

○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/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・米国社債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米国社債の投資適格銘柄に実質的に投資を行い、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・外貨建資産およびマザーファンド組入れに伴う実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。 	
主要運用対象	ベビード ファンド	米国社債インデックス・マザー ファンド受益証券
	マザー ファンド	米国社債の投資適格銘柄
組入制限	ベビード ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 ・米国社債への実質投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザー ファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・米国社債への投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等の範囲内とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

ステート・ストリート 米国社債インデックス・オープン2

第3期 運用報告書(全体版)
(決算日 2022年1月11日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申しあげます。
この度、「ステート・ストリート米国社債インデックス・オープン2」は、2022年1月11日に第3期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間(営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番地1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎設定以来の運用実績

決算期	基準価額			<ベンチマーク> ブルームバーグ 米国社債(1-10年) インデックス (円ベース)	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率				
(設定日) '19年1月28日	円 10,000	円 -	% -	10,000	% -	% -	百万円 9
1期('20年1月10日)	10,825	0	8.3	10,901	9.0	98.8	513
2期('21年1月12日)	10,977	0	1.4	11,059	1.5	98.8	574
3期('22年1月11日)	11,940	0	8.8	12,052	9.0	98.7	981

(注1) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注2) 先物比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

※ ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		<ベンチマーク> ブルームバーグ 米国社債(1-10年) インデックス(円ベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) '21年 1月 12日	円 10,977	% -	11,059	% -	% 98.8	% -
1 月末	11,032	0.5	11,115	0.5	98.9	-
2 月末	11,094	1.1	11,157	0.9	99.1	-
3 月末	11,472	4.5	11,555	4.5	98.7	-
4 月末	11,377	3.6	11,451	3.5	98.8	-
5 月末	11,532	5.1	11,613	5.0	98.7	-
6 月末	11,657	6.2	11,736	6.1	98.8	-
7 月末	11,620	5.9	11,705	5.8	98.9	-
8 月末	11,652	6.1	11,747	6.2	98.2	-
9 月末	11,792	7.4	11,896	7.6	98.5	-
10 月末	11,914	8.5	12,017	8.7	98.9	-
11 月末	11,876	8.2	11,990	8.4	98.2	-
12 月末	12,017	9.5	12,134	9.7	98.9	-
(期 末) '22年 1月 11日	11,940	8.8	12,052	9.0	98.7	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

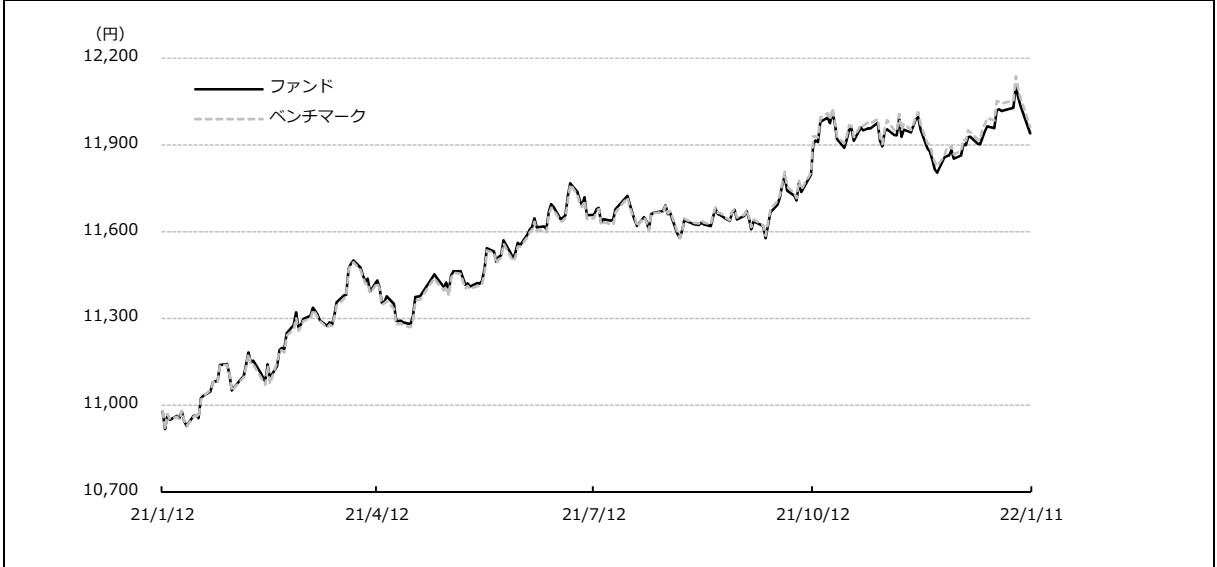
(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

※ ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

当期の運用実績

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、前期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化しています。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第3期	10,977円	11,940円	0円	+8.8%	+9.0%

当期末の基準価額は11,940円となり、前期末の10,977円に比べて963円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 期前半、堅調な米国経済指標が散見される中、米追加経済対策や新型コロナウイルスのワクチン接種進展に対する期待を背景にリスク許容度が改善し、日本円が主要通貨全般に対して円安となったことが基準価額にプラス寄与となりました。
- 期後半、米インフレ指標の上昇がみられる中、米国の金融緩和策の段階的縮小(テーパリング)や早期利上げ期待を背景に米ドル高が主導する形で円安が進行し、基準価額にプラス寄与となりました。
- 国債を上回る社債利回りがインカム要因として収益向上に働き、基準価額の上昇に寄与しました。

【マイナスの要因】

- 米インフレ指標の上昇や米連邦公開市場委員会(FOMC)における資産購入の縮小が早期に着手される可能性の示唆や利上げの開始時期の前倒しの示唆などを背景に米国債が売られ、基準価額の下落に寄与しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+8.8%となり、ベンチマークの騰落率(+9.0%)を0.2%下回りました。
主な要因は以下の通りです。

【プラスの要因】

- 当ファンドから投資しているマザーファンドにおいては、ポートフォリオの金利とクレジットのリスクをベンチマークと同等に管理しながら、幅広い発行体に高度に分散した銘柄群により、ベンチマークと同様に米国社債市場のリターンを安定的に享受することに成功しました。

【マイナスの要因】

- 信託報酬等の費用控除が主要なマイナス要因となりました。

収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、見送りとしております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

投資環境

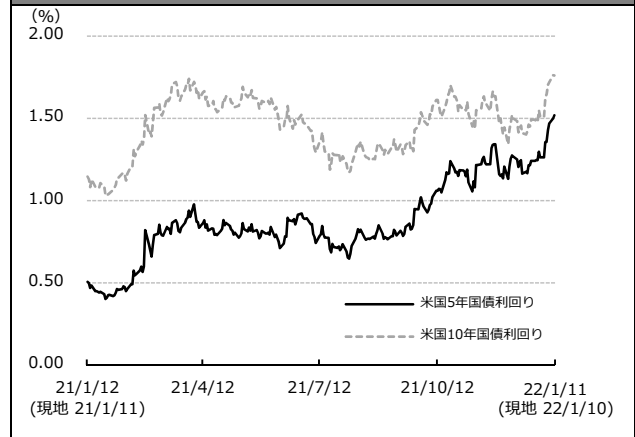
(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

米国債券市場

当期の米国債券市場は、期前半は、新型コロナウイルスのワクチン普及や大規模な経済対策案を受けて景気回復期待が高まったことや米消費者物価指数(CPI)の上昇、およびFOMCで資産購入の縮小が早期に着手される可能性が示唆されたことが債券の売り材料となりました。期後半は、9月、FOMCにて政策金利見通しの分布から利上げの開始時期の前倒しが示唆されるなど米連邦準備制度理事会(FRB)のタカ派的な姿勢を背景に債券が売られました。その後、米インフレ指標の上昇が続いたことからインフレに対する警戒感が広がり、債券が軟調となりました。前期末の2021年1月12日(現地1月11日)に0.51%だった米国5年債利回りは、当期末の2022年1月11日(現地1月10日)には1.52%へと上昇しました(債券価格は下落)。また、同期間の米国10年債利回りは、1.15%から1.76%まで上昇しました(債券価格は下落)。

米国の社債市場は、期前半、ワクチン開発の進展や経済ファンダメンタルズが堅調であること、社債の需給環境が引き続き良好であることなどが社債市場の下支え要因となりました。期後半は、インフレ指標の大幅上昇からFRBのタカ派傾向が意識されたことに加え、変異株「オミクロン」の出現がリスク回避傾向を高めクレジットスプレッドが拡大する結果となりました。ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックスの平均スプレッドは、前期末2021年1月12日(現地1月11日)の0.67%から当期末の2022年1月11日(現地1月10日)には0.70%まで拡大(債券価格にマイナス寄与)しました。クレジットスプレッドは拡大しましたが、国債を上回る相対的に魅力的な社債利回りがインカム要因として引き続き収益向上に働き、ファンドの基準価額(分配金再投資)の上昇要因となりました。

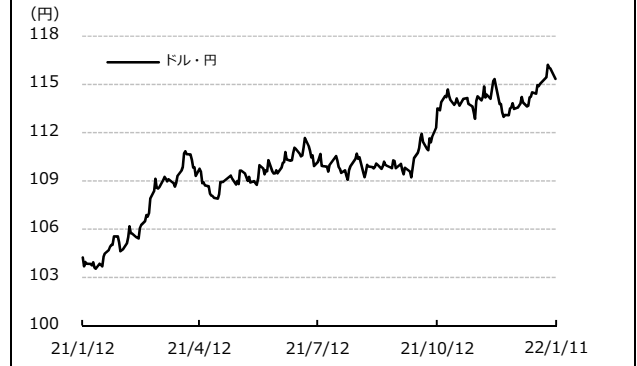
米国国債利回りの推移



為替市況

ドル・円レートは、期前半、堅調な米国経済指標が散見される中、米追加経済対策やワクチン接種進展に対する期待を背景にリスク許容度が改善し、日本円が主要通貨全般に対して下落しました。期後半は、米インフレ指標の上昇がみられる中、米国の金融緩和策の段階的縮小や早期利上げ期待を背景に米ドル高が主導する形で円安が進行しました。ドル・円相場は、前期末の104円台から円安となり、2022年1月11日には115円台となりました。

ドル・円相場の推移



運用の概況

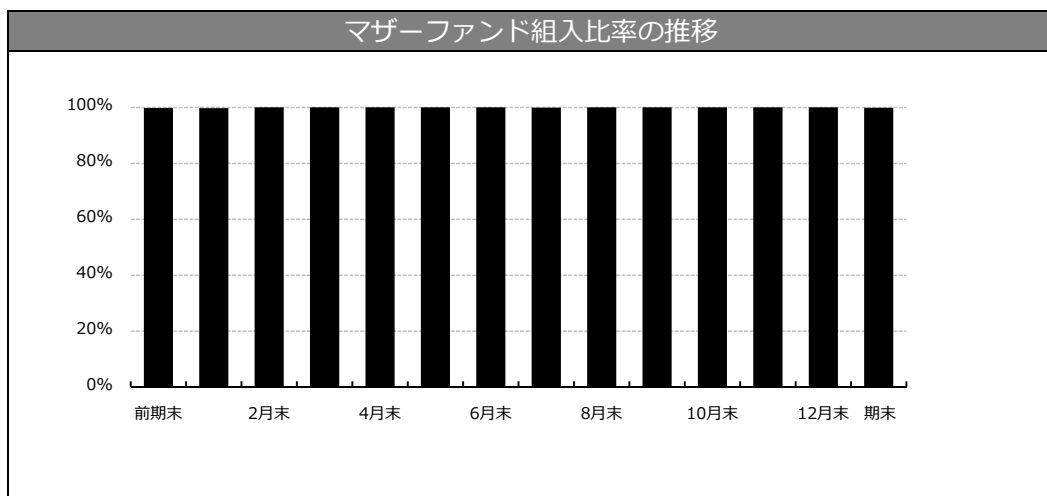
(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

当ファンドは「米国社債インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ち、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

マザーファンドは、米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とし、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行うことを基本的な運用方針としています。米国社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

マザーファンドの組入状況

当期も、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。



今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、主として米国社債の投資適格銘柄に投資することにより、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万円(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2021年1月13日~2022年1月11日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	11,586円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	34円	0.296%	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(29)	(0.252)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、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)	(4)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	3	0.029	(b)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)	(2)	(0.018)	・保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.011)	・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	・その他は、金銭信託手数料及びLEI支払手数料
合 計	37円	0.325%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万円当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

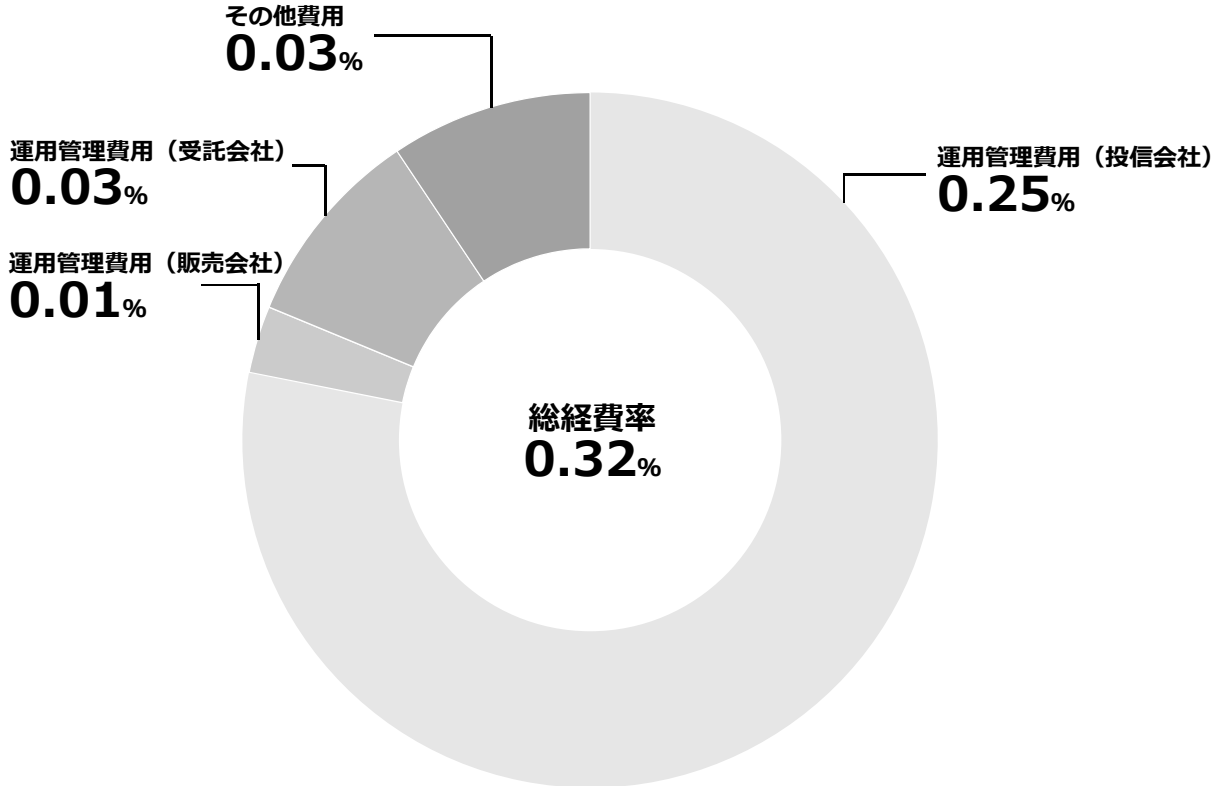
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及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**総経費率(年率)**は**0.32%**です。



(注1) 費用は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す。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎売買および取引の状況('21年1月13日から'22年1月11日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米国社債インデックス・マザーファンド	千口 295,878	千円 624,391	千口 132,230	千円 261,320

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('21年1月13日から'22年1月11日まで)

○公社債(米国社債インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
HSBC HOLDINGS PLC 2.871% 32/11/22(アメリカ)	115,665	BANK OF AMERICA CORP 3.004% 23/12/20(アメリカ)	139,769
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383% 32/7/21(アメリカ)	79,864	CITIGROUP INC 3.106% 26/4/8(アメリカ)	86,491
BROADCOM INC 2.45% 31/2/15(アメリカ)	53,423	WELLS FARGO 3.069% 23/1/24(アメリカ)	85,189
NATWEST GROUP PLC 4.892% 29/5/18(アメリカ)	49,860	APPLE INC 3.2% 25/5/13(アメリカ)	82,458
BOEING CO 2.196% 26/2/4(アメリカ)	47,873	CRED SUIS GP FUN LTD 3.8% 23/6/9(アメリカ)	74,213
WELLS FARGO & COMPANY 3.584% 28/5/22(アメリカ)	47,645	CVS HEALTH CORP 4.3% 28/3/25(アメリカ)	73,653
WALMART INC 1.5% 28/9/22(アメリカ)	44,575	BROADCOM INC 2.45% 31/2/15(アメリカ)	63,852
JPMORGAN CHASE & CO 0.969% 25/6/23(アメリカ)	44,232	NATWEST GROUP PLC 6% 23/12/19(アメリカ)	61,673
BANK OF AMERICA CORP 2.687% 32/4/22(アメリカ)	39,327	COMCAST CORP 3.6% 24/3/1(アメリカ)	60,397
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 24/7/8(アメリカ)	35,862	FEDEX CORP 3.2% 25/2/1(アメリカ)	60,226

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)で、各月末(決算日の属する月については決算日)のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('21年1月13日から'22年1月11日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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。

◎自社による当ファンドの設定・解約状況

当期設定元本	当期解約元本	当期末残高(元本)	取引の理由
千円 -	千円 -	千円 9,990	当初設定時における取得

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎組入資産の明細('22年1月11日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
米国社債インデックス・マザーファンド	千口 290,994	千口 454,641	千円 979,797	千円 979,797

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における米国社債インデックス・マザーファンド全体の口数は9,396,783千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('22年1月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国社債インデックス・マザーファンド	千円 979,797	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,421	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	987,218	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=115.34円です。

(注2) 米国社債インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(20,219,533千円)の投資信託財産総額(20,280,525千円)に対する比率は99.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('22年1月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	987,218,852
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,119,921
米 国 社 債 イ ン デ ッ ク ス ・	
マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	979,797,931
未 収 入 金	1,301,000
(B)負 債	5,980,305
未 払 解 約 金	4,746,042
未 払 信 託 報 酬	1,190,222
未 払 利 息	15
そ の 他 未 払 費 用	44,026
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	981,238,547
元 本	821,794,902
次 期 繰 越 損 益 金	159,443,645
(D)受 益 権 総 口 数	821,794,902口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	11,940円

(注) 期首元本額 523,823,919円
 期中追加設定元本額 648,908,607円
 期中一部解約元本額 350,937,624円

◎損益の状況

当期 (自'21年1月13日 至'22年1月11日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	△ 1,403
支 払 利 息	△ 1,403
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	38,656,354
売 買 損 益	44,527,334
売 買 損 益	△ 5,870,980
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,851,376
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	36,803,575
(E)前 期 繰 越 損 益 金	6,902,174
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	115,737,896
(配 当 等 相 当 額)	(51,243,028)
(売 買 損 益 相 当 額)	(64,494,868)
(G)計 算 (D + E + F)	159,443,645
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	159,443,645
追 加 信 託 差 損 益 金	115,737,896
(配 当 等 相 当 額)	(53,108,091)
(売 買 損 益 相 当 額)	(62,629,805)
分 配 準 備 積 立 金	43,705,749

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	17,476,488円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	14,577,489円
C	収益調整金	115,737,896円
D	分配準備積立金	11,651,772円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	159,443,645円
F	分配対象収益 (1万口当たり)	1,940円
G	分配金	0円
H	分配金 (1万口当たり)	0円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第3期 (2021年1月13日～ 2022年1月11日)
当期分配金	- 円
(対基準価額比率)	- %
当期の収益	- 円
当期の収益以外	- 円
翌期繰越分配対象額	1,940 円

- (注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

米国社債インデックス・マザーファンド

第 12 期 運用報告書 (決算日 2021 年 3 月 5 日)

米国社債インデックス・マザーファンドの
第 12 期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ・ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・米国社債への投資は原則として高位を維持します。 ・外資建資産については原則として為替ヘッジを行いません。
主 要 運 用 対 象	米国社債の投資適格銘柄
組 入 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ・米国社債への投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外資建資産への投資割合には制限を設けません。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目 23 番地 1 号 虎ノ門ヒルズ森タワー 25 階

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		<ベンチマーク> ブルームバーグ・ バークレイズ米国社債 (1-10年)インデックス (円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率		期中 騰落率			
8期('17年3月6日)	17,663	3.9	17,737	4.0	98.1	-	百万円 31,897
9期('18年3月5日)	16,632	△ 5.8	16,701	△ 5.8	98.7	-	31,125
10期('19年3月5日)	18,291	10.0	18,360	9.9	98.6	-	33,532
11期('20年3月5日)	19,595	7.1	19,618	6.9	98.9	-	26,047
12期('21年3月5日)	20,212	3.1	20,152	2.7	98.8	-	22,604

(注1) ベンチマークは、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、ファンド設定日の翌営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

※ブルームバーグ・バークレイズの各指数における、ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		<ベンチマーク> ブルームバーグ・ バークレイズ米国社債 (1-10年)インデックス (円ベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
'20年 3月 5日	19,595	-	19,618	-	98.9	-
3月末	18,479	△ 5.7	18,519	△ 5.6	100.0	-
4月末	18,994	△ 3.1	19,006	△ 3.1	99.1	-
5月末	19,438	△ 0.8	19,445	△ 0.9	99.2	-
6月末	19,867	1.4	19,835	1.1	99.0	-
7月末	19,571	△ 0.1	19,544	△ 0.4	98.9	-
8月末	19,698	0.5	19,671	0.3	98.6	-
9月末	19,783	1.0	19,759	0.7	98.4	-
10月末	19,580	△ 0.1	19,550	△ 0.3	98.7	-
11月末	19,651	0.3	19,613	△ 0.0	98.9	-
12月末	19,664	0.4	19,633	0.1	98.6	-
'21年 1月末	19,818	1.1	19,778	0.8	99.1	-
2月末	19,933	1.7	19,853	1.2	99.1	-
(期 末)						
'21年 3月 5日	20,212	3.1	20,152	2.7	98.8	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、ファンド設定日の翌営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

※ブルームバーグ・バークレイズの各指数における、ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

当期の運用実績

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

※ブルームバーグ・バークレイズの各指数における、ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。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。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

当期末の基準価額は20,212円となり、前期末の19,595円に比べて617円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 米連邦準備制度理事会(FRB)による利下げ、新型コロナウイルスによる世界経済への影響の懸念などが米国債の買い材料となり、ベース金利である米国債利回りが低下したことが社債価格の上昇につながりました。
- 国債を上回る相対的に魅力的な社債利回りがインカム要因として収益向上要因となったことに加え、FRBによる社債買入れが市場の安定化に寄与し基準価額の上昇につながりました。

【マイナスの要因】

- 新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり、2020年末まで円高基調が継続したことが基準価額にマイナス寄与となりました。
- カストディフィー(保管費用等)などの費用控除がわずかにマイナスに影響しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+3.1%となり、ベンチマークの騰落率(+2.7%)を0.4%上回りました。ポートフォリオの金利とクレジットのリスクをベンチマークと同等に管理しながら幅広い発行体に高度に分散した銘柄群により、ベンチマークと同様に米国社債市場のリターンを安定的に享受することに成功しました。

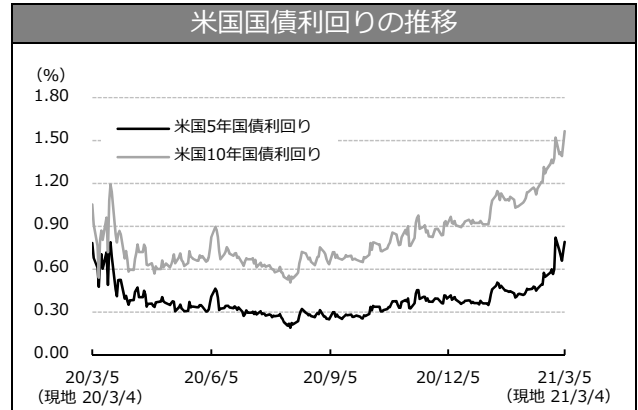
投資環境

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

米国債券市場

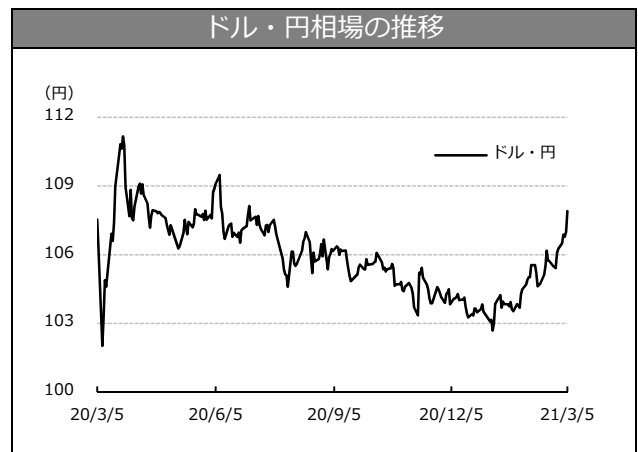
当期の米国の国債市場は、期前半、新型コロナウイルスが経済へ与える影響が懸念されたことが債券の買い材料となりました。FRBは2020年3月に2回の利下げを実施し、月間で合計1.50%の利下げを行いました。期後半に入ると雇用統計をはじめとする経済指標に底堅さが見られたことや新型コロナウイルスに対するワクチン開発の進展を背景に債券が売られました。期末にかけては財政支出の拡大見通しが債券のさらなる売り材料となりました。結果として、前期末の2020年3月5日(現地3月4日)に0.78%だった米国5年債利回りは、当期末の2021年3月5日(現地3月4日)には0.79%に小幅上昇となりました(債券価格はマイナス)。また、同期間の米国10年債利回りは、1.05%から1.56%まで上昇しました(債券価格はマイナス)。

米国の社債市場は、期前半、新型コロナウイルスによる世界経済への影響が懸念され社債スプレッドが拡大しましたが、その後はFRBが社債の買入れを開始したことがクレジットスプレッドの縮小に寄与しました。期後半はFRBによる緩和姿勢の継続と新型コロナウイルスに対するワクチン開発の進展が投資家のセンチメント改善につながり社債スプレッドが縮小する展開となりました。ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックスの平均スプレッドは、前期末の0.97%から当期末には0.68%まで縮小(債券価格にプラス)しました。



為替市況

ドル・円レートは、期前半、新型コロナウイルスを巡る懸念を背景に日本円が急上昇し、2020年3月上旬には102円台まで円高が進みましたが、その後は急速な円高が調整となりました。期後半は新型コロナウイルスの影響による世界的な景気後退懸念が強まり円高基調が継続しました。期末にかけては米国債利回りが上昇する中で米ドルが堅調となりました。結果として、前期末の2020年3月5日に107円台だった相場は、当期末の2021年3月5日には107円台となり、概ね同水準で期末を迎えました。



運用の概況

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

当マザーファンドは、米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とし、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行うことを基本的な運用方針としています。米国社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

当期は、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)の収益率を捉える目的で、層化抽出法の発想に従ってファンドの社債業種配分や格付け配分、発行体比率、デュレーション(金利感応度)、債券満期構成などをベンチマークに合致させるように努めつつ、原則としてインデックスを構成する社債に幅広く分散投資しました。インデックスの構成銘柄変更のタイミングに合わせて、各月末にファンドのリスク特性をベンチマークに合わせるべくリバランス(銘柄の入れ替え)を行うとともに、ファンドで受け取った利金の再投資も行いました。また、債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

今後の運用方針

今後も引き続き、主として米国社債の投資適格銘柄に投資することにより、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2020年3月6日~2021年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	19,539円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用	3円	0.018%	(a)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)	(3)	(0.018)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、LEI 支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	3円	0.018%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('20年3月6日から'21年3月5日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
外国	アメリカ	千米ドル 811	千米ドル 811
		141,650	173,299 (37)
	国債証券		
	普通社債券(含む投資法人債券)		

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

◎主要な売買銘柄('20年3月6日から'21年3月5日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
ORACLE CORP 2.8% 27/4/1(アメリカ)	108,026	US TREASURY N/B 1.5% 30/2/15(アメリカ)	87,294
US TREASURY N/B 1.5% 30/2/15(アメリカ)	87,247	CITIGROUP INC 3.106% 25/4/8(アメリカ)	86,491
T-MOBILE USA INC 3.75% 27/4/15(アメリカ)	86,290	WELLS FARGO & COMPANY 3.069% 23/1/24(アメリカ)	83,027
EXXON MOBIL CORPORATION 1.571% 23/4/15(アメリカ)	86,026	AMERICAN EXPRESS CO 3.4% 23/2/27(アメリカ)	78,099
CITIGROUP INC 3.106% 25/4/8(アメリカ)	84,045	CREDIT SUISSE GROUP AG 3.8% 23/6/9(アメリカ)	74,213
GENERAL DYNAMICS CORP 3.25% 25/4/1(アメリカ)	75,104	DUKE ENERGY CORP 2.65% 26/9/1(アメリカ)	74,084
BROADCOM INC 2.45% 31/2/15(アメリカ)	72,922	METLIFE INC 4.55% 30/3/23(アメリカ)	72,025
BANK OF AMERICA CORP 3.004% 22/12/20(アメリカ)	71,773	MICROSOFT CORP 3.125% 25/11/3(アメリカ)	70,943
METLIFE INC 4.55% 30/3/23(アメリカ)	69,927	GILEAD SCIENCES INC 3.65% 26/3/1(アメリカ)	65,850
BROADCOM INC 4.25% 26/4/15(アメリカ)	65,268	CITIGROUP INC 2.9% 21/12/8(アメリカ)	64,423

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれていません)で、各月末(決算日の属する月については決算日)のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('20年3月6日から'21年3月5日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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。

◎組入資産の明細('21年3月5日現在)

○外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年 以上	2年 以上	2年 未満
ア メ リ カ	千米ドル 192,854	千米ドル 206,988	千円 22,334,016	% 98.8	% -	% 49.4	% 36.6	% 12.6
合 計	192,854	206,988	22,334,016	98.8	-	49.4	36.6	12.6

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する邦貨換算金額(評価額)の比率です。

(注3) 格付については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 金額の単位未満は切り捨てています。

○外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
3M COMPANY	普通社債券	3.0	150	163	17,609	2025/ 8/ 7
3M COMPANY	普通社債券	2.0	100	104	11,249	2025/ 2/14
3M COMPANY	普通社債券	3.05	200	215	23,295	2030/ 4/15
ABB FINANCE USA INC	普通社債券	2.875	250	257	27,760	2022/ 5/ 8
ABBOTT LABORATORIES	普通社債券	3.75	100	113	12,214	2026/11/30
ABBVIE INC	普通社債券	3.2	200	216	23,320	2026/ 5/14
ABBVIE INC	普通社債券	3.25	500	518	55,920	2022/10/ 1
ABBVIE INC	普通社債券	2.3	395	407	43,946	2022/11/21
ABBVIE INC	普通社債券	3.8	300	329	35,537	2025/ 3/15
ABBVIE INC	普通社債券	3.6	100	109	11,808	2025/ 5/14
ABBVIE INC	普通社債券	2.95	145	155	16,764	2026/11/21
ABBVIE INC	普通社債券	4.25	200	230	24,837	2028/11/14
AEP TRANSMISSION CO LLC	普通社債券	3.1	50	54	5,908	2026/12/ 1
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	普通社債券	4.875	150	163	17,664	2024/ 1/16
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	普通社債券	3.15	150	157	16,949	2024/ 2/15
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	普通社債券	2.875	150	156	16,842	2024/ 8/14
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	普通社債券	3.65	150	157	17,045	2027/ 7/21
AETNA INC	普通社債券	2.75	100	103	11,149	2022/11/15
AFFILIATED MANAGERS GROU	普通社債券	3.3	70	73	7,947	2030/ 6/15
AFLAC INC	普通社債券	3.25	100	108	11,667	2025/ 3/17
AFLAC INC	普通社債券	1.125	40	39	4,304	2026/ 3/15
AFLAC INC	普通社債券	2.875	50	54	5,831	2026/10/15
AFLAC INC	普通社債券	3.6	65	72	7,798	2030/ 4/ 1
AGILENT TECHNOLOGIES INC	普通社債券	3.05	65	70	7,603	2026/ 9/22
AGILENT TECHNOLOGIES INC	普通社債券	2.1	60	58	6,363	2030/ 6/ 4
AGILENT TECHNOLOGIES INC	普通社債券	2.3	100	98	10,647	2031/ 3/12
AIR LEASE CORP	普通社債券	2.75	250	258	27,893	2023/ 1/15
AIR LEASE CORP	普通社債券	2.3	150	153	16,523	2025/ 2/ 1
AIR LEASE CORP	普通社債券	3.625	150	158	17,143	2027/12/ 1
AIR LEASE CORP	普通社債券	3.125	100	98	10,636	2030/12/ 1
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	普通社債券	2.05	35	35	3,784	2030/ 5/15
AIRCASTLE LTD	普通社債券	5.0	50	53	5,768	2023/ 4/ 1
AIRCASTLE LTD	普通社債券	4.125	50	52	5,679	2024/ 5/ 1
AIRCASTLE LTD	普通社債券	4.25	65	68	7,394	2026/ 6/15
ALABAMA POWER CO	普通社債券	2.45	100	102	11,021	2022/ 3/30
ALEXANDRIA REAL ESTATE E	普通社債券	3.45	100	109	11,766	2025/ 4/30
ALEXANDRIA REAL ESTATE E	普通社債券	3.95	100	112	12,143	2028/ 1/15
ALIBABA GROUP HOLDING	普通社債券	3.6	100	108	11,727	2024/11/28

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
ALIBABA GROUP HOLDING	普通社債券	3.4	200	217	23,519	2027/12/ 6
ALLEGION US HOLDING CO	普通社債券	3.2	50	53	5,751	2024/10/ 1
ALLEGION US HOLDING CO	普通社債券	3.55	50	54	5,831	2027/10/ 1
ALLIED WORLD ASSURANCE	普通社債券	4.35	50	53	5,823	2025/10/29
ALLSTATE CORP	普通社債券	3.15	100	106	11,457	2023/ 6/15
ALLSTATE CORP	普通社債券	5.75	100	107	11,555	2023/ 8/15
ALLY FINANCIAL INC	普通社債券	3.875	250	271	29,297	2024/ 5/21
ALPHABET INC	普通社債券	0.8	150	144	15,643	2027/ 8/15
ALPHABET INC	普通社債券	1.1	130	120	13,039	2030/ 8/15
ALTRIA GROUP INC	普通社債券	2.35	40	41	4,500	2025/ 5/ 6
ALTRIA GROUP INC	普通社債券	4.4	156	176	19,051	2026/ 2/14
ALTRIA GROUP INC	普通社債券	4.8	150	173	18,769	2029/ 2/14
ALTRIA GROUP INC	普通社債券	3.4	25	26	2,849	2030/ 5/ 6
AMAZON.COM INC	普通社債券	5.2	50	59	6,377	2025/12/ 3
AMAZON.COM INC	普通社債券	2.4	250	259	28,038	2023/ 2/22
AMAZON.COM INC	普通社債券	1.2	200	197	21,322	2027/ 6/ 3
AMAZON.COM INC	普通社債券	3.15	100	110	11,894	2027/ 8/22
AMEREN CORP	普通社債券	3.65	100	110	11,898	2026/ 2/15
AMEREN ILLINOIS CO	普通社債券	2.7	100	102	11,099	2022/ 9/ 1
AMERICA MOVIL SAB DE CV	普通社債券	2.875	200	208	22,448	2030/ 5/ 7
AMERICAN CAMPUS CMNTYS	普通社債券	2.85	100	102	11,034	2030/ 2/ 1
AMERICAN ELECTRIC POWER	普通社債券	2.95	150	155	16,747	2022/12/15
AMERICAN ELECTRIC POWER	普通社債券	0.75	20	20	2,161	2023/11/ 1
AMERICAN EXPRESS CO	普通社債券	2.75	200	205	22,160	2022/ 5/20
AMERICAN EXPRESS CO	普通社債券	3.0	100	107	11,625	2024/10/30
AMERICAN EXPRESS CO	普通社債券	3.625	350	384	41,533	2024/12/ 5
AMERICAN EXPRESS CO	普通社債券	4.2	105	119	12,889	2025/11/ 6
AMERICAN FINANCIAL GROUP	普通社債券	3.5	50	54	5,905	2026/ 8/15
AMERICAN HOMES 4 RENT	普通社債券	4.25	150	166	17,980	2028/ 2/15
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	1.95	30	30	3,301	2022/ 5/20
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	0.4	200	200	21,593	2022/10/21
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	1.95	100	103	11,147	2023/ 5/10
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	0.875	65	65	7,088	2023/ 7/ 7
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	0.65	100	100	10,836	2023/ 9/ 8
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	3.625	75	81	8,750	2023/10/10
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	2.9	200	213	23,062	2024/ 2/16
AMERICAN HONDA FINANCE	普通社債券	3.5	100	111	12,006	2028/ 2/15
AMERICAN INTL GROUP	普通社債券	2.5	100	105	11,372	2025/ 6/30
AMERICAN INTL GROUP	普通社債券	4.2	75	85	9,205	2028/ 4/ 1

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
AMERICAN INTL GROUP	普通社債券	3.4	200	216	23,366	2030/ 6/30
AMERICAN INTL GROUP	普通社債券	5.75	100	113	12,274	2028/ 4/ 1
AMERICAN TOWER CORP	普通社債券	3.0	150	158	17,078	2023/ 6/15
AMERICAN TOWER CORP	普通社債券	5.0	100	112	12,088	2024/ 2/15
AMERICAN TOWER CORP	普通社債券	1.5	100	96	10,427	2028/ 1/31
AMERICAN TOWER CORP	普通社債券	3.95	300	332	35,880	2029/ 3/15
AMERICAN TOWER CORP	普通社債券	2.9	50	51	5,559	2030/ 1/15
AMERICAN WATER CAPITAL C	普通社債券	3.4	100	108	11,755	2025/ 3/ 1
AMERICAN WATER CAPITAL C	普通社債券	3.75	100	112	12,101	2028/ 9/ 1
AMERIPRISE FINANCIAL INC	普通社債券	4.0	150	163	17,660	2023/10/15
AMERISOURCEBERGEN CORP	普通社債券	3.45	100	110	11,908	2027/12/15
AMERISOURCEBERGEN CORP	普通社債券	2.8	100	103	11,180	2030/ 5/15
AMGEN INC	普通社債券	2.65	50	51	5,527	2022/ 5/11
AMGEN INC	普通社債券	3.625	150	154	16,641	2022/ 5/15
AMGEN INC	普通社債券	2.25	100	103	11,219	2023/ 8/19
AMGEN INC	普通社債券	1.9	65	67	7,258	2025/ 2/21
AMGEN INC	普通社債券	2.2	170	176	19,022	2027/ 2/21
AMPHENOL CORP	普通社債券	2.05	100	103	11,185	2025/ 3/ 1
ANGLOGOLD HOLDINGS PLC	普通社債券	3.75	200	208	22,530	2030/10/ 1
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	普通社債券	4.75	750	872	94,177	2029/ 1/23
ANTHEM INC	普通社債券	2.95	250	260	28,092	2022/12/ 1
ANTHEM INC	普通社債券	3.65	100	112	12,091	2027/12/ 1
ANTHEM INC	普通社債券	2.25	135	133	14,413	2030/ 5/15
AON CORP	普通社債券	2.8	200	207	22,422	2030/ 5/15
APPALACHIAN POWER CO	普通社債券	3.3	100	108	11,732	2027/ 6/ 1
APPLE INC	普通社債券	2.3	350	357	38,621	2022/ 5/11
APPLE INC	普通社債券	1.7	60	61	6,613	2022/ 9/11
APPLE INC	普通社債券	2.1	150	153	16,595	2022/ 9/12
APPLE INC	普通社債券	2.4	100	103	11,195	2023/ 1/13
APPLE INC	普通社債券	2.4	100	104	11,269	2023/ 5/ 3
APPLE INC	普通社債券	3.0	150	160	17,314	2024/ 2/ 9
APPLE INC	普通社債券	3.45	100	109	11,775	2024/ 5/ 6
APPLE INC	普通社債券	1.8	100	104	11,240	2024/ 9/11
APPLE INC	普通社債券	2.75	50	53	5,754	2025/ 1/13
APPLE INC	普通社債券	2.5	100	106	11,441	2025/ 2/ 9
APPLE INC	普通社債券	3.2	200	218	23,550	2025/ 5/13
APPLE INC	普通社債券	0.7	200	196	21,236	2026/ 2/ 8
APPLE INC	普通社債券	3.35	150	166	17,915	2027/ 2/ 9
APPLE INC	普通社債券	3.2	212	233	25,180	2027/ 5/11

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
APPLE INC	普通社債券	2.9	450	489	52,836	2027/ 9/12
APPLE INC	普通社債券	3.0	200	218	23,624	2027/11/13
APPLE INC	普通社債券	1.65	200	193	20,826	2031/ 2/ 8
APPLIED MATERIALS INC	普通社債券	1.75	130	126	13,671	2030/ 6/ 1
ARES CAPITAL CORP	普通社債券	3.875	100	106	11,491	2026/ 1/15
ARIZONA PUBLIC SERVICE	普通社債券	2.95	100	108	11,736	2027/ 9/15
ARROW ELECTRONICS INC	普通社債券	3.5	200	205	22,123	2022/ 4/ 1
ASTRAZENECA PLC	普通社債券	3.375	300	328	35,490	2025/11/16
ASTRAZENECA PLC	普通社債券	1.375	200	185	19,995	2030/ 8/ 6
AT&T INC	普通社債券	2.625	100	103	11,140	2022/12/ 1
AT&T INC	普通社債券	4.45	200	220	23,825	2024/ 4/ 1
AT&T INC	普通社債券	4.25	300	340	36,761	2027/ 3/ 1
AT&T INC	普通社債券	4.1	200	226	24,405	2028/ 2/15
AT&T INC	普通社債券	4.35	470	534	57,673	2029/ 3/ 1
ATHENE HOLDING LTD	普通社債券	4.125	150	163	17,659	2028/ 1/12
ATMOS ENERGY CORP	普通社債券	3.0	65	70	7,574	2027/ 6/15
AUST & NZ BANKING GRP NY	普通社債券	2.625	250	259	27,975	2022/11/ 9
AUTODESK INC	普通社債券	4.375	100	112	12,109	2025/ 6/15
AUTONATION INC	普通社債券	3.5	100	107	11,645	2024/11/15
AUTONATION INC	普通社債券	4.5	20	22	2,413	2025/10/ 1
AUTOZONE INC	普通社債券	3.25	110	118	12,788	2025/ 4/15
AUTOZONE INC	普通社債券	4.0	200	224	24,249	2030/ 4/15
AVALONBAY COMMUNITIES	普通社債券	3.3	65	70	7,593	2029/ 6/ 1
AVALONBAY COMMUNITIES	普通社債券	2.9	50	53	5,811	2026/10/15
AVANGRID INC	普通社債券	3.8	75	83	8,962	2029/ 6/ 1
AVERY DENNISON CORP	普通社債券	4.875	100	118	12,734	2028/12/ 6
EQUITABLE HOLDINGS INC	普通社債券	3.9	65	69	7,497	2023/ 4/20
EQUITABLE HOLDINGS INC	普通社債券	4.35	100	113	12,219	2028/ 4/20
AXIS SPECIALTY FINAN PLC	普通社債券	4.0	100	112	12,186	2027/12/ 6
BAIDU INC	普通社債券	3.875	200	214	23,098	2023/ 9/29
BAIDU INC	普通社債券	3.625	200	220	23,765	2027/ 7/ 6
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL	普通社債券	3.337	150	164	17,704	2027/12/15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	普通社債券	1.125	200	197	21,338	2025/ 9/18
BANCO SANTANDER SA	普通社債券	3.125	200	209	22,635	2023/ 2/23
BANCO SANTANDER SA	普通社債券	2.746	200	211	22,783	2025/ 5/28
BANCO SANTANDER SA	普通社債券	3.8	200	218	23,623	2028/ 2/23
BANCOLOMBIA SA	普通社債券	3.0	200	207	22,402	2025/ 1/29
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	2.816	100	103	11,134	2022/ 7/21
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.004	1,227	1,280	138,189	2022/12/20

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.864	500	538	58,121	2023/ 7/23
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	4.0	100	110	11,896	2025/ 1/22
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.458	450	484	52,327	2024/ 3/15
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.559	500	550	59,399	2026/ 4/23
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	4.183	400	450	48,627	2027/11/25
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.593	150	165	17,904	2027/ 7/21
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.419	783	857	92,552	2027/12/20
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	4.271	400	456	49,295	2028/ 7/23
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.974	250	280	30,289	2029/ 2/ 7
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	3.194	150	159	17,204	2029/ 7/23
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	2.496	150	151	16,312	2030/ 2/13
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	2.592	95	96	10,378	2030/ 4/29
BANK OF AMERICA CORP	普通社債券	1.898	200	190	20,590	2030/ 7/23
BANK OF MONTREAL	普通社債券	2.35	100	103	11,122	2022/ 9/11
BANK OF MONTREAL	普通社債券	3.3	350	376	40,580	2024/ 2/ 5
BANK OF MONTREAL	普通社債券	1.85	200	206	22,273	2025/ 5/ 1
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	2.2	300	312	33,706	2023/ 8/16
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	3.25	100	108	11,755	2024/ 9/11
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	2.45	150	159	17,182	2026/ 8/17
BANK OF NOVA SCOTIA	普通社債券	2.375	50	51	5,593	2023/ 1/18
BANK OF NOVA SCOTIA	普通社債券	0.55	100	100	10,820	2023/ 9/15
BANK OF NOVA SCOTIA	普通社債券	2.2	100	104	11,229	2025/ 2/ 3
BANK OF NOVA SCOTIA	普通社債券	1.05	250	247	26,703	2026/ 3/ 2
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	2.8	100	107	11,641	2026/ 5/ 4
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	3.4	100	110	11,952	2028/ 1/29
BANK OF NY MELLON CORP	普通社債券	3.442	100	111	12,029	2027/ 2/ 7
BANKUNITED INC	普通社債券	5.125	100	114	12,332	2030/ 6/11
BARCLAYS PLC	普通社債券	3.684	250	256	27,671	2023/ 1/10
BARCLAYS PLC	普通社債券	1.007	200	200	21,633	2023/12/10
BARCLAYS PLC	普通社債券	5.2	200	228	24,663	2026/ 5/12
BARCLAYS PLC	普通社債券	4.972	200	233	25,181	2028/ 5/16
BARCLAYS PLC	普通社債券	5.088	300	343	37,070	2029/ 6/20
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	2.789	70	74	8,025	2024/ 9/ 6
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	3.215	100	106	11,533	2026/ 9/ 6
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	4.7	200	227	24,556	2027/ 4/ 2
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	3.557	100	107	11,615	2027/ 8/15
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	2.259	150	148	16,001	2028/ 3/25
BAT CAPITAL CORP	普通社債券	4.906	100	114	12,399	2030/ 4/ 2
BAXALTA INC	普通社債券	4.0	30	33	3,581	2025/ 6/23

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
TRUIST FINANCIAL CORP	普通社債券	2.75	100	102	11,052	2022/ 4/ 1
BEAM SUNTORY INC	普通社債券	3.25	150	153	16,597	2022/ 5/15
BECTON DICKINSON AND CO	普通社債券	3.363	200	215	23,249	2024/ 6/ 6
BECTON DICKINSON AND CO	普通社債券	1.957	65	62	6,753	2031/ 2/11
BEMIS COMPANY INC	普通社債券	2.63	100	101	10,926	2030/ 6/19
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	普通社債券	2.8	165	172	18,561	2023/ 1/15
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	普通社債券	3.75	100	107	11,640	2023/11/15
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	普通社債券	3.25	100	109	11,798	2028/ 4/15
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	普通社債券	3.7	100	111	12,042	2030/ 7/15
BERKSHIRE HATHAWAY FIN	普通社債券	1.45	80	76	8,244	2030/10/15
BERKSHIRE HATHAWAY INC	普通社債券	3.125	200	218	23,540	2026/ 3/15
BERRY GLOBAL INC	普通社債券	1.57	100	99	10,720	2026/ 1/15
BEST BUY CO INC	普通社債券	4.45	100	115	12,436	2028/10/ 1
BIOGEN INC	普通社債券	3.625	55	57	6,223	2022/ 9/15
BIOGEN INC	普通社債券	4.05	100	112	12,117	2025/ 9/15
BIOGEN INC	普通社債券	2.25	35	34	3,734	2030/ 5/ 1
BLACK HILLS CORP	普通社債券	3.95	50	55	5,998	2026/ 1/15
BLACK HILLS CORP	普通社債券	3.05	50	52	5,678	2029/10/15
BLACKROCK INC	普通社債券	3.5	100	109	11,794	2024/ 3/18
BLACKROCK INC	普通社債券	3.2	100	110	11,975	2027/ 3/15
BLACKROCK INC	普通社債券	3.25	60	66	7,123	2029/ 4/30
BLACK FINANCIAL LLC	普通社債券	5.5	100	105	11,386	2022/11/ 1
BOARDWALK PIPELINES LP	普通社債券	4.45	100	112	12,125	2027/ 7/15
BOARDWALK PIPELINES LP	普通社債券	4.8	20	22	2,425	2029/ 5/ 3
BOEING CO	普通社債券	1.875	250	254	27,510	2023/ 6/15
BOEING CO	普通社債券	1.433	165	165	17,813	2024/ 2/ 4
BOEING CO	普通社債券	4.875	445	496	53,583	2025/ 5/ 1
BOEING CO	普通社債券	2.196	450	449	48,550	2026/ 2/ 4
BOEING CO	普通社債券	2.7	145	148	16,043	2027/ 2/ 1
BOEING CO	普通社債券	5.04	100	114	12,393	2027/ 5/ 1
BOEING CO	普通社債券	3.25	50	52	5,631	2028/ 2/ 1
BOEING CO	普通社債券	5.15	250	288	31,156	2030/ 5/ 1
BOOKING HOLDINGS INC	普通社債券	4.5	200	233	25,178	2027/ 4/13
BORGWARNER INC	普通社債券	2.65	50	52	5,701	2027/ 7/ 1
BOSTON PROPERTIES LP	普通社債券	3.4	100	107	11,582	2029/ 6/21
BOSTON PROPERTIES LP	普通社債券	3.2	50	53	5,788	2025/ 1/15
BOSTON PROPERTIES LP	普通社債券	3.65	150	165	17,881	2026/ 2/ 1
BOSTON SCIENTIFIC CORP	普通社債券	3.45	200	215	23,215	2024/ 3/ 1
BOSTON SCIENTIFIC CORP	普通社債券	3.75	100	111	12,009	2026/ 3/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	普通社債券	2.65	100	102	11,053	2030/ 6/ 1
BP CAP MARKETS AMERICA	普通社債券	2.937	100	105	11,358	2023/ 4/ 6
BP CAP MARKETS AMERICA	普通社債券	3.194	100	107	11,643	2025/ 4/ 6
BP CAP MARKETS AMERICA	普通社債券	3.937	200	226	24,385	2028/ 9/21
BP CAP MARKETS AMERICA	普通社債券	4.234	400	458	49,458	2028/11/ 6
BP CAPITAL MARKETS PLC	普通社債券	3.814	100	109	11,785	2024/ 2/10
BP CAPITAL MARKETS PLC	普通社債券	3.279	100	109	11,770	2027/ 9/19
BPCE SA	普通社債券	4.0	250	274	29,622	2024/ 4/15
BRANDYWINE OPER PARTNERS	普通社債券	3.95	100	104	11,308	2023/ 2/15
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN	普通社債券	3.7	150	161	17,402	2027/ 6/22
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	2.6	100	102	11,095	2022/ 5/16
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.55	200	209	22,582	2022/ 8/15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	2.75	100	104	11,277	2023/ 2/15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.25	150	158	17,088	2023/ 2/20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.25	100	107	11,581	2023/11/ 1
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	2.9	64	68	7,426	2024/ 7/26
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.875	48	53	5,789	2025/ 8/15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.25	100	110	11,924	2027/ 2/27
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.45	150	167	18,054	2027/11/15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	3.9	150	170	18,385	2028/ 2/20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	普通社債券	1.45	30	28	3,056	2030/11/13
BRITISH TELECOMMUNICATIO	普通社債券	5.125	350	419	45,227	2028/12/ 4
BRIXMOR OPERATING PART	普通社債券	3.65	100	108	11,678	2024/ 6/15
BRIXMOR OPERATING PART	普通社債券	4.05	100	109	11,808	2030/ 7/ 1
BROADCOM CRP / CAYMN FI	普通社債券	3.5	150	159	17,259	2028/ 1/15
BROADCOM INC	普通社債券	4.25	350	390	42,099	2026/ 4/15
BROADCOM INC	普通社債券	1.95	80	78	8,436	2028/ 2/15
BROADCOM INC	普通社債券	4.11	369	407	43,922	2028/ 9/15
BROADCOM INC	普通社債券	4.75	350	396	42,814	2029/ 4/15
BROADCOM INC	普通社債券	2.45	500	478	51,657	2031/ 2/15
BROADRIDGE FINANCIAL SOL	普通社債券	3.4	100	109	11,795	2026/ 6/27
BROOKFIELD FINANCE INC	普通社債券	4.0	150	164	17,696	2024/ 4/ 1
BROOKFIELD FINANCE INC	普通社債券	3.9	100	111	12,038	2028/ 1/25
BUNGE LTD FINANCE CORP	普通社債券	3.0	55	56	6,141	2022/ 9/25
BUNGE LTD FINANCE CORP	普通社債券	3.75	55	61	6,619	2027/ 9/25
BURLINGTN NORTH SANTA FE	普通社債券	3.05	50	51	5,509	2022/ 3/15
BURLINGTN NORTH SANTA FE	普通社債券	3.0	150	156	16,932	2023/ 3/15
BURLINGTN NORTH SANTA FE	普通社債券	3.25	100	110	11,894	2027/ 6/15
CABOT CORP	普通社債券	3.7	50	51	5,592	2022/ 7/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
CAMDEN PROPERTY TRUST	普通社債券	4.1	45	51	5,514	2028/10/15
CAMPBELL SOUP CO	普通社債券	2.5	100	102	11,099	2022/ 8/ 2
CAMPBELL SOUP CO	普通社債券	3.95	100	110	11,930	2025/ 3/15
CANADIAN IMPERIAL BANK	普通社債券	0.95	100	101	10,901	2023/ 6/23
CANADIAN IMPERIAL BANK	普通社債券	2.606	100	102	11,097	2022/ 7/22
CANADIAN IMPERIAL BANK	普通社債券	0.5	100	99	10,769	2023/12/14
CANADIAN IMPERIAL BANK	普通社債券	3.1	100	107	11,554	2024/ 4/ 2
CANADIAN IMPERIAL BANK	普通社債券	0.95	100	98	10,681	2025/10/23
CANADIAN NATL RAILWAY	普通社債券	2.75	50	53	5,778	2026/ 3/ 1
CANADIAN NATL RESOURCES	普通社債券	2.95	100	103	11,213	2023/ 1/15
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	普通社債券	2.05	155	153	16,599	2030/ 3/ 5
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	普通社債券	3.75	150	164	17,770	2026/ 7/28
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	普通社債券	3.5	400	426	46,026	2023/ 6/15
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	普通社債券	3.2	150	160	17,368	2025/ 2/ 5
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	普通社債券	3.75	200	223	24,072	2027/ 3/ 9
CAPITAL ONE FINANCIAL CO	普通社債券	3.65	150	166	17,921	2027/ 5/11
CARDINAL HEALTH INC	普通社債券	2.616	100	102	11,057	2022/ 6/15
CARDINAL HEALTH INC	普通社債券	3.2	100	105	11,341	2023/ 3/15
CARDINAL HEALTH INC	普通社債券	3.41	100	109	11,807	2027/ 6/15
CARLISLE COS INC	普通社債券	3.5	65	70	7,623	2024/12/ 1
CARLISLE COS INC	普通社債券	2.75	100	101	11,001	2030/ 3/ 1
CARRIER GLOBAL CORP	普通社債券	2.242	50	52	5,612	2025/ 2/15
CARRIER GLOBAL CORP	普通社債券	2.722	170	173	18,690	2030/ 2/15
CATERPILLAR FINANCIAL SE	普通社債券	3.75	150	162	17,585	2023/11/24
CATERPILLAR FINL SERVICE	普通社債券	2.4	50	52	5,687	2026/ 8/ 9
CATERPILLAR FINL SERVICE	普通社債券	1.9	55	56	6,074	2022/ 9/ 6
CATERPILLAR FINL SERVICE	普通社債券	0.45	395	395	42,672	2023/ 9/14
CATERPILLAR FINL SERVICE	普通社債券	0.9	100	98	10,635	2026/ 3/ 2
CATERPILLAR INC	普通社債券	2.6	100	102	11,044	2022/ 6/26
CATERPILLAR INC	普通社債券	3.4	100	108	11,676	2024/ 5/15
CATERPILLAR INC	普通社債券	2.6	100	104	11,319	2029/ 9/19
CBOE GLOBAL MARKETS INC	普通社債券	1.625	100	94	10,183	2030/12/15
CBOE GLOBAL MARKETS INC	普通社債券	3.65	50	55	6,023	2027/ 1/12
CBRE SERVICES INC	普通社債券	4.875	100	115	12,470	2026/ 3/ 1
VIACOMCBS INC	普通社債券	2.9	100	105	11,423	2027/ 1/15
CELANESE US HOLDINGS LLC	普通社債券	4.625	100	106	11,497	2022/11/15
CENOVUS ENERGY INC	普通社債券	5.375	250	282	30,433	2025/ 7/15
CENTERPOINT ENERGY INC	普通社債券	2.5	50	51	5,550	2022/ 9/ 1
CENTERPOINT ENERGY INC	普通社債券	4.25	200	227	24,586	2028/11/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
CHARLES SCHWAB CORP	普通社債券	3.2	100	109	11,821	2028/ 1/25
CHARLES SCHWAB CORP	普通社債券	4.0	100	114	12,392	2029/ 2/ 1
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	普通社債券	4.464	300	314	33,883	2022/ 7/23
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	普通社債券	4.5	100	109	11,862	2024/ 2/ 1
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	普通社債券	4.2	250	277	29,976	2028/ 3/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	普通社債券	5.05	100	116	12,568	2029/ 3/30
CHENIERE CORP CHRISTI HD	普通社債券	7.0	100	115	12,473	2024/ 6/30
CHENIERE CORP CHRISTI HD	普通社債券	5.875	100	114	12,393	2025/ 3/31
CHENIERE CORP CHRISTI HD	普通社債券	3.7	200	212	22,941	2029/11/15
CHEVRON CORP	普通社債券	2.566	100	104	11,289	2023/ 5/16
CHEVRON CORP	普通社債券	2.954	300	324	35,047	2026/ 5/16
CHEVRON CORP	普通社債券	1.141	350	356	38,426	2023/ 5/11
CHEVRON CORP	普通社債券	2.236	100	100	10,895	2030/ 5/11
CHEVRON USA INC	普通社債券	0.426	75	75	8,102	2023/ 8/11
CHEVRON USA INC	普通社債券	3.85	100	112	12,155	2028/ 1/15
CHURCH & DWIGHT CO INC	普通社債券	2.45	100	102	11,059	2022/ 8/ 1
CI FINANCIAL CORP	普通社債券	3.2	100	99	10,725	2030/12/17
CIGNA CORP	普通社債券	3.05	100	104	11,250	2022/11/30
CIGNA CORP	普通社債券	3.0	250	263	28,386	2023/ 7/15
CIGNA CORP	普通社債券	3.4	100	109	11,837	2027/ 3/ 1
CIGNA CORP	普通社債券	4.375	350	403	43,494	2028/10/15
CIGNA CORP	普通社債券	2.375	90	89	9,630	2031/ 3/15
CIMAREX ENERGY CO	普通社債券	4.375	100	109	11,764	2024/ 6/ 1
CIMAREX ENERGY CO	普通社債券	4.375	75	83	9,006	2029/ 3/15
CINTAS CORPORATION NO. 2	普通社債券	2.9	100	102	11,060	2022/ 4/ 1
CINTAS CORPORATION NO. 2	普通社債券	3.7	100	111	12,077	2027/ 4/ 1
CISCO SYSTEMS INC	普通社債券	3.625	100	108	11,722	2024/ 3/ 4
CISCO SYSTEMS INC	普通社債券	2.5	250	264	28,590	2026/ 9/20
CITIBANK NA	普通社債券	3.65	250	271	29,276	2024/ 1/23
CITIGROUP INC	普通社債券	3.375	250	264	28,501	2023/ 3/ 1
CITIGROUP INC	普通社債券	1.678	450	460	49,700	2023/ 5/15
CITIGROUP INC	普通社債券	3.75	100	109	11,857	2024/ 6/16
CITIGROUP INC	普通社債券	3.7	150	165	17,909	2026/ 1/12
CITIGROUP INC	普通社債券	4.6	100	114	12,317	2026/ 3/ 9
CITIGROUP INC	普通社債券	4.45	300	343	37,010	2027/ 9/29
CITIGROUP INC	普通社債券	3.887	350	390	42,129	2027/ 1/10
CITIGROUP INC	普通社債券	4.125	150	167	18,105	2028/ 7/25
CITIGROUP INC	普通社債券	3.52	150	164	17,736	2027/10/27
CITIGROUP INC	普通社債券	4.075	250	281	30,335	2028/ 4/23

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
CITIGROUP INC	普通社債券	2.976	150	156	16,902	2029/11/ 5
CITIGROUP INC	普通社債券	2.666	250	254	27,441	2030/ 1/29
CITIGROUP INC	普通社債券	4.412	250	286	30,875	2030/ 3/31
CITIGROUP INC	普通社債券	2.572	150	151	16,310	2030/ 6/ 3
CITIZENS BANK NA/RI	普通社債券	2.25	250	261	28,202	2025/ 4/28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	普通社債券	3.25	130	138	14,984	2030/ 4/30
CITRIX SYSTEMS INC	普通社債券	1.25	55	54	5,878	2026/ 3/ 1
CITRIX SYSTEMS INC	普通社債券	4.5	100	115	12,486	2027/12/ 1
CLOROX COMPANY	普通社債券	3.5	100	110	11,870	2024/12/15
CLOROX COMPANY	普通社債券	3.05	64	66	7,137	2022/ 9/15
CLOROX COMPANY	普通社債券	1.8	30	29	3,143	2030/ 5/15
CME GROUP INC	普通社債券	3.0	200	208	22,453	2022/ 9/15
CNA FINANCIAL CORP	普通社債券	4.5	100	114	12,318	2026/ 3/ 1
CNA FINANCIAL CORP	普通社債券	3.45	50	55	5,970	2027/ 8/15
CNA FINANCIAL CORP	普通社債券	3.9	40	45	4,871	2029/ 5/ 1
CNH INDUSTRIAL CAP LLC	普通社債券	4.375	40	41	4,486	2022/ 4/ 5
CNH INDUSTRIAL CAP LLC	普通社債券	4.2	50	54	5,889	2024/ 1/15
CNH INDUSTRIAL CAP LLC	普通社債券	1.875	100	102	11,073	2026/ 1/15
CNO FINANCIAL GROUP INC	普通社債券	5.25	100	114	12,330	2025/ 5/30
TAPESTRY INC	普通社債券	3.0	100	102	11,070	2022/ 7/15
COCA-COLA CO/THE	普通社債券	2.95	100	107	11,650	2025/ 3/25
COCA-COLA CO/THE	普通社債券	3.375	250	277	29,974	2027/ 3/25
COCA-COLA CO/THE	普通社債券	1.45	250	249	26,940	2027/ 6/ 1
COCA-COLA CO/THE	普通社債券	1.0	60	57	6,184	2028/ 3/15
COCA-COLA CO/THE	普通社債券	2.0	165	162	17,579	2031/ 3/ 5
COCA-COLA FEMSA SAB CV	普通社債券	2.75	150	152	16,496	2030/ 1/22
COLGATE-PALMOLIVE CO	普通社債券	2.1	100	103	11,192	2023/ 5/ 1
COLUMBIA PIPELINE GROUP	普通社債券	4.5	100	112	12,162	2025/ 6/ 1
COLUMBIA PROPERTY TRUST	普通社債券	3.65	50	52	5,619	2026/ 8/15
COMCAST CORP	普通社債券	3.6	500	544	58,752	2024/ 3/ 1
COMCAST CORP	普通社債券	3.7	310	338	36,566	2024/ 4/15
COMCAST CORP	普通社債券	3.3	100	109	11,851	2027/ 2/ 1
COMCAST CORP	普通社債券	3.3	100	110	11,890	2027/ 4/ 1
COMCAST CORP	普通社債券	4.15	390	449	48,519	2028/10/15
COMCAST CORP	普通社債券	3.4	200	218	23,538	2030/ 4/ 1
COMERICA INC	普通社債券	3.7	75	80	8,689	2023/ 7/31
COMERICA INC	普通社債券	4.0	100	113	12,274	2029/ 2/ 1
COMMONSPIRIT HEALTH	普通社債券	1.547	200	201	21,745	2025/10/ 1
COMMONSPIRIT HEALTH	普通社債券	3.347	100	107	11,564	2029/10/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
COMMONSPIRIT HEALTH	普通社債券	2.782	15	15	1,660	2030/10/ 1
COMMONWEALTH EDISON CO	普通社債券	2.2	200	202	21,880	2030/ 3/ 1
CON EDISON CO OF NY INC	普通社債券	3.35	20	21	2,342	2030/ 4/ 1
CONAGRA BRANDS INC	普通社債券	4.3	60	66	7,157	2024/ 5/ 1
CONAGRA BRANDS INC	普通社債券	1.375	100	97	10,523	2027/11/ 1
CONAGRA BRANDS INC	普通社債券	4.85	100	117	12,725	2028/11/ 1
CONAGRA BRANDS INC	普通社債券	3.2	82	85	9,247	2023/ 1/25
CONNECTICUT LIGHT & PWR	普通社債券	2.5	150	155	16,755	2023/ 1/15
CONOCOPHILLIPS	普通社債券	3.75	150	168	18,172	2027/10/ 1
CONOCOPHILLIPS COMPANY	普通社債券	6.95	100	134	14,566	2029/ 4/15
CON EDISON CO OF NY INC	普通社債券	3.125	100	109	11,778	2027/11/15
CON EDISON CO OF NY INC	普通社債券	3.8	50	56	6,050	2028/ 5/15
CONSTELLATION BRANDS INC	普通社債券	2.65	100	103	11,159	2022/11/ 7
CONSTELLATION BRANDS INC	普通社債券	4.4	165	187	20,276	2025/11/15
CONSTELLATION BRANDS INC	普通社債券	3.7	50	55	5,967	2026/12/ 6
CONSTELLATION BRANDS INC	普通社債券	3.6	50	55	5,953	2028/ 2/15
CONTL AIRLINES 2012-1 A	普通社債券	4.15	126	130	14,039	2024/ 4/11
COOPERAT RABOBANK UA/NY	普通社債券	2.75	250	261	28,174	2023/ 1/10
COOPERATIEVE RABOBANK UA	普通社債券	3.75	250	276	29,857	2026/ 7/21
CORPORATE OFFICE PROP LP	普通社債券	5.0	50	56	6,107	2025/ 7/ 1
COSTCO WHOLESALE CORP	普通社債券	3.0	150	164	17,722	2027/ 5/18
COSTCO WHOLESALE CORP	普通社債券	1.375	100	99	10,777	2027/ 6/20
COSTCO WHOLESALE CORP	普通社債券	1.6	100	96	10,414	2030/ 4/20
CRANE CO	普通社債券	4.45	50	54	5,876	2023/12/15
CREDIT SUISSE GROUP AG	普通社債券	4.55	150	171	18,541	2026/ 4/17
CREDIT SUISSE NEW YORK	普通社債券	1.0	250	253	27,322	2023/ 5/ 5
CREDIT SUISSE NEW YORK	普通社債券	0.495	250	250	26,990	2024/ 2/ 2
CREDIT SUISSE NEW YORK	普通社債券	3.625	250	273	29,537	2024/ 9/ 9
CROWN CASTLE INTL CORP	普通社債券	5.25	250	270	29,226	2023/ 1/15
CROWN CASTLE INTL CORP	普通社債券	1.05	100	97	10,487	2026/ 7/15
CROWN CASTLE INTL CORP	普通社債券	4.0	100	111	12,051	2027/ 3/ 1
CROWN CASTLE INTL CORP	普通社債券	3.3	100	105	11,416	2030/ 7/ 1
CSX CORP	普通社債券	4.25	100	115	12,454	2029/ 3/15
CUMMINS INC	普通社債券	1.5	100	94	10,169	2030/ 9/ 1
CVS HEALTH CORP	普通社債券	3.7	73	77	8,368	2023/ 3/ 9
CVS HEALTH CORP	普通社債券	4.1	109	121	13,089	2025/ 3/25
CVS HEALTH CORP	普通社債券	3.625	65	71	7,763	2027/ 4/ 1
CVS HEALTH CORP	普通社債券	4.3	650	740	79,888	2028/ 3/25
CVS HEALTH CORP	普通社債券	3.75	145	160	17,284	2030/ 4/ 1

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
CVS HEALTH CORP	普通社債券	1.75	100	94	10,165	2030/ 8/21
CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	普通社債券	3.45	60	63	6,820	2029/11/15
CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	普通社債券	2.15	100	94	10,192	2030/11/ 1
DANAHER CORP	普通社債券	3.35	105	114	12,397	2025/ 9/15
SITE CENTERS CORP	普通社債券	3.625	173	179	19,400	2025/ 2/ 1
DELL INT LLC / EMC CORP	普通社債券	6.1	150	182	19,740	2027/ 7/15
APTIV CORP	普通社債券	4.15	200	218	23,590	2024/ 3/15
DELTA AIR LINES 2019-1AA	普通社債券	3.204	50	51	5,606	2024/ 4/25
DENTSPLY SIRONA INC	普通社債券	3.25	100	105	11,428	2030/ 6/ 1
DEUTSCHE BANK NY	普通社債券	3.3	100	104	11,236	2022/11/16
DEUTSCHE BANK NY	普通社債券	2.222	300	309	33,360	2023/ 9/18
DEUTSCHE BANK NY	普通社債券	2.129	150	151	16,342	2025/11/24
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	普通社債券	8.75	200	300	32,459	2030/ 6/15
DIAGEO CAPITAL PLC	普通社債券	2.625	100	104	11,261	2023/ 4/29
DIAGEO INVESTMENT CORP	普通社債券	2.875	100	102	11,108	2022/ 5/11
DELL INT LLC / EMC CORP	普通社債券	5.45	200	219	23,667	2023/ 6/15
DELL INT LLC / EMC CORP	普通社債券	6.02	450	537	57,987	2026/ 6/15
DIAMONDBACK ENERGY INC	普通社債券	5.375	100	103	11,176	2025/ 5/31
DIAMONDBACK ENERGY INC	普通社債券	3.5	100	103	11,209	2029/12/ 1
DIGITAL REALTY TRUST LP	普通社債券	4.45	100	115	12,429	2028/ 7/15
DISCOVER BANK	普通社債券	4.2	250	271	29,297	2023/ 8/ 8
DISCOVER BANK	普通社債券	3.45	250	274	29,586	2026/ 7/27
DISCOVER FINANCIAL SVS	普通社債券	5.2	83	87	9,426	2022/ 4/27
DISCOVERY COMMUNICATIONS	普通社債券	3.8	200	216	23,369	2024/ 3/13
DISCOVERY COMMUNICATIONS	普通社債券	3.95	200	220	23,819	2028/ 3/20
DISCOVERY COMMUNICATIONS	普通社債券	4.125	45	50	5,429	2029/ 5/15
DOLLAR GENERAL CORP	普通社債券	3.25	200	210	22,679	2023/ 4/15
DOLLAR GENERAL CORP	普通社債券	4.15	50	56	6,074	2025/11/ 1
DOLLAR TREE INC	普通社債券	4.2	100	113	12,203	2028/ 5/15
EASTERN ENERGY GAS	普通社債券	3.0	100	105	11,375	2029/11/15
DOMINION ENERGY INC	普通社債券	4.25	50	57	6,241	2028/ 6/ 1
DOMINION ENERGY INC	普通社債券	3.375	60	64	6,946	2030/ 4/ 1
EASTERN ENERGY GAS	普通社債券	3.6	25	27	2,951	2024/12/15
DOMINION ENERGY INC	普通社債券	5.75	100	109	11,777	2024/10/ 1
DOMTAR CORP	普通社債券	4.4	100	102	11,102	2022/ 4/ 1
DOW CHEMICAL CO/THE	普通社債券	7.375	200	275	29,708	2029/11/ 1
DUPONT DE NEMOURS INC	普通社債券	4.493	250	284	30,699	2025/11/15
DUPONT DE NEMOURS INC	普通社債券	4.725	100	117	12,672	2028/11/15
DTE ENERGY CO	普通社債券	3.5	100	107	11,633	2024/ 6/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
DTE ENERGY CO	普通社債券	2.85	100	107	11,573	2026/10/ 1
DTE ENERGY CO	普通社債券	2.25	50	51	5,553	2022/11/ 1
DTE ENERGY CO	普通社債券	2.529	75	79	8,560	2024/10/ 1
DTE ENERGY CO	普通社債券	1.05	70	69	7,497	2025/ 6/ 1
DTE ENERGY CO	普通社債券	2.95	50	52	5,631	2030/ 3/ 1
DUKE ENERGY CAROLINAS	普通社債券	3.05	200	210	22,711	2023/ 3/15
DUKE ENERGY CAROLINAS	普通社債券	3.95	400	459	49,586	2028/11/15
DUKE ENERGY CAROLINAS	普通社債券	2.45	25	25	2,784	2029/ 8/15
DUKE ENERGY CORP	普通社債券	3.15	100	108	11,657	2027/ 8/15
DUKE ENERGY FLORIDA LLC	普通社債券	1.75	105	101	10,983	2030/ 6/15
DUKE REALTY LP	普通社債券	3.75	100	109	11,853	2024/12/ 1
DUKE REALTY LP	普通社債券	4.0	50	56	6,117	2028/ 9/15
DUPONT DE NEMOURS INC	普通社債券	2.169	235	236	25,504	2023/ 5/ 1
DXC TECHNOLOGY CO	普通社債券	4.25	100	108	11,721	2024/ 4/15
E*TRADE FINANCIAL CORP	普通社債券	2.95	50	51	5,581	2022/ 8/24
E*TRADE FINANCIAL CORP	普通社債券	3.8	15	16	1,818	2027/ 8/24
E*TRADE FINANCIAL CORP	普通社債券	4.5	50	57	6,200	2028/ 6/20
EASTMAN CHEMICAL CO	普通社債券	4.5	100	116	12,599	2028/12/ 1
EATON VANCE CORP	普通社債券	3.5	50	54	5,904	2027/ 4/ 6
EBAY INC	普通社債券	2.6	200	204	22,099	2022/ 7/15
EBAY INC	普通社債券	3.6	100	110	11,969	2027/ 6/ 5
EBAY INC	普通社債券	2.7	70	72	7,789	2030/ 3/11
ECOLAB INC	普通社債券	2.375	100	102	11,076	2022/ 8/10
ECOLAB INC	普通社債券	3.25	50	52	5,656	2023/ 1/14
ECOLAB INC	普通社債券	2.7	45	48	5,225	2026/11/ 1
ECOLAB INC	普通社債券	4.8	45	54	5,867	2030/ 3/24
EDISON INTERNATIONAL	普通社債券	3.125	35	36	3,918	2022/11/15
EDISON INTERNATIONAL	普通社債券	4.95	40	44	4,842	2025/ 4/15
EDISON INTERNATIONAL	普通社債券	5.75	160	187	20,257	2027/ 6/15
ELECTRONIC ARTS INC	普通社債券	1.85	60	57	6,220	2031/ 2/15
ELI LILLY & CO	普通社債券	3.375	195	216	23,366	2029/ 3/15
EMERA US FINANCE LP	普通社債券	3.55	65	71	7,678	2026/ 6/15
EMERSON ELECTRIC CO	普通社債券	3.15	100	108	11,681	2025/ 6/ 1
ENEL GENERACION CHILE SA	普通社債券	4.25	50	54	5,836	2024/ 4/15
ENABLE MIDSTREAM PARTNER	普通社債券	3.9	100	106	11,542	2024/ 5/15
ENABLE MIDSTREAM PARTNER	普通社債券	4.4	100	109	11,806	2027/ 3/15
ENBRIDGE ENERGY PARTNERS	普通社債券	5.875	100	118	12,774	2025/10/15
ENBRIDGE INC	普通社債券	2.9	50	51	5,558	2022/ 7/15
ENBRIDGE INC	普通社債券	3.7	50	55	5,974	2027/ 7/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
ENBRIDGE INC	普通社債券	3.125	100	105	11,348	2029/11/15
ENEL CHILE SA	普通社債券	4.875	100	116	12,612	2028/ 6/12
ENERGY TRANSFER OPERATNG	普通社債券	3.6	250	261	28,169	2023/ 2/ 1
ENERGY TRANSFER OPERATNG	普通社債券	5.875	250	279	30,197	2024/ 1/15
ENERGY TRANSFER OPERATNG	普通社債券	4.5	100	109	11,812	2024/ 4/15
ENERGY TRANSFER OPERATNG	普通社債券	5.25	200	229	24,773	2029/ 4/15
ENSTAR GROUP LTD	普通社債券	4.95	100	112	12,186	2029/ 6/ 1
ENTERGY CORP	普通社債券	4.0	50	52	5,621	2022/ 7/15
ENTERGY CORP	普通社債券	1.9	85	83	9,062	2028/ 6/15
ENTERGY LOUISIANA LLC	普通社債券	2.4	300	315	34,049	2026/10/ 1
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	普通社債券	2.8	160	165	17,867	2022/ 8/16
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	普通社債券	4.875	100	95	10,251	2028/ 2/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	普通社債券	5.375	100	99	10,700	2030/ 1/31
EOG RESOURCES INC	普通社債券	4.375	30	34	3,764	2030/ 4/15
EQUIFAX INC	普通社債券	3.95	40	43	4,640	2023/ 6/15
EQUINIX INC	普通社債券	1.25	200	199	21,530	2025/ 7/15
EQUINIX INC	普通社債券	1.0	100	98	10,618	2025/ 9/15
EQUINIX INC	普通社債券	5.375	75	80	8,729	2027/ 5/15
EQUINIX INC	普通社債券	3.2	45	47	5,105	2029/11/18
EQUINIX INC	普通社債券	2.15	100	96	10,358	2030/ 7/15
ERP OPERATING LP	普通社債券	3.25	35	38	4,122	2027/ 8/ 1
ERP OPERATING LP	普通社債券	4.15	50	56	6,143	2028/12/ 1
ERP OPERATING LP	普通社債券	2.5	100	102	11,047	2030/ 2/15
ESSENTIAL UTILITIES INC	普通社債券	2.704	60	61	6,662	2030/ 4/15
ESSEX PORTFOLIO LP	普通社債券	3.875	50	54	5,865	2024/ 5/ 1
ESSEX PORTFOLIO LP	普通社債券	3.5	100	108	11,718	2025/ 4/ 1
ESSEX PORTFOLIO LP	普通社債券	1.7	85	83	8,964	2028/ 3/ 1
ESSEX PORTFOLIO LP	普通社債券	4.0	100	111	12,072	2029/ 3/ 1
ESTEE LAUDER CO INC	普通社債券	3.15	100	109	11,849	2027/ 3/15
ESTEE LAUDER CO INC	普通社債券	2.6	100	104	11,316	2030/ 4/15
ESTEE LAUDER CO INC	普通社債券	1.95	45	44	4,789	2031/ 3/15
EVERGY INC	普通社債券	2.9	100	104	11,268	2029/ 9/15
EVERSOURCE ENERGY	普通社債券	2.75	50	51	5,517	2022/ 3/15
EVERSOURCE ENERGY	普通社債券	2.9	50	53	5,776	2024/10/ 1
EXELON CORP	普通社債券	3.4	100	109	11,809	2026/ 4/15
EXELON CORP	普通社債券	3.497	100	103	11,167	2022/ 6/ 1
EXELON GENERATION CO LLC	普通社債券	3.25	200	214	23,107	2025/ 6/ 1
EXPEDIA GROUP INC	普通社債券	3.6	25	26	2,876	2023/12/15
EXPEDIA GROUP INC	普通社債券	4.625	75	83	9,022	2027/ 8/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
EXPEDIA GROUP INC	普通社債券	3.25	200	202	21,881	2030/ 2/15
EXXON MOBIL CORPORATION	普通社債券	1.571	800	820	88,496	2023/ 4/15
EXXON MOBIL CORPORATION	普通社債券	2.275	100	104	11,278	2026/ 8/16
EXXON MOBIL CORPORATION	普通社債券	3.294	250	276	29,855	2027/ 3/19
EXXON MOBIL CORPORATION	普通社債券	2.44	100	102	11,090	2029/ 8/16
FAIRFAX FINL HLDGS LTD	普通社債券	4.625	100	109	11,801	2030/ 4/29
FEDERAL REALTY INVESTMEN	普通社債券	1.25	100	99	10,750	2026/ 2/15
FEDERAL REALTY INVESTMEN	普通社債券	3.25	50	53	5,769	2027/ 7/15
FEDERAL REALTY INVESTMEN	普通社債券	3.2	50	52	5,686	2029/ 6/15
FEDEX CORP	普通社債券	3.2	500	539	58,191	2025/ 2/ 1
STELLANTIS NV	普通社債券	5.25	200	217	23,495	2023/ 4/15
FIBRIA OVERSEAS FINANCE	普通社債券	5.5	50	57	6,228	2027/ 1/17
FIDELITY NATIONAL INFORM	普通社債券	4.25	155	179	19,327	2028/ 5/15
FIDELITY NATL FINANCIAL	普通社債券	4.5	100	114	12,309	2028/ 8/15
FIDELITY NATL INFO SERV	普通社債券	0.375	20	19	2,155	2023/ 3/ 1
FIDELITY NATL INFO SERV	普通社債券	0.6	15	14	1,614	2024/ 3/ 1
FIDELITY NATL INFO SERV	普通社債券	1.15	25	24	2,672	2026/ 3/ 1
FIDELITY NATL INFO SERV	普通社債券	1.65	20	19	2,117	2028/ 3/ 1
FIDELITY NATL INFO SERV	普通社債券	2.25	50	48	5,285	2031/ 3/ 1
FIFTH THIRD BANCORP	普通社債券	3.65	100	108	11,661	2024/ 1/25
FIFTH THIRD BANCORP	普通社債券	2.55	60	63	6,857	2027/ 5/ 5
FIFTH THIRD BANK	普通社債券	2.25	250	261	28,206	2027/ 2/ 1
FISERV INC	普通社債券	3.8	250	270	29,147	2023/10/ 1
FISERV INC	普通社債券	3.2	250	271	29,319	2026/ 7/ 1
FISERV INC	普通社債券	2.65	100	102	11,024	2030/ 6/ 1
FLEX LTD	普通社債券	4.875	85	98	10,587	2030/ 5/12
FLEX LTD	普通社債券	4.75	125	140	15,144	2025/ 6/15
FLORIDA POWER & LIGHT CO	普通社債券	2.85	200	214	23,170	2025/ 4/ 1
FLOWERS FOODS INC	普通社債券	3.5	35	37	4,091	2026/10/ 1
FORTIS INC	普通社債券	3.055	100	108	11,666	2026/10/ 4
FORTIVE CORPORATION	普通社債券	3.15	50	54	5,861	2026/ 6/15
FORTUNE BRANDS HOME & SE	普通社債券	4.0	100	108	11,693	2023/ 9/21
FOX CORP	普通社債券	4.03	150	163	17,647	2024/ 1/25
FOX CORP	普通社債券	4.709	100	116	12,540	2029/ 1/25
FOX CORP	普通社債券	3.5	25	26	2,906	2030/ 4/ 8
FRANKLIN RESOURCES INC	普通社債券	1.6	100	94	10,159	2030/10/30
FS KKR CAPITAL CORP	普通社債券	4.125	100	103	11,161	2025/ 2/ 1
FS KKR CAPITAL CORP	普通社債券	3.4	100	99	10,720	2026/ 1/15
GATX CORP	普通社債券	4.7	150	175	18,936	2029/ 4/ 1

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
GATX CORP	普通社債券	1.9	100	93	10,133	2031/ 6/ 1
GE CAPITAL FUNDING LLC	普通社債券	4.4	200	225	24,304	2030/ 5/15
GENERAL DYNAMICS CORP	普通社債券	2.25	100	102	11,085	2022/11/15
GENERAL DYNAMICS CORP	普通社債券	3.25	250	271	29,276	2025/ 4/ 1
GENERAL DYNAMICS CORP	普通社債券	2.125	100	104	11,292	2026/ 8/15
GENERAL DYNAMICS CORP	普通社債券	3.75	80	90	9,712	2028/ 5/15
GENERAL ELECTRIC CO	普通社債券	3.45	200	214	23,196	2024/ 5/15
GENERAL ELECTRIC CO	普通社債券	3.45	200	218	23,560	2027/ 5/ 1
GENERAL MILLS INC	普通社債券	3.7	140	151	16,301	2023/10/17
GENERAL MILLS INC	普通社債券	4.0	100	111	11,982	2025/ 4/17
GENERAL MILLS INC	普通社債券	4.2	100	114	12,367	2028/ 4/17
GENERAL MOTORS CO	普通社債券	5.4	100	111	12,009	2023/10/ 2
GENERAL MOTORS CO	普通社債券	6.125	200	237	25,579	2025/10/ 1
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	3.15	70	72	7,784	2022/ 6/30
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	3.7	250	264	28,559	2023/ 5/ 9
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	5.1	200	222	23,954	2024/ 1/17
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	3.95	100	108	11,696	2024/ 4/13
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	1.25	200	196	21,231	2026/ 1/ 8
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	4.35	100	111	12,078	2027/ 1/17
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	3.85	250	270	29,223	2028/ 1/ 5
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	5.65	100	120	12,959	2029/ 1/17
GENERAL MOTORS FINL CO	普通社債券	3.6	150	160	17,278	2030/ 6/21
GEORGIA POWER CO	普通社債券	3.25	50	54	5,887	2026/ 4/ 1
GEORGIA POWER CO	普通社債券	2.65	70	72	7,835	2029/ 9/15
GILEAD SCIENCES INC	普通社債券	1.95	30	30	3,289	2022/ 3/ 1
GILEAD SCIENCES INC	普通社債券	2.5	70	73	7,905	2023/ 9/ 1
GILEAD SCIENCES INC	普通社債券	3.7	250	270	29,216	2024/ 4/ 1
GILEAD SCIENCES INC	普通社債券	3.65	100	110	11,949	2026/ 3/ 1
GILEAD SCIENCES INC	普通社債券	1.65	60	56	6,144	2030/10/ 1
GLAXOSMITHKLINE CAP INC	普通社債券	3.375	350	373	40,282	2023/ 5/15
GLAXOSMITHKLINE CAP INC	普通社債券	3.625	55	60	6,562	2025/ 5/15
GLAXOSMITHKLINE CAP INC	普通社債券	3.875	100	114	12,327	2028/ 5/15
GLOBAL PAYMENTS INC	普通社債券	4.0	100	107	11,579	2023/ 6/ 1
GLOBAL PAYMENTS INC	普通社債券	1.2	190	187	20,223	2026/ 3/ 1
GLOBAL PAYMENTS INC	普通社債券	2.9	45	46	5,009	2030/ 5/15
GLP CAPITAL LP / FIN II	普通社債券	5.375	145	158	17,102	2023/11/ 1
GLP CAPITAL LP / FIN II	普通社債券	5.375	85	97	10,487	2026/ 4/15
GLP CAPITAL LP / FIN II	普通社債券	5.75	45	52	5,685	2028/ 6/ 1
GOLDMAN SACHS BDC INC	普通社債券	2.875	100	101	10,975	2026/ 1/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.0	365	366	39,521	2022/ 4/26
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.625	500	529	57,124	2023/ 1/22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.2	250	262	28,282	2023/ 2/23
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	2.908	250	257	27,762	2022/ 6/ 5
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.75	600	659	71,180	2025/ 5/22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	0.855	85	83	9,045	2025/ 2/12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.85	300	333	35,945	2027/ 1/26
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	1.431	160	159	17,215	2026/ 3/ 9
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.691	200	222	23,971	2027/ 6/ 5
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	4.223	500	567	61,187	2028/ 5/ 1
GOLDMAN SACHS GROUP INC	普通社債券	3.8	200	223	24,105	2030/ 3/15
GOLUB CAPITAL BDC	普通社債券	2.5	60	59	6,401	2026/ 8/24
GRUPO TELEVISIA SAB	普通社債券	6.625	150	178	19,303	2025/ 3/18
GULF POWER CO	普通社債券	3.3	100	110	11,939	2027/ 5/30
HANOVER INSURANCE GROUP	普通社債券	4.5	50	57	6,182	2026/ 4/15
L3HARRIS TECH INC	普通社債券	4.4	150	172	18,628	2028/ 6/15
HASBRO INC	普通社債券	3.55	125	136	14,708	2026/11/19
HASBRO INC	普通社債券	3.5	30	32	3,521	2027/ 9/15
HCA INC	普通社債券	4.75	105	113	12,240	2023/ 5/ 1
HCA INC	普通社債券	5.0	200	223	24,087	2024/ 3/15
HCA INC	普通社債券	4.5	105	119	12,856	2027/ 2/15
HCA INC	普通社債券	4.125	100	110	11,976	2029/ 6/15
HEALTHPEAK PROPERTIES	普通社債券	3.25	50	54	5,924	2026/ 7/15
HEALTHPEAK PROPERTIES	普通社債券	3.0	100	105	11,344	2030/ 1/15
HERSHEY COMPANY	普通社債券	2.05	100	104	11,322	2024/11/15
HERSHEY COMPANY	普通社債券	1.7	80	77	8,409	2030/ 6/ 1
HESS CORP	普通社債券	4.3	100	110	11,911	2027/ 4/ 1
HIGHWOODS REALTY LP	普通社債券	3.05	100	101	10,976	2030/ 2/15
HOLLYFRONTIER CORP	普通社債券	5.875	100	114	12,347	2026/ 4/ 1
HOME DEPOT INC	普通社債券	2.5	100	106	11,488	2027/ 4/15
HOME DEPOT INC	普通社債券	2.8	100	108	11,666	2027/ 9/14
HOME DEPOT INC	普通社債券	0.9	30	28	3,118	2028/ 3/15
HOME DEPOT INC	普通社債券	3.9	100	114	12,369	2028/12/ 6
HOME DEPOT INC	普通社債券	2.7	55	57	6,241	2030/ 4/15
HOME DEPOT INC	普通社債券	2.125	125	130	14,128	2026/ 9/15
HONEYWELL INTERNATIONAL	普通社債券	2.15	95	97	10,519	2022/ 8/ 8
HONEYWELL INTERNATIONAL	普通社債券	2.7	120	127	13,737	2029/ 8/15
HORMEL FOODS CORP	普通社債券	1.8	155	150	16,236	2030/ 6/11
HOST HOTELS & RESORTS LP	普通社債券	3.875	50	52	5,712	2024/ 4/ 1

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
HOST HOTELS & RESORTS LP	普通社債券	4.5	150	163	17,619	2026/ 2/ 1
HP ENTERPRISE CO	普通社債券	2.25	300	310	33,486	2023/ 4/ 1
HP ENTERPRISE CO	普通社債券	1.45	100	101	10,994	2024/ 4/ 1
HP ENTERPRISE CO	普通社債券	4.9	200	229	24,785	2025/10/15
HP INC	普通社債券	3.0	100	107	11,596	2027/ 6/17
HP INC	普通社債券	3.4	150	159	17,226	2030/ 6/17
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	4.25	200	218	23,593	2024/ 3/14
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	3.95	300	321	34,659	2023/ 5/18
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	3.803	400	433	46,723	2024/ 3/11
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	2.099	530	544	58,706	2025/ 6/ 4
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	1.589	200	199	21,491	2026/ 5/24
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	4.041	250	278	30,077	2027/ 3/13
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	4.583	200	228	24,614	2028/ 6/19
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	3.973	200	220	23,811	2029/ 5/22
HSBC HOLDINGS PLC	普通社債券	2.848	200	204	22,027	2030/ 6/ 4
HUBBELL INC	普通社債券	3.35	100	107	11,625	2026/ 3/ 1
HUDSON PACIFIC PROPERTIE	普通社債券	3.25	100	101	11,002	2030/ 1/15
HUMANA INC	普通社債券	2.9	50	52	5,612	2022/12/15
HUMANA INC	普通社債券	3.85	150	164	17,748	2024/10/ 1
HUNTINGTON BANCSHARES	普通社債券	2.55	100	101	10,996	2030/ 2/ 4
HUNTSMAN INTERNATIONAL L	普通社債券	4.5	100	112	12,113	2029/ 5/ 1
HUSKY ENERGY INC	普通社債券	3.95	100	102	11,068	2022/ 4/15
HYATT HOTELS CORP	普通社債券	4.85	50	55	5,976	2026/ 3/15
HYATT HOTELS CORP	普通社債券	4.375	50	54	5,870	2028/ 9/15
IBM CORP	普通社債券	2.875	100	104	11,258	2022/11/ 9
IBM CORP	普通社債券	1.875	150	153	16,564	2022/ 8/ 1
IBM CORP	普通社債券	3.375	250	268	28,963	2023/ 8/ 1
IBM CORP	普通社債券	1.7	470	472	50,976	2027/ 5/15
IBM CORP	普通社債券	3.5	100	109	11,843	2029/ 5/15
IBM CREDIT LLC	普通社債券	2.2	100	102	11,097	2022/ 9/ 8
IBM CREDIT LLC	普通社債券	3.0	100	105	11,349	2023/ 2/ 6
IDEX CORP	普通社債券	3.0	50	52	5,675	2030/ 5/ 1
ILLINOIS TOOL WORKS INC	普通社債券	2.65	100	107	11,605	2026/11/15
ING GROEP NV	普通社債券	4.1	200	217	23,508	2023/10/ 2
INGERSOLL-RAND GL HLD CO	普通社債券	4.25	150	162	17,508	2023/ 6/15
TRANE TECHNOLOGIES LUX	普通社債券	3.55	100	109	11,766	2024/11/ 1
INGREDION INC	普通社債券	2.9	100	103	11,179	2030/ 6/ 1
INTEL CORP	普通社債券	2.875	100	106	11,536	2024/ 5/11
INTEL CORP	普通社債券	3.7	145	160	17,335	2025/ 7/29

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
INTEL CORP	普通社債券	2.6	50	53	5,765	2026/ 5/19
INTEL CORP	普通社債券	3.9	250	286	30,943	2030/ 3/25
INTERCONTINENTALEXCHANGE	普通社債券	0.7	45	45	4,877	2023/ 6/15
INTERCONTINENTALEXCHANGE	普通社債券	3.1	200	218	23,618	2027/ 9/15
INTERPUBLIC GROUP COS	普通社債券	4.65	25	29	3,133	2028/10/ 1
INTERPUBLIC GROUP COS	普通社債券	4.75	100	116	12,605	2030/ 3/30
INTERSTATE POWER & LIGHT	普通社債券	3.25	100	108	11,703	2024/12/ 1
INTERSTATE POWER & LIGHT	普通社債券	3.6	50	55	6,012	2029/ 4/ 1
INTL FLAVOR & FRAGRANCES	普通社債券	4.45	45	51	5,557	2028/ 9/26
INTUIT INC	普通社債券	0.65	100	100	10,858	2023/ 7/15
INVESCO FINANCE PLC	普通社債券	3.75	150	166	17,946	2026/ 1/15
IPALCO ENTERPRISES INC	普通社債券	4.25	100	110	11,908	2030/ 5/ 1
ITC HOLDINGS CORP	普通社債券	3.65	25	27	2,921	2024/ 6/15
ITC HOLDINGS CORP	普通社債券	3.25	60	65	7,042	2026/ 6/30
JABIL INC	普通社債券	3.6	150	158	17,155	2030/ 1/15
JD.COM INC	普通社債券	3.375	200	211	22,834	2030/ 1/14
JEFFERIES GRP LLC / CAP	普通社債券	4.85	90	104	11,296	2027/ 1/15
JEFFERIES GRP LLC / CAP	普通社債券	4.15	100	111	12,080	2030/ 1/23
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	1.95	70	71	7,717	2022/ 6/13
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	2.7	50	52	5,629	2023/ 1/ 6
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	3.45	50	53	5,770	2023/ 6/ 7
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	0.7	100	100	10,880	2023/ 7/ 5
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	2.65	50	53	5,760	2024/ 6/24
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	2.25	100	104	11,316	2026/ 9/14
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	1.75	200	204	22,023	2027/ 3/ 9
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	3.05	50	54	5,863	2028/ 1/ 6
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	1.5	250	246	26,612	2028/ 3/ 6
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	2.8	50	53	5,744	2029/ 7/18
JOHN DEERE CAPITAL CORP	普通社債券	2.45	200	207	22,410	2030/ 1/ 9
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	2.05	100	103	11,148	2023/ 3/ 1
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	0.55	50	49	5,317	2025/ 9/ 1
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	2.45	100	106	11,528	2026/ 3/ 1
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	2.95	100	109	11,843	2027/ 3/ 3
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	0.95	65	63	6,858	2027/ 9/ 1
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	2.9	100	109	11,765	2028/ 1/15
JOHNSON & JOHNSON	普通社債券	1.3	170	161	17,373	2030/ 9/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.972	300	306	33,061	2023/ 1/15
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.2	500	526	56,786	2023/ 1/25
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.776	113	115	12,511	2022/ 4/25

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.375	200	212	22,898	2023/ 5/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.559	150	159	17,220	2023/ 4/23
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	1.514	200	204	22,061	2023/ 6/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.797	200	214	23,187	2023/ 7/23
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	0.653	135	135	14,646	2023/ 9/16
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	0.563	90	89	9,668	2024/ 2/16
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.22	200	214	23,154	2024/ 3/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.005	600	619	66,823	2025/ 3/13
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.96	200	223	24,126	2026/ 1/29
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	1.04	200	196	21,168	2026/ 2/ 4
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	4.25	100	114	12,397	2027/10/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.182	400	409	44,199	2027/ 6/ 1
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	3.509	250	273	29,525	2028/ 1/23
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	4.005	100	112	12,165	2028/ 4/23
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	4.203	700	800	86,421	2028/ 7/23
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.739	100	103	11,166	2029/10/15
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	4.493	150	174	18,793	2030/ 3/24
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	2.956	150	154	16,619	2030/ 5/13
JPMORGAN CHASE & CO	普通社債券	1.953	220	210	22,750	2031/ 2/ 4
JUNIPER NETWORKS INC	普通社債券	3.75	50	54	5,863	2029/ 8/15
JUNIPER NETWORKS INC	普通社債券	2.0	100	93	10,064	2030/12/10
KAISER FOUNDATION HOSPITAL	普通社債券	3.15	50	55	5,965	2027/ 5/ 1
EVERGY METRO	普通社債券	3.15	79	82	8,935	2023/ 3/15
KANSAS CITY SOUTHERN	普通社債券	2.875	65	67	7,281	2029/11/15
KELLOGG CO	普通社債券	4.3	100	114	12,366	2028/ 5/15
KEMPER CORP	普通社債券	4.35	35	38	4,116	2025/ 2/15
KEMPER CORP	普通社債券	2.4	100	97	10,522	2030/ 9/30
KEURIG DR PEPPER INC	普通社債券	4.057	100	107	11,599	2023/ 5/25
KEURIG DR PEPPER INC	普通社債券	4.597	250	291	31,444	2028/ 5/25
KEURIG DR PEPPER INC	普通社債券	2.25	40	39	4,248	2031/ 3/15
KEY BANK NA	普通社債券	3.4	200	218	23,531	2026/ 5/20
KEYCORP	普通社債券	2.25	100	104	11,237	2027/ 4/ 6
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	普通社債券	4.6	60	70	7,557	2027/ 4/ 6
KILROY REALTY LP	普通社債券	4.375	100	110	11,886	2025/10/ 1
KILROY REALTY LP	普通社債券	3.05	100	102	11,056	2030/ 2/15
KIMBERLY-CLARK CORP	普通社債券	2.75	150	162	17,500	2026/ 2/15
KIMBERLY-CLARK CORP	普通社債券	1.05	100	97	10,568	2027/ 9/15
KIMCO REALTY CORP	普通社債券	2.7	50	52	5,676	2024/ 3/ 1
KIMCO REALTY CORP	普通社債券	3.3	80	86	9,301	2025/ 2/ 1

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
KIMCO REALTY CORP	普通社債券	1.9	50	49	5,318	2028/ 3/ 1
KINDER MORGAN ENER PART	普通社債券	4.15	100	103	11,183	2022/ 3/ 1
KITE REALTY GROUP LP	普通社債券	4.0	50	52	5,672	2026/10/ 1
KLA CORP	普通社債券	4.1	100	114	12,368	2029/ 3/15
KOHL'S CORPORATION	普通社債券	9.5	55	71	7,667	2025/ 5/15
KROGER CO	普通社債券	4.0	100	108	11,748	2024/ 2/ 1
KROGER CO	普通社債券	3.5	150	165	17,840	2026/ 2/ 1
L3HARRIS TECH INC	普通社債券	3.85	70	75	8,106	2023/ 6/15
L3HARRIS TECH INC	普通社債券	4.4	100	115	12,419	2028/ 6/15
LABORATORY CORP OF AMER	普通社債券	3.6	150	168	18,130	2027/ 9/ 1
LABORATORY CORP OF AMER	普通社債券	4.0	50	53	5,825	2023/11/ 1
LAM RESEARCH CORP	普通社債券	4.0	55	62	6,784	2029/ 3/15
LAS VEGAS SANDS CORP	普通社債券	3.2	110	115	12,437	2024/ 8/ 8
LAS VEGAS SANDS CORP	普通社債券	3.5	70	73	7,979	2026/ 8/18
LAS VEGAS SANDS CORP	普通社債券	3.9	105	111	12,039	2029/ 8/ 8
LAZARD GROUP LLC	普通社債券	3.625	100	108	11,740	2027/ 3/ 1
LAZARD GROUP LLC	普通社債券	4.5	50	57	6,237	2028/ 9/19
LEAR CORP	普通社債券	4.25	100	110	11,946	2029/ 5/15
LEGGETT & PLATT INC	普通社債券	3.4	50	51	5,548	2022/ 8/15
LEGGETT & PLATT INC	普通社債券	3.5	50	53	5,791	2027/11/15
LEIDOS INC	普通社債券	2.95	45	47	5,086	2023/ 5/15
LENNAR CORP	普通社債券	4.875	200	219	23,645	2023/12/15
LENNOX INTERNATIONAL INC	普通社債券	1.35	25	25	2,703	2025/ 8/ 1
JEFFERIES FIN GROUP INC	普通社債券	5.5	100	108	11,705	2023/10/18
LIFE STORAGE LP	普通社債券	4.0	100	111	11,991	2029/ 6/15
LINCOLN NATIONAL CORP	普通社債券	3.35	150	163	17,646	2025/ 3/ 9
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	4.582	200	224	24,266	2025/12/10
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	2.858	200	204	22,089	2022/ 3/17
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	2.907	400	415	44,778	2022/11/ 7
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	0.695	200	200	21,588	2024/ 5/11
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	4.45	200	224	24,267	2025/ 5/ 8
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	4.65	200	225	24,366	2026/ 3/24
LLOYDS BANKING GROUP PLC	普通社債券	4.55	200	231	24,960	2028/ 8/16
LOCKHEED MARTIN CORP	普通社債券	3.55	100	110	11,963	2026/ 1/15
LOCKHEED MARTIN CORP	普通社債券	1.85	100	98	10,676	2030/ 6/15
LOEWS CORP	普通社債券	2.625	150	156	16,889	2023/ 5/15
LOWE'S COS INC	普通社債券	4.0	100	111	12,001	2025/ 4/15
LOWE'S COS INC	普通社債券	3.1	100	109	11,798	2027/ 5/ 3
LOWE'S COS INC	普通社債券	1.3	245	235	25,434	2028/ 4/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
LOWE'S COS INC	普通社債券	3.65	100	110	11,951	2029/ 4/ 5
LYB INT FINANCE III	普通社債券	1.25	20	19	2,148	2025/10/ 1
LYB INT FINANCE III	普通社債券	2.25	125	122	13,209	2030/10/ 1
LYB INTERNATIONAL FINANC	普通社債券	3.5	150	164	17,755	2027/ 3/ 2
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN	普通社債券	5.0	50	58	6,270	2026/ 3/ 1
MAGNA INTERNATIONAL INC	普通社債券	4.15	50	56	6,050	2025/10/ 1
MAGNA INTERNATIONAL INC	普通社債券	2.45	100	101	10,948	2030/ 6/15
MAIN STREET CAPITAL CORP	普通社債券	3.0	85	85	9,185	2026/ 7/14
MANULIFE FINANCIAL CORP	普通社債券	2.484	35	36	3,952	2027/ 5/19
MARATHON OIL CORP	普通社債券	2.8	51	52	5,655	2022/11/ 1
MARATHON PETROLEUM CORP	普通社債券	4.75	100	110	11,907	2023/12/15
MARATHON PETROLEUM CORP	普通社債券	3.8	30	32	3,522	2028/ 4/ 1
MARKEL CORP	普通社債券	4.9	70	74	7,987	2022/ 7/ 1
MARRIOTT INTERNATIONAL	普通社債券	3.6	50	53	5,759	2024/ 4/15
MARRIOTT INTERNATIONAL	普通社債券	5.75	200	230	24,916	2025/ 5/ 1
MARRIOTT INTERNATIONAL	普通社債券	3.125	100	104	11,325	2026/ 6/15
MARRIOTT INTERNATIONAL	普通社債券	4.625	110	123	13,373	2030/ 6/15
MARSH & MCLENNAN COS INC	普通社債券	3.875	350	382	41,267	2024/ 3/15
MARSH & MCLENNAN COS INC	普通社債券	4.375	95	110	11,912	2029/ 3/15
MARTIN MARIETTA MATERIAL	普通社債券	4.25	30	33	3,566	2024/ 7/ 2
MARTIN MARIETTA MATERIAL	普通社債券	3.45	21	23	2,498	2027/ 6/ 1
MARTIN MARIETTA MATERIAL	普通社債券	3.5	50	55	6,003	2027/12/15
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	普通社債券	4.2	100	107	11,628	2023/ 6/22
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	普通社債券	4.875	100	116	12,552	2028/ 6/22
MASCO CORP	普通社債券	4.375	90	103	11,118	2026/ 4/ 1
MASCO CORP	普通社債券	1.5	50	48	5,271	2028/ 2/15
MASCO CORP	普通社債券	2.0	15	14	1,564	2030/10/ 1
MASTERCARD INC	普通社債券	3.375	200	217	23,439	2024/ 4/ 1
MASTERCARD INC	普通社債券	3.5	30	33	3,623	2028/ 2/26
MASTERCARD INC	普通社債券	2.95	100	108	11,657	2029/ 6/ 1
MASTERCARD INC	普通社債券	3.35	100	110	11,924	2030/ 3/26
MAXIM INTEGRATED PRODUCT	普通社債券	3.45	100	111	11,998	2027/ 6/15
MCCORMICK & CO	普通社債券	2.7	50	51	5,557	2022/ 8/15
MCCORMICK & CO	普通社債券	0.9	95	92	10,033	2026/ 2/15
MCCORMICK & CO	普通社債券	2.5	100	102	11,012	2030/ 4/15
MCDONALD'S CORP	普通社債券	3.5	100	111	11,985	2027/ 7/ 1
MCDONALD'S CORP	普通社債券	3.6	100	110	11,878	2030/ 7/ 1
MCDONALD'S CORP	普通社債券	3.35	205	216	23,390	2023/ 4/ 1
MCDONALD'S CORP	普通社債券	3.8	150	167	18,042	2028/ 4/ 1

銘柄	当期末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
MCKESSON CORP	普通社債券	3.796	100	108	11,720	2024/ 3/15
MCKESSON CORP	普通社債券	3.95	200	225	24,307	2028/ 2/16
MEAD JOHNSON NUTRITION C	普通社債券	4.125	60	67	7,297	2025/11/15
MEDTRONIC INC	普通社債券	3.5	141	154	16,690	2025/ 3/15
MERCK & CO INC	普通社債券	2.8	200	210	22,748	2023/ 5/18
MERCK & CO INC	普通社債券	3.4	300	332	35,834	2029/ 3/ 7
MERCY HEALTHCARE SYSTEM	普通社債券	4.302	15	17	1,866	2028/ 7/ 1
METLIFE INC	普通社債券	4.368	100	109	11,846	2023/ 9/15
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	普通社債券	4.333	100	107	11,617	2023/ 6/ 1
MICRON TECHNOLOGY INC	普通社債券	5.327	50	59	6,440	2029/ 2/ 6
MICROSOFT CORP	普通社債券	2.375	100	103	11,216	2023/ 5/ 1
MICROSOFT CORP	普通社債券	2.0	200	207	22,434	2023/ 8/ 8
MICROSOFT CORP	普通社債券	3.625	150	162	17,535	2023/12/15
MICROSOFT CORP	普通社債券	2.7	100	106	11,518	2025/ 2/12
MICROSOFT CORP	普通社債券	2.4	150	159	17,220	2026/ 8/ 8
MICROSOFT CORP	普通社債券	3.3	300	332	35,913	2027/ 2/ 6
MID-AMERICA APARTMENTS	普通社債券	3.95	100	111	12,078	2029/ 3/15
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	2.665	400	412	44,484	2022/ 7/25
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	3.455	100	105	11,408	2023/ 3/ 2
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	3.407	200	215	23,276	2024/ 3/ 7
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	0.848	200	201	21,709	2023/ 9/15
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	2.193	200	207	22,367	2025/ 2/25
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	4.05	200	229	24,742	2028/ 9/11
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	3.195	200	215	23,276	2029/ 7/18
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	2.757	200	214	23,091	2026/ 9/13
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	普通社債券	3.961	100	112	12,161	2028/ 3/ 2
MIZUHO FINANCIAL GROUP	普通社債券	2.721	200	205	22,226	2022/ 7/16
MIZUHO FINANCIAL GROUP	普通社債券	1.241	200	202	21,887	2023/ 7/10
MIZUHO FINANCIAL GROUP	普通社債券	0.849	200	201	21,704	2023/ 9/ 8
MIZUHO FINANCIAL GROUP	普通社債券	4.018	200	224	24,263	2028/ 3/ 5
MIZUHO FINANCIAL GROUP	普通社債券	2.869	200	208	22,459	2029/ 9/13
MONDELEZ INTERNATIONAL	普通社債券	0.625	70	70	7,582	2022/ 7/ 1
MOODY'S CORPORATION	普通社債券	4.5	200	209	22,644	2022/ 9/ 1
MORGAN STANLEY	普通社債券	2.75	250	256	27,727	2022/ 5/19
MORGAN STANLEY	普通社債券	4.875	250	267	28,874	2022/11/ 1
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.125	250	262	28,343	2023/ 1/23
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.75	200	212	22,952	2023/ 2/25
MORGAN STANLEY	普通社債券	4.1	300	321	34,719	2023/ 5/22
MORGAN STANLEY	普通社債券	0.56	115	115	12,423	2022/11/10

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
MORGAN STANLEY	普通社債券	0.529	200	199	21,568	2023/ 1/25
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.737	100	106	11,503	2023/ 4/24
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.875	500	558	60,262	2026/ 1/27
MORGAN STANLEY	普通社債券	2.188	50	51	5,592	2025/ 4/28
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.125	450	488	52,755	2026/ 7/27
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.95	100	112	12,110	2027/ 4/23
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.591	200	221	23,936	2027/ 7/22
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.772	200	221	23,881	2028/ 1/24
MORGAN STANLEY	普通社債券	2.699	300	307	33,139	2030/ 1/22
MORGAN STANLEY	普通社債券	3.622	200	218	23,616	2030/ 4/ 1
MOTOROLA SOLUTIONS INC	普通社債券	4.0	91	100	10,850	2024/ 9/ 1
MOTOROLA SOLUTIONS INC	普通社債券	4.6	100	115	12,453	2029/ 5/23
MPLX LP	普通社債券	3.5	235	245	26,518	2022/12/ 1
MPLX LP	普通社債券	3.375	50	52	5,654	2023/ 3/15
MPLX LP	普通社債券	4.875	250	281	30,384	2025/ 6/ 1
MPLX LP	普通社債券	1.75	35	35	3,793	2026/ 3/ 1
MPLX LP	普通社債券	4.8	100	114	12,402	2029/ 2/15
MPLX LP	普通社債券	2.65	45	44	4,765	2030/ 8/15
UTAH ACQUISITION SUB	普通社債券	3.95	250	278	30,002	2026/ 6/15
NASDAQ INC	普通社債券	3.85	30	33	3,616	2026/ 6/30
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	普通社債券	2.5	250	266	28,777	2026/ 7/12
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY	普通社債券	3.0	250	262	28,316	2023/ 1/20
NATIONAL BANK OF CANADA	普通社債券	0.9	250	251	27,145	2022/ 8/15
NATIONAL FUEL GAS CO	普通社債券	5.5	15	17	1,865	2026/ 1/15
NATIONAL FUEL GAS CO	普通社債券	3.95	50	53	5,759	2027/ 9/15
NATIONAL FUEL GAS CO	普通社債券	4.75	50	55	6,026	2028/ 9/ 1
NATIONAL HEALTH INVESTOR	普通社債券	3.0	25	23	2,577	2031/ 2/ 1
NATIONAL RETAIL PROP INC	普通社債券	4.3	65	73	7,932	2028/10/15
NATIONAL RETAIL PROP INC	普通社債券	4.0	65	71	7,746	2025/11/15
NATIONAL RURAL UTIL COOP	普通社債券	2.4	250	255	27,579	2022/ 4/25
NATIONAL RURAL UTIL COOP	普通社債券	5.25	150	162	17,479	2026/ 4/20
NATWEST GROUP PLC	普通社債券	6.0	500	566	61,075	2023/12/19
NATWEST GROUP PLC	普通社債券	4.519	500	542	58,546	2023/ 6/25
NETAPP INC	普通社債券	2.375	100	103	11,154	2027/ 6/22
NEXTERA ENERGY CAPITAL	普通社債券	2.9	100	102	11,092	2029/ 5/ 1
NEXTERA ENERGY CAPITAL	普通社債券	2.8	50	52	5,620	2022/ 4/ 1
NEXTERA ENERGY CAPITAL	普通社債券	2.75	200	212	22,879	2023/ 1/15
NEXTERA ENERGY CAPITAL	普通社債券	5.65	150	169	18,276	2025/ 5/ 1
NIKE INC	普通社債券	2.25	50	51	5,593	2023/ 5/ 1

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
NIKE INC	普通社債券	2.375	100	105	11,405	2026/11/ 1
NIKE INC	普通社債券	2.85	50	53	5,759	2030/ 3/27
NISOURCE INC	普通社債券	3.49	100	110	11,898	2027/ 5/15
NOMURA HOLDINGS INC	普通社債券	3.103	200	207	22,435	2030/ 1/16
NORFOLK SOUTHERN CORP	普通社債券	2.9	65	70	7,565	2026/ 6/15
NORFOLK SOUTHERN CORP	普通社債券	2.903	200	208	22,508	2023/ 2/15
NORFOLK SOUTHERN CORP	普通社債券	3.15	75	81	8,821	2027/ 6/ 1
NORFOLK SOUTHERN CORP	普通社債券	3.8	50	56	6,081	2028/ 8/ 1
NORTHERN TRUST CORP	普通社債券	3.95	100	112	12,172	2025/10/30
NORTHERN TRUST CORP	普通社債券	3.65	50	56	6,062	2028/ 8/ 3
NORTHERN TRUST CORP	普通社債券	3.375	62	66	7,228	2027/ 5/ 8
NORTHROP GRUMMAN CORP	普通社債券	2.55	200	206	22,281	2022/10/15
NORTHROP GRUMMAN CORP	普通社債券	3.25	200	216	23,307	2028/ 1/15
NOVARTIS CAPITAL CORP	普通社債券	2.4	150	153	16,572	2022/ 5/17
NOVARTIS CAPITAL CORP	普通社債券	1.75	100	103	11,153	2025/ 2/14
NOVARTIS CAPITAL CORP	普通社債券	2.0	100	103	11,186	2027/ 2/14
NSTAR ELECTRIC CO	普通社債券	3.2	50	54	5,923	2027/ 5/15
NSTAR ELECTRIC CO	普通社債券	3.25	100	109	11,822	2029/ 5/15
NUTRIEN LTD	普通社債券	3.15	150	155	16,740	2022/10/ 1
NUTRIEN LTD	普通社債券	3.0	100	106	11,512	2025/ 4/ 1
VIDIA CORP	普通社債券	2.85	100	106	11,448	2030/ 4/ 1
NVR INC	普通社債券	3.0	65	67	7,296	2030/ 5/15
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	普通社債券	3.875	100	110	11,958	2026/ 6/18
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	普通社債券	3.4	45	48	5,199	2030/ 5/ 1
NXP BV/NXP FUNDING LLC	普通社債券	4.875	100	111	12,004	2024/ 3/ 1
NXP BV/NXP FUNDING LLC	普通社債券	5.55	100	120	13,028	2028/12/ 1
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	普通社債券	4.35	150	171	18,514	2028/ 6/ 1
OFFICE PPTY INCOME TRST	普通社債券	4.5	100	106	11,503	2025/ 2/ 1
OKLAHOMA G&E CO	普通社債券	3.25	55	59	6,410	2030/ 4/ 1
OLD REPUBLIC INTL CORP	普通社債券	3.875	100	112	12,136	2026/ 8/26
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	普通社債券	4.95	100	109	11,828	2024/ 4/ 1
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	普通社債券	4.5	50	54	5,885	2025/ 1/15
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	普通社債券	4.5	100	110	11,954	2027/ 4/ 1
OMNICOM GP/OMNICOM CAP	普通社債券	3.625	150	155	16,761	2022/ 5/ 1
OMNICOM GP/OMNICOM CAP	普通社債券	3.6	100	110	11,928	2026/ 4/15
OMNICOM GROUP INC	普通社債券	2.45	100	101	10,903	2030/ 4/30
ONCOR ELECTRIC DELIVERY	普通社債券	3.7	100	112	12,149	2028/11/15
ONE GAS INC	普通社債券	2.0	100	97	10,477	2030/ 5/15
ONEOK INC	普通社債券	5.85	65	76	8,270	2026/ 1/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
ONEOK INC	普通社債券	4.0	85	93	10,077	2027/ 7/13
ONEOK INC	普通社債券	4.55	150	166	17,977	2028/ 7/15
ONEOK INC	普通社債券	3.1	200	202	21,803	2030/ 3/15
ORACLE CORP	普通社債券	2.5	350	362	39,072	2022/10/15
ORACLE CORP	普通社債券	2.625	105	109	11,800	2023/ 2/15
ORACLE CORP	普通社債券	3.625	150	161	17,401	2023/ 7/15
ORACLE CORP	普通社債券	2.8	700	748	80,783	2027/ 4/ 1
ORACLE CORP	普通社債券	3.25	150	164	17,799	2027/11/15
ORACLE CORP	普通社債券	3.25	100	108	11,660	2030/ 5/15
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	普通社債券	3.55	50	55	5,948	2026/ 3/15
ORIX CORP	普通社債券	2.9	30	30	3,336	2022/ 7/18
ORIX CORP	普通社債券	3.25	100	108	11,708	2024/12/ 4
ORIX CORP	普通社債券	3.7	50	56	6,050	2027/ 7/18
OTIS WORLDWIDE CORP	普通社債券	2.056	100	104	11,225	2025/ 4/ 5
OTIS WORLDWIDE CORP	普通社債券	2.293	35	36	3,937	2027/ 4/ 5
OTIS WORLDWIDE CORP	普通社債券	2.565	40	40	4,382	2030/ 2/15
OWENS CORNING	普通社債券	3.95	180	201	21,702	2029/ 8/15
OWL ROCK CAPITAL CORP	普通社債券	4.0	100	105	11,346	2025/ 3/30
OWL ROCK CAPITAL CORP	普通社債券	3.4	100	102	11,066	2026/ 7/15
PACCAR FINANCIAL CORP	普通社債券	2.0	65	66	7,198	2022/ 9/26
PACCAR FINANCIAL CORP	普通社債券	1.9	200	205	22,220	2023/ 2/ 7
PACCAR FINANCIAL CORP	普通社債券	3.4	50	53	5,786	2023/ 8/ 9
PACIFIC GAS & ELECTRIC	普通社債券	1.75	100	100	10,818	2022/ 6/16
PACIFIC GAS & ELECTRIC	普通社債券	3.45	300	321	34,681	2025/ 7/ 1
PACIFIC GAS & ELECTRIC	普通社債券	3.75	100	106	11,539	2028/ 7/ 1
PACIFIC GAS & ELECTRIC	普通社債券	4.55	300	330	35,628	2030/ 7/ 1
PACKAGING CORP OF AMERIC	普通社債券	3.4	35	38	4,180	2027/12/15
PARKER-HANNIFIN CORP	普通社債券	3.3	150	163	17,605	2024/11/21
PAYPAL HOLDINGS INC	普通社債券	1.35	35	35	3,847	2023/ 6/ 1
PAYPAL HOLDINGS INC	普通社債券	2.4	105	111	11,981	2024/10/ 1
PAYPAL HOLDINGS INC	普通社債券	2.85	200	211	22,793	2029/10/ 1
PEACEHEALTH OBLIGATED GR	普通社債券	1.375	100	100	10,856	2025/11/15
PEPSICO INC	普通社債券	0.75	115	116	12,531	2023/ 5/ 1
PEPSICO INC	普通社債券	2.25	100	105	11,350	2025/ 3/19
PEPSICO INC	普通社債券	2.85	100	107	11,626	2026/ 2/24
PEPSICO INC	普通社債券	3.0	100	109	11,797	2027/10/15
PEPSICO INC	普通社債券	2.75	200	210	22,747	2030/ 3/19
PERRIGO FINANCE UNLIMITE	普通社債券	4.375	200	220	23,770	2026/ 3/15
PFIZER INC	普通社債券	2.8	65	66	7,197	2022/ 3/11

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
PFIZER INC	普通社債券	3.0	250	263	28,424	2023/ 6/15
PFIZER INC	普通社債券	3.45	200	222	23,985	2029/ 3/15
PFIZER INC	普通社債券	2.625	200	209	22,615	2030/ 4/ 1
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	2.375	100	102	11,083	2022/ 8/17
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	2.5	100	103	11,158	2022/11/ 2
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	1.125	145	147	15,895	2023/ 5/ 1
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	1.5	100	101	10,972	2025/ 5/ 1
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	2.75	150	160	17,310	2026/ 2/25
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	0.875	50	48	5,281	2026/ 5/ 1
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	3.125	100	108	11,747	2027/ 8/17
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	2.1	35	34	3,709	2030/ 5/ 1
PHILIP MORRIS INTL INC	普通社債券	1.75	50	47	5,125	2030/11/ 1
PHILLIPS 66	普通社債券	4.3	100	104	11,229	2022/ 4/ 1
PHILLIPS 66	普通社債券	3.7	100	106	11,483	2023/ 4/ 6
PHILLIPS 66	普通社債券	0.9	100	100	10,801	2024/ 2/15
PHILLIPS 66	普通社債券	3.85	100	109	11,868	2025/ 4/ 9
PHILLIPS 66 PARTNERS LP	普通社債券	3.55	75	80	8,736	2026/10/ 1
PHILLIPS 66 PARTNERS LP	普通社債券	3.15	100	101	10,907	2029/12/15
PIEDMONT OPERATING PARTN	普通社債券	3.15	100	98	10,635	2030/ 8/15
PIONEER NATURAL RESOURCE	普通社債券	4.45	100	113	12,207	2026/ 1/15
PIONEER NATURAL RESOURCE	普通社債券	2.15	70	67	7,254	2031/ 1/15
PLAINS ALL AMER PIPELINE	普通社債券	3.6	200	214	23,165	2024/11/ 1
PLAINS ALL AMER PIPELINE	普通社債券	4.65	200	221	23,861	2025/10/15
PLAINS ALL AMER PIPELINE	普通社債券	4.5	50	55	5,977	2026/12/15
PNC BANK NA	普通社債券	3.5	250	266	28,772	2023/ 6/ 8
PNC BANK NA	普通社債券	3.25	250	272	29,423	2025/ 6/ 1
PNC BANK NA	普通社債券	4.05	250	285	30,797	2028/ 7/26
PNC BANK NA	普通社債券	2.7	250	258	27,900	2029/10/22
PPG INDUSTRIES INC	普通社債券	3.2	100	104	11,328	2023/ 3/15
PPG INDUSTRIES INC	普通社債券	2.55	100	102	11,081	2030/ 6/15
PPL CAPITAL FUNDING INC	普通社債券	3.95	100	108	11,688	2024/ 3/15
PPL CAPITAL FUNDING INC	普通社債券	4.125	100	113	12,228	2030/ 4/15
LINDE INC/CT	普通社債券	3.2	50	54	5,913	2026/ 1/30
LINDE INC/CT	普通社債券	1.1	100	92	9,942	2030/ 8/10
PRECISION CASTPARTS CORP	普通社債券	2.5	200	206	22,312	2023/ 1/15
BOOKING HOLDINGS INC	普通社債券	3.6	100	110	11,916	2026/ 6/ 1
BOOKING HOLDINGS INC	普通社債券	2.75	100	104	11,277	2023/ 3/15
PRINCIPAL FINANCIAL GRP	普通社債券	3.7	50	55	6,027	2029/ 5/15
PRINCIPAL FINANCIAL GRP	普通社債券	2.125	100	97	10,500	2030/ 6/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	普通社債券	2.45	100	106	11,520	2026/11/ 3
PROCTER & GAMBLE CO/THE	普通社債券	2.8	200	217	23,439	2027/ 3/25
PROCTER & GAMBLE CO/THE	普通社債券	3.0	100	108	11,714	2030/ 3/25
PROCTER & GAMBLE CO/THE	普通社債券	1.2	50	47	5,085	2030/10/29
PROGRESSIVE CORP	普通社債券	3.2	100	109	11,846	2030/ 3/26
PROLOGIS LP	普通社債券	2.125	50	51	5,579	2027/ 4/15
PROV ST JOSEPH HLTH OBL	普通社債券	2.532	100	103	11,215	2029/10/ 1
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	普通社債券	5.625	500	537	57,984	2023/ 6/15
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	普通社債券	4.5	100	107	11,576	2027/ 9/15
PRUDENTIAL PLC	普通社債券	3.125	100	107	11,605	2030/ 4/14
PUBLIC SERVICE COLORADO	普通社債券	3.7	50	55	6,034	2028/ 6/15
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	普通社債券	3.25	50	53	5,755	2023/ 9/ 1
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	普通社債券	3.0	150	161	17,413	2025/ 5/15
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	普通社債券	3.0	100	108	11,719	2027/ 5/15
PUBLIC SERVICE ELECTRIC	普通社債券	2.45	35	36	3,908	2030/ 1/15
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	普通社債券	1.6	100	93	10,034	2030/ 8/15
PUBLIC STORAGE	普通社債券	3.094	125	137	14,789	2027/ 9/15
PUGET ENERGY INC	普通社債券	5.625	100	105	11,383	2022/ 7/15
QUALCOMM INC	普通社債券	2.6	100	104	11,232	2023/ 1/30
QUALCOMM INC	普通社債券	2.9	300	320	34,603	2024/ 5/20
QUALCOMM INC	普通社債券	3.45	100	109	11,850	2025/ 5/20
QUALCOMM INC	普通社債券	3.25	100	110	11,916	2027/ 5/20
QUEST DIAGNOSTICS INC	普通社債券	3.5	100	108	11,757	2025/ 3/30
RALPH LAUREN CORP	普通社債券	1.7	100	101	10,967	2022/ 6/15
RALPH LAUREN CORP	普通社債券	3.75	50	55	5,978	2025/ 9/15
RAYMOND JAMES FINANCIAL	普通社債券	4.65	100	117	12,686	2030/ 4/ 1
RAYTHEON TECH CORP	普通社債券	2.5	250	257	27,812	2022/12/15
RAYTHEON TECH CORP	普通社債券	2.25	200	199	21,550	2030/ 7/ 1
REALTY INCOME CORP	普通社債券	0.75	80	77	8,408	2026/ 3/15
REALTY INCOME CORP	普通社債券	3.65	200	220	23,807	2028/ 1/15
REGENCY CENTERS LP	普通社債券	3.6	30	32	3,535	2027/ 2/ 1
REGENCY CENTERS LP	普通社債券	4.125	50	55	5,996	2028/ 3/15
REGENERON PHARMACEUTICAL	普通社債券	1.75	135	125	13,589	2030/ 9/15
REINSURANCE GRP OF AMER	普通社債券	3.9	75	83	8,966	2029/ 5/15
REINSURANCE GRP OF AMER	普通社債券	3.15	35	36	3,971	2030/ 6/15
RELIANCE STEEL & ALUM	普通社債券	4.5	100	107	11,558	2023/ 4/15
RELX CAPITAL INC	普通社債券	3.0	85	89	9,651	2030/ 5/22
RENAISSANCERE FINANCE	普通社債券	3.45	65	70	7,644	2027/ 7/ 1
RENAISSANCERE HOLDINGS L	普通社債券	3.6	25	27	2,963	2029/ 4/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
REPUBLIC SERVICES INC	普通社債券	2.5	45	47	5,133	2024/ 8/15
REPUBLIC SERVICES INC	普通社債券	0.875	100	98	10,635	2025/11/15
REPUBLIC SERVICES INC	普通社債券	3.375	60	66	7,168	2027/11/15
REPUBLIC SERVICES INC	普通社債券	3.95	100	113	12,233	2028/ 5/15
REYNOLDS AMERICAN INC	普通社債券	4.45	250	279	30,112	2025/ 6/12
RIO TINTO FIN USA LTD	普通社債券	7.125	100	136	14,720	2028/ 7/15
ROGERS COMMUNICATIONS IN	普通社債券	2.9	200	216	23,348	2026/11/15
ROPER TECHNOLOGIES INC	普通社債券	3.125	150	155	16,796	2022/11/15
ROPER TECHNOLOGIES INC	普通社債券	3.8	55	61	6,671	2026/12/15
ROPER TECHNOLOGIES INC	普通社債券	2.0	100	97	10,481	2030/ 6/30
ROYAL BANK OF CANADA	普通社債券	1.95	100	102	11,109	2023/ 1/17
ROYAL BANK OF CANADA	普通社債券	3.7	100	108	11,679	2023/10/ 5
ROYAL BANK OF CANADA	普通社債券	2.25	150	157	17,018	2024/11/ 1
ROYAL BANK OF CANADA	普通社債券	4.65	150	173	18,699	2026/ 1/27
NATWEST GROUP PLC	普通社債券	4.8	200	228	24,648	2026/ 4/ 5
NATWEST GROUP PLC	普通社債券	4.445	200	226	24,488	2029/ 5/ 8
ROYALTY PHARMA PLC	普通社債券	0.75	105	105	11,350	2023/ 9/ 2
ROYALTY PHARMA PLC	普通社債券	2.2	65	62	6,784	2030/ 9/ 2
RPM INTERNATIONAL INC	普通社債券	4.55	50	57	6,153	2029/ 3/ 1
RYDER SYSTEM INC	普通社債券	3.65	100	108	11,710	2024/ 3/18
S&P GLOBAL INC	普通社債券	4.0	50	55	6,020	2025/ 6/15
S&P GLOBAL INC	普通社債券	2.95	150	161	17,469	2027/ 1/22
SABINE PASS LIQUEFACTION	普通社債券	5.75	100	113	12,249	2024/ 5/15
SABINE PASS LIQUEFACTION	普通社債券	4.2	400	445	48,037	2028/ 3/15
SABINE PASS LIQUEFACTION	普通社債券	4.5	255	288	31,090	2030/ 5/15
SABRA HEALTH CARE LP	普通社債券	4.8	50	54	5,882	2024/ 6/ 1
SABRA HEALTH CARE LP	普通社債券	3.9	50	51	5,593	2029/10/15
SALESFORCE.COM INC	普通社債券	3.7	200	225	24,300	2028/ 4/11
SANDS CHINA LTD	普通社債券	4.6	200	214	23,139	2023/ 8/ 8
SANDS CHINA LTD	普通社債券	5.125	200	223	24,163	2025/ 8/ 8
SANOFI	普通社債券	3.375	100	106	11,517	2023/ 6/19
SANOFI	普通社債券	3.625	100	112	12,091	2028/ 6/19
SANTANDER HOLDINGS USA	普通社債券	3.4	200	208	22,550	2023/ 1/18
SANTANDER HOLDINGS USA	普通社債券	3.5	70	75	8,104	2024/ 6/ 7
SANTANDER HOLDINGS USA	普通社債券	3.45	100	107	11,577	2025/ 6/ 2
SANTANDER HOLDINGS USA	普通社債券	4.4	120	134	14,474	2027/ 7/13
BANCO SANTANDER SA	普通社債券	5.179	200	230	24,890	2025/11/19
SANTANDER UK GROUP HLDGS	普通社債券	4.796	200	220	23,829	2023/11/15
SANTANDER UK PLC	普通社債券	2.1	200	206	22,247	2023/ 1/13

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
SCHLUMBERGER INVESTMENT	普通社債券	3.65	200	215	23,246	2023/12/ 1
SEMPRA ENERGY	普通社債券	2.875	100	103	11,128	2022/10/ 1
SEMPRA ENERGY	普通社債券	3.4	100	108	11,726	2028/ 2/ 1
SHELL INTERNATIONAL FIN	普通社債券	2.875	200	215	23,226	2026/ 5/10
SHELL INTERNATIONAL FIN	普通社債券	3.4	350	376	40,619	2023/ 8/12
SHELL INTERNATIONAL FIN	普通社債券	3.875	150	169	18,318	2028/11/13
SHELL INTERNATIONAL FIN	普通社債券	2.375	100	101	10,963	2029/11/ 7
SHELL INTERNATIONAL FIN	普通社債券	2.75	185	192	20,770	2030/ 4/ 6
SHERWIN-WILLIAMS CO	普通社債券	3.125	50	53	5,784	2024/ 6/ 1
SHERWIN-WILLIAMS CO	普通社債券	3.45	100	109	11,850	2027/ 6/ 1
SHIRE ACQ INV IRELAND DA	普通社債券	2.875	150	158	17,059	2023/ 9/23
SIGNATURE BANK NEW YORK	普通社債券	4.0	100	103	11,133	2025/10/15
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	2.0	100	103	11,209	2024/ 9/13
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	3.375	100	108	11,663	2024/10/ 1
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	3.5	65	70	7,630	2025/ 9/ 1
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	3.25	100	108	11,728	2026/11/30
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	3.375	100	108	11,749	2027/12/ 1
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	2.45	100	100	10,804	2029/ 9/13
SIMON PROPERTY GROUP LP	普通社債券	2.65	100	99	10,782	2030/ 7/15
SIXTH STREET SPECIALTY	普通社債券	2.5	65	64	6,939	2026/ 8/ 1
SL GREEN REALTY CORP	普通社債券	4.5	50	52	5,678	2022/12/ 1
SMITH & NEPHEW PLC	普通社債券	2.032	50	47	5,169	2030/10/14
SOUTHERN CAL EDISON	普通社債券	3.5	100	106	11,530	2023/10/ 1
SOUTHERN CAL EDISON	普通社債券	2.25	35	34	3,739	2030/ 6/ 1
SOUTHERN CALIF GAS CO	普通社債券	3.15	100	108	11,681	2024/ 9/15
SOUTHERN CO	普通社債券	3.7	250	273	29,550	2030/ 4/30
SOUTHERN CO	普通社債券	4.0	100	104	11,246	2025/10/15
SOUTHERN CO GAS CAPITAL	普通社債券	2.45	50	52	5,633	2023/10/ 1
SOUTHERN COPPER CORP	普通社債券	3.5	67	69	7,536	2022/11/ 8
SOUTHWEST AIRLINES CO	普通社債券	3.0	100	105	11,410	2026/11/15
SOUTHWEST AIRLINES CO	普通社債券	5.125	170	198	21,417	2027/ 6/15
SOUTHWESTERN ELEC POWER	普通社債券	4.1	100	112	12,120	2028/ 9/15
LIFESTORAGE LP	普通社債券	3.5	50	54	5,934	2026/ 7/ 1
SPECTRA ENERGY PARTNERS	普通社債券	4.75	150	165	17,873	2024/ 3/15
SPIRIT REALTY LP	普通社債券	3.2	100	104	11,296	2027/ 1/15
SPIRIT REALTY LP	普通社債券	3.4	100	104	11,292	2030/ 1/15
SSM HEALTH CARE	普通社債券	3.688	100	106	11,469	2023/ 6/ 1
STANLEY BLACK & DECKER I	普通社債券	3.4	70	77	8,312	2026/ 3/ 1
STANLEY BLACK & DECKER I	普通社債券	4.0	30	31	3,392	2025/ 3/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
STARBUCKS CORP	普通社債券	3.8	100	111	11,985	2025/ 8/15
STARBUCKS CORP	普通社債券	2.0	200	205	22,122	2027/ 3/12
STARBUCKS CORP	普通社債券	3.5	50	55	5,942	2028/ 3/ 1
STEEL DYNAMICS INC	普通社債券	2.8	150	159	17,240	2024/12/15
STIFEL FINANCIAL CORP	普通社債券	4.25	100	111	11,990	2024/ 7/18
STORE CAPITAL CORP	普通社債券	4.625	50	56	6,077	2029/ 3/15
STRYKER CORP	普通社債券	3.5	25	27	2,983	2026/ 3/15
STRYKER CORP	普通社債券	1.95	100	97	10,506	2030/ 6/15
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.784	150	167	18,040	2026/ 3/ 9
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.102	250	262	28,307	2023/ 1/17
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	2.448	200	211	22,779	2024/ 9/27
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	2.348	200	209	22,558	2025/ 1/15
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	0.948	200	196	21,177	2026/ 1/12
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.364	200	219	23,723	2027/ 7/12
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.544	100	110	11,912	2028/ 1/17
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.944	100	112	12,172	2028/ 7/19
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	3.04	200	212	22,899	2029/ 7/16
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	普通社債券	1.71	200	190	20,511	2031/ 1/12
SUNCOR ENERGY INC	普通社債券	3.1	40	42	4,620	2025/ 5/15
SUNOCO LOGISTICS PARTNER	普通社債券	4.25	60	65	7,020	2024/ 4/ 1
TRUIST BANK	普通社債券	2.8	300	308	33,269	2022/ 5/17
TRUIST BANK	普通社債券	2.45	100	102	11,099	2022/ 8/ 1
TRUIST BANK	普通社債券	3.3	200	218	23,581	2026/ 5/15
TRUIST FINANCIAL CORP	普通社債券	4.0	150	166	17,997	2025/ 5/ 1
SUTTER HEALTH	普通社債券	2.294	100	100	10,837	2030/ 8/15
SUZANO AUSTRIA GMBH	普通社債券	6.0	200	236	25,496	2029/ 1/15
SVB FINANCIAL GROUP	普通社債券	3.5	150	162	17,555	2025/ 1/29
SYNCHRONY FINANCIAL	普通社債券	2.85	30	30	3,335	2022/ 7/25
SYNCHRONY FINANCIAL	普通社債券	3.7	150	162	17,565	2026/ 8/ 4
SYNOVUS FINANCIAL CORP	普通社債券	3.125	30	31	3,353	2022/11/ 1
SYSCO CORPORATION	普通社債券	3.55	150	163	17,652	2025/ 3/15
SYSCO CORPORATION	普通社債券	3.25	200	217	23,470	2027/ 7/15
SYSCO CORPORATION	普通社債券	5.95	120	150	16,276	2030/ 4/ 1
T-MOBILE USA INC	普通社債券	3.75	650	713	77,039	2027/ 4/15
T-MOBILE USA INC	普通社債券	3.875	200	218	23,586	2030/ 4/15
TAKEDA PHARMACEUTICAL	普通社債券	4.4	200	219	23,693	2023/11/26
TAKEDA PHARMACEUTICAL	普通社債券	2.05	200	193	20,915	2030/ 3/31
TARGET CORP	普通社債券	2.25	250	262	28,359	2025/ 4/15
TARGET CORP	普通社債券	2.65	100	105	11,353	2030/ 9/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
TC PIPELINES LP	普通社債券	3.9	40	44	4,777	2027/ 5/25
TD AMERITRADE HOLDING CO	普通社債券	3.75	100	109	11,777	2024/ 4/ 1
TECK RESOURCES LIMITED	普通社債券	3.9	100	106	11,543	2030/ 7/15
TELEFONICA EMISIONES SAU	普通社債券	4.103	300	338	36,503	2027/ 3/ 8
TELUS CORP	普通社債券	2.8	50	53	5,817	2027/ 2/16
TEXAS INSTRUMENTS INC	普通社債券	1.375	130	132	14,317	2025/ 3/12
TEXAS INSTRUMENTS INC	普通社債券	2.9	70	76	8,268	2027/11/ 3
TEXAS INSTRUMENTS INC	普通社債券	2.25	65	66	7,140	2029/ 9/ 4
TEXTRON INC	普通社債券	4.3	115	124	13,482	2024/ 3/ 1
TEXTRON INC	普通社債券	4.0	25	27	2,978	2026/ 3/15
TEXTRON INC	普通社債券	3.0	100	102	11,090	2030/ 6/ 1
THERMO FISHER SCIENTIFIC	普通社債券	3.2	200	218	23,572	2027/ 8/15
TIMKEN CO	普通社債券	3.875	70	74	8,077	2024/ 9/ 1
TJX COS INC	普通社債券	3.5	270	295	31,830	2025/ 4/15
GLOBE LIFE INC	普通社債券	3.8	75	78	8,491	2022/ 9/15
TORONTO-DOMINION BANK	普通社債券	3.5	200	214	23,177	2023/ 7/19
TORONTO-DOMINION BANK	普通社債券	0.55	250	249	26,907	2024/ 3/ 4
TORONTO-DOMINION BANK	普通社債券	0.75	200	195	21,137	2026/ 1/ 6
TORONTO-DOMINION BANK	普通社債券	3.625	125	138	14,923	2026/ 9/15
TOTAL CAPITAL INTL SA	普通社債券	3.7	100	109	11,764	2024/ 1/15
TOTAL CAPITAL INTL SA	普通社債券	3.75	150	164	17,761	2024/ 4/10
TOTAL CAPITAL INTL SA	普通社債券	2.829	200	211	22,785	2030/ 1/10
TOYOTA MOTOR CORP	普通社債券	2.157	55	56	6,078	2022/ 7/ 2
TOYOTA MOTOR CORP	普通社債券	3.419	100	107	11,556	2023/ 7/20
TOYOTA MOTOR CORP	普通社債券	3.669	70	79	8,529	2028/ 7/20
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	2.25	200	209	22,616	2023/10/18
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	0.45	100	100	10,816	2022/ 7/22
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	2.15	100	102	11,087	2022/ 9/ 8
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	2.9	10	10	1,135	2023/ 3/30
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	0.5	155	155	16,759	2023/ 8/14
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	1.8	200	206	22,265	2025/ 2/13
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	3.2	100	109	11,851	2027/ 1/11
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	普通社債券	2.15	100	101	10,899	2030/ 2/13
TRANSCANADA PIPELINES	普通社債券	3.75	150	160	17,331	2023/10/16
TRANSCANADA PIPELINES	普通社債券	4.25	150	170	18,397	2028/ 5/15
TRANSCANADA PIPELINES	普通社債券	4.1	100	112	12,179	2030/ 4/15
TRANSCONT GAS PIPE LINE	普通社債券	7.85	100	128	13,846	2026/ 2/ 1
TRANSCONT GAS PIPE LINE	普通社債券	3.25	150	158	17,069	2030/ 5/15
TRIMBLE INC	普通社債券	4.9	100	116	12,606	2028/ 6/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
TRUIST BANK	普通社債券	1.5	250	254	27,485	2025/ 3/10
TRUIST FINANCIAL CORP	普通社債券	1.267	60	59	6,468	2026/ 3/ 2
TRUIST FINANCIAL CORP	普通社債券	1.125	200	194	21,024	2027/ 8/ 3
TRUIST FINANCIAL CORP	普通社債券	1.95	65	64	6,957	2030/ 6/ 5
TYCO ELECTRONICS GROUP S	普通社債券	3.7	100	111	11,986	2026/ 2/15
TYSON FOODS INC	普通社債券	3.9	40	43	4,660	2023/ 9/28
TYSON FOODS INC	普通社債券	3.95	100	109	11,865	2024/ 8/15
TYSON FOODS INC	普通社債券	4.0	135	150	16,250	2026/ 3/ 1
TYSON FOODS INC	普通社債券	4.35	100	115	12,484	2029/ 3/ 1
UDR INC	普通社債券	3.2	150	159	17,216	2030/ 1/15
UNILEVER CAPITAL CORP	普通社債券	2.2	100	102	11,018	2022/ 5/ 5
UNILEVER CAPITAL CORP	普通社債券	3.25	100	108	11,661	2024/ 3/ 7
UNILEVER CAPITAL CORP	普通社債券	3.1	100	109	11,762	2025/ 7/30
UNILEVER CAPITAL CORP	普通社債券	3.5	100	112	12,153	2028/ 3/22
UNION ELECTRIC CO	普通社債券	2.95	50	54	5,842	2027/ 6/15
UNION PACIFIC CORP	普通社債券	3.5	100	106	11,492	2023/ 6/ 8
UNION PACIFIC CORP	普通社債券	3.75	100	110	11,956	2025/ 7/15
UNION PACIFIC CORP	普通社債券	3.25	200	217	23,436	2025/ 8/15
UNION PACIFIC CORP	普通社債券	2.75	100	106	11,497	2026/ 3/ 1
MUFG AMERICAS HLDGS CORP	普通社債券	3.5	100	103	11,214	2022/ 6/18
UNITED AIR 2014-2 A PTT	普通社債券	3.75	138	143	15,520	2026/ 9/ 3
UNITED AIR 2020-1 A PTT	普通社債券	5.875	243	273	29,464	2027/10/15
UNITED AIR 2020-1 B PTT	普通社債券	4.875	100	104	11,225	2026/ 1/15
UNITED PARCEL SERVICE	普通社債券	2.35	100	102	11,034	2022/ 5/16
UNITED PARCEL SERVICE	普通社債券	2.2	20	21	2,267	2024/ 9/ 1
UNITED PARCEL SERVICE	普通社債券	3.05	150	164	17,773	2027/11/15
UNITED PARCEL SERVICE	普通社債券	2.5	20	20	2,239	2029/ 9/ 1
RAYTHEON TECH CORP	普通社債券	3.125	150	163	17,625	2027/ 5/ 4
RAYTHEON TECH CORP	普通社債券	4.125	100	114	12,320	2028/11/16
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.5	250	267	28,817	2023/ 6/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.5	20	21	2,341	2024/ 2/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	2.375	70	73	7,978	2024/ 8/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.75	150	166	18,013	2025/ 7/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.7	20	22	2,409	2025/12/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	1.25	35	35	3,792	2026/ 1/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.45	200	221	23,917	2027/ 1/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	3.875	25	28	3,066	2028/12/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	普通社債券	2.875	75	80	8,635	2029/ 8/15
UNUM GROUP	普通社債券	4.0	100	109	11,767	2024/ 3/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
VIATRIS INC	普通社債券	2.3	100	102	11,053	2027/ 6/22
VIATRIS INC	普通社債券	2.7	100	99	10,769	2030/ 6/22
UDR INC	普通社債券	2.95	25	26	2,893	2026/ 9/ 1
US BANCORP	普通社債券	2.4	100	105	11,413	2024/ 7/30
US BANCORP	普通社債券	2.375	150	158	17,082	2026/ 7/22
US BANCORP	普通社債券	3.15	100	109	11,850	2027/ 4/27
US BANCORP	普通社債券	1.375	150	141	15,241	2030/ 7/22
US BANK NA CINCINNATI	普通社債券	3.4	250	267	28,858	2023/ 7/24
US BANK NA CINCINNATI	普通社債券	2.05	250	260	28,070	2025/ 1/21
VALE OVERSEAS LIMITED	普通社債券	6.25	100	121	13,058	2026/ 8/10
VALE OVERSEAS LIMITED	普通社債券	3.75	100	105	11,410	2030/ 7/ 8
VALERO ENERGY CORP	普通社債券	3.65	150	162	17,504	2025/ 3/15
VALERO ENERGY CORP	普通社債券	2.15	150	148	16,033	2027/ 9/15
VALERO ENERGY CORP	普通社債券	4.35	70	77	8,405	2028/ 6/ 1
VALERO ENERGY PARTNERS	普通社債券	4.375	45	50	5,480	2026/12/15
VENTAS REALTY LP	普通社債券	3.1	200	209	22,624	2023/ 1/15
VENTAS REALTY LP	普通社債券	3.5	100	108	11,701	2025/ 2/ 1
VENTAS REALTY LP	普通社債券	4.4	100	113	12,198	2029/ 1/15
VEREIT OPERATING PARTNER	普通社債券	4.6	40	43	4,744	2024/ 2/ 6
VEREIT OPERATING PARTNER	普通社債券	4.875	50	57	6,251	2026/ 6/ 1
VEREIT OPERATING PARTNER	普通社債券	3.95	40	44	4,794	2027/ 8/15
VERISK ANALYTICS INC	普通社債券	4.0	200	221	23,933	2025/ 6/15
VERIZON COMMUNICATIONS	普通社債券	5.15	250	278	30,042	2023/ 9/15
VERIZON COMMUNICATIONS	普通社債券	3.376	300	326	35,235	2025/ 2/15
VERIZON COMMUNICATIONS	普通社債券	4.125	200	228	24,683	2027/ 3/16
VERIZON COMMUNICATIONS	普通社債券	4.329	321	368	39,790	2028/ 9/21
VERIZON COMMUNICATIONS	普通社債券	1.68	547	511	55,186	2030/10/30
VF CORP	普通社債券	2.8	200	214	23,117	2027/ 4/23
VF CORP	普通社債券	2.95	65	68	7,405	2030/ 4/23
VIACOMCBS INC	普通社債券	3.875	100	108	11,702	2024/ 4/ 1
VIACOMCBS INC	普通社債券	3.7	200	219	23,660	2028/ 6/ 1
VIRGINIA ELEC & POWER CO	普通社債券	3.1	100	107	11,612	2025/ 5/15
VIRGINIA ELEC & POWER CO	普通社債券	3.15	200	217	23,469	2026/ 1/15
VISA INC	普通社債券	2.15	20	20	2,215	2022/ 9/15
VISA INC	普通社債券	1.9	350	361	39,000	2027/ 4/15
VISA INC	普通社債券	2.75	50	54	5,848	2027/ 9/15
VISA INC	普通社債券	2.05	95	96	10,360	2030/ 4/15
VMWARE INC	普通社債券	3.9	100	110	11,911	2027/ 8/21
VODAFONE GROUP PLC	普通社債券	2.5	250	257	27,830	2022/ 9/26

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
VODAFONE GROUP PLC	普通社債券	3.75	95	103	11,149	2024/ 1/16
VODAFONE GROUP PLC	普通社債券	4.375	100	115	12,488	2028/ 5/30
VORNADO REALTY LP	普通社債券	3.5	100	105	11,422	2025/ 1/15
VOYA FINANCIAL INC	普通社債券	3.65	100	112	12,086	2026/ 6/15
VULCAN MATERIALS CO	普通社債券	4.5	100	112	12,118	2025/ 4/ 1
VULCAN MATERIALS CO	普通社債券	3.9	20	22	2,457	2027/ 4/ 1
WESTINGHOUSE AIR BRAKE	普通社債券	4.95	150	172	18,642	2028/ 9/15
WALMART INC	普通社債券	2.55	200	208	22,480	2023/ 4/11
WALGREEN CO	普通社債券	3.1	150	155	16,832	2022/ 9/15
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	普通社債券	3.2	75	79	8,557	2030/ 4/15
WALMART INC	普通社債券	3.55	100	110	11,957	2025/ 6/26
WALMART INC	普通社債券	3.7	400	453	48,937	2028/ 6/26
WALMART INC	普通社債券	2.375	90	93	10,061	2029/ 9/24
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	1.65	35	35	3,850	2022/ 9/ 1
TWDC ENTERPRISES 18 CORP	普通社債券	2.35	150	155	16,742	2022/12/ 1
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	3.7	100	109	11,822	2024/ 9/15
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	3.35	100	108	11,753	2025/ 3/24
TWDC ENTERPRISES 18 CORP	普通社債券	2.95	100	108	11,741	2027/ 6/15
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	2.2	270	278	30,059	2028/ 1/13
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	2.0	65	64	6,991	2029/ 9/ 1
WALT DISNEY COMPANY/THE	普通社債券	3.8	100	111	12,084	2030/ 3/22
WASTE CONNECTIONS INC	普通社債券	3.5	100	110	11,898	2029/ 5/ 1
WASTE MANAGEMENT INC	普通社債券	2.9	150	154	16,701	2022/ 9/15
WEC ENERGY GROUP INC	普通社債券	0.55	100	100	10,798	2023/ 9/15
WEIBO CORP	普通社債券	3.375	200	199	21,556	2030/ 7/ 8
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	3.55	200	219	23,730	2025/ 9/29
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	4.125	250	271	29,287	2023/ 8/15
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	3.75	250	271	29,256	2024/ 1/24
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	1.654	150	153	16,566	2023/ 6/ 2
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	2.164	325	337	36,370	2025/ 2/11
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	2.188	95	98	10,618	2025/ 4/30
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	4.1	200	224	24,273	2026/ 6/ 3
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	3.0	200	215	23,229	2026/10/23
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	3.196	200	216	23,355	2026/ 6/17
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	3.584	415	456	49,291	2027/ 5/22
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	2.393	200	206	22,239	2027/ 6/ 2
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	4.15	250	284	30,684	2029/ 1/24
WELLS FARGO & COMPANY	普通社債券	2.879	150	156	16,921	2029/10/30
WELLTOWER INC	普通社債券	3.625	130	140	15,176	2024/ 3/15

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
WELLTOWER INC	普通社債券	2.7	100	106	11,466	2027/ 2/15
WELLTOWER INC	普通社債券	4.25	50	56	6,102	2028/ 4/15
WESTERN UNION CO/THE	普通社債券	3.6	50	51	5,549	2022/ 3/15
WESTERN UNION CO/THE	普通社債券	4.25	50	53	5,800	2023/ 6/ 9
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	2.85	150	161	17,407	2026/ 5/13
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	2.0	30	30	3,340	2023/ 1/13
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	3.65	100	107	11,574	2023/ 5/15
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	3.35	100	110	11,969	2027/ 3/ 8
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	2.894	250	258	27,944	2025/ 2/ 4
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	4.322	100	111	12,042	2026/11/23
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	4.11	150	161	17,446	2029/ 7/24
WESTPAC BANKING CORP	普通社債券	2.668	85	82	8,908	2030/11/15
WHIRLPOOL CORP	普通社債券	3.7	100	109	11,830	2025/ 5/ 1
WILLIAMS COMPANIES INC	普通社債券	4.55	140	155	16,760	2024/ 6/24
WILLIAMS COMPANIES INC	普通社債券	2.6	100	98	10,678	2031/ 3/15
WILLIAMS COMPANIES INC	普通社債券	4.3	200	218	23,536	2024/ 3/ 4
WILLIS NORTH AMERICA INC	普通社債券	3.6	50	54	5,841	2024/ 5/15
WILLIS NORTH AMERICA INC	普通社債券	4.5	100	114	12,388	2028/ 9/15
WPP FINANCE 2010	普通社債券	3.625	150	156	16,906	2022/ 9/ 7
WPP FINANCE 2010	普通社債券	3.75	100	109	11,846	2024/ 9/19
WPX ENERGY INC	普通社債券	4.5	250	266	28,747	2030/ 1/15
WRKCO INC	普通社債券	4.0	50	56	6,047	2028/ 3/15
WRKCO INC	普通社債券	3.9	100	111	12,060	2028/ 6/ 1
WRKCO INC	普通社債券	4.9	200	236	25,542	2029/ 3/15
WW GRAINGER INC	普通社債券	1.85	50	51	5,581	2025/ 2/15
WYETH LLC	普通社債券	6.45	100	116	12,561	2024/ 2/ 1
XCEL ENERGY INC	普通社債券	0.5	300	300	32,400	2023/10/15
XCEL ENERGY INC	普通社債券	4.0	50	56	6,075	2028/ 6/15
XLIT LTD	普通社債券	4.45	50	56	6,063	2025/ 3/31
XYLEM INC	普通社債券	3.25	55	60	6,508	2026/11/ 1
ZIMMER BIOMET HOLDINGS	普通社債券	3.05	100	107	11,636	2026/ 1/15
ZIMMER BIOMET HOLDINGS	普通社債券	3.55	100	108	11,740	2025/ 4/ 1
ZOETIS INC	普通社債券	3.9	25	28	3,024	2028/ 8/20
ZOETIS INC	普通社債券	2.0	100	97	10,499	2030/ 5/15
合 計					22,334,016	

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('21年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 22,334,016	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	386,201	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	22,720,217	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=107.90円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(22,602,572千円)の投資信託財産総額(22,720,217千円)に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('21年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	22,756,217,917
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	201,531,426
公 社 債(評価額)	22,334,016,375
未 収 入 金	42,513,121
未 収 利 息	169,157,314
前 払 費 用	8,999,681
(B)負 債	152,072,238
未 払 金	121,372,978
未 払 解 約 金	30,699,189
未 払 利 息	71
(C)純 資 産 総 額(A - B)	22,604,145,679
元 本	11,183,285,945
次 期 繰 越 損 益 金	11,420,859,734
(D)受 益 権 総 口 数	11,183,285,945口
1 万口当たり基準価額(C/D×10,000)	20,212円

(注1) 期首元本額 13,293,314,494円

期中追加設定元本額 5,147,124,646円

期中一部解約元本額 7,257,153,195円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーファンド別内訳は、次の通りです。

米国社債インデックス・ファンド(年金)〈適格機関投資家限定〉 5,582,956,535円

ステート・ストリート米国社債インデックス・オープン(為替ヘッジあり) 2,824,316,305円

米国社債インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)〈適格機関投資家限定〉 2,242,563,341円

米国社債インデックス・ファンド(為替ヘッジ付き)〈適格機関投資家限定(別枠)〉(為替ヘッジなし) 253,371,099円

ステート・ストリート米国社債インデックス・オープン2 189,921,041円

ステート・ストリートUSボンド・オープン(為替ヘッジあり) 90,157,624円

◎損益の状況

当期 (自'20年3月6日 至'21年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	828,635,863
受 取 利 息	828,386,246
そ の 他 収 益 金	291,595
支 払 利 息	△ 41,978
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 55,060,346
売 買 益	567,033,460
売 買 損	△ 622,093,806
(C)そ の 他 費 用	△ 4,674,964
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	768,900,553
(E)前 期 繰 越 損 益 金	12,754,466,689
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	5,011,491,336
(G)解 約 差 損 益 金	△ 7,113,998,844
(H) 計 (D + E + F + G)	11,420,859,734
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	11,420,859,734

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。