

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和3年10月29日
【発行者名】	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 (Pacific Investment Management Company LLC)
【代表者の役職氏名】	マネージング・ディレクター ピーター・G・ストレロウ (Peter G. Strelow, Managing Director)
【本店の所在の場所】	アメリカ合衆国、92660 カリフォルニア、ニューポート・ビーチ、 ニューポート・センター・ドライブ650番 (650 Newport Center Drive, Newport Beach, CA 92660, USA)
【代理人の氏名又は名称】	弁 護 士 三 浦 健
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁 護 士 三 浦 健
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【届出の対象とした募集 (売出) 外国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	ピムコ・バミューダ・トラスト - PIMCOショート・ターム・モーゲージ・インカム (PIMCO Bermuda Trust - PIMCO Short-Term Mortgage Income)
【届出の対象とした募集 (売出) 外国投資信託受益証券 の金額】	各クラス受益証券の上限見込額は以下の通りとする。 米ドルクラス：30億米ドル（約3,293億円）を上限とする。 ユーロクラス：30億ユーロ（約4,012億円）を上限とする。 円クラス： 3,000億円を上限とする。
	(注) アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）およびユーロの円貨換算は、 2021年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 （ 1 米ドル = 109.76円および 1 ユーロ = 133.74円 ）による。
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年3月31日に提出した有価証券届出書（2021年7月30日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済）（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうちファンドのベンチマーク指標が2021年10月29日付で変更され、また「リスクに関する参考情報」中、代表的な資産クラスを表す指数の名称が変更されましたので、当該記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

下線の部分は訂正箇所を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

2 投資方針

（1）投資方針

< 訂正前 >

PIMCOショートターム・モーゲージ・インカムの投資目的は、元本の安全性およびファンドのベンチマーク指標を上回る投資実績を追求することにある。以下の表は、ファンドの各クラスのベンチマーク指標を挙げたものである。

クラス	ベンチマーク指標
米ドルクラス	1 か月物米ドルLIBORインデックス
ユーロクラス	<u>1 か月物ユーロLIBORインデックス</u>
円クラス	<u>1 か月物日本円LIBORインデックス</u>

（後略）

< 訂正後 >

PIMCOショートターム・モーゲージ・インカムの投資目的は、元本の安全性およびファンドのベンチマーク指標を上回る投資実績を追求することにある。以下の表は、ファンドの各クラスのベンチマーク指標を挙げたものである。

クラス	ベンチマーク指標
米ドルクラス	1 か月物米ドルLIBORインデックス
ユーロクラス	<u>ICE BofA ESTR オーバーナイトレートインデックス</u>
円クラス	<u>ICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックス</u>

（後略）

3 投資リスク

リスクに関する参考情報

<訂正前>

（前略）

（ご注意）

- ・分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。ただし、ファンドについては分配金の支払実績はないため、分配金再投資1口当たり純資産価格は受益証券1口当たり純資産価格と等しくなります。
- ・ファンドの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における分配金再投資1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が営業日でない場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ・ファンドの年間騰落率は、ファンドの参照通貨建てで計算されており、円貨に為替換算されておりません。したがって、円貨に為替換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。
- ・代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ・ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。
- ・ファンドは、代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

・代表的な資産クラスを表す指数

日本株……………TOPIX(配当込み)
先進国株……………FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)
新興国株……………S&P新興国総合指数
日本国債……………BBGバークレイズE1年超日本国債指数
先進国債……………FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)
新興国債……………FTSE新興国市場国債指数(円ベース)

(注1)S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

(注2)2021年8月24日付で、BBGバークレイズE1年超日本国債指数は、ブルームバークE1年超日本国債指数に名称を変更します。

（後略）

<訂正後>

（前略）

（ご注意）

- ・分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。ただし、ファンドについては分配金の支払実績はないため、分配金再投資1口当たり純資産価格は受益証券1口当たり純資産価格と等しくなります。
- ・ファンドの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における分配金再投資1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が営業日でない場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ・ファンドの年間騰落率は、ファンドの参照通貨建てで計算されており、円貨に為替換算されておりません。したがって、円貨に為替換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。
- ・代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。(月末が休日の場合は直前の営業日を月末とみなします。)
- ・ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。
- ・ファンドは、代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

・代表的な資産クラスを表す指数

日本株……………TOPIX(配当込み)
先進国株……………FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)
新興国株……………S&P新興国総合指数
日本国債……………ブルームバークE1年超日本国債指数
先進国債……………FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)
新興国債……………FTSE新興国市場国債指数(円ベース)

(注)S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

（後略）

5 運用状況

(3) 運用実績

< 参考情報 >

< 訂正前 >

※ファンドの運用実績は2021年5月末現在のものであり、将来の運用成果等を保証または示唆するものではありません。
 ※金額および比率を表示する場合には、四捨五入して記入しております。したがって、合計の数値が一致しない場合があります。

■ ミドルクラス

純資産の推移 (2015年10月29日(運用開始日)～2021年5月末日)

1口当たり純資産価格(米ドル)	10.82
純資産総額(百万米ドル)	8.69



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは1か月物米ドルLIBORインデックス

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格(分配前の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10米ドル))

*2015年10月29日(運用開始日)～2016年10月31日

■ ユーロクラス

純資産の推移 (2015年10月29日(運用開始日)～2021年5月末日)

1口当たり純資産価格(ユーロ)	9.68
純資産総額(百万ユーロ)	0.35



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは1か月物ユーロLIBORインデックス

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格(分配前の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10ユーロ))

*2015年10月29日(運用開始日)～2016年10月31日

円クラス

純資産の推移 (2015年10月29日(運用開始日)～2021年5月末日)

1口当たり純資産価格(円)	9.868
純資産総額(億円)	12.97



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは1か月物日本円LIBORインデックス

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格(分配前の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10,000円))

*2015年10月29日(運用開始日)～2016年10月31日

(後略)

<訂正後>

※ファンドの運用実績は2021年5月末現在のものであり、将来の運用成果等を保証または示唆するものではありません。
 ※金額および比率を表示する場合には、四捨五入して記入しております。したがって、合計の数値が一致しない場合があります。

■米ドルクラス

純資産の推移（2015年10月29日（運用開始日）～2021年5月末日）

1口当たり純資産価格（米ドル）	10.82
純資産総額（百万米ドル）	8.69



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは1か月物米ドルLIBORインデックス

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格 (該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格 (分配額の額) (第1会計年度については、1口当たり当初発行価格 (10米ドル))

*2015年10月29日 (運用開始日)～2016年10月31日

■ユーロクラス

純資産の推移（2015年10月29日（運用開始日）～2021年5月末日）

1口当たり純資産価格（ユーロ）	9.68
純資産総額（百万ユーロ）	0.35



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは2021年10月28日まで「1か月物ユーロLIBORインデックス」でしたが、2021年10月29日から「ICE BofA ESTR オーバーナイトレートインデックス」に変更されました。

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格 (該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格 (分配額の額) (第1会計年度については、1口当たり当初発行価格 (10ユーロ))

*2015年10月29日 (運用開始日)～2016年10月31日

円クラス

純資産の推移 (2015年10月29日(運用開始日)～2021年5月末日)

1口当たり純資産価格(円)	9,868
純資産総額(億円)	12.97



分配の推移

該当ありません。

収益率の推移



(注1) ベンチマークは2021年10月28日まで「1か月物日本円LIBORインデックス」でしたが、2021年10月29日から「ICE BofA TONAR オーバーナイトレートインデックス」に変更されました。

(注2) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 会計年度末の1口当たりの純資産価格(該当会計年度の分配金の合計金額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たりの純資産価格(分配前の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10,000円))

*2015年10月29日(運用開始日)～2016年10月31日

(後略)