						
5.250% due 07/01/2032	400	396						
5.250% due 07/01/2034	400	398						
5.250% due 07/01/2037	410	407						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008								
5.000% due 07/01/2023	300	294						
5.125% due 07/01/2028	130	127						
5.500% due 07/01/2032	10,780	10,605						
5.700% due 07/01/2023	685	657						
6.000% due 07/01/2038	4,070	4,065						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009								
5.750% due 07/01/2038	550	534						
6.000% due 07/01/2039	215	210						
6.500% due 07/01/2037	400	402						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011								
5.375% due 07/01/2030	685	664						
5.750% due 07/01/2041	1,900	1,850						
6.500% due 07/01/2040	120	120						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012								
5.000% due 07/01/2023	1,010	929						
5.000% due 07/01/2041	3,660	3,262						
5.125% due 07/01/2037	800	734						
5.500% due 07/01/2026	1,900	1,774						
5.500% due 07/01/2039	4,215	3,941						
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014								
8.000% due 07/01/2035	13,450	11,870						
Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021								
2.246% due 06/01/2029	1,600	1,602						
3.000% due 06/01/2046	800	822						
Puerto Rico, Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010								
6.050% due 07/01/2032	800	769						
6.125% due 07/01/2040	3,000	2,914						
Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016								
0.838% due 09/25/2056	783	784						
Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017								
0.838% due 01/25/2057	7,213	7,194						
Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014								
8.250% due 07/01/2024	400	403						
地方債等合計	81,706							
(原価 32,299米ドル)								
米国政府機関債 23.3%								
Fannie Mae								
2.500% due 10/01/2022	34	36						
3.000% due 07/01/2023	23	24						
3.000% due 11/01/2025	40	42						
3.000% due 12/01/2025	\$ 30	\$ 31						
3.000% due 10/01/2026	28	29						
3.000% due 01/01/2027	289	303						
3.000% due 02/01/2027	1,772	1,857						
3.000% due 01/01/2034	96	101						
3.000% due 01/01/2035	66	70						
3.000% due 06/01/2035	253	267						
3.000% due 07/01/2035	1,871	1,967						
3.000% due 09/01/2035	533	558						
3.000% due 09/01/2049	238	254						
3.000% due 03/01/2050	23,295	24,555						
3.500% due 08/01/2042	27	29						
3.500% due 09/01/2047	242	257						
3.500% due 03/01/2048	77	81						
3.500% due 05/01/2049	107	113						
3.500% due 06/01/2049	1	1						
3.500% due 07/01/2049	33	35						
3.500% due 08/01/2049	45	47						
3.500% due 10/01/2049	14	15						
3.500% due 12/01/2049	3	3						
3.500% due 01/01/2050	21	22						
3.500% due 02/01/2050	31	32						
3.500% due 03/01/2050	220	233						
3.500% due 05/01/2050	1,653	1,743						
3.500% due 06/01/2050	430	455						
3.500% due 07/01/2050	1,163	1,217						
3.500% due 10/01/2050	238	251						
3.500% due 12/01/2050	197	209						
3.500% due 01/01/2051	10,499	11,078						
3.500% due 04/01/2051	1,000	1,060						
4.000% due 07/01/2040	9	9						
4.000% due 12/01/2041	65	69						
4.000% due 07/01/2042	77	81						
4.000% due 08/01/2042	24	25						
4.000% due 09/01/2042	101	109						
4.000% due 11/01/2045	129	140						
4.000% due 03/01/2047	49	53						
4.000% due 04/0								

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

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
6.000% due 08/01/2031	\$ 25	\$ 25	Ginnie Mae			2.625% due 02/15/2029	\$ 5,000	\$ 5,402
6.000% due 06/01/2032	1	2	4.000% due 06/20/2041	\$ 2	\$ 2	2.750% due 08/15/2047	2,830	3,291
6.000% due 09/01/2039	388	427	4.000% due 04/20/2047	2,442	2,617	3.000% due 08/15/2048	155	189
6.000% due 10/01/2047	8	9	4.000% due 05/20/2047	43,961	47,062	3.000% due 02/15/2049	77	94
6.111% due 05/25/2048	2,815	632	4.000% due 06/20/2047	20,833	22,322	3.125% due 05/15/2048	180	225
6.500% due 01/01/2037	3	4	4.000% due 07/20/2047	18,616	19,977	U.S. Treasury Notes		
6.500% due 10/01/2037	5	5	4.000% due 02/20/2048	13,086	14,042	1.125% due 02/29/2028	318,900	313,936
7.000% due 09/01/2031	32	32	4.000% due 05/20/2049	47,040	50,125	1.125% due 02/15/2031	773	746
7.000% due 05/01/2037	1	1	4.000% due 02/20/2050	574	609	1.625% due 02/15/2026	2,200	2,250
7.500% due 09/01/2032	7	7	4.000% due 07/20/2050	263	279	2.000% due 02/15/2025	11,021	11,437
			4.000% due 08/20/2050	41	44	2.000% due 08/15/2025	1,400	1,453
Fannie Mae, TBA			4.000% due 09/20/2050	3,099	3,294	2.000% due 11/15/2026	800	831
2.000% due 12/01/2036	6,600	6,762	4.000% due 10/20/2050	99,793	106,077	2.250% due 11/15/2024	12,300	12,848
2.000% due 12/01/2051	55,100	54,989	4.500% due 01/20/2040	82	88	2.250% due 02/15/2027	28,000	29,447
2.500% due 12/01/2036	3,000	3,116	4.500% due 03/20/2040	8	8			
2.500% due 01/01/2052	72,900	74,545	5.000% due 08/20/2030	219	239	米国財務省証券合計		1,158,496
3.000% due 01/01/2052	26,900	27,997	5.000% due 05/20/2040	363	395	(原価 1,093,770米ドル)		
3.500% due 12/01/2051	744,350	786,336	5.000% due 11/20/2040	19	20	モーニング証券 31.5%		
4.000% due 12/01/2051	113,500	121,536	5.000% due 04/20/2041	7	8	Accredited Mortgage Loan Trust		
			5.500% due 05/20/2038	8	8	1.034% due 07/25/2035	9,806	9,811
Freddie Mac			5.500% due 06/20/2038	70	78	1.784% due 07/25/2035	715	718
3.000% due 01/01/2026	792	831	5.500% due 07/20/2038	77	84	ACE Securities Corporate Home Equity Loan Trust		
3.000% due 09/01/2026	2,282	2,406	5.500% due 08/20/2038	378	423	0.244% due 08/25/2036	5,423	5,330
3.000% due 10/01/2026	39	41	5.500% due 09/20/2038	77	87	0.884% due 01/25/2035	988	982
3.000% due 11/01/2026	10	11	5.500% due 10/20/2038	16	18	0.914% due 02/25/2034	5,384	5,415
3.000% due 06/01/2034	142	149	5.500% due 01/20/2039	11	12	0.989% due 08/25/2035	5,023	5,035
3.000% due 07/01/2034	767	807	5.500% due 02/20/2039	44	49	Adjustable Rate Mortgage Trust		
3.000% due 08/01/2035	32	33	5.500% due 09/20/2039	58	65	1.039% due 08/25/2035	4,257	4,243
3.000% due 11/01/2046	80	85	5.500% due 10/20/2039	11	12	AFC Home Equity Loan Trust		
3.000% due 12/01/2047	2,548	2,668	5.500% due 11/20/2039	317	355	0.899% due 06/25/2029	1,875	1,500
3.000% due 03/01/2048	145	152	5.500% due 12/20/2039	26	28	Alternative Loan Trust		
3.500% due 10/01/2039	187	199	5.500% due 01/20/2040	200	220	0.276% due 09/20/2046	1,069	986
3.500% due 10/01/2047	2,916	3,097	5.500% due 06/20/2040	274	317	0.429% due 01/25/2037	2	121
3.500% due 12/01/2047	946	1,006	5.500% due 07/20/2040	502	552	0.449% due 07/25/2036	7,262	7,179
3.500% due 03/01/2048	3,619	3,839	Ginnie Mae, TBA			0.469% due 08/25/2046	10,715	9,957
3.500% due 04/01/2048	1,555	1,654	2.000% due 12/01/2051	19,000	19,199	0.489% due 05/25/2036	14,309	13,330
3.500% due 10/01/2048	1,488	1,573	2.500% due 11/01/2051	5,400	5,551	0.506% due 03/20/2046	6,753	5,755
3.500% due 12/01/2048	3,458	3,664	2.500% due 12/01/2051	83,000	85,154	0.589% due 12/25/2046	17,880	17,504
3.500% due 03/01/2049	2,256	2,382	3.000% due 11/01/2051	7,740	8,038	0.629% due 07/25/2036	22,397	20,997
3.500% due 05/01/2049	129	136	3.000% due 12/01/2052	492,260	510,566	0.689% due 01/25/2036	2,512	2,447
3.500% due 06/01/2049	1	1	4.000% due 11/01/2051	65,423	69,341	0.726% due 12/20/2035	6,616	6,356
3.500% due 07/01/2049	1	1	4.000% due 12/01/2051	696,135	737,713	1.437% due 08/25/2035	481	436
3.500% due 10/01/2049	278	294	米国政府機関債合計		2,954,394	2.248% due 09/25/2034	1,126	1,106
3.500% due 12/01/2049	35	37	(原価 2,953,245米ドル)			3.070% due 08/25/2035	523	511
3.500% due 01/01/2050	51	53	米国国債 0.1%			5.500% due 08/25/2035	5,688	5,441
3.500% due 02/01/2050	1,819	1,919	Treasury Inflation Protected Securities			5.500% due 08/25/2036	66	67
3.500% due 04/01/2050	203	214	0.125% due 10/15/2024	45,743	49,163	5.500% due 02/25/2036	17	13
3.500% due 05/01/2050	100	105	0.125% due 07/15/2030	60,498	67,371	6.000% due 07/25/2037	26,922	18,113
3.500% due 07/01/2050	1,521	1,607	0.250% due 07/15/2029	166,422	186,534	7.000% due 10/25/2037	31,416	15,978
3.500% due 09/01/2050	17	18	0.250% due 02/15/2050	25,325	29,563	Ameriquest Mortgage Securities Trust		
3.500% due 05/01/2051	93	100	0.375% due 01/15/2027	5,259	5,835	0.599% due 04/25/2036	4,473	4,460
4.000% due 09/01/2033	1	1	0.375% due 07/15/2027	1,409	1,576	0.704% due 03/25/2036	27,500	27,108
4.000% due 04/01/2047	451	487	0.625% due 02/15/2043	2,618	3,188	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
4.000% due 05/01/2047	441	476	0.750% due 07/15/2028	102,114	117,490	1.157% due 09/25/2032	264	274
4.000% due 08/01/2047	876	944	0.750% due 02/15/2042	6,174	7,683	1.844% due 10/25/2034	9,913	10,095
4.000% due 08/01/2048	1,013	1,086	0.750% due 02/15/2045	20,098	25,285	Argent Mortgage Loan Trust		
4.000% due 09/01/2048	411	440	0.875% due 01/15/2029	56,416	65,535	0.569% due 05/25/2035	22,537	21,476
4.000% due 12/01/2048	15,327	16,564	0.875% due 02/15/2047	24,252	31,929	Argent Securities Trust		
4.000% due 02/01/2049	5,758	6,223	1.000% due 02/15/2046	10,622	14,170	0.449% due 04/25/2036	8,096	3,596
4.000% due 03/01/2049	440	475	1.000% due 02/15/2048	23,075	31,465	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
5.000% due 06/01/2034	177	191	1.000% due 02/15/2049	67,730	93,461	0.854% due 10/25/2035	36,400	35,859
5.000% due 08/01/2035	44	46	1.375% due 02/15/2044	3,052	4,264	2.789% due 09/25/2033	1,288	1,296
5.000% due 01/01/2037	3	4	2.125% due 02/15/2040	3,164	4,783	Asset-Backed Funding Certificates Trust		
5.000% due 01/01/2038	2	2	2.125% due 02/15/2041	1,749	2,679	0.749% due 03/25/2035	16,991	16,964
5.500% due 01/01/2035	573	607	U.S. Treasury Bonds			0.824% due 06/25/2035	10,728	10,697
5.500% due 05/01/2037	2	3	2.250% due 08/15/2046	100	106			
5.500% due 06/01/2037	209	222	2.375% due 05/15/2029	32,200	34,267			
5.750% due 05/01/2037	223	251						
6.000% due 07/01/2037	46	50						
6.460% due 06/15/2042	40	8						

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			Citigroup Mortgage Loan Trust			CWABS Asset-Backed Certificates Trust		
0.554% due 05/25/2036	\$ 37,857	\$ 39,141	0.369% due 12/25/2036	\$ 3,767	\$ 3,724	0.329% due 03/25/2037	\$ 33,000	\$ 32,081
Atrium Hotel Portfolio Trust			0.479% due 01/25/2037	645	648	0.329% due 03/25/2047	26,535	25,070
1.520% due 06/15/2035	18,395	18,343	0.689% due 03/25/2037	5,700	5,699	0.349% due 09/25/2046	5,600	5,392
Bank of America Alternative Loan Trust			0.909% due 09/25/2037	17,435	15,931	0.809% due 05/25/2036	2,106	1,730
4.310% due 04/25/2022	71	70	1.561% due 08/25/2036	16,176	7,397	1.214% due 12/25/2034	530	532
6.000% due 07/25/2046	1,858	1,808	2.824% due 08/25/2036	5,347	5,477	1.664% due 03/25/2035	5,500	5,621
Bank of America Funding Trust			2.995% due 07/25/2037	3,249	3,153	5.633% due 06/25/2035	8,644	8,945
2.160% due 11/20/2034	367	393	3.000% due 11/25/2038	98	98	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust		
2.408% due 06/20/2036	5,461	5,524	7.250% due 05/25/2036	10,356	7,171	0.340% due 03/15/2030	1,005	997
3.191% due 02/20/2035	1,635	1,710	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust		
3.413% due 01/20/2047	116	113	1.124% due 05/25/2035	6,300	6,283	0.409% due 03/25/2037	10,515	6,490
Bayview Opportunity Master Fund Iva Trust			Commercial Mortgage Trust			0.419% due 08/25/2037	24,960	21,548
3.475% due 08/28/2034	1,296	1,306	0.176% due 04/10/2047	33,000	139	0.589% due 09/25/2047	14,982	14,267
BCAP LLC Trust			Conseco Finance Corp.			Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust		
0.483% due 07/26/2036	15	15	6.870% due 04/01/2030	276	277	2.716% due 10/25/2035	9,954	9,966
5.876% due 04/26/2037	3,224	2,280	6.920% due 12/01/2030	1,621	1,751	Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.		
6.000% due 04/26/2036	5,434	3,966	7.500% due 03/01/2030	49,985	27,302	0.806% due 11/27/2036	2,263	2,254
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			7.600% due 04/15/2028	5,067	1,671	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
3.031% due 11/25/2034	222	224	Countrywide Asset-Backed Certificates			0.270% due 10/19/2036	8,652	7,796
Bear Stearns Alternative-A Trust			0.229% due 06/25/2035	1,851	1,797	0.680% due 10/19/2045	1,248	1,281
0.429% due 04/25/2037	7,174	7,061	0.229% due 06/25/2037	15,865	15,211	0.740% due 09/19/2045	5,927	4,519
0.509% due 11/25/2046	9,417	9,307	0.229% due 07/25/2037	10,725	10,573	Dragon Finance BV		
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust			0.239% due 04/25/2047	2,361	2,352	1.074% due 07/13/2023	GBP 88	119
0.329% due 02/25/2037	4,140	6,911	0.249% due 05/25/2037	2,275	2,273	Ellington Loan Acquisition Trust		
0.489% due 05/25/2036	9,370	3,758	0.269% due 11/25/2047	6,595	7,005	1.189% due 05/25/2037	\$ 1,369	1,373
0.629% due 04/25/2036	7,329	7,304	0.309% due 08/25/2037	25,800	24,586	EMC Mortgage Loan Trust		
0.689% due 02/25/2036	4,146	4,143	0.319% due 05/25/2037	14,583	14,181	1.139% due 04/25/2042	8,542	8,589
0.734% due 12/25/2035	2,531	2,533	0.319% due 10/25/2047	13,709	13,621	Encore Credit Receivables Trust		
1.109% due 06/25/2034	5,452	5,453	0.339% due 02/25/2036	1,500	1,478	1.019% due 11/25/2035	6,510	6,532
1.139% due 11/25/2035	3,537	3,515	0.509% due 01/25/2045	3,128	3,117	Eurosil-UK PLC		
1.139% due 08/25/2037	19,530	18,956	0.569% due 05/25/2036	10,003	9,041	0.837% due 09/13/2045	GBP 4,867	6,528
1.169% due 12/25/2035	9,268	7,971	0.588% due 08/26/2033	261	258	1.017% due 06/13/2045	9,559	13,106
6.511% due 05/25/2036	9,370	719	0.689% due 06/25/2036	3,874	3,856	FBR Securitization Trust		
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			0.749% due 04/25/2036	3,433	3,436	0.764% due 10/25/2035	\$ 20,968	19,248
2.114% due 06/25/2035	924	955	0.789% due 03/25/2036	1,745	1,673	0.769% due 10/25/2035	3,391	3,393
5.500% due 11/25/2033	4,915	5,134	1.184% due 06/25/2035	7,000	7,038	0.854% due 09/25/2035	7,500	7,455
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			First Franklin Mortgage Loan Trust		
0.289% due 02/25/2037	6,265	6,056	2.463% due 06/25/2034	1	1	0.399% due 11/25/2036	59,328	54,834
BHP Trust			2.685% due 11/25/2034	9	9	0.409% due 04/25/2036	4,604	4,533
2.658% due 08/15/2036	27,720	27,646	2.971% due 10/20/2035	5,359	5,309	0.779% due 01/25/2036	10,000	9,756
Business Loan Express Business Loan Trust			3.041% due 11/25/2037	5,011	4,990	0.794% due 05/25/2036	3,142	3,140
0.379% due 09/25/2038	1,084	1,048	3.379% due 03/25/2037	5,776	5,817	0.944% due 04/25/2035	4,301	4,289
0.639% due 09/25/2038	525	477	5.500% due 11/25/2035	6,558	4,966	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust		
1.189% due 09/25/2038	38	35	6.000% due 07/25/2036	20,665	15,160	0.589% due 05/25/2035	1,502	1,002
BX Trust			6.000% due 11/25/2037	4,613	3,453	4.911% due 05/25/2035	1,502	209
1.726% due 10/15/2036	16,400	16,363	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			Fremont Home Loan Trust		
1.975% due 10/15/2036	18,000	17,963	2.039% due 01/25/2033	1,359	1,374	0.369% due 02/25/2037	8,324	6,902
1.977% due 10/15/2036	6,000	5,949	Credit Suisse Mortgage Capital			1.109% due 01/25/2035	6,483	6,488
Canterbury Finance No.1 PLC			0.256% due 11/27/2036	11,400	13,684	Gien Securities Finance DAC		
1.400% due 05/16/2056	GBP 25,377	35,053	3.000% due 01/29/2036	814	823	0.000% due 10/28/2038	EUR 12,700	14,692
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			3.000% due 06/27/2037	2,932	2,987	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.		
6.040% due 01/25/2039	\$ 827	799	6.113% due 10/26/2036	167	164	5.456% due 03/10/2051	\$ 12,120	13,416
Centex Home Equity Loan Trust			Credit Suisse Mortgage Capital Trust			GreenPoint Mortgage Funding Trust		
0.734% due 03/25/2035	5,418	5,421	0.000% due 01/25/2058	25	25	0.649% due 11/25/2045	54	44
CGMS Commercial Mortgage Trust			0.000% due 04/25/2058	1	1	Grifonos Finance No.1 PLC		
1.190% due 07/15/2030	5,016	5,000	1.090% due 07/15/2032	5,200	5,188	0.000% due 08/28/2039	EUR 748	850
Chase Mortgage Finance Trust			1.340% due 07/15/2032	4,000	3,971	GS Mortgage Securities Corporation Trust		
2.993% due 12/25/2035	4,468	4,313	1.540% due 07/15/2032	2,400	2,371	2.230% due 06/15/2038	\$ 27,488	27,475
ChaseFlex Trust			2.868% due 06/01/2050	58,503	59,906	3.419% due 10/10/2032	3,300	3,363
0.389% due 07/25/2037	1,072	1,006	3.622% due 06/25/2050	46,826	42,650	4.591% due 10/10/2032	8,215	8,181
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			3.623% due 01/25/2058	21,877	20,906	GSAA Home Equity Trust		
0.449% due 03/25/2035	343	356	3.648% due 04/25/2058	38,825	40,235	6.500% due 11/25/2037	20	12
CIT Mortgage Loan Trust			Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			GSAMP Trust		
1.439% due 10/25/2037	8,710	8,790	6.980% due 03/25/2046	4,266	4,258	0.229% due 03/25/2047	4,369	4,217
Citigroup Commercial Mortgage Trust			Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			0.249% due 01/25/2037	19,186	14,222
0.269% due 03/10/2047	25,400	177	0.389% due 07/25/2036	704	704	0.409% due 05/25/2046	390	389
2.441% due 02/15/2039	8,790	8,811			0.609% due 08/25/2036	16,307	16,150	
2.500% due 02/15/2039	9,766	9,725			0.734% due 11/25/2035	7,323	7,074	

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
GSMSC Resecuritization Trust			0.494% due 05/25/2036	\$ 12,851	\$ 12,733	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
0.266% due 09/26/2036	\$ 4,534	\$ 3,512	JPMorgan Mortgage Trust			0.780% due 11/15/2052	\$ 134,258	\$ 5,066
7.218% due 04/26/2037	44,351	16,986	0.389% due 10/25/2035	4,867	4,073	Morgan Stanley Capital I Trust		
GSR Mortgage Loan Trust			2.667% due 01/25/2037	525	472	1.740% due 08/15/2033	3,154	3,131
0.389% due 03/25/2037	8,057	1,355	JPMorgan Resecuritization Trust			2.428% due 04/05/2042	13,500	13,756
6.611% due 03/25/2037	8,057	1,866	3.064% due 02/26/2037	2,750	2,703	Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust		
HarborView Mortgage Loan Trust			Kentmere No.2 PLC			0.629% due 02/25/2036	18,203	19,413
0.320% due 12/19/2036	1,013	1,017	0.000% due 01/28/2042	GBP 9,500	7,203	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
0.640% due 02/19/2036	11,678	9,287	0.850% due 01/28/2042	67,365	92,579	0.599% due 02/25/2036	14,415	13,961
0.720% due 08/19/2045	8,539	7,666	0.870% due 01/28/2042	2,439	2,589	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust		
Hawaii Hotel Trust			1.450% due 01/28/2042	5,693	7,806	0.549% due 07/25/2036	11,004	6,029
1.740% due 05/15/2038	2,000	2,000	1.800% due 01/28/2042	4,066	5,563	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
2.250% due 05/15/2038	Hawksmoor 12,500	12,475	2.250% due 01/28/2042	2,439	3,330	2.817% due 11/25/2037	1,460	1,255
Mortgages			3.050% due 01/28/2042	1,626	2,197	6.000% due 12/25/2035	525	296
1.100% due 05/25/2053	GBP 60,806	83,396	5.050% due 01/28/2042	3,252	4,087	Morgan Stanley Reremic Trust		
Home Equity Asset Trust			Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			0.406% due 11/26/2036	7,011	6,625
0.569% due 10/25/2036	\$ 23,475	16,962	0.000% due 06/15/2045	EUR 4,059	4,490	Mortgage Loan Trust		
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			Legacy Mortgage Asset Trust			5.370% due 03/25/2034	3,310	3,430
0.229% due 11/25/2036	15,074	14,361	0.000% due 09/25/2059	\$ 709,719	3,602	Natis Commercial Mortgage Securities Trust		
0.329% due 04/25/2037	14,677	11,791	0.000% due 09/25/2059	18,390	9,772	0.840% due 02/15/2033	7,885	7,884
0.449% due 06/25/2036	3,059	2,977	0.791% due 09/25/2059	18,352	16,041	1.190% due 02/15/2033	8,265	8,247
1.079% due 08/25/2035	5,750	5,744	1.835% due 01/28/2070	67,698	68,368	2.140% due 02/15/2033	3,600	3,575
HPLY Trust			3.000% due 06/25/2059	226	227	3.790% due 11/15/2032	1,400	1,409
2.440% due 11/15/2036	22,109	21,997	3.000% due 09/25/2059	139,923	144,660	3.821% due 02/15/2039	2,900	3,193
HSI Asset Securitization Corp. Trust			3.438% due 05/25/2059	69	69	New York Mortgage Trust		
0.339% due 05/25/2037	7,197	7,113	4.057% due 09/25/2059	111,258	112,682	0.629% due 04/25/2035	938	965
Impac CMB Trust			Lehman XS Trust			Newgate Funding PLC		
0.769% due 01/25/2035	11,518	11,797	0.289% due 02/25/2037	14,995	14,928	0.230% due 12/15/2050	GBP 20,498	27,121
Impac Secured Assets Corp.			0.469% due 09/25/2036	7,053	6,443	Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
0.649% due 03/25/2036	12,210	10,904	0.469% due 12/25/2036	11,461	10,590	5.034% due 05/25/2035	\$ 3,342	2,158
Impac Secured Assets Trust			0.609% due 02/25/2047	25,310	24,932	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust		
0.469% due 01/25/2037	2,794	2,658	0.939% due 10/25/2037	22,155	21,525	0.854% due 05/25/2035	7,400	7,380
IMT Trust			6.500% due 06/25/2046	5,473	5,489	5.745% due 10/25/2036	22,529	8,055
0.790% due 06/15/2034	1,690	1,691	Liberty			Nomura Resecuritization Trust		
1.040% due 06/15/2034	1,267	1,267	1.260% due 10/10/2049	AUD 3,799	2,861	1.161% due 03/28/2037	6,759	6,190
1.190% due 06/15/2034	775	775	Long Beach Mortgage Loan Trust			NovaStar Mortgage Funding Trust		
IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust			0.469% due 02/25/2036	\$ 5,840	5,380	0.289% due 09/25/2037	25,129	24,790
6.500% due 10/25/2037	9,152	6,900	0.469% due 03/25/2046	35,411	17,044	0.409% due 05/25/2036	8,825	8,748
IndyMac INSC Mortgage Loan Trust			Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			0.409% due 10/25/2036	5,886	4,836
2.893% due 06/25/2037	9,778	7,970	3.339% due 03/25/2032	1,567	1,566	0.809% due 10/25/2035	2,145	2,149
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust			MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			Option One Mortgage Loan Trust		
0.269% due 02/25/2037	25,839	26,028	2.206% due 04/25/2034	1	1	0.189% due 02/25/2037	5,356	3,293
0.469% due 10/25/2036	5,659	3,110	Mastr Asset-Backed Securities Trust			0.209% due 03/25/2037	11,015	10,780
2.856% due 07/25/2037	22,349	22,501	0.309% due 11/25/2036	28	21	0.229% due 03/25/2037	37,541	36,212
2.950% due 03/25/2036	4,919	4,352	0.459% due 01/25/2036	7,500	7,314	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
3.098% due 04/25/2037	8,089	7,815	1.239% due 08/25/2037	13,649	13,431	0.824% due 09/25/2035	4,510	4,514
3.143% due 04/25/2037	16,308	16,690	Mastr Specialized Loan Trust			0.869% due 09/25/2035	25,075	24,722
3.216% due 11/25/2036	13,860	11,155	0.809% due 02/25/2036	5,336	4,637	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust		
IXIS Real Estate Capital Trust			MBRT			0.249% due 09/25/2036	27,128	7,534
0.854% due 12/25/2035	3,868	3,912	1.490% due 11/15/2036	6,435	6,428	Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust		
Jefferies Resecuritization Trust			Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			0.399% due 11/25/2036	14,837	13,361
5.198% due 06/25/2047	627	576	1.089% due 10/25/2037	4,857	4,890	3.695% due 07/25/2035	9,601	9,098
JPMorgan Alternative Loan Trust			1.589% due 10/25/2037	17,772	18,118	Precise Mortgage Funding PLC		
0.649% due 04/25/2047	2,227	2,224	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			0.000% due 12/12/2055	GBP 0	1,464
2.796% due 03/25/2036	374	334	0.229% due 05/25/2037	21,464	14,308	PRET LLC		
5.730% due 03/25/2036	114	118	0.809% due 07/25/2034	5,120	4,960	1.843% due 09/25/2051	\$ 50,417	50,198
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			0.884% due 09/25/2035	1,806	1,807	Quest Trust		
0.940% due 12/15/2036	3,700	3,702	1.169% due 10/25/2035	1,309	1,313	1.514% due 03/25/2035	5,550	5,572
1.190% due 10/15/2032	8,134	8,104	1.847% due 02/25/2033	12	12	RAAC Trust		
1.490% due 10/15/2032	7,200	7,158	Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			0.794% due 02/25/2036	9,049	8,724
2.230% due 10/15/2032	11,000	10,922	0.339% due 07/25/2036	5,889	5,309	0.839% due 06/25/2047	21,323	19,969
5.337% due 05/15/2047	227	210	0.389% due 07/25/2036	48,361	25,174	RBSC Mortgage Loan Trust		
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			0.569% due 06/25/2036	23,462	21,929	6.000% due 01/25/2037	2	2
0.449% due 03/25/2036	5,201	5,196	0.589% due 07/25/2036	48,124	25,581	RBSSP Resecuritization Trust		
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			0.629% due 03/25/2036	5,822	5,778	0.585% due 04/26/2037	32	32
0.339% due 07/25/2036	1,662	1,664	0.794% due 07/25/2035	263	272	Real Estate Asset Liquidity Trust		
0.359% due 08/25/2036	8,600	8,264	0.824% due 07/25/2035	6,912	6,907	2.419% due 06/12/2054	CAD 7,512	6,134
0.359% due 06/25/2037	34,806	33,587	1.089% due 03/25/2033	91	90			
0.369% due 06/25/2037	22,826	20,976	1.089% due 07/25/2037	625	626			

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)		額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
Renaissance Home Equity Loan Trust								
0.809% due 11/25/2034	\$	57	\$	56				
1.089% due 09/25/2037		43		41				
5.612% due 04/25/2037	10,124	4,316						
5.675% due 06/25/2037		3,910		1,586				
Residential Accredited Securities Corporation Trust								
0.239% due 01/25/2037	1,887	1,880						
0.249% due 11/25/2036	156	254						
0.309% due 02/25/2037	14,000	13,614						
0.386% due 01/25/2037	35,802	29,833						
0.584% due 04/25/2036	12,438	12,450						
1.064% due 09/25/2035	7,400	7,404						
1.664% due 04/25/2034	1,333	1,348						
Residential Asset Mortgage Products Trust								
0.689% due 02/25/2036	3,551	3,533						
0.764% due 11/25/2035	13,000	12,945						
0.769% due 12/25/2035	12,528	12,079						
0.839% due 09/25/2035	12,591	12,562						
RESIMAC Bastille Trust								
1.005% due 09/05/2057	3,329	3,329						
Saxon Asset Securities Trust								
0.884% due 03/25/2035	597	596						
1.839% due 12/25/2037	4,071	4,071						
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust								
0.629% due 03/25/2036	5,909	5,713						
0.914% due 10/25/2035	10,136	10,047						
1.139% due 03/25/2035	8,849	8,858						
Sequoia Mortgage Trust								
0.486% due 05/20/2035	1,665	1,727						
0.606% due 06/20/2034	31	31						
Sestante Finance Srl	EUR	10,331	11,034					
SG Mortgage Securities Trust								
0.449% due 02/25/2036	\$	5,071	3,379					
Shamrock Residential DAC	EUR	14,026	16,279					
0.291% due 12/24/2059								
Soundview Home Loan Trust								
0.329% due 07/25/2036	\$	24,020	23,015					
0.399% due 06/25/2036		42,490	43,131					
0.509% due 06/25/2036		5,089	5,206					
1.064% due 03/25/2036		8,102	7,820					
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust								
1.064% due 12/25/2035	1,306	1,308						
SREIT Trust								
1.545% due 10/15/2038	24,605	24,667						
1.893% due 10/15/2038	20,425	20,476						
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust								
0.409% due 10/25/2035	5,478	5,492						
1.064% due 08/25/2035	11,959	11,795						
1.487% due 05/25/2035	68	58						
2.631% due 06/25/2037	2,785	2,775						
2.821% due 07/25/2035	2,425	1,532						
Structured Asset Investment Loan Trust								
0.239% due 06/25/2036	9,492	9,384						
0.809% due 04/25/2035	6,857	6,865						
0.889% due 02/25/2034	19,365	19,335						
1.289% due 12/25/2034	4,684	4,696						
Structured Asset Mortgage Investments II Trust								
0.509% due 09/25/2047	24,315	27,209						
0.755% due 04/19/2035	2,064	2,127						
Structured Asset Mortgage Investments Trust								
0.740% due 09/19/2032	25	25						
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust								
0.219% due 05/25/2036	7,869	7,783						
0.339% due 05/25/2036	4,347	3,581						
0.349% due 04/25/2036	351	351						
0.399% due 07/25/2036	22,610	22,384						
0.589% due 04/25/2031	8,945	8,890						
1.019% due 11/25/2035	19,865	19,909						
Summerhill Residential								
0.000% due 03/24/2059	EUR	5	\$	5				
0.289% due 03/24/2059		170,916		197,912				
0.689% due 03/24/2059		22,011		25,461				
1.239% due 03/24/2059		17,746		20,499				
1.839% due 03/24/2059		14,202		16,369				
3.089% due 03/24/2059		8,521		9,790				
4.439% due 03/24/2059		4,256		4,887				
5.439% due 03/24/2059		4,256		4,891				
6.500% due 03/24/2059		6,568		6,459				
7.000% due 03/24/2059		35,506		43,311				
Sutherland Commercial Mortgage Loans								
3.192% due 05/25/2037	\$	353	\$	352				
Taurus UK DAC								
1.175% due 06/22/2029	GBP	5,472	7,514					
Terwin Mortgage Trust								
1.469% due 09/25/2035	\$	2,943	2,952					
Trinidad Mortgage Securities PLC								
1.006% due 01/24/2059	GBP	8,897	12,222					
Truman Capital Mortgage Loan Trust								
0.349% due 03/25/2036	\$	1,407	1,401					
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust								
0.808% due 01/25/2045	502	493						
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC								
0.000% due 12/21/2049	GBP	0	584					
1.000% due 12/21/2049		34,240	47,117					
1.700% due 12/21/2049		4,921	6,781					
2.200% due 12/21/2049		2,460	3,392					
2.700% due 12/21/2049		1,406	1,937					
3.200% due 12/21/2049		1,406	1,931					
6.670% due 12/21/2049		0	962					
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates								
WMALT Trust								
0.937% due 10/25/2046	\$	12,208	10,273					
5.500% due 11/25/2035		69	71					
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust								
0.359% due 07/25/2036	2,296	2,294						
0.509% due 03/25/2037	1,184	1,148						
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates								
0.689% due 04/25/2034	4,740	4,677						
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust								
2.537% due 10/25/2036	199	196						
WFRBS Commercial Mortgage Trust								
0.415% due 03/15/2047	8,800	93						
モーゲージ証券合計								
(原簿 3,920,255米ドル)				4,000,995				
投資信託資産合計								
(原簿 3,920,255米ドル)					2.7%			
ASSET Trust								
3.987% due 05/16/2042	193	178						
ALESCO Preferred Funding XI Ltd.								
0.578% due 12/23/2036	5,000	4,325						
American Homes 4 Rent Trust								
6.231% due 10/17/2036	1,150	1,252						
BSPT Issuer Ltd.								
2.640% due 03/15/2028	8,960	8,980						
3.540% due 03/15/2028	4,050	4,052						
Cairn CLO III DAC								
0.650% due 10/20/2028	EUR	6,335	7,344					
Cairn CLO VI BV								
0.790% due 07/25/2029	2,981	3,456						
Capitalsource Real Estate Loan Trust								
0.771% due 01/20/2037	\$	12,079	11,513					
0.871% due 01/20/2037		4,800	4,340					
0.971% due 01/20/2037		2,700	1,724					
Castlake Aircraft Securitization Trust								
4.125% due 06/15/2043		2,567	2,546					
Catamaran CLO Ltd.								
0.985% due 01/27/2028	1,370	1,370						
Cavendish Square Funding PLC								
0.307% due 02/11/2055	EUR	8	\$	9				
FAB CBO BV								
0.473% due 08/20/2080		106		113				
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.								
5.000% due 03/12/2038	CAD	8,695	6,741					
Goodgreen								
3.930% due 10/15/2053	\$	5,834	6,133					
Harley Marine Financing LLC								
5.682% due 05/15/2043		5,263	5,118					
Humboldt Americas LLC								
0.000% due 07/31/2022	COP62	570,000	14,850					
7.078% due 11/30/2021	CLP23,414,122	27,378						
Jubilee CLO BV								
0.293% due 07/12/2028	EURP	815	944					
KKR CLO 18 Ltd.								
1.062% due 07/18/2030	\$	1,900	1,900					
LP Credit Card Asset-Backed Securities Master Trust								
1.638% due 08/20/2024		3,857	3,857					
Mackay Shields Euro CLO-2 DAC								
1.550% due 08/15/2033	EUR	8,150	9,438					
METAL LLC								
4.581% due 10/15/2042	\$	12,209						

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

	額面金額 (単位：千)	時価 (単位：千)
0.005% due 11/01/2021	\$ 52	52
HSBC Bank PLC		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 1,984	2,296
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 11/01/2021	\$ 14,910	\$ 14,910
MUFG Bank Ltd.		
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 1,181,321	10,360
National Australia Bank Ltd.		
0.005% due 11/01/2021	\$ 369	369
Royal Bank of Canada		
0.005% due 11/01/2021	CAD 1,534	1,534
0.005% due 11/01/2021	CAD 327	264
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 1,261	1,459
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 5	0
0.005% due 11/01/2021	\$ 29,455	29,455
0.005% due 11/01/2021	GBP 81	111
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.790%) due 11/01/2021	EUR 3,962	4,585
(0.280%) due 11/01/2021	¥ 141,497	1,241
0.005% due 11/01/2021	\$ 5,224	5,224
0.005% due 11/01/2021	GBP 1,325	1,817
		103,817
アルゼンチン短期証券 0.1%		
(39.915%) due 02/28/2022	ARS 781,991	4,853
40.179% due 11/30/2021	2,934,810	13,826
		18,679
米国短期証券 2.4%		
0.053% due 04/14/2022	\$ 5,800	5,799
0.055% due 04/07/2022	292,800	292,733
		298,532
米国短期証券(CMB) 6.1%		
0.035% due 01/25/2022	218,100	218,073
0.042% due 01/11/2022	194,600	194,580
0.050% due 02/01/2022	356,500	356,450
0.057% due 02/08/2022	6,100	6,099
		775,202
短期証券合計		1,329,557
(原価 1,331,327米ドル)		
有価証券に対する投資合計 118.5%	\$ 15,042,273	
(原価 14,877,410米ドル)		
金融デリバティブ商品 0.0%		(4,695)
(原価またはプレミアム 純額) (20,275米ドル)		
その他資産および負債 純額 (18.5%)		(2,346,715)
純資産 100.0%	\$	12,690,863

マネー・マーケット・マザーファンド

第11期 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2011年5月31日)
運用方針	主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

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

■ 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		公社債組入比率	純資産総額
		期中騰落率		
	円	%	%	百万円
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
10期 (2021年3月1日)	10,002	△0.1	75.9	76
11期 (2022年3月1日)	9,994	△0.1	76.0	76

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

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

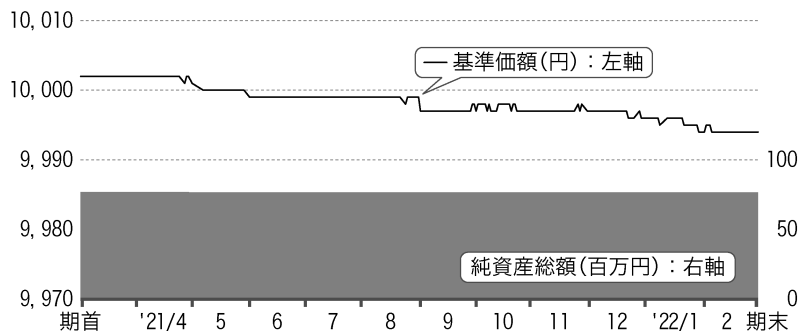
年月日	基準価額		公社債組入比率
		騰落率	
(期首) 2021年3月1日	円	%	%
3月末	10,002	-	75.9
4月末	10,002	0.0	75.8
5月末	10,001	△0.0	75.9
6月末	9,999	△0.0	76.1
7月末	9,999	△0.0	76.0
8月末	9,999	△0.0	75.9
9月末	9,997	△0.0	76.0
10月末	9,997	△0.0	76.0
11月末	9,997	△0.0	76.0
12月末	9,996	△0.1	76.1
2022年1月末	9,994	△0.1	76.0
2月末	9,994	△0.1	76.0
(期末) 2022年3月1日	9,994	△0.1	76.0

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

基準価額等の推移



期首	10,002円
期末	9,994円
騰落率	-0.1%

▶ 基準価額の変動要因 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

短期金利は小幅上昇しました。

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、発行額の増減などにより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、短期国債の買入れ額を調整したことから、期を通じて概ねレンジ推移となりました。

▶ ポートフォリオについて (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、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維持しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

2 今後の運用方針

2%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、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(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	1円 (1)	0.005% (0.005)	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	0.005	

期中の平均基準価額は9,998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(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	特殊債券	千円 58,518	千円 — (58,000)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年3月2日から2022年3月1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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 58	百万円 15	% 25.9	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、S M B C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
(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2022年3月1日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区分	期				末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券 (除く金融債券)	58,000 (58,000)	58,193 (58,193)	76.0 (76.0)	— (—)	— (—)	— (—)	76.0 (76.0)
合計	58,000 (58,000)	58,193 (58,193)	76.0 (76.0)	— (—)	— (—)	— (—)	76.0 (76.0)

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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 (除く金融債券)	159 政保道路機構	0.9000	14,000	14,005	2022/03/18
	163 政保道路機構	0.9010	15,000	15,033	2022/05/31
	40政保地方公共団	0.8190	15,000	15,068	2022/09/16
	180 政保道路機構	0.7340	14,000	14,085	2022/12/28
	小 計	—	58,000	58,193	—
	合 計	—	58,000	58,193	—

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年3月1日現在)

項目	期 末	
	評価額	比率
	千円	%
公 社 債	58,193	76.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,392	24.0
投 資 信 託 財 産 総 額	76,586	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月1日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	76,586,115円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,301,901
公 社 債 (評 価 額)	58,193,302
未 収 利 息	90,912
(B) 負 債	263
そ の 他 未 払 費 用	263
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	76,585,852
元 本	76,632,575
次 期 繰 越 損 益 金	△ 46,723
(D) 受 益 権 総 口 数	76,632,575口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	9,994円

※当期における期首元本額76,752,334円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額119,759円です。

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

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

高成長インド・中型株式ファンド	17,711,132円
アジア好利回りリート・ファンド	99,971円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型)	7,742,960円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジなし/年1回決算型)	1,337,053円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジあり/3カ月決算型)	4,909,194円
三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド (為替ヘッジなし/3カ月決算型)	1,456,790円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド (為替ヘッジなし)	14,208,735円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド (限定為替ヘッジ)	1,237,272円
三井住友・ニュー・アジア・ファンド	369,177円
アジア好利回りリート・ファンド (年1回決算型)	997円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド (為替ヘッジなし/年2回決算型)	1,187,376円
日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド (限定為替ヘッジ/年2回決算型)	389,132円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド (為替ヘッジあり)	289,352円
日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド (為替ヘッジなし)	419,066円
グローバル自動運転関連株式ファンド (為替ヘッジあり)	4,140,881円
グローバル自動運転関連株式ファンド (為替ヘッジなし)	11,065,647円
グローイング・フロンティア株式ファンド	2,185,185円
高成長インド・中型株式ファンド (年1回決算型)	7,882,655円

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

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2021年3月2日 至2022年3月1日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	542,668円
受 取 利 息	555,652
支 払 利 息	△ 12,984
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 603,028
売	△ 603,028
買	△ 603,028
(C) そ の 他 費 用 等	△ 3,836
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 64,196
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,437
(F) 解 約 差 損 益 金	36
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 46,723
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△ 46,723

※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。

※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。