

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|            |  |
|------------|--|
| 商品分類       | 追加型投信／海外／債券  |
| 信託期間       | 無期限（設定日：2003年6月16日）  |
| 運用方針       | 外国投資信託証券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して安定運用を行います。   |
| 主要投資対象     | 当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。<br><b>PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド</b><br>オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等。<br><b>PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド</b><br>オーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等。また、通常、資産の60%以上を社債等に投資します。  |
| 当ファンドの運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> <li>■主としてオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはその関連派生商品（先物取引、オプション取引、各種スワップ取引等）で運用します。</li> <li>■外貨建資産については、原則として円に対しての為替ヘッジを行いません。</li> <li>■ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。</li> <li>■運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。</li> </ul> |
| 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       | <ul style="list-style-type: none"> <li>■毎月5日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配を行います。</li> <li>■分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</li> <li>■分配金額は、委託会社が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。</li> </ul> ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。  |

# 三井住友・豪ドル債ファンド

## 【運用報告書(全体版)】

第38作成期（2021年11月6日から2022年5月6日まで）

第 **221** 期 / 第 **222** 期 / 第 **223** 期  
 決算日2021年12月6日 決算日2022年1月5日 決算日2022年2月7日

第 **224** 期 / 第 **225** 期 / 第 **226** 期  
 決算日2022年3月7日 決算日2022年4月5日 決算日2022年5月6日

### 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

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

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



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

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

■当運用報告書についてのお問い合わせ

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

### ■ 最近30期の運用実績

| 決算期              | 基準価額  |           |           | (ベンチマーク)<br>ブルームバーグ<br>オーストラリア債券<br>(総合)インデックス |           | 投資信託<br>証券組入<br>率 | 純資産額   |
|------------------|-------|-----------|-----------|--|-----------|-------------------|--------|
|                  | (分配落) | 税込<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (円ベース)   | 期中<br>騰落率 |                   |        |
|                  | 円     | 円         | %         |  | %         | %                 | 百万円    |
| 197期(2019年12月5日) | 4,105 | 25        | 0.4       | 235.47   | 0.4       | 98.8              | 81,311 |
| 198期(2020年1月6日)  | 4,095 | 10        | 0.0       | 235.25   | △ 0.1     | 97.3              | 80,088 |
| 199期(2020年2月5日)  | 4,075 | 10        | △ 0.2     | 234.48   | △ 0.3     | 99.3              | 77,055 |
| 200期(2020年3月5日)  | 3,960 | 10        | △ 2.6     | 229.15   | △ 2.3     | 98.8              | 73,678 |
| 201期(2020年4月6日)  | 3,536 | 10        | △ 10.5    | 209.10   | △ 8.8     | 99.0              | 64,840 |
| 202期(2020年5月7日)  | 3,686 | 10        | 4.5       | 218.36   | 4.4       | 98.4              | 67,252 |
| 203期(2020年6月5日)  | 4,101 | 10        | 11.5      | 242.95   | 11.3      | 98.9              | 74,533 |
| 204期(2020年7月6日)  | 4,031 | 10        | △ 1.5     | 239.99   | △ 1.2     | 99.2              | 72,250 |
| 205期(2020年8月5日)  | 4,129 | 10        | 2.7       | 244.81   | 2.0       | 99.3              | 72,926 |
| 206期(2020年9月7日)  | 4,200 | 10        | 2.0       | 249.07   | 1.7       | 98.9              | 72,597 |
| 207期(2020年10月5日) | 4,127 | 10        | △ 1.5     | 245.52   | △ 1.4     | 99.2              | 69,923 |
| 208期(2020年11月5日) | 4,105 | 10        | △ 0.3     | 244.72   | △ 0.3     | 99.0              | 68,588 |
| 209期(2020年12月7日) | 4,218 | 10        | 3.0       | 251.40   | 2.7       | 99.2              | 69,191 |
| 210期(2021年1月5日)  | 4,320 | 10        | 2.7       | 257.46   | 2.4       | 98.0              | 69,143 |
| 211期(2021年2月5日)  | 4,326 | 10        | 0.4       | 258.21   | 0.3       | 98.9              | 67,409 |
| 212期(2021年3月5日)  | 4,401 | 10        | 2.0       | 263.59   | 2.1       | 98.8              | 67,058 |
| 213期(2021年4月5日)  | 4,399 | 10        | 0.2       | 264.65   | 0.4       | 97.6              | 65,648 |
| 214期(2021年5月6日)  | 4,447 | 10        | 1.3       | 267.96   | 1.3       | 98.6              | 65,385 |
| 215期(2021年6月7日)  | 4,456 | 5         | 0.3       | 268.88   | 0.3       | 99.2              | 64,377 |
| 216期(2021年7月5日)  | 4,409 | 5         | △ 0.9     | 266.89   | △ 0.7     | 98.9              | 61,855 |
| 217期(2021年8月5日)  | 4,335 | 5         | △ 1.6     | 263.15   | △ 1.4     | 99.2              | 59,878 |
| 218期(2021年9月6日)  | 4,351 | 5         | 0.5       | 264.58   | 0.5       | 99.2              | 59,125 |
| 219期(2021年10月5日) | 4,247 | 5         | △ 2.3     | 258.56   | △ 2.3     | 99.0              | 56,764 |
| 220期(2021年11月5日) | 4,309 | 5         | 1.6       | 263.43   | 1.9       | 99.0              | 56,202 |
| 221期(2021年12月6日) | 4,097 | 5         | △ 4.8     | 251.20   | △ 4.6     | 98.9              | 52,466 |
| 222期(2022年1月5日)  | 4,321 | 5         | 5.6       | 264.91   | 5.5       | 98.1              | 54,779 |
| 223期(2022年2月7日)  | 4,132 | 5         | △ 4.3     | 253.38   | △ 4.3     | 99.3              | 51,712 |
| 224期(2022年3月7日)  | 4,219 | 5         | 2.2       | 260.17   | 2.7       | 99.1              | 52,284 |
| 225期(2022年4月5日)  | 4,451 | 5         | 5.6       | 275.21   | 5.8       | 99.4              | 54,190 |
| 226期(2022年5月6日)  | 4,330 | 5         | △ 2.6     | 268.31   | △ 2.5     | 99.0              | 51,593 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

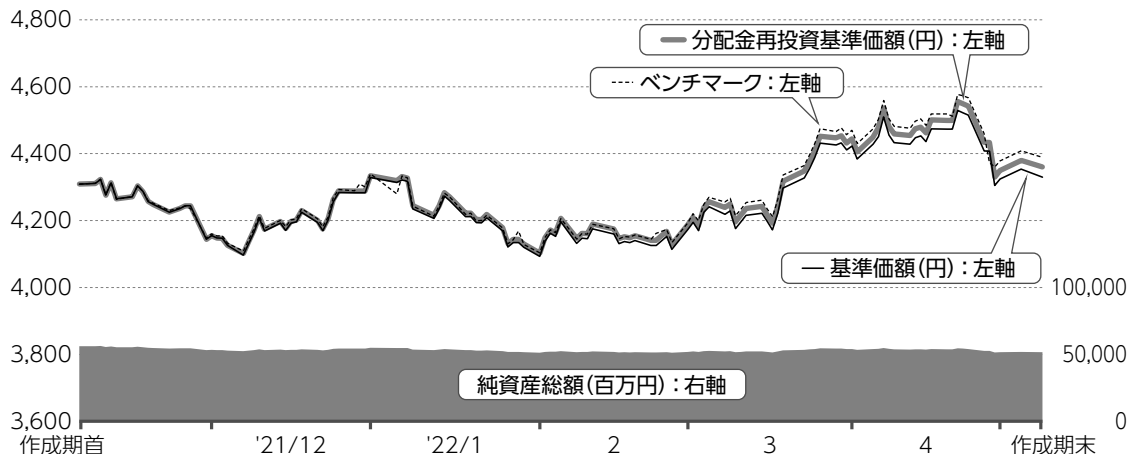
| 決算期   | 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | (ベンチマーク)<br>ブルームバーグ<br>オーストラリア債券<br>(総合)インデックス<br>(円ベース) |       | 投資信託<br>証券組入<br>比 率 |
|-------|---------------------|---------|-------|--|-------|---------------------|
|       |                     |         | 騰 落 率 |  | 騰 落 率 |                     |
| 第221期 | (期 首)<br>2021年11月5日 | 円       | %     |  | %     | %                   |
|       |                     | 4,309   | —     | 263.43   | —     | 99.0                |
|       | 11月末                | 4,155   | △3.6  | 254.33   | △3.5  | 98.8                |
| 第222期 | (期 末)<br>2021年12月6日 | 4,102   | △4.8  | 251.20   | △4.6  | 98.9                |
|       | (期 首)<br>2021年12月6日 | 4,097   | —     | 251.20   | —     | 98.9                |
|       | 12月末                | 4,329   | 5.7   | 265.31   | 5.6   | 98.0                |
| 第223期 | (期 末)<br>2022年1月5日  | 4,326   | 5.6   | 264.91   | 5.5   | 98.1                |
|       | (期 首)<br>2022年1月5日  | 4,321   | —     | 264.91   | —     | 98.1                |
|       | 1月末                 | 4,093   | △5.3  | 250.85   | △5.3  | 98.9                |
| 第224期 | (期 末)<br>2022年2月7日  | 4,137   | △4.3  | 253.38   | △4.3  | 99.3                |
|       | (期 首)<br>2022年2月7日  | 4,132   | —     | 253.38   | —     | 99.3                |
|       | 2月末                 | 4,173   | 1.0   | 256.37   | 1.2   | 98.8                |
| 第225期 | (期 末)<br>2022年3月7日  | 4,224   | 2.2   | 260.17   | 2.7   | 99.1                |
|       | (期 首)<br>2022年3月7日  | 4,219   | —     | 260.17   | —     | 99.1                |
|       | 3月末                 | 4,423   | 4.8   | 273.26   | 5.0   | 98.8                |
| 第226期 | (期 末)<br>2022年4月5日  | 4,456   | 5.6   | 275.21   | 5.8   | 99.4                |
|       | (期 首)<br>2022年4月5日  | 4,451   | —     | 275.21   | —     | 99.4                |
|       | 4月末                 | 4,324   | △2.9  | 267.66   | △2.7  | 98.9                |
|       | (期 末)<br>2022年5月6日  | 4,335   | △2.6  | 268.31   | △2.5  | 99.0                |

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

## 基準価額等の推移



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

|      |                               |
|------|-------------------------------|
| 作成期首 | 4,309円                        |
| 作成期末 | 4,330円<br>(当作成期既払分配金30円(税引前)) |
| 騰落率  | +1.2%<br>(分配金再投資ベース)          |

## 分配金再投資基準価額について

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

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

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

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

**基準価額の主な変動要因(2021年11月6日から2022年5月6日まで)**

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

外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行っていません。

**上昇要因**

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

**下落要因**

- オーストラリアの金利が上昇(価格は下落)したこと

投資環境について(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

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

### 債券市場

期の前半は、RBA(オーストラリア準備銀行)が2022年2月までは債券買入れを継続すると表明したことや、変異ウイルス(オミクロン型)の世界的な感染拡大による景気の先行き不透明感などから、オーストラリア国債利回りは小幅に低下しました。

期の後半は、FRB(米連邦準備制度理事会)をはじめ主要中央銀行が金融引き締め姿勢を明確に示し世界的に金利上昇圧力が強まったことに加え、オーストラリア国内でも雇用市場の回復を受けてRBAの早期利上げ観測が高まったことなどから、オーストラリア国債利回りは大きく上昇しました。

### 為替市場

期の前半は、オーストラリア国内のロックダウン(都市封鎖)により景気への影響が懸念されたことなどから、豪ドルは対円で下落基調となりました。

期の後半は国内の雇用市場の回復を背景にRBAの早期利上げ観測が高まったことや、ロシアによるウクライナ侵攻を受け資源価格が一段と上昇したことなどにより、豪ドルは対円で上昇しました。

ポートフォリオについて(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

## 当ファンド

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

## 組入れファンド

### ●デュレーション(投資資金の平均回収期間)戦略

オーストラリアのデュレーション戦略では、期の前半は金利リスクをアンダーウェイト、後半はオーバーウェイトで調整しました。また、米国、欧州を売り持ちとし、ポートフォリオ全体のデュレーションをアンダーウェイトとしました。

### ●イールドカーブ(利回り曲線)戦略

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

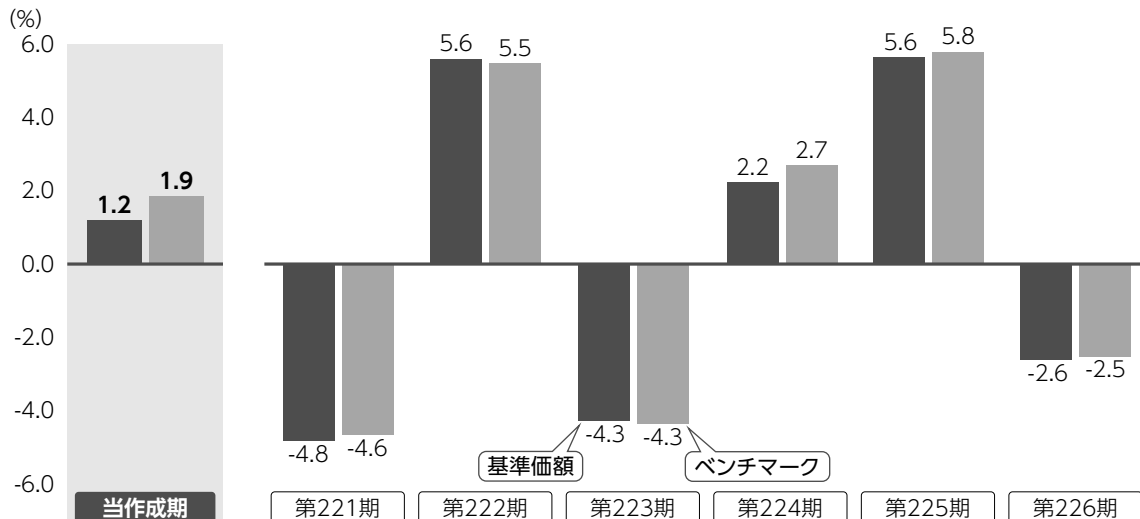
### ●種別配分

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

ベンチマークとの差異について(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

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

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※当作成期の基準価額は分配金再投資ベース、各期は分配金(税引前)込み。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+1.2%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+1.9%を0.7%下回りました。

プラス要因

- 米国や欧州の金利リスクを売持ちとしていたこと

マイナス要因

- デンマークやニュージーランドの金利リスクを取得していたこと



## 分配金について(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

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

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目        | 第221期   | 第222期   | 第223期   | 第224期   | 第225期   | 第226期   |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金     | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       |
| (対基準価額比率) | (0.12%) | (0.12%) | (0.12%) | (0.12%) | (0.11%) | (0.12%) |
| 当期の収益     | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       |
| 当期の収益以外   | -       | -       | -       | -       | -       | -       |
| 翌期繰越分配対象額 | 164     | 170     | 172     | 178     | 184     | 185     |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### 組入れファンド

PIMCOでは、ロシアによるウクライナ侵攻およびそれに伴うロシアへの経済制裁の影響から2022年における先進国の実質GDP(国内総生産)成長率は大きく鈍化するとみています。主要国の金融政策については、FRBが2000年以来となる0.5%の利上げ

に踏み切るなど、中央銀行による金融引き締めが当面は継続すると考えています。

景気見通しに対するリスク要因としては、中国の一部で実施されているロックダウンの影響による生産・流通の停滞の長期化、高水準でのインフレ継続、想定よりも早いペースでの金融引き締めなどを想定しています。特にインフレ率については、今回のウクライナ侵攻を受けたエネルギー価格の急騰に加え、広範な物資の物流停滞による影響も受けており、一段の上昇に警戒が必要です。

オーストラリアについては、国内経済がコロナショック前の水準を回復しており、堅調な労働市場や企業の景況感などを背景に中央銀行が利上げを開始したことは豪ドルのサ

ポート材料になるとみています。一方で、最大の貿易相手国である中国の景気減速懸念や世界的なインフレ高進によって経済活動が低迷し外需が落ち込むリスクには注意が必要です。

かかる環境下、「PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド」および「PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド」の合算ベースで、

オーストラリアの金利リスクはベンチマークとほぼ同水準としています。年限別では、市場参加者がRBAによる金融政策を十分に織り込んでいることを念頭に置きつつ、市場動向に応じて柔軟に対応する方針とします。セクター別には、銘柄を厳選した上でオーストラリアのモーゲージ債や一部社債などへの選択投資を継続します。

### 3 お知らせ

#### 約款変更について

該当事項はございません。

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### 1万口当たりの費用明細 (2021年11月6日から2022年5月6日まで)

| 項目          | 金額        | 比率           | 項目の概要   |
|-------------|-----------|--------------|---|
| (a) 信託報酬    | 29円       | 0.673%       | 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)<br><b>期中の平均基準価額は4,260円です。</b> |
| （投信会社）      | (15)      | (0.345)      | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価  |
| （販売会社）      | (13)      | (0.312)      | 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                |
| （受託会社）      | (1)       | (0.016)      | 受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価                          |
| (b) 売買委託手数料 | -         | -            | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数                                 |
| （株式）        | (-)       | (-)          | 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                               |
| （先物・オプション）  | (-)       | (-)          |   |
| （投資信託証券）    | (-)       | (-)          |   |
| (c) 有価証券取引税 | -         | -            | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数                                 |
| （株式）        | (-)       | (-)          | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                |
| （公社債）       | (-)       | (-)          |   |
| （投資信託証券）    | (-)       | (-)          |   |
| (d) その他費用   | 0         | 0.001        | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                     |
| （保管費用）      | (-)       | (-)          | 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用            |
| （監査費用）      | (0)       | (0.001)      | 監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用  |
| （その他）       | (0)       | (0.000)      | その他：信託事務の処理等に要するその他費用   |
| <b>合計</b>   | <b>29</b> | <b>0.674</b> |   |

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

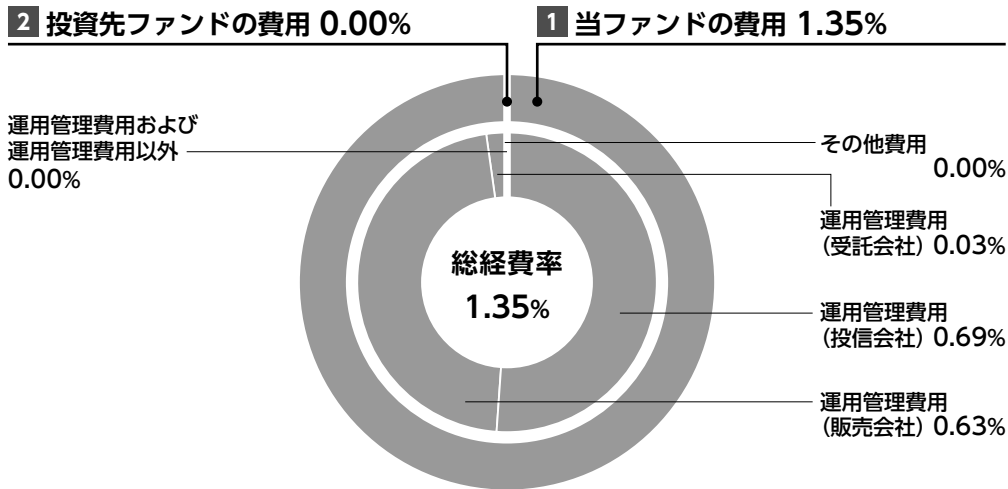
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

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



## 参考情報 総経費率(年率換算)



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

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

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

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

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

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

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2021年11月6日から2022年5月6日まで)

投資信託証券

|    |                                | 当 作 成 期 |       |         |           |
|----|--------------------------------|---------|-------|---------|-----------|
|    |                                | 買 付     |       | 売 付     |           |
|    |                                | 口 数     | 買 付 額 | 口 数     | 売 付 額     |
|    |                                | 口       | 千円    | 口       | 千円        |
| 国内 | PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド | —       | —     | 387,969 | 3,746,498 |
|    | PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド  | —       | —     | 135,998 | 936,602   |

※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6日から2022年5月6日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2021年11月6日から2022年5月6日まで)

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

■ 組入れ資産の明細 (2022年5月6日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名                      | 作成期首      | 作 成 期 末   |            |         |
|--------------------------------|-----------|-----------|------------|---------|
|                                | 口 数       | 口 数       | 評 価 額      | 組 入 比 率 |
|                                | 口         | 口         | 千円         | %       |
| PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド | 4,617,110 | 4,229,141 | 40,840,814 | 79.2    |
| PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド  | 1,591,356 | 1,455,358 | 10,223,889 | 19.8    |
| 合 計                            | 6,208,466 | 5,684,499 | 51,064,704 | 99.0    |

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

## ■ 投資信託財産の構成

(2022年5月6日現在)

| 項 目                     | 作 成 期 末    |       |
|-------------------------|------------|-------|
|                         | 評 価 額      | 比 率   |
|                         | 千円         | %     |
| 投 資 信 託 受 益 証 券         | 51,064,704 | 98.6  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 735,296    | 1.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 51,800,001 | 100.0 |

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年12月6日)(2022年1月5日)(2022年2月7日)(2022年3月7日)(2022年4月5日)(2022年5月6日)

| 項 目                    | 第221期末                  | 第222期末                  | 第223期末                  | 第224期末                  | 第225期末                  | 第226期末                  |
|------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>(A) 資 産</b>         | <b>52,670,092,397円</b>  | <b>55,026,105,713円</b>  | <b>51,889,349,445円</b>  | <b>52,572,861,091円</b>  | <b>54,453,183,486円</b>  | <b>51,800,001,073円</b>  |
| コール・ローン等               | 762,198,314             | 1,290,942,879           | 556,278,971             | 739,676,422             | 606,268,424             | 735,296,486             |
| 投資信託受益証券(評価額)          | 51,907,894,083          | 53,735,162,834          | 51,333,070,474          | 51,833,184,669          | 53,846,915,062          | 51,064,704,587          |
| <b>(B) 負 債</b>         | <b>203,561,100</b>      | <b>246,762,313</b>      | <b>176,742,272</b>      | <b>287,913,653</b>      | <b>262,230,157</b>      | <b>206,261,618</b>      |
| 未払収益分配金                | 64,032,128              | 63,388,882              | 62,576,380              | 61,958,204              | 60,881,861              | 59,582,557              |
| 未払解約金                  | 76,436,555              | 123,211,359             | 49,271,811              | 171,962,959             | 144,042,100             | 85,306,710              |
| 未払信託報酬                 | 62,926,918              | 59,997,780              | 64,729,357              | 53,829,516              | 57,143,352              | 61,209,266              |
| その他未払費用                | 165,499                 | 164,292                 | 164,724                 | 162,974                 | 162,844                 | 163,085                 |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b>  | <b>52,466,531,297</b>   | <b>54,779,343,400</b>   | <b>51,712,607,173</b>   | <b>52,284,947,438</b>   | <b>54,190,953,329</b>   | <b>51,593,739,455</b>   |
| 元 本                    | 128,064,257,502         | 126,777,765,466         | 125,152,760,069         | 123,916,409,631         | 121,763,723,465         | 119,165,114,570         |
| 次期繰越損益金                | △ 75,597,726,205        | △ 71,998,422,066        | △ 73,440,152,896        | △ 71,631,462,193        | △ 67,572,770,136        | △ 67,571,375,115        |
| <b>(D) 受 益 権 総 口 数</b> | <b>128,064,257,502口</b> | <b>126,777,765,466口</b> | <b>125,152,760,069口</b> | <b>123,916,409,631口</b> | <b>121,763,723,465口</b> | <b>119,165,114,570口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)        | <b>4,097円</b>           | <b>4,321円</b>           | <b>4,132円</b>           | <b>4,219円</b>           | <b>4,451円</b>           | <b>4,330円</b>           |

※当作成期における作成期首元本額130,438,433,462円、作成期中追加設定元本額543,635,302円、作成期中一部解約元本額11,816,954,194円です。

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

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### ■ 損益の状況

(自2021年11月6日) (自2021年12月7日) (自2022年1月6日) (自2022年2月8日) (自2022年3月8日) (自2022年4月6日)  
 至2022年12月6日 至2022年1月5日 至2022年2月7日 至2022年3月7日 至2022年4月5日 至2022年5月6日

| 項 目                   | 第221期             | 第222期             | 第223期             | 第224期             | 第225期             | 第226期             |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 取 益         | 144,439,285円      | 141,809,109円      | 141,675,038円      | 139,994,835円      | 137,628,753円      | 134,780,070円      |
| 受 取 配 当 金             | 144,475,288       | 141,844,441       | 141,702,160       | 140,004,801       | 137,633,254       | 134,790,933       |
| 受 取 利 息               | 1,191             | 97                | 2,996             | 945               | 131               | 51                |
| 支 払 利 息               | △ 37,194          | △ 35,429          | △ 30,118          | △ 10,911          | △ 4,632           | △ 10,914          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | △ 2,733,060,565   | 2,819,921,347     | △ 2,380,418,940   | 1,057,592,523     | 2,792,599,363     | △ 1,457,557,779   |
| 売 買 損 益               | 13,970,286        | 2,835,546,084     | 21,378,174        | 1,062,979,546     | 2,823,661,029     | 17,011,944        |
| 売 買 損 益               | △ 2,747,030,851   | △ 15,624,737      | △ 2,401,797,114   | △ 5,387,023       | △ 31,061,666      | △ 1,474,569,723   |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △ 63,091,879      | △ 60,161,373      | △ 64,893,216      | △ 53,992,069      | △ 57,305,860      | △ 61,372,050      |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △ 2,651,713,159   | 2,901,569,083     | △ 2,303,637,118   | 1,143,595,289     | 2,872,922,256     | △ 1,384,149,759   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | △13,820,520,394   | △16,357,637,392   | △13,335,693,320   | △15,525,940,635   | △14,181,138,453   | △11,118,164,029   |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | △59,061,460,524   | △58,478,964,875   | △57,738,246,078   | △57,187,158,643   | △56,203,672,078   | △55,009,478,770   |
| (配当等相当額)              | ( 388,051,561)    | ( 385,364,156)    | ( 381,532,862)    | ( 379,966,277)    | ( 374,718,712)    | ( 367,592,835)    |
| (売買損益相当額)             | (△59,449,512,085) | (△58,864,329,031) | (△58,119,778,940) | (△57,567,124,920) | (△56,578,390,790) | (△55,377,071,605) |
| (G) 合 計 ( D + E + F ) | △75,533,694,077   | △71,935,033,184   | △73,377,576,516   | △71,569,503,989   | △67,511,888,275   | △67,511,792,558   |
| (H) 収 益 分 配 金         | △ 64,032,128      | △ 63,388,882      | △ 62,576,380      | △ 61,958,204      | △ 60,881,861      | △ 59,582,557      |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)   | △75,597,726,205   | △71,998,422,066   | △73,440,152,896   | △71,631,462,193   | △67,572,770,136   | △67,571,375,115   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | △59,061,460,524   | △58,478,964,875   | △57,738,246,078   | △57,187,158,643   | △56,203,672,078   | △55,009,478,770   |
| (配当等相当額)              | ( 388,051,561)    | ( 385,364,156)    | ( 381,532,862)    | ( 379,966,277)    | ( 374,718,712)    | ( 367,592,835)    |
| (売買損益相当額)             | (△59,449,512,085) | (△58,864,329,031) | (△58,119,778,940) | (△57,567,124,920) | (△56,578,390,790) | (△55,377,071,605) |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 1,722,559,722     | 1,780,575,575     | 1,772,965,245     | 1,826,345,963     | 1,868,935,819     | 1,845,003,066     |
| 繰 越 損 益 金             | △18,258,825,402   | △15,300,032,766   | △17,474,872,063   | △16,270,649,513   | △13,238,033,877   | △14,406,899,411   |

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

※投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するため要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は130,637,773円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

|                       | 第221期         | 第222期         | 第223期         | 第224期         | 第225期         | 第226期         |
|-----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益       | 81,347,406円   | 138,927,379円  | 76,781,822円   | 133,683,162円  | 134,935,378円  | 73,408,020円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益   | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| (c) 収益調整金             | 388,051,561   | 385,364,156   | 381,532,862   | 379,966,277   | 374,718,712   | 367,592,835   |
| (d) 分配準備積立金           | 1,705,244,444 | 1,705,037,078 | 1,758,759,803 | 1,754,621,005 | 1,794,882,302 | 1,831,177,603 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 2,174,643,411 | 2,229,328,613 | 2,217,074,487 | 2,268,270,444 | 2,304,536,392 | 2,272,178,458 |
| 1万口当たり当期分配対象額         | 169.81        | 175.85        | 177.15        | 183.05        | 189.26        | 190.67        |
| (f) 分配金               | 64,032,128    | 63,388,882    | 62,576,380    | 61,958,204    | 60,881,861    | 59,582,557    |
| 1万口当たり分配金             | 5             | 5             | 5             | 5             | 5             | 5             |

### ■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金(税引前) | 第221期 | 第222期 | 第223期 | 第224期 | 第225期 | 第226期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
|                | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    |

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

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

## ■ 組入れ投資信託証券の内容

## 投資信託証券の概要

|         |   |
|---------|---|
| ファンド名   | ・ P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド<br>・ P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド   |
| 形態      | ケイマン籍契約型投資信託（円建て）   |
| 主要投資対象  | 外国債券  |
| 運用の基本方針 | ベンチマークを上回ることを目指して運用を行います。<br>P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド<br>・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。<br>P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド<br>・ 通常、資産の70%以上をオーストラリアドル建ての債券、ニュージーランドドル建ての債券、またはそれらの関連派生商品等に投資します。また、通常、資産の60%を社債等に投資します。<br>・ 投資する債券は、原則として、取得時において、B B B - 1格相当以上とし、ポートフォリオの平均格付けはA - 1格以上とします。<br>※格付けは、主要格付機関のいずれかからの格付けによるものとし、いずれの主要格付機関からの格付けもないものについては、P I M C O が同等の信用度を認めたものに投資することができるものとします。<br>※保有する債券が、格下げにより、上記の最低格付けを下回った場合は、当該銘柄を継続して保有することがあります。<br>・ オーストラリアドル建て以外の資産については、少なくともその85%を対オーストラリアドルでヘッジします（外貨建資産の対円でのヘッジは行いません。）。 |
| 決算日     | 年1回、原則として毎年2月末  |
| 分配方針    | 毎月、分配を行う方針です。   |
| ベンチマーク  | P I M C O ケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド<br>・ ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円ベース)<br>P I M C O ケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド<br>・ ブルームバーグオーストラリア債券 (Credit) インデックス (円ベース)   |
| 主な投資制限  | ・ 株式関連証券への投資は、転換社債、優先株を除き行いません。<br>・ 同一銘柄または同一発行者にかかる証券への投資は、政府系証券を除き、取得時において、純資産総額の10%以下とします。<br>・ エマージングマーケットへの投資は、取得時において、純資産総額の10%以下とします。   |
| 運用管理費用  | ありません。  |
| その他の費用  | ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。<br>これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。  |
| 申込手数料   | ありません。  |
| 信託財産留保額 | ありません。  |
| 投資顧問会社  | P I M C O (パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)   |
| 購入の可否   | 日本において一般投資者は購入できません。  |

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



■ 損益計算書(2020年3月1日から2021年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

(単位：千)

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

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

### ■ 投資明細表(2021年2月28日現在)

#### PIMCOケイマン オーストラリア・マルチセクター・ファンド

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

### 三井住友・豪ドル債ファンド

|   | 額面金額<br>(単位: 千) | 時価<br>(単位: 千) |
|---|-----------------|---------------|
| 0.905% 期日 04/17/2062  | AUD 1,210       | 1,210         |
| Progress Trust  |                 |               |
| 0.805% 期日 07/20/2046  | 1,152           | 1,156         |
| 0.955% 期日 07/22/2045  | 639             | 643           |
| 1.235% 期日 02/21/2048  | 1,804           | 1,823         |
| REDS Trust  |                 |               |
| 1.355% 期日 05/24/2044  | 272             | 276           |
| Residential Asset Mortgage Products Trust                   |                 |               |
| 0.678% 期日 06/25/2032  | USD 3           | 4             |
| Resimac Bastille Trust                                      |                 |               |
| 0.960% 期日 12/05/2051  | AUD 1,197       | 1,198         |
| RESIMAC Bastille Trust                                      |                 |               |
| 0.963% 期日 12/05/2059  | USD 719         | 928           |
| 1.043% 期日 09/05/2057  | 525             | 680           |
| RESIMAC Premier   |                 |               |
| 1.010% 期日 06/07/2051  | AUD 968         | 970           |
| 1.160% 期日 02/10/2051  | 2,338           | 2,355         |
| 1.310% 期日 02/07/2052  | 1,797           | 1,818         |
| Sapphire XXIII Trust  |                 |               |
| 0.905% 期日 06/21/2052  | 1,367           | 1,368         |
| 0.955% 期日 05/21/2052  | 219             | 219           |
| 1.655% 期日 05/21/2052  | 1,500           | 1,516         |
| Securitized Australian Mortgage Trust                       |                 |               |
| 0.785% 期日 02/20/2046  | 1,041           | 1,048         |
| Silverstone Master Issuer PLC                               |                 |               |
| 0.794% 期日 01/21/2070  | USD 572         | 740           |
| Structured Asset Mortgage Investments II Trust              |                 |               |
| 0.558% 期日 05/25/2046  | 31              | 22            |
| Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust |                 |               |
| 1.123% 期日 11/25/2035  | 1,800           | 2,295         |
| 1.623% 期日 04/25/2035  | 46              | 59            |
| Superannuation Members Home Loan Securitisation Fund        |                 |               |
| 1.185% 期日 04/27/2048  | AUD 1,320       | 1,332         |
| TORRENS Trust   |                 |               |
| 1.335% 期日 02/18/2048  | 873             | 890           |
| Towd Point Mortgage Trust                                   |                 |               |
| 1.118% 期日 05/25/2058  | USD 1,890       | 2,466         |
| 1.118% 期日 10/25/2059  | 1,404           | 1,835         |

|   | 額面金額<br>(単位: 千) | 時価<br>(単位: 千) |
|---|-----------------|---------------|
| 2.900% 期日 10/25/2059                          | 2,173           | 2,944         |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                 |               |
| 0.638% 期日 11/25/2045                          | 48              | 62            |
| 0.658% 期日 12/25/2045                          | 168             | 220           |
| 1.138% 期日 04/25/2047                          | 35              | 44            |
| 3.710% 期日 06/25/2033                          | 7               | 9             |
| Westpac Securitisation Trust                  |                 |               |
| 0.785% 期日 07/21/2045                          | AUD 463         | 465           |
| 0.805% 期日 01/18/2047                          | 1,414           | 1,422         |
| モーゲージ証券合計                                     |                 | 99,139        |
| (取得原価 AUD 102,046)                            |                 |               |
| 資産担保証券 1.6%                                   |                 |               |
| Cairn CLO III BV                              |                 |               |
| 0.650% 期日 10/20/2028                          | EUR 505         | 794           |
| Cairn CLO IV BV                               |                 |               |
| 0.930% 期日 04/30/2031                          | 200             | 313           |
| Driver Australia Five Trust                   |                 |               |
| 0.935% 期日 07/21/2026                          | AUD 410         | 410           |
| Driver Australia Four Trust                   |                 |               |
| 0.955% 期日 08/21/2025                          | 57              | 57            |
| Driver Australia Six Trust                    |                 |               |
| 0.905% 期日 12/21/2027                          | 1,343           | 1,346         |
| Flexi Asset-Backed Securities Trust           |                 |               |
| 0.910% 期日 04/14/2025                          | 1,874           | 1,877         |
| Grosvenor Place CLO BV                        |                 |               |
| 0.720% 期日 10/30/2029                          | EUR 1,066       | 1,674         |
| Monarch Grove CLO                             |                 |               |
| 1.098% 期日 01/25/2028                          | USD 977         | 1,259         |
| Pepper SPARKZ Trust No.3                      |                 |               |
| 1.055% 期日 08/17/2028                          | AUD 2,116       | 2,130         |
| TICP CLO I Ltd.                               |                 |               |
| 1.024% 期日 07/20/2027                          | USD 447         | 578           |
| 資産担保証券合計                                      |                 | 10,438        |
| (取得原価 AUD 10,376)                             |                 |               |
| ソブリン債 62.5%                                   |                 |               |
| Asian Development Bank                        |                 |               |

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

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

■ 損益計算書(2020年3月1日から2021年2月28日まで)

PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

(単位：千)

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

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



## 三井住友・豪ドル債ファンド

### ■ 投資明細表(2021年2月28日現在)

#### PIMCOケイマン オーストラリア・コーポレート・ファンド

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

## 三井住友・豪ドル債ファンド

|                    |   | 額面金額   | 時価     |         |  |     | 額面金額   | 時価     |        |
|--------------------|---|--------|--------|---------|--|-----|--------|--------|--------|
|                    |   | (単位：千) | (単位：千) |         |  |     | (単位：千) | (単位：千) |        |
| 公共事業               | 7.7%  |        |        |         | 1.932% 期日 02/25/2033                         | USD | 3      |        | 4      |
|                    | AGL Energy Ltd.   |        |        |         | Pepper Residential Securities Trust No.27    |     |        |        |        |
|                    | 5.000% 期日 11/05/2021                                      | 2,700  |        | 2,722   | 0.955% 期日 06/13/2062                         | AUD | 1,513  |        | 1,515  |
|                    | AT&T, Inc.  |        |        |         | Progress Trust                               |     |        |        |        |
|                    | 4.600% 期日 09/19/2028                                      | 3,400  |        | 3,894   | 1.555% 期日 06/18/2044                         |     | 1,696  |        | 1,712  |
|                    | DBNGP Finance Co. Pty Ltd.                                |        |        |         | モーゲージ証券合計                                    |     |        |        | 6,476  |
|                    | 4.225% 期日 05/28/2025                                      | 2,700  |        | 2,982   | (取得原価 AUD 6,431)                             |     |        |        |        |
|                    | Origin Energy Finance Ltd.                                |        |        |         |  |     |        |        |        |
|                    | 2.650% 期日 11/11/2027                                      | 2,500  |        | 2,517   | ソブリン債 20.8%                                  |     |        |        |        |
|                    |   |        |        | 12,115  | Australia Government Bond                    |     |        |        |        |
| 社債券等合計             |   |        |        | 115,361 | 0.250% 期日 11/21/2025                         |     | 500    |        | 488    |
| (取得原価 AUD 113,071) |   |        |        |         | 1.750% 期日 06/21/2051                         |     | 3,500  |        | 2,689  |
|                    |   |        |        |         | 3.000% 期日 03/21/2047                         |     | 2,600  |        | 2,682  |
| 米国政府機関債            | 0.0%  |        |        |         | 3.250% 期日 04/21/2029                         |     | 1,200  |        | 1,352  |
|                    | Fannie Mae  |        |        |         | BNG Bank NV                                  |     |        |        |        |
|                    | 0.518% 期日 06/25/2029                                      | USD    | 1      | 2       | 3.500% 期日 07/19/2027                         |     | 3,100  |        | 3,473  |
| 米国政府機関債合計          |   |        |        | 2       | European Investment Bank                     |     |        |        |        |
| (取得原価 AUD 2)       |   |        |        |         | 2.900% 期日 10/17/2025                         |     | 1,100  |        | 1,200  |
|                    |   |        |        |         | 4.750% 期日 08/07/2024                         |     | 2,500  |        | 2,857  |
| モーゲージ証券            | 4.1%  |        |        |         | Kommunalbanken A/S                           |     |        |        |        |
|                    | AFG Trust   |        |        |         | 3.000% 期日 12/09/2026                         |     | 3,600  |        | 3,933  |
|                    | 0.960% 期日 01/10/2052                                      | AUD    | 893    | 895     | Northern Territory Treasury Corp.            |     |        |        |        |
|                    | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust         |        |        |         | 2.000% 期日 05/21/2029                         |     | 4,000  |        | 4,019  |
|                    | 0.778% 期日 02/25/2035                                      | USD    | 13     | 16      | Treasury Corp. of Victoria                   |     |        |        |        |
|                    | 0.798% 期日 02/25/2035                                      |        | 14     | 17      | 4.250% 期日 12/20/2032                         |     | 2,000  |        | 2,410  |
|                    | CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates |        |        |         | Western Australian Treasury Corp.            |     |        |        |        |
|                    | 2.595% 期日 07/25/2033                                      |        | 13     | 17      | 3.000% 期日 10/21/2026                         |     | 6,800  |        | 7,506  |
|                    | Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates          |        |        |         | 3.250% 期日 07/20/2028                         |     | 200    |        | 223    |
|                    | 1.778% 期日 07/25/2044                                      |        | 10     | 13      | ソブリン債合計                                      |     |        |        | 32,832 |
|                    | Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates             |        |        |         | (取得原価 AUD 31,904)                            |     |        |        |        |
|                    | 3.170% 期日 10/25/2033                                      |        | 9      | 13      |  |     |        |        |        |
|                    | Liberty   |        |        |         | 短期証券 1.0%                                    |     |        |        |        |
|                    | 1.010% 期日 12/25/2051                                      | AUD    | 498    | 499     | 定期性預金 1.0%                                   |     |        |        |        |
|                    | Medallion Trust   |        |        |         | Australia and New Zealand Banking Group Ltd. |     |        |        |        |
|                    | 1.405% 期日 03/21/2044                                      |        | 1,751  | 1,775   | (0.060%) 期日 03/01/2021                       | USD | 182    |        | 182    |
|                    | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                    |        |        |         | 0.000% 期日 03/01/2021                         |     | 156    |        | 202    |

