

○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"> <li>・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・パ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。</li> <li>・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。</li> </ul>                               |                                                                                                                                                                                                                                |
| 主要運用対象 | ベビーフンド                                                                                                                                                                                                                                                              | 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   | ベビーフンド                                                                                                                                                                                                                                                              | <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・米国社債への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> </ul> |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                             | <ul style="list-style-type: none"> <li>・米国社債への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>                                              |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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> |                                                                                                                                                                                                                                |

<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](http://www.ssga.com/jp)

**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1期 運用報告書(全体版)  
(決算日 2020年1月10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、2020年1月10日に第1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。

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><br>ブルームバーグ・<br>パークレイズ米国社債<br>(1-10年)インデックス<br>(円ベース) |        | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額 |
|--------------------|-------------|------------|-----------|---------------------------------------------------------------|--------|------------|------------|-----------|
|                    | (分配落)       | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率                                                     |        |            |            |           |
| (設定日)<br>'19年1月28日 | 円<br>10,000 | 円<br>-     | %<br>-    | 10,000                                                        | %<br>- | %<br>-     | %<br>-     | 百万円<br>9  |
| 1期('20年1月10日)      | 10,825      | 0          | 8.3       | 10,901                                                        | 9.0    | 98.8       | -          | 513       |

(注1) ベンチマークは、ブルームバーグ・パ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・パ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。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ビ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・パークレイズ・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><br>ブルームバーグ・<br>パークレイズ米国社債(1-10年)<br>インデックス(円ベース) |        | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 |
|--------------------|--------|--------|-----------------------------------------------------------|--------|------------|------------|
|                    | 円      | 騰落率    | 円                                                         | 騰落率    |            |            |
| (設定日)<br>'19年1月28日 | 10,000 | %<br>- | 10,000                                                    | %<br>- | %<br>-     | %<br>-     |
| 1月末                | 9,941  | △ 0.6  | 9,965                                                     | △ 0.3  | 97.1       | -          |
| 2月末                | 10,188 | 1.9    | 10,213                                                    | 2.1    | 97.6       | -          |
| 3月末                | 10,377 | 3.8    | 10,403                                                    | 4.0    | 96.7       | -          |
| 4月末                | 10,472 | 4.7    | 10,499                                                    | 5.0    | 99.0       | -          |
| 5月末                | 10,296 | 3.0    | 10,363                                                    | 3.6    | 97.8       | -          |
| 6月末                | 10,333 | 3.3    | 10,399                                                    | 4.0    | 97.9       | -          |
| 7月末                | 10,458 | 4.6    | 10,511                                                    | 5.1    | 98.1       | -          |
| 8月末                | 10,410 | 4.1    | 10,477                                                    | 4.8    | 98.0       | -          |
| 9月末                | 10,533 | 5.3    | 10,600                                                    | 6.0    | 98.6       | -          |
| 10月末               | 10,652 | 6.5    | 10,723                                                    | 7.2    | 98.4       | -          |
| 11月末               | 10,759 | 7.6    | 10,833                                                    | 8.3    | 98.8       | -          |
| 12月末               | 10,811 | 8.1    | 10,884                                                    | 8.8    | 98.6       | -          |
| (期末)<br>'20年1月10日  | 10,825 | 8.3    | 10,901                                                    | 9.0    | 98.8       | -          |

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) ベンチマークは、ブルームバーグ・パ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・パ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。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ビ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・パークレイズ・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

(2019年1月28日から2020年1月10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・パークレイズ米国社債(1-10年)インデックス(円ベース)※で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

※ブルームバーグ・パ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。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ビ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・パークレイズ・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。

| 決算期 | 当初元本    | 期末基準価額<br>(分配落ち) | 分配金 | 基準価額<br>騰落率 | ベンチマーク<br>騰落率 |
|-----|---------|------------------|-----|-------------|---------------|
| 第1期 | 10,000円 | 10,825円          | 0円  | +8.3%       | +9.0%         |

当期末の基準価額は10,825円となり、当初元本の10,000円に比べて825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】

- 期の半ばにトランプ米大統領が中国製品への新たな関税措置を発表したことを受けて債券が買われ、債券価格の上昇となりました。
- 米連邦準備制度理事会(FRB)の利下げが国債の下支え要因となるとともに投資家のリスクセンチメントの改善につながり、社債スプレッド(社債の国債に対する上乘せ利回り)が縮小し社債価格の上昇要因となりました。

### 【マイナスの要因】

- 期の半ばにリスクオフとなる中で円高が進み、基準価額にマイナス寄与しました。

## ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+8.3%となり、ベンチマークの騰落率(+9.0%)を0.7%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。

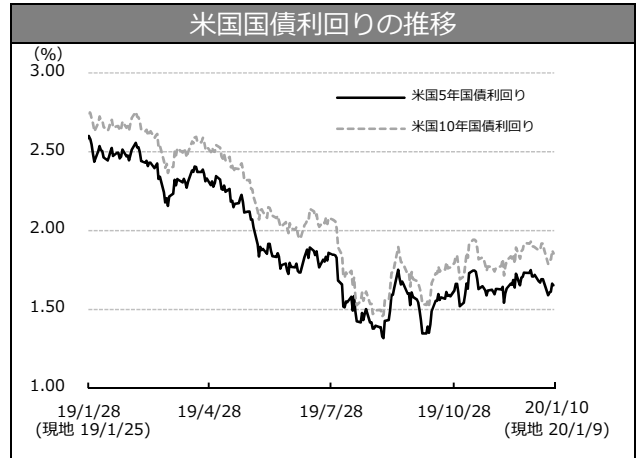
投資環境

(2019年1月28日から2020年1月10日まで)

米国債券市場

当期の米国の国債市場は、期前半、FRBがハト派色を強めたことや米中貿易摩擦激化が世界経済へ与える影響への懸念が債券の買い材料となりました。期後半に入ると、7月下旬にはFRBが0.25%の利下げをし債券が買われました。また、8月にはトランプ米大統領が中国製品への新たな関税措置を発表したことを受け、債券が大きく買い進まれました。その後は堅調な米雇用統計や米中貿易交渉の進展が見られたことから債券が売り戻される展開となりました。設定日の2019年1月28日(現地1月25日)に2.60%だった米国5年債利回りは、当期末の2020年1月10日(現地1月9日)には1.65%となりました(債券価格はプラス)。また、同期間の米国10年債利回りは、2.76%から1.85%まで低下しました(債券価格はプラス)。

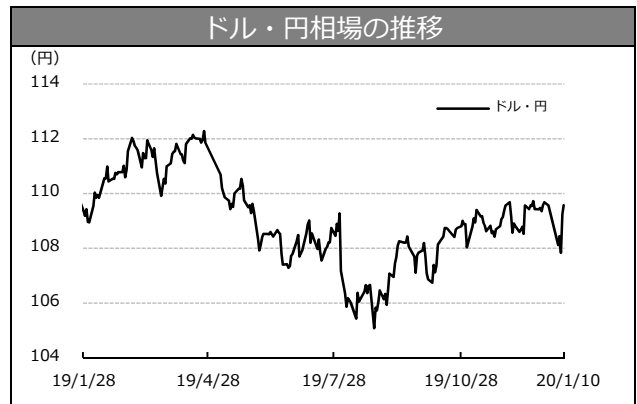
米国の社債市場は、期前半はFRBによるハト派への転換を受けて投資家のセンチメントが改善し、社債スプレッドが縮小傾向となりました。期後半は米中貿易摩擦に対する懸念が強まる場面では平均スプレッドが拡大しましたが、FRBによる3回の利下げや米中貿易摩擦の懸念後退、特に12月に米中貿易協議の第1段階が合意に至ったことが投資家のセンチメント改善につながり、社債スプレッドが縮小する展開となりました。ブルームバーグ・バークレイズ米国社債(1-10年)インデックスの平均スプレッドは、設定日2019年1月28日(現地1月25日)の1.09%から当期末の2020年1月10日(現地1月9日)には0.72%まで縮小(債券価格にプラス)しました。



同期間の米国10年債利回りは、2.76%から1.85%まで低下しました(債券価格はプラス)。

為替市況

ドル・円レートは、期前半、FRBのハト派的な姿勢を背景に世界経済に与えるマイナスの影響を和らげるとの期待から、投資家のセンチメントが改善し円安傾向となりました。8月にはトランプ米大統領が中国製品への新たな関税措置を発表したことを受け、投資家のセンチメントが悪化し円高が進みました。その後は米中貿易協議への進展期待や、英国の欧州連合(EU)離脱に対する懸念の後退を受けて世界的にリスク許容度が改善したことを背景に円安基調となりました。結果として、設定日の2019年1月28日に109円台前半だった相場は、当期末の2020年1月10日には概ね同水準の109円台半ばとなりました。



## 運用の概況

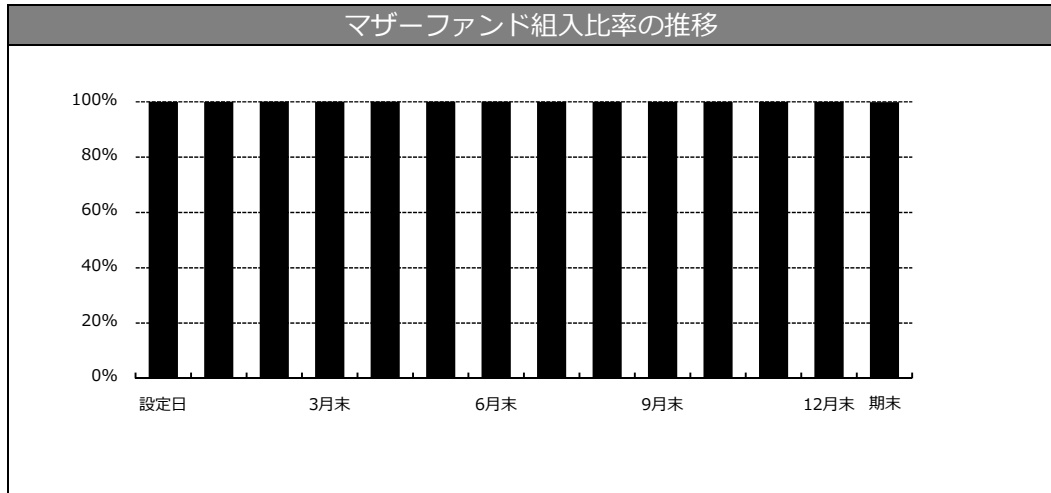
(2019年1月28日から2020年1月10日まで)

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・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。

### マザーファンドの組入状況

設定日からマザーファンドの組み入れを開始し、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・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。

◎1万円(元本10,000円)当たりの費用の明細

| 項 目       | 当 期<br>(2019年1月28日~2020年1月10日) |         | 項 目 の 概 要                                          |
|-----------|--------------------------------|---------|----------------------------------------------------|
|           | 金 額                            | 比 率     |                                                    |
| 平均基準価額    | 10,435円                        | -       | 期中の平均基準価額です。                                       |
| (a) 信託報酬  | 30円                            | 0.283%  | (a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率<br>消費税は報告日の税率を採用しています。     |
| (投信会社)    | ( 25)                          | (0.241) | 委託した資金の運用の対価                                       |
| (販売会社)    | ( 1)                           | (0.010) | 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)    | ( 3)                           | (0.031) | 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       | 33円                            | 0.312%  |                                                    |

(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。

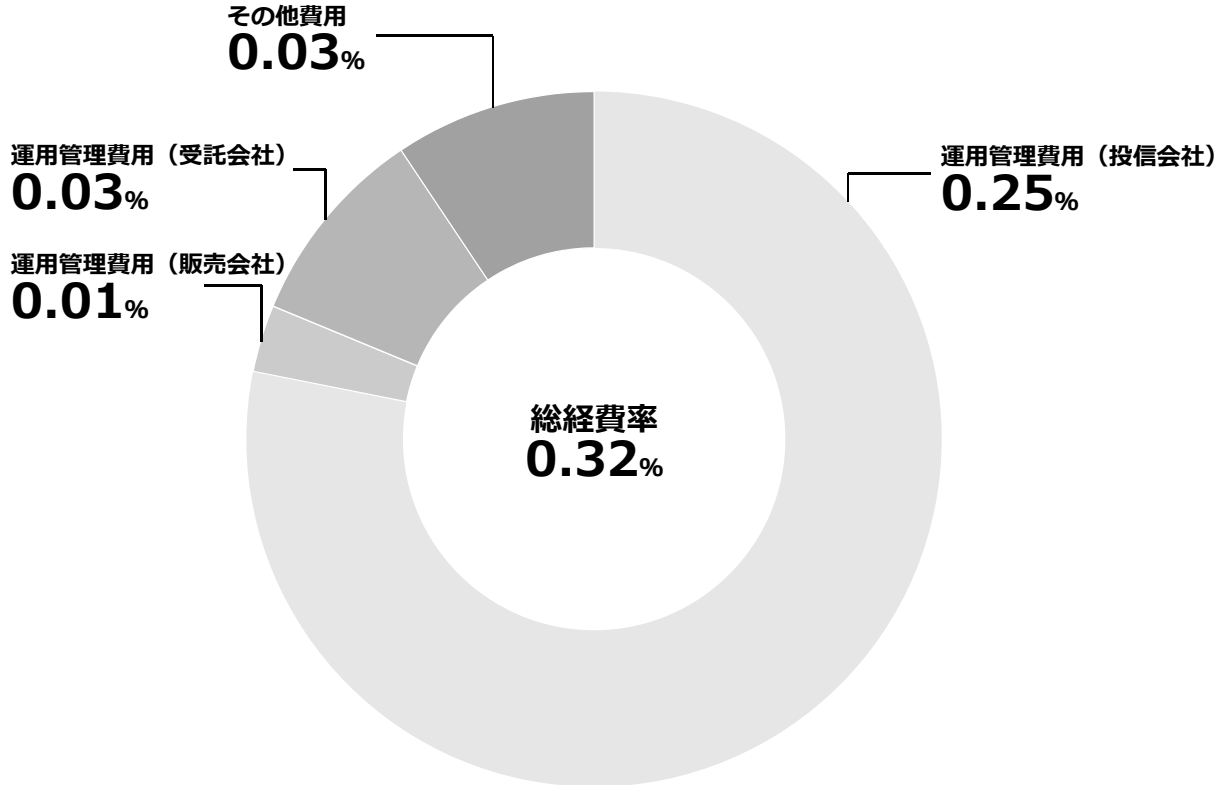
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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('19年1月28日から'20年1月10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<br>271,856 | 千円<br>506,236 | 千口<br>7,333 | 千円<br>13,853 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('19年1月28日から'20年1月10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     |
| CITIBANK NA 3.4% 21/7/23(アメリカ)               | 61,617 | VERIZON COMMUNICATIONS 4.329% 28/9/21(アメリカ)   | 95,353 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% 29/1/23(アメリカ) | 56,094 | ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 3.65% 26/2/1(アメリカ)    | 91,405 |
| HUNTINGTON BANCSHARES 2.625% 24/8/6(アメリカ)    | 54,201 | GE CAPITAL INTL FUNDING 2.342% 20/11/15(アメリカ) | 81,760 |
| BANK OF AMERICA CORP 3.458% 25/3/15(アメリカ)    | 49,783 | ANHEUSER BUSCH INBEV FIN 2.65% 21/2/1(アメリカ)   | 65,963 |
| HSBC HOLDINGS PLC 3.973% 30/5/22(アメリカ)       | 49,657 | JPMORGAN CHASE & CO 2.295% 21/8/15(アメリカ)      | 65,104 |
| IBM CORP 3.5% 29/5/15(アメリカ)                  | 46,361 | CITIGROUP INC 3.3% 25/4/27(アメリカ)              | 61,765 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.596% 22/1/7(アメリカ) | 46,159 | CITIBANK NA 3.4% 21/7/23(アメリカ)                | 60,939 |
| BROADCOM INC 4.25% 26/4/15(アメリカ)             | 45,099 | MORGAN STANLEY 2.65% 20/1/27(アメリカ)            | 59,702 |
| COMCAST CORP 3.45% 21/10/1(アメリカ)             | 44,929 | BANK OF AMERICA CORP 3.3% 23/1/11(アメリカ)       | 55,792 |
| US BANK NA CINCINNATI 3.15% 21/4/26(アメリカ)    | 44,544 | WELLS FARGO & COMPANY 3.5% 22/3/8(アメリカ)       | 55,764 |

(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('19年1月28日から'20年1月10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<br>9,990 | 千円<br>- | 千円<br>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('20年1月10日現在)

○親投資信託残高

| 種 類                                | 当 期 末         |               |
|------------------------------------|---------------|---------------|
|                                    | 口 数           | 評 価 額         |
| 米 国 社 債 イン デ ッ ク ス ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | 千口<br>264,523 | 千円<br>512,593 |

(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13,244,897千口です。

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('20年1月10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<br>512,593 | %<br>99.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,660         | 0.7       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 516,253       | 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=109.57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(25,647,478千円)の投資信託財産総額(25,787,704千円)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

('20年1月10日現在)

| 項 目                     | 当 期 末        |
|-------------------------|--------------|
|                         | 円            |
| (A)資 産                  | 516,253,867  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等         | 2,944,607    |
| 米国社債インデックス・マザーファンド(評価額) | 512,593,260  |
| 未 収 入 金                 | 716,000      |
| (B)負 債                  | 2,873,207    |
| 未 払 解 約 金               | 2,208,129    |
| 未 払 信 託 報 酬             | 641,367      |
| 未 払 利 息                 | 8            |
| そ の 他 未 払 費 用           | 23,703       |
| (C)純 資 産 総 額(A - B)     | 513,380,660  |
| 元 本                     | 474,264,729  |
| 次 期 繰 越 損 益 金           | 39,115,931   |
| (D)受 益 権 総 口 数          | 474,264,729口 |
| 1 万口当たり基準価額(C/D×10,000) | 10,825円      |

(注) 設定元本額 9,990,000円

期中追加設定元本額 530,352,729円

期中一部解約元本額 66,078,000円

◎損益の状況

当期(自'19年1月28日 至'20年1月10日)

| 項 目                        | 当 期           |
|----------------------------|---------------|
|                            | 円             |
| (A)配 当 等 収 益               | △ 556         |
| 支 払 利 息                    | △ 556         |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益         | 19,277,867    |
| 売 買 益                      | 20,471,334    |
| 売 買 損                      | △ 1,193,467   |
| (C)信 託 報 酬 等               | △ 820,169     |
| (D)当 期 損 益 金 ( A + B + C ) | 18,457,142    |
| (E)追 加 信 託 差 損 益 金         | 20,658,789    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )            | (△ 103)       |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )          | ( 20,658,892) |
| (F) 計 ( D + E )            | 39,115,931    |
| (G)収 益 分 配 金               | 0             |
| 次 期 繰 越 損 益 金 ( F + G )    | 39,115,931    |
| 追 加 信 託 差 損 益 金            | 20,658,789    |
| ( 配 当 等 相 当 額 )            | ( 1,652,145)  |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )          | ( 19,006,644) |
| 分 配 準 備 積 立 金              | 18,457,142    |

(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)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。

◎1 万口当たり分配原資の内訳(税込み)

| 項 目       | 第1期<br>(2019年1月28日～<br>2020年1月10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 | 824 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 10 期 運用報告書 (決算日 2019 年 3 月 5 日)

米国社債インデックス・マザーファンドの  
第 10 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"> <li>・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。</li> <li>・米国社債への投資は原則として高位を維持します。</li> <li>・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。</li> </ul> |
| 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"> <li>・米国社債への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外資建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>         |

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><br>ブルームバーグ・<br>バークレイズ米国社債<br>(1-10年)インデックス<br>(円ベース) |           | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額 |
|---------------|--------|-----------|---------------------------------------------------------------|-----------|------------|------------|-----------|
|               | 円      | 期中<br>騰落率 |                                                               | 期中<br>騰落率 |            |            |           |
| 6期('15年3月5日)  | 17,754 | 21.7      | 17,832                                                        | 21.4      | 98.2       | -          | 8,653     |
| 7期('16年3月7日)  | 17,000 | △4.2      | 17,051                                                        | △4.4      | 98.8       | -          | 29,710    |
| 8期('17年3月6日)  | 17,663 | 3.9       | 17,737                                                        | 4.0       | 98.1       | -          | 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    |

(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><br>ブルームバーグ・<br>バークレイズ米国社債<br>(1-10年)インデックス<br>(円ベース) |       | 債 券<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|------------|---------|-------|---------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------|
|            |         | 騰 落 率 |                                                               | 騰 落 率 |             |             |
| (期 首)      | 円       | %     |                                                               | %     | %           | %           |
| '18年 3月 5日 | 16,632  | -     | 16,701                                                        | -     | 98.7        | -           |
| 3月末        | 16,761  | 0.8   | 16,833                                                        | 0.8   | 98.6        | -           |
| 4月末        | 17,153  | 3.1   | 17,221                                                        | 3.1   | 98.3        | -           |
| 5月末        | 17,167  | 3.2   | 17,233                                                        | 3.2   | 98.1        | -           |
| 6月末        | 17,419  | 4.7   | 17,491                                                        | 4.7   | 98.4        | -           |
| 7月末        | 17,569  | 5.6   | 17,636                                                        | 5.6   | 98.3        | -           |
| 8月末        | 17,695  | 6.4   | 17,758                                                        | 6.3   | 98.6        | -           |
| 9月末        | 18,051  | 8.5   | 18,112                                                        | 8.4   | 98.4        | -           |
| 10月末       | 17,955  | 8.0   | 18,018                                                        | 7.9   | 98.0        | -           |
| 11月末       | 17,958  | 8.0   | 18,024                                                        | 7.9   | 98.7        | -           |
| 12月末       | 17,712  | 6.5   | 17,765                                                        | 6.4   | 97.6        | -           |
| '19年 1月末   | 17,665  | 6.2   | 17,733                                                        | 6.2   | 97.1        | -           |
| 2月末        | 18,109  | 8.9   | 18,172                                                        | 8.8   | 97.6        | -           |
| (期 末)      |         |       |                                                               |       |             |             |
| '19年 3月 5日 | 18,291  | 10.0  | 18,360                                                        | 9.9   | 98.6        | -           |

(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。

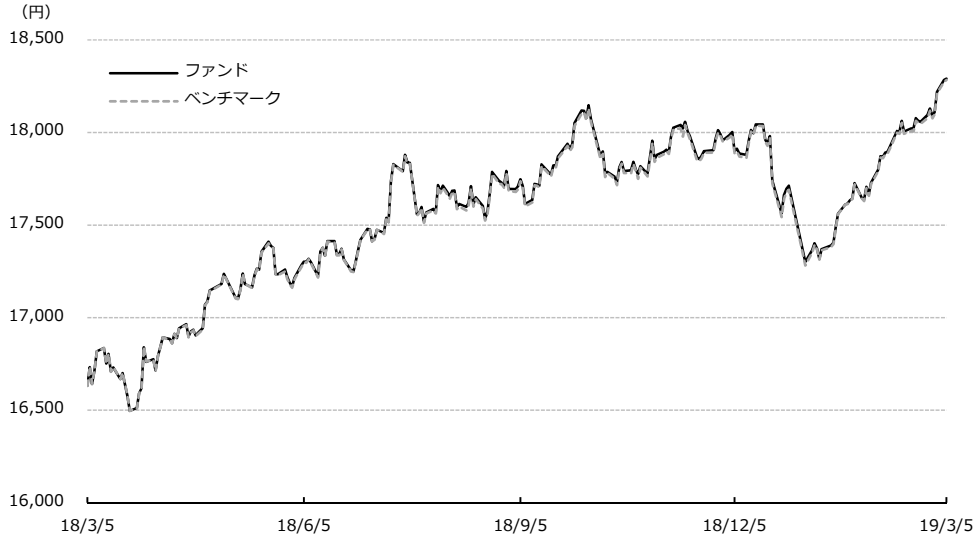
(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

※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

(2018年3月6日から2019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・パ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・パ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。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・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・パークレイズ・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18,291円となり、前期末の16,632円に比べて1,659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】

- 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り、プラスに寄与しました。

### 【マイナスの要因】

- 期前半に米利上げペースが加速するとの期待が高まったことを背景に国債利回りが上昇し、社債価格の下落要因となりました。
- 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+10.0%となり、ベンチマークの騰落率(+9.9%)と同水準となりました。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。

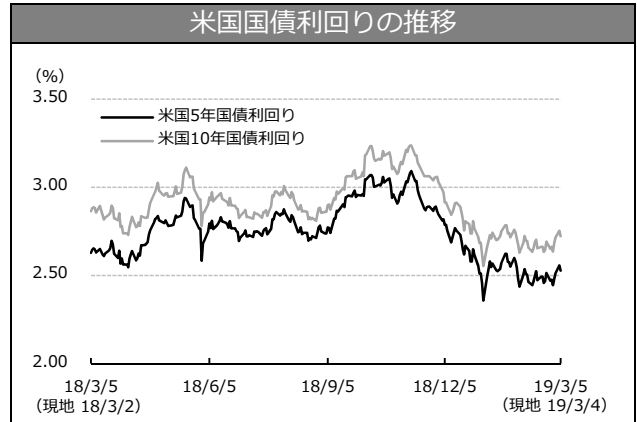
投資環境

(2018年3月6日から2019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、底堅い米国内景気が継続する中、米税制改革への期待から良好な市場センチメントが示されたことや、米利上げペースが加速するとの期待が高まったことを背景に国債利回りは上昇しました。しかし、期後半は世界的な株価の急落を受けて、安全資産としての国債が選好され国債利回りが低下しました。2019年に入ると米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する慎重な姿勢が債券の買い材料となりました。米国5年債利回りは、前期末2018年3月5日（現地3月2日）の2.63%から当期末2019年3月5日（現地3月4日）の2.53%へ低下（債券価格は上昇）しました。また、同期間の米国10年債利回りは、2.86%から2.72%まで低下しました。

米国の社債市場は、早いペースの米利上げが世界経済へ与える影響が懸念されたことや米中貿易摩擦の激化懸念の高まりを背景に、社債スプレッド（社債の国債に対する上乗せ利回り）が拡大しました。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、前期末の約0.8%から当期末には約0.9%まで拡大（債券価格にマイナス）しました。



## 為替市況

ドル・円レートは、期前半はFRBの利上げ決定や今後の米利上げ期待を背景に円安が進行しました。期後半は、世界的な株価の急落に加え、原油価格の下落や米中貿易摩擦の激化懸念などを背景に投資家のセンチメントが悪化し円高が進行しました。期末にかけては、過度なリスク回避姿勢の後退から円安傾向へと転じました。前期末2018年3月5日に105円台半ばだった相場は、当期末2019年3月5日には111円台後半となりました。

## ドル・円相場の推移



## 運用の概況

(2018年3月6日から2019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<br>(2018年3月6日~2019年3月5日) |         | 項 目 の 概 要                                         |
|-------------|------------------------------|---------|---------------------------------------------------|
|             | 金 額                          | 比 率     |                                                   |
| 平均基準価額      | 17,601円                      | -       | 期中の平均基準価額です。                                      |
| (a) その他費用   | 2円                           | 0.012%  | (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 ) | ( 2 )                        | (0.012) | 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         | 2円                           | 0.012%  |                                                   |

(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('18年3月6日から'19年3月5日まで)

○公社債

|    |      |                 | 買 付 額          | 売 付 額                   |
|----|------|-----------------|----------------|-------------------------|
| 外国 | アメリカ | 普通社債券(含む投資法人債券) | 千米ドル<br>66,097 | 千米ドル<br>62,388<br>( 74) |

(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('18年3月6日から'19年3月5日まで)

○公社債

| 買 付                            |               | 金 額     | 売 付                            |                | 金 額     |
|--------------------------------|---------------|---------|--------------------------------|----------------|---------|
| 銘 柄                            |               | 千円      | 銘 柄                            |                | 千円      |
| VERIZON COMMUNICATIONS 4.329%  | 28/9/21(アメリカ) | 185,022 | AT&T INC 4.1%                  | 28/2/15(アメリカ)  | 105,833 |
| CVS HEALTH CORP 4.3%           | 28/3/25(アメリカ) | 103,038 | ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN 3.65% | 26/2/1(アメリカ)   | 95,351  |
| ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 3.65%  | 26/2/1(アメリカ)  | 95,255  | ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 3.65%  | 26/2/1(アメリカ)   | 91,405  |
| CITIBANK NA 3.4%               | 21/7/23(アメリカ) | 61,895  | VERIZON COMMUNICATIONS 4.329%  | 28/9/21(アメリカ)  | 72,075  |
| AT&T INC 3%                    | 22/2/15(アメリカ) | 59,985  | VERIZON COMMUNICATIONS 2.946%  | 22/3/15(アメリカ)  | 71,253  |
| CVS HEALTH CORP 3.7%           | 23/3/9(アメリカ)  | 57,715  | ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN 2.65% | 21/2/1(アメリカ)   | 65,963  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% | 29/1/23(アメリカ) | 56,094  | MORGAN STANLEY 2.65%           | 20/1/27(アメリカ)  | 59,702  |
| COMCAST CORP 3.45%             | 21/10/1(アメリカ) | 54,546  | JPMORGAN CHASE & CO 2.2%       | 19/10/22(アメリカ) | 55,831  |
| CVS HEALTH CORP 4.1%           | 25/3/25(アメリカ) | 48,429  | TORONTO-DOMINION BANK 1.9%     | 19/10/24(アメリカ) | 55,469  |
| VERIZON COMMUNICATIONS 5.15%   | 23/9/15(アメリカ) | 45,872  | CITIGROUP INC 2.4%             | 20/2/18(アメリカ)  | 55,170  |

(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('18年3月6日から'19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('19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<br>金 額      | 評 価 額           |                  | 組 入<br>比 率 | うちBB格<br>以 下<br>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<br>以上  | 2年<br>以上  | 2年<br>未満  |
| ア メ リ カ | 千米ドル<br>296,449 | 千米ドル<br>295,370 | 千円<br>33,054,958 | %<br>98.6  | %<br>-               | %<br>43.9 | %<br>39.0 | %<br>15.5 |
| 合 計     | 296,449         | 295,370         | 33,054,958       | 98.6       | -                    | 43.9      | 39.0      | 15.5      |

(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     |            |
| 21ST CENTURY FOX AMERICA | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,479 | 2021/ 2/15 |
| 21ST CENTURY FOX AMERICA | 普通社債券 | 3.0   | 200  | 199   | 22,313 | 2022/ 9/15 |
| 21ST CENTURY FOX AMERICA | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 101   | 11,388 | 2024/ 9/15 |
| 3M CO                    | 普通社債券 | 1.625 | 150  | 146   | 16,341 | 2021/ 9/19 |
| 3M CO                    | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 148   | 16,662 | 2025/ 8/ 7 |
| 3M COMPANY               | 普通社債券 | 3.625 | 200  | 205   | 22,986 | 2028/ 9/14 |
| ABB FINANCE USA INC      | 普通社債券 | 2.875 | 250  | 250   | 27,979 | 2022/ 5/ 8 |
| ABBOTT LABORATORIES      | 普通社債券 | 2.9   | 250  | 249   | 27,932 | 2021/11/30 |
| ABBOTT LABORATORIES      | 普通社債券 | 3.4   | 105  | 105   | 11,860 | 2023/11/30 |
| ABBOTT LABORATORIES      | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 98    | 11,008 | 2025/ 3/15 |
| ABBOTT LABORATORIES      | 普通社債券 | 3.875 | 80   | 82    | 9,211  | 2025/ 9/15 |
| ABBOTT LABORATORIES      | 普通社債券 | 3.75  | 113  | 114   | 12,827 | 2026/11/30 |
| ABBVIE                   | 普通社債券 | 2.3   | 300  | 294   | 32,945 | 2021/ 5/14 |
| ABBVIE                   | 普通社債券 | 3.2   | 200  | 189   | 21,162 | 2026/ 5/14 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 2.5   | 200  | 198   | 22,248 | 2020/ 5/14 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 3.375 | 85   | 85    | 9,551  | 2021/11/14 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 2.9   | 450  | 443   | 49,660 | 2022/11/ 6 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 99    | 11,138 | 2022/11/ 6 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 3.6   | 350  | 345   | 38,707 | 2025/ 5/14 |
| ABBVIE INC               | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 198   | 22,232 | 2028/11/14 |
| ACE INA HOLDINGS         | 普通社債券 | 2.3   | 250  | 247   | 27,713 | 2020/11/ 3 |
| ACE INA HOLDINGS         | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 99    | 11,091 | 2025/ 3/15 |
| ACTAVIS FUNDING SCS      | 普通社債券 | 3.0   | 350  | 349   | 39,126 | 2020/ 3/12 |
| ACTAVIS FUNDING SCS      | 普通社債券 | 3.45  | 300  | 298   | 33,453 | 2022/ 3/15 |
| ACTAVIS FUNDING SCS      | 普通社債券 | 3.8   | 500  | 494   | 55,324 | 2025/ 3/15 |
| ACTAVIS INC              | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 98    | 11,046 | 2022/10/ 1 |
| ACTIVISION BLIZZARD      | 普通社債券 | 2.3   | 65   | 63    | 7,115  | 2021/ 9/15 |
| ACTIVISION BLIZZARD      | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 95    | 10,672 | 2026/ 9/15 |
| ADOBE SYSTEMS INC        | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 201   | 22,512 | 2025/ 2/ 1 |
| AEGON NV                 | 普通社債券 | 5.5   | 200  | 192   | 21,556 | 2028/ 4/11 |
| AEP TRANSMISSION CO LLC  | 普通社債券 | 3.1   | 50   | 48    | 5,421  | 2026/12/ 1 |
| AERCAP IRELAND CAP LTD/A | 普通社債券 | 4.625 | 250  | 254   | 28,425 | 2020/10/30 |
| AERCAP IRELAND CAP LTD/A | 普通社債券 | 4.5   | 225  | 227   | 25,492 | 2021/ 5/15 |
| AERCAP IRELAND CAP LTD/A | 普通社債券 | 3.95  | 300  | 301   | 33,692 | 2022/ 2/ 1 |
| AERCAP IRELAND CAP/GLOBA | 普通社債券 | 4.125 | 150  | 149   | 16,688 | 2023/ 7/ 3 |
| AERCAP IRELAND CAP/GLOBA | 普通社債券 | 4.875 | 150  | 153   | 17,164 | 2024/ 1/16 |
| AERCAP IRELAND CAP/GLOBA | 普通社債券 | 3.65  | 150  | 135   | 15,110 | 2027/ 7/21 |
| AETNA INC                | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 97    | 10,897 | 2023/ 6/15 |
| AETNA INC                | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 97    | 10,927 | 2022/11/15 |

| 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     |            |
| AETNA INC                | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 98    | 11,056 | 2024/11/15 |
| AFLAC INC                | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 98    | 11,044 | 2025/ 3/17 |
| AFLAC INC                | 普通社債券 | 2.875 | 50   | 47    | 5,316  | 2026/10/15 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 普通社債券 | 5.0   | 100  | 102   | 11,456 | 2020/ 7/15 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 普通社債券 | 3.05  | 65   | 61    | 6,862  | 2026/ 9/22 |
| AGL CAPITAL CORP         | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 150   | 16,849 | 2021/ 9/15 |
| AIR LEASE CORP           | 普通社債券 | 3.875 | 50   | 50    | 5,634  | 2021/ 4/ 1 |
| AIR LEASE CORP           | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 200   | 22,395 | 2022/ 2/ 1 |
| AIR LEASE CORP           | 普通社債券 | 2.625 | 100  | 96    | 10,766 | 2022/ 7/ 1 |
| AIR LEASE CORP           | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 239   | 26,818 | 2023/ 1/15 |
| AIR LEASE CORP           | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 137   | 15,366 | 2027/12/ 1 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS | 普通社債券 | 3.35  | 50   | 50    | 5,639  | 2024/ 7/31 |
| AIRCASTLE LTD            | 普通社債券 | 7.625 | 30   | 31    | 3,497  | 2020/ 4/15 |
| AIRCASTLE LTD            | 普通社債券 | 5.125 | 50   | 51    | 5,745  | 2021/ 3/15 |
| AIRCASTLE LTD            | 普通社債券 | 5.5   | 50   | 51    | 5,799  | 2022/ 2/15 |
| AIRCASTLE LTD            | 普通社債券 | 5.0   | 50   | 50    | 5,681  | 2023/ 4/ 1 |
| AIRCASTLE LTD            | 普通社債券 | 4.125 | 50   | 48    | 5,424  | 2024/ 5/ 1 |
| ALABAMA POWER CO         | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 98    | 11,010 | 2022/ 3/30 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE E | 普通社債券 | 4.0   | 155  | 157   | 17,591 | 2024/ 1/15 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE E | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 97    | 10,906 | 2025/ 4/30 |
| ALIBABA GROUP HOLDING    | 普通社債券 | 3.6   | 400  | 403   | 45,204 | 2024/11/28 |
| ALIBABA GROUP HOLDING    | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 191   | 21,407 | 2027/12/ 6 |
| ALLEGION US HOLDING CO   | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 47    | 5,321  | 2024/10/ 1 |
| ALLEGION US HOLDING CO   | 普通社債券 | 3.55  | 50   | 46    | 5,172  | 2027/10/ 1 |
| ALLIED WORLD ASSURANCE   | 普通社債券 | 4.35  | 50   | 49    | 5,487  | 2025/10/29 |
| ALLSTATE CORP            | 普通社債券 | 3.15  | 150  | 150   | 16,795 | 2023/ 6/15 |
| ALLSTATE CORP            | 普通社債券 | 5.75  | 100  | 101   | 11,302 | 2023/ 8/15 |
| ALPHABET INC             | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 102   | 11,443 | 2021/ 5/19 |
| ALPHABET INC             | 普通社債券 | 1.998 | 350  | 324   | 36,261 | 2026/ 8/15 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 4.75  | 150  | 155   | 17,358 | 2021/ 5/ 5 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 2.85  | 200  | 196   | 22,011 | 2022/ 8/ 9 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 4.0   | 200  | 202   | 22,654 | 2024/ 1/31 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 3.8   | 65   | 65    | 7,284  | 2024/ 2/14 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 4.4   | 200  | 201   | 22,572 | 2026/ 2/14 |
| ALTRIA GROUP INC         | 普通社債券 | 4.8   | 300  | 298   | 33,428 | 2029/ 2/14 |
| AMAZON COM INC           | 普通社債券 | 5.2   | 50   | 56    | 6,282  | 2025/12/ 3 |
| AMAZON.COM INC           | 普通社債券 | 1.9   | 30   | 29    | 3,318  | 2020/ 8/21 |
| AMAZON.COM INC           | 普通社債券 | 3.3   | 250  | 253   | 28,409 | 2021/12/ 5 |
| AMAZON.COM INC           | 普通社債券 | 2.4   | 150  | 147   | 16,476 | 2023/ 2/22 |
| AMAZON.COM INC           | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 99    | 11,089 | 2024/ 8/22 |

| 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     |            |
| AMAZON.COM INC              | 普通社債券 | 3.8   | 200  | 208   | 23,354 | 2024/12/ 5 |
| AMAZON.COM INC              | 普通社債券 | 3.15  | 300  | 295   | 33,062 | 2027/ 8/22 |
| AMER AIRLN 15-1 A PTT       | 普通社債券 | 3.375 | 165  | 159   | 17,894 | 2027/ 5/ 1 |
| AMEREN CORP                 | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 98    | 11,046 | 2026/ 2/15 |
| AMEREN ILLINOIS CO          | 普通社債券 | 2.7   | 100  | 98    | 11,046 | 2022/ 9/ 1 |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV     | 普通社債券 | 5.0   | 450  | 458   | 51,289 | 2020/ 3/30 |
| AMERICAN AIRLINES 2013-2    | 普通社債券 | 4.95  | 102  | 104   | 11,745 | 2023/ 1/15 |
| AMERICAN CAMPUS CMNTYS      | 普通社債券 | 3.35  | 50   | 49    | 5,588  | 2020/10/ 1 |
| AMERICAN CAMPUS CMNTYS      | 普通社債券 | 4.125 | 50   | 50    | 5,635  | 2024/ 7/ 1 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 普通社債券 | 2.15  | 70   | 68    | 7,720  | 2020/11/13 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 普通社債券 | 2.95  | 150  | 148   | 16,571 | 2022/12/15 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 2.2   | 310  | 306   | 34,265 | 2020/10/30 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 3.0   | 165  | 165   | 18,476 | 2021/ 2/22 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 3.7   | 105  | 106   | 11,929 | 2021/11/ 5 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 2.5   | 300  | 293   | 32,882 | 2022/ 8/ 1 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 201   | 22,569 | 2023/ 2/27 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 97    | 10,932 | 2024/10/30 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 101   | 11,302 | 2024/12/ 5 |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 普通社債券 | 4.2   | 105  | 109   | 12,204 | 2025/11/ 6 |
| AMERICAN EXPRESS CREDIT     | 普通社債券 | 2.2   | 200  | 198   | 22,236 | 2020/ 3/ 3 |
| AMERICAN EXPRESS CREDIT     | 普通社債券 | 2.6   | 200  | 198   | 22,268 | 2020/ 9/14 |
| AMERICAN EXPRESS CREDIT     | 普通社債券 | 2.25  | 200  | 196   | 22,036 | 2021/ 5/ 5 |
| AMERICAN EXPRESS CREDIT     | 普通社債券 | 3.3   | 165  | 164   | 18,396 | 2027/ 5/ 3 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP    | 普通社債券 | 3.5   | 85   | 80    | 9,006  | 2026/ 8/15 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT       | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 145   | 16,246 | 2028/ 2/15 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 99    | 11,140 | 2021/ 2/12 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 101   | 11,308 | 2021/12/10 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 3.625 | 75   | 76    | 8,561  | 2023/10/10 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 98    | 11,022 | 2024/ 2/16 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,197 | 2028/ 2/15 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 2.45  | 200  | 198   | 22,248 | 2020/ 9/24 |
| AMERICAN HONDA FINANCE CORP | 普通社債券 | 1.7   | 150  | 145   | 16,246 | 2021/ 9/ 9 |
| AMERICAN INTL GROUP         | 普通社債券 | 3.3   | 150  | 150   | 16,811 | 2021/ 3/ 1 |
| AMERICAN INTL GROUP         | 普通社債券 | 4.125 | 200  | 203   | 22,788 | 2024/ 2/15 |
| AMERICAN INTL GROUP         | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 98    | 11,028 | 2026/ 4/ 1 |
| AMERICAN INTL GROUP         | 普通社債券 | 4.2   | 75   | 74    | 8,335  | 2028/ 4/ 1 |
| AMERICAN INTL GROUP         | 普通社債券 | 5.75  | 100  | 92    | 10,379 | 2028/ 4/ 1 |
| AMERICAN TOWER CORP         | 普通社債券 | 2.8   | 200  | 199   | 22,296 | 2020/ 6/ 1 |
| AMERICAN TOWER CORP         | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 100   | 11,229 | 2021/ 9/15 |
| AMERICAN TOWER CORP         | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 249   | 27,957 | 2023/ 1/31 |



| 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 TOWER CORP      | 普通社債券 | 3.0   | 50   | 48    | 5,470  | 2023/ 6/15 |
| AMERICAN TOWER CORP      | 普通社債券 | 5.0   | 100  | 105   | 11,852 | 2024/ 2/15 |
| AMERICAN TOWER CORP      | 普通社債券 | 4.0   | 200  | 201   | 22,572 | 2025/ 6/ 1 |
| AMERICAN TOWER CORP      | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 95    | 10,721 | 2027/ 7/15 |
| AMERICAN WATER CAPITAL   | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 99    | 11,137 | 2025/ 3/ 1 |
| AMERICAN WATER CAPITAL   | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 101   | 11,344 | 2028/ 9/ 1 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 155   | 17,418 | 2023/10/15 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP   | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,244 | 2021/11/15 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP   | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 95    | 10,727 | 2027/12/15 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.125 | 200  | 198   | 22,162 | 2020/ 5/ 1 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.2   | 150  | 148   | 16,637 | 2020/ 5/11 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 1.85  | 50   | 48    | 5,442  | 2021/ 8/19 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 3.875 | 100  | 101   | 11,396 | 2021/11/15 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.7   | 225  | 222   | 24,896 | 2022/ 5/ 1 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.65  | 50   | 49    | 5,508  | 2022/ 5/11 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 151   | 16,992 | 2022/ 5/15 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 96    | 10,814 | 2023/ 8/19 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 2.6   | 100  | 92    | 10,371 | 2026/ 8/19 |
| AMGEN INC                | 普通社債券 | 3.2   | 150  | 143   | 16,075 | 2027/11/ 2 |
| AMPHENOL CORP            | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 199   | 22,330 | 2021/ 9/15 |
| ANADARKO PETROLEUM       | 普通社債券 | 4.85  | 160  | 164   | 18,407 | 2021/ 3/15 |
| ANADARKO PETROLEUM       | 普通社債券 | 5.55  | 200  | 213   | 23,871 | 2026/ 3/15 |
| ANALOG DEVICES INC       | 普通社債券 | 2.5   | 30   | 29    | 3,284  | 2021/12/ 5 |
| ANALOG DEVICES INC       | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 97    | 10,948 | 2023/12/ 5 |
| ANALOG DEVICES INC       | 普通社債券 | 3.9   | 60   | 60    | 6,727  | 2025/12/15 |
| ANALOG DEVICES INC       | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 96    | 10,818 | 2026/12/ 5 |
| ANDEAVOR LOGIS LP/CORP   | 普通社債券 | 3.5   | 235  | 233   | 26,158 | 2022/12/ 1 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR | 普通社債券 | 4.0   | 285  | 284   | 31,885 | 2028/ 4/13 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR | 普通社債券 | 4.75  | 500  | 522   | 58,457 | 2029/ 1/23 |
| ANTHEM INC               | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 196   | 21,987 | 2027/12/ 1 |
| AON CORP                 | 普通社債券 | 5.0   | 100  | 102   | 11,468 | 2020/ 9/30 |
| AON PLC                  | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,158 | 2024/ 6/14 |
| AON PLC                  | 普通社債券 | 3.875 | 250  | 254   | 28,427 | 2025/12/15 |
| APACHE CORP              | 普通社債券 | 3.25  | 58   | 57    | 6,435  | 2022/ 4/15 |
| APACHE CORP              | 普通社債券 | 4.375 | 200  | 197   | 22,093 | 2028/10/15 |
| APPALACHIAN POWER CO     | 普通社債券 | 3.3   | 100  | 96    | 10,779 | 2027/ 6/ 1 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.0   | 200  | 198   | 22,201 | 2020/ 5/ 6 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.0   | 100  | 98    | 11,067 | 2020/11/13 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.25  | 400  | 396   | 44,407 | 2021/ 2/23 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.15  | 300  | 294   | 33,002 | 2022/ 2/ 9 |

| 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 | 2.5   | 100  | 99    | 11,099 | 2022/ 2/ 9 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.3   | 100  | 98    | 11,030 | 2022/ 5/11 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.7   | 200  | 199   | 22,281 | 2022/ 5/13 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.1   | 150  | 146   | 16,388 | 2022/ 9/12 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.4   | 100  | 98    | 10,997 | 2023/ 1/13 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.85  | 350  | 350   | 39,228 | 2023/ 2/23 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 150   | 16,820 | 2024/ 2/ 9 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 102   | 11,423 | 2024/ 5/ 6 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.85  | 150  | 149   | 16,682 | 2024/ 5/11 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 49    | 5,488  | 2025/ 1/13 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 96    | 10,823 | 2025/ 2/ 9 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.2   | 500  | 502   | 56,195 | 2025/ 5/13 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 150   | 16,789 | 2026/ 2/23 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.45  | 200  | 189   | 21,189 | 2026/ 8/ 4 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.35  | 150  | 150   | 16,790 | 2027/ 2/ 9 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.2   | 212  | 209   | 23,469 | 2027/ 5/11 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.0   | 60   | 58    | 6,529  | 2027/ 6/20 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 2.9   | 150  | 144   | 16,224 | 2027/ 9/12 |
| APPLE INC                | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 145   | 16,317 | 2027/11/13 |
| APPLIED MATERIALS INC    | 普通社債券 | 4.3   | 100  | 102   | 11,518 | 2021/ 6/15 |
| APPLIED MATERIALS INC    | 普通社債券 | 3.3   | 55   | 54    | 6,082  | 2027/ 4/ 1 |
| ARCELORMITTAL            | 普通社債券 | 5.25  | 85   | 86    | 9,729  | 2020/ 8/ 5 |
| ARCELORMITTAL            | 普通社債券 | 5.5   | 65   | 67    | 7,564  | 2021/ 3/ 1 |
| ARCELORMITTAL            | 普通社債券 | 6.25  | 60   | 64    | 7,200  | 2022/ 2/25 |
| ARCELORMITTAL            | 普通社債券 | 6.125 | 45   | 49    | 5,499  | 2025/ 6/ 1 |
| ARCH CAPITAL GROUP INC   | 普通社債券 | 4.011 | 50   | 50    | 5,672  | 2026/12/15 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND   | 普通社債券 | 3.375 | 60   | 60    | 6,806  | 2022/ 3/15 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND   | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 94    | 10,534 | 2026/ 8/11 |
| ARES CAPITAL CORP        | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 189   | 21,206 | 2023/ 2/10 |
| ARIZONA PUBLIC SERVICE   | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 95    | 10,650 | 2027/ 9/15 |
| ARROW ELECTRONICS INC    | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 197   | 22,067 | 2022/ 4/ 1 |
| ASSURED GUARANTY US HLDG | 普通社債券 | 5.0   | 150  | 156   | 17,563 | 2024/ 7/ 1 |
| ASTRAZENECA PLC          | 普通社債券 | 2.375 | 450  | 445   | 49,802 | 2020/11/16 |
| ASTRAZENECA PLC          | 普通社債券 | 3.375 | 350  | 344   | 38,541 | 2025/11/16 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 2.45  | 500  | 496   | 55,573 | 2020/ 6/30 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 3.0   | 550  | 547   | 61,216 | 2022/ 2/15 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 3.2   | 65   | 64    | 7,268  | 2022/ 3/ 1 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 3.8   | 300  | 302   | 33,907 | 2024/ 3/ 1 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 3.9   | 350  | 354   | 39,709 | 2024/ 3/11 |
| AT&T INC                 | 普通社債券 | 4.45  | 200  | 207   | 23,239 | 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     |            |
| AT&T INC                   | 普通社債券 | 3.4   | 300  | 291   | 32,666 | 2025/ 5/15 |
| AT&T INC                   | 普通社債券 | 4.125 | 250  | 250   | 28,016 | 2026/ 2/17 |
| AT&T INC                   | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 200   | 22,409 | 2027/ 3/ 1 |
| AT&T INC                   | 普通社債券 | 4.1   | 188  | 185   | 20,715 | 2028/ 2/15 |
| AT&T INC                   | 普通社債券 | 4.35  | 220  | 218   | 24,477 | 2029/ 3/ 1 |
| ATHENE HOLDING LTD         | 普通社債券 | 4.125 | 150  | 140   | 15,668 | 2028/ 1/12 |
| ATMOS ENERGY CORP          | 普通社債券 | 3.0   | 65   | 62    | 7,026  | 2027/ 6/15 |
| AUST & NZ BANKING GRP NY   | 普通社債券 | 2.7   | 250  | 248   | 27,841 | 2020/11/16 |
| AUST & NZ BANKING GRP NY   | 普通社債券 | 2.625 | 250  | 245   | 27,434 | 2022/11/ 9 |
| AUTODESK INC               | 普通社債券 | 4.375 | 100  | 101   | 11,347 | 2025/ 6/15 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING  | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 99    | 11,116 | 2020/ 9/15 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING  | 普通社債券 | 3.375 | 50   | 51    | 5,711  | 2025/ 9/15 |
| AUTONATION INC             | 普通社債券 | 3.35  | 25   | 24    | 2,788  | 2021/ 1/15 |
| AUTONATION INC             | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 93    | 10,493 | 2024/11/15 |
| AUTONATION INC             | 普通社債券 | 4.5   | 20   | 19    | 2,181  | 2025/10/ 1 |
| AUTOZONE INC               | 普通社債券 | 4.0   | 154  | 155   | 17,381 | 2020/11/15 |
| AUTOZONE INC               | 普通社債券 | 3.25  | 110  | 106   | 11,905 | 2025/ 4/15 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC  | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 99    | 11,173 | 2025/ 6/ 1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC  | 普通社債券 | 4.2   | 150  | 155   | 17,424 | 2023/12/15 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC  | 普通社債券 | 2.9   | 50   | 47    | 5,320  | 2026/10/15 |
| AVANGRID INC               | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 97    | 10,869 | 2024/12/ 1 |
| AVNET INC                  | 普通社債券 | 3.75  | 75   | 74    | 8,346  | 2021/12/ 1 |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 100   | 11,284 | 2023/ 4/20 |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC | 普通社債券 | 4.35  | 200  | 197   | 22,125 | 2028/ 4/20 |
| AXIS SPECIALTY FINAN PLC   | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 96    | 10,820 | 2027/12/ 6 |
| BAIDU INC                  | 普通社債券 | 3.875 | 200  | 201   | 22,494 | 2023/ 9/29 |
| BAIDU INC                  | 普通社債券 | 4.375 | 200  | 204   | 22,919 | 2024/ 5/14 |
| BAIDU INC                  | 普通社債券 | 3.625 | 200  | 189   | 21,255 | 2027/ 7/ 6 |
| BAKER HUGHES LLC/CO-OBL    | 普通社債券 | 2.773 | 100  | 98    | 11,003 | 2022/12/15 |
| BAKER HUGHES LLC/CO-OBL    | 普通社債券 | 3.337 | 150  | 142   | 15,950 | 2027/12/15 |
| BALTIMORE GAS & ELECTRIC   | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,265 | 2021/11/15 |
| BANCO SANTANDER SA         | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 194   | 21,765 | 2023/ 2/23 |
| BANCO SANTANDER SA         | 普通社債券 | 3.8   | 200  | 189   | 21,210 | 2028/ 2/23 |
| BANCOLOMBIA SA             | 普通社債券 | 5.95  | 150  | 157   | 17,583 | 2021/ 6/ 3 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 2.151 | 100  | 98    | 11,033 | 2020/11/ 9 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 3.875 | 400  | 407   | 45,649 | 2025/ 8/ 1 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 2.25  | 500  | 495   | 55,487 | 2020/ 4/21 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 2.625 | 300  | 298   | 33,412 | 2020/10/19 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 2.625 | 100  | 99    | 11,117 | 2021/ 4/19 |
| BANK OF AMERICA CORP       | 普通社債券 | 2.369 | 200  | 197   | 22,157 | 2020/ 7/21 |

| 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     |            |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 2.328 | 150  | 148   | 16,591 | 2020/10/ 1 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 2.738 | 200  | 198   | 22,209 | 2021/ 1/23 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.499 | 350  | 352   | 39,455 | 2021/ 5/17 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.3   | 500  | 502   | 56,223 | 2023/ 1/11 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 2.816 | 100  | 98    | 10,992 | 2022/ 7/21 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.004 | 577  | 570   | 63,879 | 2022/12/20 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.125 | 150  | 155   | 17,380 | 2024/ 1/22 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.55  | 250  | 250   | 28,087 | 2023/ 3/ 5 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.0   | 400  | 411   | 46,032 | 2024/ 4/ 1 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.864 | 200  | 203   | 22,758 | 2023/ 7/23 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.2   | 350  | 358   | 40,142 | 2024/ 8/26 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 100   | 11,249 | 2025/ 1/22 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.95  | 400  | 400   | 44,856 | 2025/ 4/21 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.093 | 250  | 243   | 27,301 | 2024/10/ 1 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.366 | 200  | 196   | 22,026 | 2025/ 1/23 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 98    | 11,075 | 2026/ 4/19 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 201   | 22,563 | 2026/10/22 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.824 | 400  | 399   | 44,668 | 2027/ 1/20 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.593 | 150  | 146   | 16,427 | 2027/ 7/21 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.419 | 583  | 562   | 62,897 | 2027/12/20 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.97  | 250  | 251   | 28,132 | 2028/ 3/ 5 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 4.271 | 400  | 411   | 46,006 | 2028/ 7/23 |
| BANK OF AMERICA CORP    | 普通社債券 | 3.974 | 250  | 251   | 28,114 | 2029/ 2/ 7 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 3.1   | 60   | 60    | 6,739  | 2021/ 4/13 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 1.9   | 150  | 146   | 16,370 | 2021/ 8/27 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 2.35  | 100  | 97    | 10,911 | 2022/ 9/11 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 2.55  | 100  | 98    | 11,001 | 2022/11/ 6 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 3.3   | 350  | 348   | 39,013 | 2024/ 2/ 5 |
| BANK OF MONTREAL        | 普通社債券 | 3.803 | 150  | 142   | 15,973 | 2027/12/15 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 2.6   | 200  | 199   | 22,290 | 2020/ 8/17 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 2.45  | 150  | 149   | 16,685 | 2020/11/27 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 99    | 11,086 | 2021/ 4/15 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 101   | 11,362 | 2021/ 9/23 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 2.2   | 50   | 48    | 5,379  | 2023/ 8/16 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 100   | 11,192 | 2024/ 9/11 |
| BANK OF NEW YORK MELLON | 普通社債券 | 2.45  | 150  | 140   | 15,708 | 2026/ 8/17 |
| BANK OF NOVA SCOTIA     | 普通社債券 | 2.15  | 250  | 247   | 27,713 | 2020/ 7/14 |
| BANK OF NOVA SCOTIA     | 普通社債券 | 2.35  | 50   | 49    | 5,540  | 2020/10/21 |
| BANK OF NOVA SCOTIA     | 普通社債券 | 2.45  | 150  | 148   | 16,620 | 2021/ 3/22 |
| BANK OF NOVA SCOTIA     | 普通社債券 | 2.7   | 250  | 247   | 27,723 | 2022/ 3/ 7 |

| 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 NOVA SCOTIA      | 普通社債券 | 4.65  | 250  | 227   | 25,494 | 2022/10/12 |
| BANK OF NOVA SCOTIA      | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 99    | 11,190 | 2024/ 2/11 |
| BANK OF NOVA SCOTIA      | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,484 | 2025/12/16 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 99    | 11,136 | 2023/ 1/29 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 2.661 | 100  | 98    | 11,032 | 2022/ 5/16 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 3.45  | 350  | 354   | 39,665 | 2023/ 8/11 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 148   | 16,565 | 2025/ 2/24 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 98    | 11,055 | 2027/ 5/16 |
| BANK OF NY MELLON CORP   | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 99    | 11,181 | 2028/ 1/29 |
| BARCLAYS BANK PLC        | 普通社債券 | 5.14  | 100  | 102   | 11,443 | 2020/10/14 |
| BARCLAYS BANK PLC        | 普通社債券 | 2.65  | 265  | 262   | 29,333 | 2021/ 1/11 |
| BARCLAYS PLC             | 普通社債券 | 3.2   | 250  | 247   | 27,726 | 2021/ 8/10 |
| BARCLAYS PLC             | 普通社債券 | 3.684 | 250  | 247   | 27,691 | 2023/ 1/10 |
| BARCLAYS PLC             | 普通社債券 | 3.65  | 300  | 289   | 32,373 | 2025/ 3/16 |
| BARCLAYS PLC             | 普通社債券 | 4.375 | 200  | 198   | 22,227 | 2026/ 1/12 |
| BARCLAYS PLC             | 普通社債券 | 4.972 | 200  | 203   | 22,742 | 2028/ 5/16 |
| BAT CAPITAL CORP         | 普通社債券 | 2.297 | 100  | 98    | 11,025 | 2020/ 8/14 |
| BAT CAPITAL CORP         | 普通社債券 | 2.764 | 100  | 97    | 10,871 | 2022/ 8/15 |
| BAT CAPITAL CORP         | 普通社債券 | 3.222 | 200  | 192   | 21,558 | 2024/ 8/15 |
| BAT CAPITAL CORP         | 普通社債券 | 3.557 | 350  | 320   | 35,887 | 2027/ 8/15 |
| BAXALTA INC              | 普通社債券 | 2.875 | 30   | 29    | 3,341  | 2020/ 6/23 |
| BAXALTA INC              | 普通社債券 | 4.0   | 30   | 29    | 3,351  | 2025/ 6/23 |
| BB&T CORPORATION         | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 99    | 11,107 | 2022/ 4/ 1 |
| BB&T CORPORATION         | 普通社債券 | 3.7   | 150  | 152   | 17,115 | 2025/ 6/ 5 |
| BEAM INC                 | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 147   | 16,552 | 2022/ 5/15 |
| BECTON DICKINSON AND CO  | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 149   | 16,772 | 2020/11/12 |
| BECTON DICKINSON AND CO  | 普通社債券 | 2.404 | 35   | 34    | 3,878  | 2020/ 6/ 5 |
| BECTON DICKINSON AND CO  | 普通社債券 | 2.894 | 315  | 311   | 34,827 | 2022/ 6/ 6 |
| BECTON DICKINSON AND CO  | 普通社債券 | 3.734 | 200  | 200   | 22,448 | 2024/12/15 |
| BECTON DICKINSON AND CO  | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 194   | 21,774 | 2027/ 6/ 6 |
| BEMIS CO INC             | 普通社債券 | 3.1   | 100  | 91    | 10,264 | 2026/ 9/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY       | 普通社債券 | 2.2   | 150  | 148   | 16,621 | 2021/ 3/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY ENERG | 普通社債券 | 2.8   | 165  | 163   | 18,307 | 2023/ 1/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY ENERG | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 102   | 11,490 | 2023/11/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY FIN   | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 153   | 17,233 | 2021/ 1/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC   | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 199   | 22,313 | 2023/ 3/15 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC   | 普通社債券 | 3.125 | 300  | 296   | 33,202 | 2026/ 3/15 |
| BEST BUY CO INC          | 普通社債券 | 4.45  | 100  | 96    | 10,822 | 2028/10/ 1 |
| BHP BILLITON FIN USA LTD | 普通社債券 | 2.875 | 300  | 298   | 33,444 | 2022/ 2/24 |
| BIOGEN INC               | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 99    | 11,174 | 2020/ 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     |            |
| BIOGEN INC               | 普通社債券 | 3.625 | 55   | 55    | 6,245  | 2022/ 9/15 |
| BIOGEN INC               | 普通社債券 | 4.05  | 200  | 203   | 22,814 | 2025/ 9/15 |
| BLACK HILLS CORP         | 普通社債券 | 3.95  | 50   | 49    | 5,559  | 2026/ 1/15 |
| BLACKROCK INC            | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 154   | 17,281 | 2021/ 5/24 |
| BLACKROCK INC            | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 102   | 11,452 | 2024/ 3/18 |
| BLOCK FINANCIAL LLC      | 普通社債券 | 4.125 | 100  | 101   | 11,309 | 2020/10/ 1 |
| BLOCK FINANCIAL LLC      | 普通社債券 | 5.5   | 100  | 103   | 11,624 | 2022/11/ 1 |
| BNP PARIBAS              | 普通社債券 | 2.375 | 250  | 248   | 27,801 | 2020/ 5/21 |
| BNP PARIBAS              | 普通社債券 | 5.0   | 150  | 155   | 17,381 | 2021/ 1/15 |
| BNP PARIBAS              | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 100   | 11,259 | 2023/ 3/ 3 |
| BNP PARIBAS              | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 202   | 22,659 | 2024/10/15 |
| BOARDWALK PIPELINES LP   | 普通社債券 | 4.95  | 150  | 152   | 17,092 | 2024/12/15 |
| BOEING CO                | 普通社債券 | 8.75  | 100  | 114   | 12,760 | 2021/ 8/15 |
| BOEING CO                | 普通社債券 | 2.35  | 400  | 395   | 44,263 | 2021/10/30 |
| BOSTON PROPERTIES LP     | 普通社債券 | 4.125 | 100  | 101   | 11,397 | 2021/ 5/15 |
| BOSTON PROPERTIES LP     | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 48    | 5,439  | 2025/ 1/15 |
| BOSTON PROPERTIES LP     | 普通社債券 | 3.65  | 250  | 247   | 27,682 | 2026/ 2/ 1 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP   | 普通社債券 | 2.85  | 200  | 200   | 22,400 | 2020/ 5/15 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP   | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 150   | 16,884 | 2028/ 3/ 1 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 2.112 | 100  | 97    | 10,948 | 2021/ 9/16 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 3.245 | 100  | 100   | 11,278 | 2022/ 5/ 6 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 2.52  | 400  | 392   | 43,955 | 2022/ 9/19 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 3.224 | 100  | 100   | 11,237 | 2024/ 4/14 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 3.119 | 200  | 195   | 21,825 | 2026/ 5/ 4 |
| BP CAP MARKETS AMERICA   | 普通社債券 | 4.234 | 200  | 210   | 23,568 | 2028/11/ 6 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC   | 普通社債券 | 3.062 | 250  | 250   | 28,020 | 2022/ 3/17 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC   | 普通社債券 | 3.994 | 400  | 414   | 46,346 | 2023/ 9/26 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC   | 普通社債券 | 3.814 | 100  | 102   | 11,494 | 2024/ 2/10 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC   | 普通社債券 | 3.506 | 150  | 151   | 16,918 | 2025/ 3/17 |
| BP CAPITAL MARKETS PLC   | 普通社債券 | 3.279 | 200  | 195   | 21,915 | 2027/ 9/19 |
| BPCE SA                  | 普通社債券 | 4.0   | 250  | 254   | 28,460 | 2024/ 4/15 |
| BPCE SA                  | 普通社債券 | 3.375 | 250  | 241   | 27,068 | 2026/12/ 2 |
| BRANCH BANKING & TRUST   | 普通社債券 | 2.25  | 250  | 247   | 27,747 | 2020/ 6/ 1 |
| BRANCH BANKING & TRUST   | 普通社債券 | 2.625 | 250  | 247   | 27,656 | 2022/ 1/15 |
| BRANCH BANKING & TRUST   | 普通社債券 | 3.625 | 250  | 250   | 28,047 | 2025/ 9/16 |
| BRANDYWINE OPER PARTNERS | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 100   | 11,233 | 2023/ 2/15 |
| BRASKEM FINANCE LTD      | 普通社債券 | 6.45  | 200  | 217   | 24,351 | 2024/ 2/ 3 |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN | 普通社債券 | 3.7   | 150  | 134   | 14,996 | 2027/ 6/22 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO  | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 100   | 11,245 | 2023/11/ 1 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO  | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 96    | 10,835 | 2027/ 2/27 |

| 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     |            |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS | 普通社債券 | 5.125 | 200  | 208   | 23,305 | 2028/12/ 4 |
| BRIXMOR OPERATING PART     | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 97    | 10,918 | 2024/ 6/15 |
| BRIXMOR OPERATING PART     | 普通社債券 | 3.85  | 150  | 146   | 16,391 | 2025/ 2/ 1 |
| BRIXMOR OPERATING PART     | 普通社債券 | 3.9   | 50   | 48    | 5,374  | 2027/ 3/15 |
| BROADCOM CRP               | 普通社債券 | 3.0   | 300  | 294   | 32,966 | 2022/ 1/15 |
| BROADCOM CRP               | 普通社債券 | 3.625 | 200  | 195   | 21,867 | 2024/ 1/15 |
| BROADCOM CRP               | 普通社債券 | 3.875 | 400  | 371   | 41,519 | 2027/ 1/15 |
| BROADCOM CRP / CAYMN FI    | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 134   | 15,044 | 2028/ 1/15 |
| BROADCOM CRP / CAYMN FI    | 普通社債券 | 2.2   | 100  | 98    | 10,978 | 2021/ 1/15 |
| BROADCOM CRP / CAYMN FI    | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 95    | 10,683 | 2023/ 1/15 |
| BROADCOM CRP / CAYMN FI    | 普通社債券 | 3.125 | 70   | 65    | 7,293  | 2025/ 1/15 |
| BROADRIDGE FINACIAL SOLU   | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 95    | 10,658 | 2026/ 6/27 |
| BROOKFIELD FINANCE INC     | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 150   | 16,818 | 2024/ 4/ 1 |
| BROOKFIELD FINANCE INC     | 普通社債券 | 3.9   | 200  | 187   | 21,008 | 2028/ 1/25 |
| BROWN & BROWN INC          | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 99    | 11,181 | 2029/ 3/15 |
| BUCKEYE PARTNERS           | 普通社債券 | 3.95  | 150  | 139   | 15,652 | 2026/12/ 1 |
| BUCKEYE PARTNERS LP        | 普通社債券 | 4.875 | 100  | 102   | 11,424 | 2021/ 2/ 1 |
| BUNGE LTD FINANCE CORP     | 普通社債券 | 3.5   | 75   | 74    | 8,377  | 2020/11/24 |
| BUNGE LTD FINANCE CORP     | 普通社債券 | 3.0   | 55   | 53    | 5,972  | 2022/ 9/25 |
| BUNGE LTD FINANCE CORP     | 普通社債券 | 3.25  | 45   | 39    | 4,437  | 2026/ 8/15 |
| BUNGE LTD FINANCE CORP     | 普通社債券 | 3.75  | 55   | 48    | 5,438  | 2027/ 9/25 |
| BURLINGTN NORTH SANTA FE   | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 100   | 11,296 | 2021/ 9/15 |
| BURLINGTN NORTH SANTA FE   | 普通社債券 | 3.05  | 50   | 50    | 5,600  | 2022/ 3/15 |
| BURLINGTN NORTH SANTA FE   | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 149   | 16,770 | 2023/ 3/15 |
| BURLINGTN NORTH SANTA FE   | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 101   | 11,381 | 2024/ 9/ 1 |
| BURLINGTN NORTH SANTA FE   | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,136 | 2027/ 6/15 |
| BURLINGTON NORTHERN SANT   | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 204   | 22,925 | 2025/ 9/ 1 |
| CA INC                     | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 99    | 11,189 | 2020/ 8/ 1 |
| CA INC                     | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 99    | 11,096 | 2022/ 8/15 |
| CABOT CORP                 | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 49    | 5,591  | 2022/ 7/15 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST      | 普通社債券 | 4.1   | 45   | 45    | 5,142  | 2028/10/15 |
| CAMPBELL SOUP CO           | 普通社債券 | 3.3   | 65   | 64    | 7,263  | 2021/ 3/15 |
| CAMPBELL SOUP CO           | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 96    | 10,770 | 2022/ 8/ 2 |
| CAMPBELL SOUP CO           | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 99    | 11,144 | 2023/ 3/15 |
| CAMPBELL SOUP CO           | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 98    | 10,988 | 2025/ 3/15 |
| CAMPBELL SOUP CO           | 普通社債券 | 4.15  | 100  | 95    | 10,740 | 2028/ 3/15 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK     | 普通社債券 | 2.7   | 125  | 124   | 13,939 | 2021/ 2/ 2 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK     | 普通社債券 | 2.55  | 200  | 197   | 22,107 | 2022/ 6/16 |
| CANADIAN NATIONAL RAILWA   | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 48    | 5,389  | 2026/ 3/ 1 |
| CANADIAN NATL RESOURCES    | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 97    | 10,931 | 2023/ 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     |            |
| CANADIAN NATURAL RESOURC  | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 152   | 17,013 | 2025/ 2/ 1 |
| CANADIAN PACIFIC RR CO    | 普通社債券 | 2.9   | 200  | 193   | 21,631 | 2025/ 2/ 1 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 142   | 15,976 | 2026/ 7/28 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 2.4   | 50   | 49    | 5,524  | 2020/10/30 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.45  | 150  | 150   | 16,867 | 2021/ 4/30 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 103   | 11,539 | 2021/ 7/15 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.05  | 100  | 99    | 11,110 | 2022/ 3/ 9 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 98    | 11,047 | 2023/ 1/30 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,092 | 2023/ 6/15 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.3   | 100  | 96    | 10,820 | 2024/10/30 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.2   | 150  | 144   | 16,121 | 2025/ 2/ 5 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 151   | 16,989 | 2025/ 4/30 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 192   | 21,519 | 2027/ 3/ 9 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO  | 普通社債券 | 3.8   | 150  | 144   | 16,142 | 2028/ 1/31 |
| CAPITAL ONE NA            | 普通社債券 | 2.95  | 350  | 347   | 38,870 | 2021/ 7/23 |
| CAPITAL ONE NA            | 普通社債券 | 2.25  | 250  | 243   | 27,234 | 2021/ 9/13 |
| CARDINAL HEALTH INC       | 普通社債券 | 4.625 | 150  | 153   | 17,213 | 2020/12/15 |
| CARDINAL HEALTH INC       | 普通社債券 | 2.616 | 100  | 97    | 10,857 | 2022/ 6/15 |
| CARDINAL HEALTH INC       | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 98    | 10,982 | 2023/ 3/15 |
| CARDINAL HEALTH INC       | 普通社債券 | 3.079 | 50   | 48    | 5,378  | 2024/ 6/15 |
| CARDINAL HEALTH INC       | 普通社債券 | 3.41  | 100  | 93    | 10,439 | 2027/ 6/15 |
| CARLISLE COS INC          | 普通社債券 | 3.5   | 65   | 63    | 7,102  | 2024/12/ 1 |
| CARNIVAL CORP             | 普通社債券 | 3.95  | 67   | 67    | 7,602  | 2020/10/15 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 1.7   | 100  | 97    | 10,886 | 2021/ 8/ 9 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 153   | 17,152 | 2023/11/24 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 2.4   | 50   | 46    | 5,187  | 2026/ 8/ 9 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 1.931 | 50   | 48    | 5,461  | 2021/10/ 1 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 2.4   | 100  | 98    | 10,995 | 2022/ 6/ 6 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 3.35  | 100  | 100   | 11,282 | 2020/12/ 7 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 3.15  | 80   | 80    | 8,992  | 2021/ 9/ 7 |
| CATERPILLAR FIN SRVC CORP | 普通社債券 | 2.95  | 150  | 149   | 16,785 | 2022/ 2/25 |
| CATERPILLAR INC           | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 153   | 17,218 | 2021/ 5/27 |
| CATERPILLAR INC           | 普通社債券 | 2.6   | 100  | 98    | 11,059 | 2022/ 6/26 |
| CATERPILLAR INC           | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 101   | 11,352 | 2024/ 5/15 |
| CATHOLIC HEALTH INITIATI  | 普通社債券 | 2.95  | 200  | 195   | 21,858 | 2022/11/ 1 |
| CBOE HOLDINGS             | 普通社債券 | 3.65  | 50   | 49    | 5,533  | 2027/ 1/12 |
| CBRE GROUP INC            | 普通社債券 | 4.875 | 100  | 103   | 11,535 | 2026/ 3/ 1 |
| CBS CORP                  | 普通社債券 | 2.5   | 50   | 47    | 5,345  | 2023/ 2/15 |
| CBS CORP                  | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 99    | 11,110 | 2024/ 8/15 |
| CBS CORP                  | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 90    | 10,180 | 2027/ 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     |            |
| CBS CORP                 | 普通社債券 | 3.375 | 180  | 167   | 18,752 | 2028/ 2/15 |
| CELANESE US HOLDINGS LLC | 普通社債券 | 5.875 | 40   | 41    | 4,680  | 2021/ 6/15 |
| CELANESE US HOLDINGS LLC | 普通社債券 | 4.625 | 50   | 51    | 5,715  | 2022/11/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 2.875 | 200  | 199   | 22,312 | 2020/ 8/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 3.25  | 250  | 248   | 27,834 | 2022/ 8/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 97    | 10,908 | 2023/ 2/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 148   | 16,647 | 2023/ 2/20 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 3.875 | 100  | 100   | 11,245 | 2025/ 8/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 3.45  | 150  | 142   | 15,978 | 2027/11/15 |
| CELGENE CORP             | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 147   | 16,507 | 2028/ 2/20 |
| CELULOSA ARAUCO CONSTITU | 普通社債券 | 4.5   | 200  | 203   | 22,717 | 2024/ 8/ 1 |
| CENOVUS ENERGY INC       | 普通社債券 | 3.0   | 80   | 77    | 8,660  | 2022/ 8/15 |
| CENOVUS ENERGY INC       | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 143   | 16,050 | 2027/ 4/15 |
| CENTERPOINT ENERGY INC   | 普通社債券 | 1.85  | 200  | 194   | 21,782 | 2021/ 6/ 1 |
| CENTERPOINT ENERGY INC   | 普通社債券 | 3.6   | 20   | 20    | 2,256  | 2021/11/ 1 |
| CENTERPOINT ENERGY INC   | 普通社債券 | 2.5   | 50   | 48    | 5,400  | 2022/ 9/ 1 |
| CENTERPOINT ENERGY INC   | 普通社債券 | 3.85  | 50   | 50    | 5,604  | 2024/ 2/ 1 |
| CENTERPOINT ENERGY INC   | 普通社債券 | 4.25  | 50   | 50    | 5,647  | 2028/11/ 1 |
| CHARLES SCHWAB CORP      | 普通社債券 | 4.45  | 200  | 204   | 22,874 | 2020/ 7/22 |
| CHARLES SCHWAB CORP      | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 101   | 11,399 | 2024/ 2/ 1 |
| CHARLES SCHWAB CORP      | 普通社債券 | 3.2   | 150  | 146   | 16,368 | 2028/ 1/25 |
| CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 普通社債券 | 4.464 | 300  | 307   | 34,404 | 2022/ 7/23 |
| CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 普通社債券 | 4.908 | 400  | 414   | 46,426 | 2025/ 7/23 |
| CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 普通社債券 | 4.5   | 250  | 256   | 28,674 | 2024/ 2/ 1 |
| CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 140   | 15,774 | 2028/ 2/15 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.1   | 100  | 98    | 11,050 | 2021/ 5/16 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.566 | 100  | 98    | 11,030 | 2023/ 5/16 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.954 | 250  | 245   | 27,509 | 2026/ 5/16 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 1.961 | 250  | 248   | 27,806 | 2020/ 3/ 3 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 1.991 | 31   | 30    | 3,445  | 2020/ 3/ 3 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.498 | 50   | 49    | 5,558  | 2022/ 3/ 3 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.355 | 250  | 245   | 27,499 | 2022/12/ 5 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 3.191 | 300  | 303   | 33,936 | 2023/ 6/24 |
| CHEVRON CORP             | 普通社債券 | 2.895 | 50   | 49    | 5,589  | 2024/ 3/ 3 |
| CHUBB INA HOLDINGS INC   | 普通社債券 | 3.35  | 200  | 199   | 22,306 | 2026/ 5/ 3 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC   | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 97    | 10,901 | 2022/ 8/ 1 |
| CIGNA CORP               | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,428 | 2021/ 3/15 |
| CIGNA CORP               | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 145   | 16,306 | 2025/ 4/15 |
| CIMAREX ENERGY CO        | 普通社債券 | 4.375 | 100  | 101   | 11,400 | 2024/ 6/ 1 |
| CINTAS CORP NO 2         | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 99    | 11,153 | 2022/ 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     |            |
| CINTAS CORP NO 2            | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 100   | 11,208 | 2027/ 4/ 1 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 2.45  | 250  | 249   | 27,908 | 2020/ 6/15 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 102   | 11,463 | 2025/ 6/15 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 2.2   | 200  | 198   | 22,159 | 2021/ 2/28 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 1.85  | 150  | 146   | 16,409 | 2021/ 9/20 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 103   | 11,615 | 2024/ 3/ 4 |
| CISCO SYSTEMS INC           | 普通社債券 | 2.5   | 150  | 143   | 16,033 | 2026/ 9/20 |
| CITIBANK NA                 | 普通社債券 | 2.1   | 250  | 247   | 27,702 | 2020/ 6/12 |
| CITIBANK NA                 | 普通社債券 | 2.125 | 300  | 296   | 33,139 | 2020/10/20 |
| CITIBANK NA                 | 普通社債券 | 2.85  | 250  | 249   | 27,929 | 2021/ 2/12 |
| CITIBANK NA                 | 普通社債券 | 3.4   | 550  | 555   | 62,111 | 2021/ 7/23 |
| CITIBANK NA                 | 普通社債券 | 3.65  | 250  | 254   | 28,483 | 2024/ 1/23 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 2.65  | 200  | 198   | 22,234 | 2020/10/26 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 2.7   | 50   | 49    | 5,555  | 2021/ 3/30 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 2.9   | 350  | 348   | 38,959 | 2021/12/ 8 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 2.7   | 150  | 147   | 16,468 | 2022/10/27 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.375 | 250  | 250   | 27,982 | 2023/ 3/ 1 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 250   | 27,988 | 2023/ 5/15 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 2.876 | 300  | 295   | 33,090 | 2022/ 7/24 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 101   | 11,354 | 2024/ 6/16 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.3   | 550  | 542   | 60,661 | 2025/ 4/27 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 4.4   | 250  | 254   | 28,485 | 2025/ 6/10 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.7   | 300  | 299   | 33,509 | 2026/ 1/12 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.4   | 250  | 243   | 27,304 | 2026/ 5/ 1 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 4.45  | 300  | 301   | 33,776 | 2027/ 9/29 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.887 | 350  | 348   | 38,994 | 2027/ 1/10 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.668 | 300  | 294   | 32,903 | 2027/ 7/24 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 4.125 | 200  | 196   | 22,002 | 2028/ 7/25 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 3.52  | 150  | 144   | 16,225 | 2027/10/27 |
| CITIGROUP INC               | 普通社債券 | 4.075 | 250  | 252   | 28,221 | 2028/ 4/23 |
| CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE | 普通社債券 | 2.55  | 250  | 246   | 27,605 | 2021/ 5/13 |
| CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE | 普通社債券 | 2.25  | 250  | 248   | 27,775 | 2020/ 3/ 2 |
| CITRIX SYSTEMS INC          | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 96    | 10,750 | 2027/12/ 1 |
| CLOROX CO                   | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 102   | 11,426 | 2024/12/15 |
| CLOROX COMPANY              | 普通社債券 | 3.05  | 64   | 63    | 7,156  | 2022/ 9/15 |
| CME GROUP INC               | 普通社債券 | 3.0   | 200  | 200   | 22,440 | 2022/ 9/15 |
| CMS ENERGY CORP             | 普通社債券 | 5.05  | 150  | 156   | 17,526 | 2022/ 3/15 |
| CNA FINANCIAL CORP          | 普通社債券 | 5.75  | 30   | 31    | 3,542  | 2021/ 8/15 |
| CNA FINANCIAL CORP          | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,441 | 2026/ 3/ 1 |
| CNA FINANCIAL CORP          | 普通社債券 | 3.45  | 50   | 47    | 5,302  | 2027/ 8/15 |

| 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     |            |
| CNH INDUSTRIAL CAP LLC   | 普通社債券 | 3.875 | 35   | 35    | 3,938  | 2021/10/15 |
| CNH INDUSTRIAL CAP LLC   | 普通社債券 | 4.375 | 40   | 40    | 4,532  | 2022/ 4/ 5 |
| CNH INDUSTRIAL CAP LLC   | 普通社債券 | 4.2   | 50   | 49    | 5,592  | 2024/ 1/15 |
| CNH INDUSTRIAL CAP LLC   | 普通社債券 | 4.375 | 50   | 50    | 5,659  | 2020/11/ 6 |
| CNH INDUSTRIAL CAP LLC   | 普通社債券 | 4.875 | 40   | 40    | 4,584  | 2021/ 4/ 1 |
| CNH INDUSTRIAL NV        | 普通社債券 | 3.85  | 70   | 64    | 7,221  | 2027/11/15 |
| COACH INC                | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 96    | 10,852 | 2022/ 7/15 |
| COCA-COLA CO/THE         | 普通社債券 | 1.875 | 200  | 197   | 22,084 | 2020/10/27 |
| COCA-COLA CO/THE         | 普通社債券 | 2.25  | 300  | 279   | 31,240 | 2026/ 9/ 1 |
| COCA-COLA CO/THE         | 普通社債券 | 3.3   | 350  | 355   | 39,747 | 2021/ 9/ 1 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTN | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 200   | 22,473 | 2020/ 9/15 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO     | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 99    | 11,140 | 2021/11/15 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO     | 普通社債券 | 2.1   | 100  | 97    | 10,891 | 2023/ 5/ 1 |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP  | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,478 | 2025/ 6/ 1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST  | 普通社債券 | 3.65  | 50   | 46    | 5,255  | 2026/ 8/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 5.15  | 350  | 357   | 40,047 | 2020/ 3/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.45  | 485  | 491   | 54,962 | 2021/10/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 100   | 11,247 | 2022/ 7/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 2.85  | 100  | 99    | 11,114 | 2023/ 1/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 98    | 11,022 | 2023/ 3/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 99    | 11,084 | 2024/ 2/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.6   | 200  | 203   | 22,762 | 2024/ 3/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.7   | 310  | 316   | 35,413 | 2024/ 4/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.15  | 450  | 440   | 49,348 | 2026/ 3/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 2.35  | 200  | 182   | 20,463 | 2027/ 1/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.3   | 100  | 97    | 10,935 | 2027/ 2/ 1 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 3.15  | 250  | 240   | 26,940 | 2028/ 2/15 |
| COMCAST CORP             | 普通社債券 | 4.15  | 390  | 403   | 45,114 | 2028/10/15 |
| COMERICA INC             | 普通社債券 | 3.7   | 75   | 75    | 8,504  | 2023/ 7/31 |
| COMERICA INC             | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 100   | 11,294 | 2029/ 2/ 1 |
| COMMONWEALTH BK AUSTR    | 普通社債券 | 2.55  | 250  | 247   | 27,649 | 2021/ 3/15 |
| COMMONWEALTH BK AUSTR    | 普通社債券 | 2.4   | 250  | 247   | 27,740 | 2020/11/ 2 |
| COMMONWEALTH EDISON      | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 50    | 5,667  | 2020/ 8/ 1 |
| COMPASS BANK             | 普通社債券 | 3.875 | 250  | 242   | 27,181 | 2025/ 4/10 |
| CONAGRA BRANDS INC       | 普通社債券 | 4.3   | 60   | 60    | 6,803  | 2024/ 5/ 1 |
| CONAGRA BRANDS INC       | 普通社債券 | 4.85  | 195  | 195   | 21,907 | 2028/11/ 1 |
| CONAGRA FOODS INC        | 普通社債券 | 3.2   | 157  | 153   | 17,229 | 2023/ 1/25 |
| CONCHO RESOURCES INC     | 普通社債券 | 4.375 | 50   | 50    | 5,685  | 2025/ 1/15 |
| CONCHO RESOURCES INC     | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 145   | 16,309 | 2027/10/ 1 |
| CONNECTICUT LIGHT & PWR  | 普通社債券 | 2.5   | 150  | 147   | 16,536 | 2023/ 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     |            |
| CONOCOPHILLIPS           | 普通社債券 | 4.95  | 100  | 109   | 12,287 | 2026/ 3/15 |
| CONSOLIDATED EDISON CO O | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 97    | 10,867 | 2027/11/15 |
| CONSOLIDATED EDISON CO O | 普通社債券 | 3.8   | 50   | 51    | 5,725  | 2028/ 5/15 |
| CONSOLIDATED EDISON INC  | 普通社債券 | 2.0   | 25   | 24    | 2,772  | 2020/ 3/15 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 2.25  | 200  | 196   | 22,039 | 2020/11/ 6 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 3.75  | 40   | 40    | 4,513  | 2021/ 5/ 1 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 97    | 10,857 | 2022/11/ 7 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 154   | 17,260 | 2023/ 5/ 1 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 4.4   | 65   | 66    | 7,459  | 2025/11/15 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 48    | 5,433  | 2026/12/ 6 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 普通社債券 | 3.6   | 150  | 142   | 15,945 | 2028/ 2/15 |
| CONTINENTAL RESOURCES    | 普通社債券 | 5.0   | 136  | 137   | 15,386 | 2022/ 9/15 |
| CONTINENTAL RESOURCES    | 普通社債券 | 4.5   | 130  | 132   | 14,855 | 2023/ 4/15 |
| CONTINENTAL RESOURCES    | 普通社債券 | 3.8   | 85   | 84    | 9,410  | 2024/ 6/ 1 |
| CONTINENTAL RESOURCES    | 普通社債券 | 4.375 | 85   | 84    | 9,488  | 2028/ 1/15 |
| CONTL AIRLINES 2012-1 A  | 普通社債券 | 4.15  | 145  | 147   | 16,466 | 2024/ 4/11 |
| COOPERAT RABOBANK UA/NY  | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 247   | 27,703 | 2021/ 1/19 |
| COOPERAT RABOBANK UA/NY  | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 245   | 27,463 | 2023/ 1/10 |
| COOPERATIEVE RABOBANK UA | 普通社債券 | 3.75  | 250  | 242   | 27,110 | 2026/ 7/21 |
| CORPORATE OFFICE PROP LP | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 49    | 5,546  | 2021/ 6/15 |
| CORPORATE OFFICE PROP LP | 普通社債券 | 5.0   | 50   | 51    | 5,730  | 2025/ 7/ 1 |
| COSTCO WHOLESALE CORP    | 普通社債券 | 2.3   | 200  | 197   | 22,115 | 2022/ 5/18 |
| COSTCO WHOLESALE CORP    | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 145   | 16,336 | 2027/ 5/18 |
| CRANE CO                 | 普通社債券 | 4.45  | 50   | 51    | 5,745  | 2023/12/15 |
| CRED SUIS GP FUN LTD     | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 248   | 27,817 | 2020/ 3/26 |
| CRED SUIS GP FUN LTD     | 普通社債券 | 3.8   | 150  | 150   | 16,837 | 2023/ 6/ 9 |
| CRED SUIS GP FUN LTD     | 普通社債券 | 3.75  | 300  | 296   | 33,134 | 2025/ 3/26 |
| CREDIT SUISSE AG         | 普通社債券 | 3.0   | 250  | 249   | 27,920 | 2021/10/29 |
| CREDIT SUISSE GROUP      | 普通社債券 | 3.125 | 500  | 499   | 55,848 | 2020/12/10 |
| CREDIT SUISSE GROUP      | 普通社債券 | 4.55  | 150  | 153   | 17,231 | 2026/ 4/17 |
| CREDIT SUISSE NEW YORK   | 普通社債券 | 3.625 | 250  | 251   | 28,105 | 2024/ 9/ 9 |
| CROWN CASTLE INTERNATION | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 200   | 22,425 | 2021/ 2/15 |
| CROWN CASTLE INTERNATION | 普通社債券 | 2.25  | 55   | 53    | 6,011  | 2021/ 9/ 1 |
| CROWN CASTLE INTERNATION | 普通社債券 | 4.45  | 200  | 203   | 22,809 | 2026/ 2/15 |
| CROWN CASTLE INTERNATION | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 97    | 10,907 | 2026/ 6/15 |
| CROWN CASTLE INTL CORP   | 普通社債券 | 5.25  | 250  | 264   | 29,594 | 2023/ 1/15 |
| CROWN CASTLE INTL CORP   | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 98    | 10,992 | 2027/ 3/ 1 |
| CSX CORP                 | 普通社債券 | 3.7   | 300  | 306   | 34,275 | 2023/11/ 1 |
| CSX CORP                 | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 96    | 10,780 | 2027/ 6/ 1 |
| CVS CAREMARK CORP        | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 152   | 17,085 | 2023/12/ 5 |

| 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     |            |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 2.125 | 350  | 341   | 38,187 | 2021/ 6/ 1 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 93    | 10,438 | 2026/ 6/ 1 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 200   | 22,399 | 2020/ 3/ 9 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 2.8   | 250  | 248   | 27,850 | 2020/ 7/20 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 3.35  | 220  | 220   | 24,664 | 2021/ 3/ 9 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 195   | 21,882 | 2022/12/ 1 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 3.7   | 545  | 548   | 61,362 | 2023/ 3/ 9 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 4.1   | 450  | 456   | 51,116 | 2025/ 3/25 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 3.875 | 300  | 299   | 33,526 | 2025/ 7/20 |
| CVS HEALTH CORP          | 普通社債券 | 4.3   | 820  | 820   | 91,801 | 2028/ 3/25 |
| DANAHER CORP             | 普通社債券 | 3.35  | 105  | 103   | 11,527 | 2025/ 9/15 |
| DDR CORP                 | 普通社債券 | 3.625 | 173  | 166   | 18,661 | 2025/ 2/ 1 |
| DELMARVA PWR & LIGHT CO  | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 152   | 17,019 | 2023/11/15 |
| DELPHI CORP              | 普通社債券 | 4.15  | 200  | 201   | 22,495 | 2024/ 3/15 |
| DELTA AIR LINES INC      | 普通社債券 | 2.875 | 95   | 94    | 10,598 | 2020/ 3/13 |
| DELTA AIR LINES INC      | 普通社債券 | 2.6   | 25   | 24    | 2,760  | 2020/12/ 4 |
| DELTA AIR LINES INC      | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 99    | 11,145 | 2022/ 3/15 |
| DEUTSCHE BANK AG         | 普通社債券 | 3.375 | 200  | 195   | 21,927 | 2021/ 5/12 |
| DEUTSCHE BANK AG         | 普通社債券 | 4.25  | 350  | 348   | 39,010 | 2021/10/14 |
| DEUTSCHE BANK AG LONDON  | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 187   | 21,032 | 2024/ 5/30 |
| DEUTSCHE BANK NY         | 普通社債券 | 2.7   | 100  | 98    | 10,980 | 2020/ 7/13 |
| DEUTSCHE BANK NY         | 普通社債券 | 3.15  | 450  | 439   | 49,192 | 2021/ 1/22 |
| DEUTSCHE BANK NY         | 普通社債券 | 3.3   | 100  | 94    | 10,603 | 2022/11/16 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 普通社債券 | 5.85  | 125  | 137   | 15,427 | 2025/12/15 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,142 | 2022/ 5/15 |
| DIAGEO CAPITAL PLC       | 普通社債券 | 4.828 | 100  | 102   | 11,484 | 2020/ 7/15 |
| DIAGEO CAPITAL PLC       | 普通社債券 | 2.625 | 100  | 98    | 11,061 | 2023/ 4/29 |
| DIAGEO INVESTMENT CORP   | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 99    | 11,156 | 2022/ 5/11 |
| DIAMOND 1 FIN            | 普通社債券 | 4.42  | 400  | 407   | 45,614 | 2021/ 6/15 |
| DIAMOND 1 FIN            | 普通社債券 | 5.45  | 200  | 211   | 23,625 | 2023/ 6/15 |
| DIAMOND 1 FIN            | 普通社債券 | 6.02  | 400  | 425   | 47,627 | 2026/ 6/15 |
| DIGITAL REALTY TRUST LP  | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 48    | 5,387  | 2023/ 2/ 1 |
| DIGITAL REALTY TRUST LP  | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 96    | 10,802 | 2027/ 8/15 |
| DISCOVER BANK            | 普通社債券 | 3.1   | 250  | 249   | 27,964 | 2020/ 6/ 4 |
| DISCOVER BANK            | 普通社債券 | 4.2   | 250  | 255   | 28,570 | 2023/ 8/ 8 |
| DISCOVER BANK            | 普通社債券 | 3.45  | 250  | 236   | 26,471 | 2026/ 7/27 |
| DISCOVER FINANCIAL SVS   | 普通社債券 | 5.2   | 83   | 86    | 9,710  | 2022/ 4/27 |
| DISCOVER FINANCIAL SVS   | 普通社債券 | 4.1   | 75   | 73    | 8,178  | 2027/ 2/ 9 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 197   | 22,123 | 2022/ 6/15 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS | 普通社債券 | 2.95  | 50   | 48    | 5,423  | 2023/ 3/20 |

| 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     |            |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS | 普通社債券 | 3.8   | 250  | 247   | 27,659 | 2024/ 3/13 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS | 普通社債券 | 4.9   | 100  | 103   | 11,532 | 2026/ 3/11 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 95    | 10,671 | 2028/ 3/20 |
| DOLLAR GENERAL CORP      | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 98    | 11,074 | 2023/ 4/15 |
| DOLLAR GENERAL CORP      | 普通社債券 | 4.15  | 50   | 50    | 5,690  | 2025/11/ 1 |
| DOLLAR TREE INC          | 普通社債券 | 3.7   | 90   | 89    | 10,000 | 2023/ 5/15 |
| DOLLAR TREE INC          | 普通社債券 | 4.0   | 200  | 196   | 22,014 | 2025/ 5/15 |
| DOMINION ENERGY INC      | 普通社債券 | 2.579 | 70   | 69    | 7,755  | 2020/ 7/ 1 |
| DOMINION ENERGY INC      | 普通社債券 | 4.25  | 50   | 51    | 5,716  | 2028/ 6/ 1 |
| DOMINION GAS HLD LLC     | 普通社債券 | 2.8   | 150  | 149   | 16,694 | 2020/11/15 |
| DOMINION GAS HOLDINGS LL | 普通社債券 | 3.6   | 25   | 24    | 2,797  | 2024/12/15 |
| DOMINION RESOURCES       | 普通社債券 | 4.104 | 40   | 40    | 4,525  | 2021/ 4/ 1 |
| DOMINION RESOURCES       | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 49    | 5,493  | 2022/ 1/15 |
| DOMINION RESOURCES INC   | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 100   | 11,262 | 2025/10/ 1 |
| DOMINION RESOURCES INC   | 普通社債券 | 5.75  | 100  | 100   | 11,255 | 2024/10/ 1 |
| DOMINION RESOURCES INC   | 普通社債券 | 2.0   | 20   | 19    | 2,172  | 2021/ 8/15 |
| DOMTAR CORP              | 普通社債券 | 4.4   | 100  | 100   | 11,298 | 2022/ 4/ 1 |
| DOVER CORP               | 普通社債券 | 4.3   | 100  | 101   | 11,376 | 2021/ 3/ 1 |
| DOW CHEMICAL CO/THE      | 普通社債券 | 4.25  | 250  | 253   | 28,417 | 2020/11/15 |
| DOW CHEMICAL CO/THE      | 普通社債券 | 4.125 | 200  | 204   | 22,912 | 2021/11/15 |
| DOW CHEMICAL CO/THE      | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,178 | 2024/10/ 1 |
| DOWDUPONT INC            | 普通社債券 | 3.766 | 150  | 152   | 17,012 | 2020/11/15 |
| DOWDUPONT INC            | 普通社債券 | 4.205 | 200  | 206   | 23,102 | 2023/11/15 |
| DOWDUPONT INC            | 普通社債券 | 4.493 | 150  | 156   | 17,513 | 2025/11/15 |
| DOWDUPONT INC            | 普通社債券 | 4.725 | 200  | 209   | 23,445 | 2028/11/15 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP  | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 95    | 10,648 | 2025/11/15 |
| DTE ENERGY               | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,099 | 2024/ 6/ 1 |
| DTE ENERGY               | 普通社債券 | 2.85  | 100  | 92    | 10,375 | 2026/10/ 1 |
| DUKE ENERGY              | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 93    | 10,427 | 2026/ 9/ 1 |
| DUKE ENERGY CAROLINAS    | 普通社債券 | 3.05  | 200  | 200   | 22,456 | 2023/ 3/15 |
| DUKE ENERGY CAROLINAS    | 普通社債券 | 3.95  | 200  | 207   | 23,242 | 2028/11/15 |
| DUKE ENERGY CORP         | 普通社債券 | 3.55  | 200  | 201   | 22,599 | 2021/ 9/15 |
| DUKE ENERGY CORP         | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 203   | 22,759 | 2024/ 4/15 |
| DUKE ENERGY CORP         | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 95    | 10,674 | 2027/ 8/15 |
| DUKE ENERGY FLORIDA LLC  | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 97    | 10,944 | 2027/ 1/15 |
| DUKE ENERGY PROGRESS LLC | 普通社債券 | 3.45  | 140  | 139   | 15,598 | 2029/ 3/15 |
| DUKE REALTY LP           | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 100   | 11,198 | 2024/12/ 1 |
| DUKE REALTY LP           | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 50    | 5,631  | 2028/ 9/15 |
| DXC TECHNOLOGY CO        | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 99    | 11,141 | 2020/ 3/27 |
| DXC TECHNOLOGY CO        | 普通社債券 | 4.25  | 100  | 100   | 11,209 | 2024/ 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     |            |
| E*TRADE FINANCIAL CORP   | 普通社債券 | 2.95  | 50   | 49    | 5,490  | 2022/ 8/24 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP   | 普通社債券 | 3.8   | 15   | 14    | 1,593  | 2027/ 8/24 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP   | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 49    | 5,583  | 2028/ 6/20 |
| E.I. DU PONT DE NEMOURS  | 普通社債券 | 2.2   | 33   | 32    | 3,666  | 2020/ 5/ 1 |
| EASTMAN CHEMICAL CO      | 普通社債券 | 3.8   | 250  | 247   | 27,749 | 2025/ 3/15 |
| EATON CORP               | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 247   | 27,670 | 2022/11/ 2 |
| EATON VANCE CORP         | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 48    | 5,432  | 2027/ 4/ 6 |
| EBAY INC                 | 普通社債券 | 3.25  | 50   | 50    | 5,611  | 2020/10/15 |
| EBAY INC                 | 普通社債券 | 2.875 | 200  | 198   | 22,254 | 2021/ 8/ 1 |
| EBAY INC                 | 普通社債券 | 2.6   | 200  | 195   | 21,825 | 2022/ 7/15 |
| EBAY INC                 | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 95    | 10,686 | 2027/ 6/ 5 |
| ECOLAB INC               | 普通社債券 | 2.375 | 300  | 292   | 32,728 | 2022/ 8/10 |
| ECOLAB INC               | 普通社債券 | 3.25  | 50   | 50    | 5,622  | 2023/ 1/14 |
| ECOLAB INC               | 普通社債券 | 2.7   | 45   | 42    | 4,799  | 2026/11/ 1 |
| EDISON INTERNATIONAL     | 普通社債券 | 2.125 | 50   | 49    | 5,508  | 2020/ 4/15 |
| EDISON INTERNATIONAL     | 普通社債券 | 4.125 | 100  | 92    | 10,333 | 2028/ 3/15 |
| EL PASO PIPELINE PART OP | 普通社債券 | 5.0   | 150  | 155   | 17,434 | 2021/10/ 1 |
| ELECTRONIC ARTS INC      | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 101   | 11,351 | 2021/ 3/ 1 |
| ELI LILLY & CO           | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 197   | 22,054 | 2025/ 6/ 1 |
| ELI LILLY & CO           | 普通社債券 | 3.375 | 95   | 94    | 10,629 | 2029/ 3/15 |
| EMBRAER NETHERLANDS FINA | 普通社債券 | 5.4   | 65   | 70    | 7,837  | 2027/ 2/ 1 |
| EMBRAER SA               | 普通社債券 | 5.05  | 150  | 159   | 17,814 | 2025/ 6/15 |
| EMERA US FINANCE LP      | 普通社債券 | 2.7   | 50   | 49    | 5,488  | 2021/ 6/15 |
| EMERA US FINANCE LP      | 普通社債券 | 3.55  | 65   | 62    | 6,976  | 2026/ 6/15 |
| EMERSON ELECTRIC CO      | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 97    | 10,948 | 2025/ 6/ 1 |
| EMPRESA NACIONAL DE ELEC | 普通社債券 | 4.25  | 50   | 50    | 5,697  | 2024/ 4/15 |
| ENABLE MIDSTREAM PARTNER | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 97    | 10,888 | 2024/ 5/15 |
| ENABLE MIDSTREAM PARTNER | 普通社債券 | 4.4   | 100  | 95    | 10,732 | 2027/ 3/15 |
| ENBRIDGE ENERGY PARTNERS | 普通社債券 | 5.875 | 100  | 111   | 12,462 | 2025/10/15 |
| ENBRIDGE INC             | 普通社債券 | 2.9   | 50   | 49    | 5,493  | 2022/ 7/15 |
| ENBRIDGE INC             | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,408 | 2023/10/ 1 |
| ENBRIDGE INC             | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 203   | 22,749 | 2026/12/ 1 |
| ENBRIDGE INC             | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 48    | 5,478  | 2027/ 7/15 |
| ENCANA CORP              | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 100   | 11,284 | 2021/11/15 |
| ENEL CHILE SA            | 普通社債券 | 4.875 | 100  | 103   | 11,532 | 2028/ 6/12 |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 3.6   | 250  | 249   | 27,968 | 2023/ 2/ 1 |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 4.15  | 100  | 101   | 11,313 | 2020/10/ 1 |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 4.65  | 250  | 256   | 28,664 | 2021/ 6/ 1 |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 5.2   | 200  | 208   | 23,317 | 2022/ 2/ 1 |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 4.05  | 150  | 149   | 16,695 | 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     |            |
| ENERGY TRANSFER PARTNERS | 普通社債券 | 4.95  | 200  | 205   | 22,967 | 2028/ 6/15 |
| ENERGY CORP              | 普通社債券 | 5.125 | 100  | 101   | 11,392 | 2020/ 9/15 |
| ENERGY CORP              | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 50    | 5,695  | 2022/ 7/15 |
| ENERGY CORP              | 普通社債券 | 2.95  | 30   | 28    | 3,144  | 2026/ 9/ 1 |
| ENERGY LOUISIANA LLC     | 普通社債券 | 2.4   | 350  | 321   | 36,020 | 2026/10/ 1 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 2.8   | 250  | 249   | 27,870 | 2021/ 2/15 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 3.5   | 75   | 75    | 8,480  | 2022/ 2/ 1 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 3.35  | 200  | 200   | 22,451 | 2023/ 3/15 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 101   | 11,338 | 2025/ 2/15 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 4.15  | 275  | 282   | 31,602 | 2028/10/16 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 4.875 | 100  | 91    | 10,239 | 2022/ 8/16 |
| ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 普通社債券 | 5.375 | 100  | 88    | 9,904  | 2028/ 2/15 |
| ENTERTAINMENT PROPERTIES | 普通社債券 | 5.75  | 50   | 52    | 5,882  | 2022/ 8/15 |
| EOG RESOURCES INC        | 普通社債券 | 4.1   | 250  | 254   | 28,485 | 2021/ 2/ 1 |
| EOG RESOURCES INC        | 普通社債券 | 2.625 | 150  | 147   | 16,481 | 2023/ 3/15 |
| EPR PROPERTIES           | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 100   | 11,259 | 2026/12/15 |
| EQT CORP                 | 普通社債券 | 2.5   | 35   | 34    | 3,845  | 2020/10/ 1 |
| EQT CORP                 | 普通社債券 | 3.0   | 35   | 33    | 3,781  | 2022/10/ 1 |
| EQT CORP                 | 普通社債券 | 3.9   | 100  | 91    | 10,192 | 2027/10/ 1 |
| EQT MIDSTREAM PARTNERS L | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 100   | 11,277 | 2023/ 7/15 |
| EQT MIDSTREAM PARTNERS L | 普通社債券 | 5.5   | 200  | 198   | 22,259 | 2028/ 7/15 |
| EQUIFAX INC              | 普通社債券 | 2.3   | 50   | 48    | 5,432  | 2021/ 6/ 1 |
| EQUIFAX INC              | 普通社債券 | 3.95  | 40   | 40    | 4,493  | 2023/ 6/15 |
| ERP OPERATING LP         | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 101   | 11,401 | 2020/ 7/15 |
| ERP OPERATING LP         | 普通社債券 | 4.625 | 150  | 155   | 17,455 | 2021/12/15 |
| ERP OPERATING LP         | 普通社債券 | 3.25  | 35   | 34    | 3,816  | 2027/ 8/ 1 |
| ERP OPERATING LP         | 普通社債券 | 4.15  | 50   | 51    | 5,805  | 2028/12/ 1 |
| ESSEX PORTFOLIO LP       | 普通社債券 | 3.875 | 50   | 50    | 5,646  | 2024/ 5/ 1 |
| ESSEX PORTFOLIO LP       | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 98    | 11,046 | 2025/ 4/ 1 |
| ESTEE LAUDER COS INC     | 普通社債券 | 1.7   | 30   | 29    | 3,272  | 2021/ 5/10 |
| ESTEE LAUDER COS INC     | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 98    | 10,970 | 2027/ 3/15 |
| EVERSOURCE ENERGY        | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 49    | 5,532  | 2022/ 3/15 |
| EVERSOURCE ENERGY        | 普通社債券 | 3.8   | 120  | 122   | 13,696 | 2023/12/ 1 |
| EVERSOURCE ENERGY        | 普通社債券 | 2.9   | 50   | 48    | 5,431  | 2024/10/ 1 |
| EXELON CORP              | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 98    | 10,987 | 2021/ 4/15 |
| EXELON CORP              | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 97    | 10,884 | 2026/ 4/15 |
| EXELON CORP              | 普通社債券 | 2.85  | 50   | 49    | 5,576  | 2020/ 6/15 |
| EXELON CORP              | 普通社債券 | 3.497 | 100  | 99    | 11,134 | 2022/ 6/ 1 |
| EXELON CORP              | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 101   | 11,312 | 2025/ 6/15 |
| EXPEDIA INC              | 普通社債券 | 5.95  | 100  | 103   | 11,615 | 2020/ 8/15 |



| 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     |            |
| EXPEDIA INC              | 普通社債券 | 5.0   | 200  | 206   | 23,146 | 2026/ 2/15 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 4.5   | 200  | 205   | 22,948 | 2026/ 2/25 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 2.6   | 100  | 98    | 11,078 | 2020/11/30 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 4.75  | 250  | 259   | 29,074 | 2021/11/15 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 3.05  | 100  | 98    | 11,034 | 2022/11/30 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,100 | 2024/ 6/15 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING  | 普通社債券 | 3.4   | 150  | 143   | 16,050 | 2027/ 3/ 1 |
| EXXON MOBIL CORPORATION  | 普通社債券 | 1.912 | 150  | 148   | 16,665 | 2020/ 3/ 6 |
| EXXON MOBIL CORPORATION  | 普通社債券 | 2.709 | 250  | 246   | 27,560 | 2025/ 3/ 6 |
| EXXON MOBIL INC          | 普通社債券 | 2.222 | 200  | 197   | 22,148 | 2021/ 3/ 1 |
| EXXON MOBIL INC          | 普通社債券 | 2.726 | 70   | 69    | 7,787  | 2023/ 3/ 1 |
| EXXON MOBIL INC          | 普通社債券 | 3.043 | 200  | 199   | 22,278 | 2026/ 3/ 1 |
| FEDERAL REALTY INVESTMEN | 普通社債券 | 3.25  | 50   | 48    | 5,382  | 2027/ 7/15 |
| FEDEX CORP               | 普通社債券 | 3.4   | 70   | 70    | 7,893  | 2022/ 1/14 |
| FEDEX CORP               | 普通社債券 | 3.2   | 200  | 196   | 22,023 | 2025/ 2/ 1 |
| FEDEX CORP               | 普通社債券 | 3.4   | 150  | 143   | 16,079 | 2028/ 2/15 |
| FIBRIA OVERSEAS FINANCE  | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 97    | 10,963 | 2025/ 1/14 |
| FIBRIA OVERSEAS FINANCE  | 普通社債券 | 5.5   | 50   | 52    | 5,819  | 2027/ 1/17 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 3.625 | 90   | 90    | 10,139 | 2020/10/15 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,155 | 2023/ 4/15 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 3.875 | 28   | 28    | 3,141  | 2024/ 6/ 5 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 5.0   | 28   | 29    | 3,319  | 2025/10/15 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 93    | 10,419 | 2026/ 8/15 |
| FIDELITY NATIONAL INFORM | 普通社債券 | 4.25  | 155  | 155   | 17,359 | 2028/ 5/15 |
| FIDELITY NATL FINANCIAL  | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 98    | 11,041 | 2028/ 8/15 |
| FIFTH THIRD BANCORP      | 普通社債券 | 2.875 | 200  | 199   | 22,328 | 2020/ 7/27 |
| FIFTH THIRD BANCORP      | 普通社債券 | 2.6   | 100  | 97    | 10,958 | 2022/ 6/15 |
| FIFTH THIRD BANCORP      | 普通社債券 | 3.65  | 250  | 252   | 28,297 | 2024/ 1/25 |
| FIFTH THIRD BANK         | 普通社債券 | 2.2   | 200  | 197   | 22,082 | 2020/10/30 |
| FIFTH THIRD BANK         | 普通社債券 | 2.875 | 200  | 198   | 22,229 | 2021/10/ 1 |
| FIFTH THIRD BANK         | 普通社債券 | 3.85  | 200  | 199   | 22,337 | 2026/ 3/15 |
| FIRST HORIZON NATIONAL   | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,214 | 2020/12/15 |
| FIRSTENERGY CORP         | 普通社債券 | 2.85  | 60   | 58    | 6,574  | 2022/ 7/15 |
| FIRSTENERGY CORP         | 普通社債券 | 4.25  | 70   | 71    | 8,007  | 2023/ 3/15 |
| FIRSTENERGY CORP         | 普通社債券 | 3.9   | 65   | 64    | 7,224  | 2027/ 7/15 |
| FISERV INC               | 普通社債券 | 2.7   | 150  | 149   | 16,677 | 2020/ 6/ 1 |
| FISERV INC               | 普通社債券 | 3.8   | 50   | 50    | 5,645  | 2023/10/ 1 |
| FISERV INC               | 普通社債券 | 4.2   | 65   | 64    | 7,184  | 2028/10/ 1 |
| FLEXTRONICS INTERNATIONA | 普通社債券 | 4.75  | 125  | 127   | 14,218 | 2025/ 6/15 |
| FLORIDA POWER & LIGHT CO | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 101   | 11,348 | 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     |            |
| FLORIDA POWER & LIGHT CO | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 200   | 22,387 | 2025/12/ 1 |
| FLOWERS FOODS INC        | 普通社債券 | 3.5   | 35   | 32    | 3,686  | 2026/10/ 1 |
| FLUOR CORP               | 普通社債券 | 4.25  | 100  | 96    | 10,845 | 2028/ 9/15 |
| FORD MOTOR COMPANY       | 普通社債券 | 4.346 | 100  | 90    | 10,174 | 2026/12/ 8 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 3.81  | 200  | 186   | 20,847 | 2024/ 1/ 9 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 3.096 | 200  | 185   | 20,706 | 2023/ 5/ 4 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 2.459 | 450  | 444   | 49,766 | 2020/ 3/27 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 2.343 | 450  | 439   | 49,159 | 2020/11/ 2 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 5.875 | 400  | 415   | 46,449 | 2021/ 8/ 2 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 3.664 | 200  | 182   | 20,417 | 2024/ 9/ 8 |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 普通社債券 | 3.815 | 400  | 340   | 38,094 | 2027/11/ 2 |
| FORTIS INC               | 普通社債券 | 3.055 | 200  | 187   | 20,930 | 2026/10/ 4 |
| FORTIVE CORP             | 普通社債券 | 2.35  | 50   | 49    | 5,491  | 2021/ 6/15 |
| FORTIVE CORP             | 普通社債券 | 3.15  | 50   | 47    | 5,318  | 2026/ 6/15 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SE | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,334 | 2023/ 9/21 |
| FOX CORP                 | 普通社債券 | 4.03  | 150  | 153   | 17,150 | 2024/ 1/25 |
| FOX CORP                 | 普通社債券 | 4.709 | 235  | 244   | 27,375 | 2029/ 1/25 |
| FRANCE TELECOM           | 普通社債券 | 4.125 | 150  | 154   | 17,300 | 2021/ 9/14 |
| FRANKLIN RESOURCES INC   | 普通社債券 | 2.85  | 200  | 193   | 21,671 | 2025/ 3/30 |
| GATX CORP                | 普通社債券 | 2.6   | 200  | 198   | 22,223 | 2020/ 3/30 |
| GATX CORP                | 普通社債券 | 4.35  | 100  | 101   | 11,389 | 2024/ 2/15 |
| GE CAPITAL INTL FUNDING  | 普通社債券 | 2.342 | 750  | 737   | 82,512 | 2020/11/15 |
| GE CAPITAL INTL FUNDING  | 普通社債券 | 3.373 | 250  | 240   | 26,891 | 2025/11/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 100   | 11,203 | 2020/ 5/11 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 3.0   | 75   | 75    | 8,422  | 2021/ 5/11 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 97    | 10,939 | 2022/11/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 3.375 | 75   | 76    | 8,520  | 2023/ 5/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 2.375 | 50   | 47    | 5,363  | 2024/11/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 101   | 11,370 | 2025/ 5/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 2.125 | 100  | 92    | 10,342 | 2026/ 8/15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP    | 普通社債券 | 3.75  | 80   | 82    | 9,205  | 2028/ 5/15 |
| GENERAL ELECTRIC CO      | 普通社債券 | 2.7   | 650  | 629   | 70,503 | 2022/10/ 9 |
| GENERAL MILLS INC        | 普通社債券 | 3.2   | 15   | 15    | 1,685  | 2021/ 4/16 |
| GENERAL MILLS INC        | 普通社債券 | 3.15  | 150  | 150   | 16,795 | 2021/12/15 |
| GENERAL MILLS INC        | 普通社債券 | 3.7   | 140  | 141   | 15,820 | 2023/10/17 |
| GENERAL MILLS INC        | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 100   | 11,292 | 2025/ 4/17 |
| GENERAL MILLS INC        | 普通社債券 | 4.2   | 200  | 202   | 22,704 | 2028/ 4/17 |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL | 普通社債券 | 3.2   | 500  | 494   | 55,352 | 2021/ 7/ 6 |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL | 普通社債券 | 3.45  | 250  | 248   | 27,793 | 2022/ 4/10 |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL | 普通社債券 | 4.0   | 250  | 241   | 26,992 | 2025/ 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     |            |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 2.45  | 200  | 196   | 22,007 | 2020/11/ 6 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 4.2   | 60   | 60    | 6,798  | 2021/11/ 6 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 3.15  | 70   | 68    | 7,681  | 2022/ 6/30 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 3.7   | 250  | 246   | 27,557 | 2023/ 5/ 9 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 4.15  | 150  | 150   | 16,817 | 2023/ 6/19 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 98    | 10,992 | 2024/ 4/13 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 188   | 21,067 | 2024/11/ 7 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 4.35  | 150  | 147   | 16,453 | 2025/ 4/ 9 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 94    | 10,521 | 2026/10/ 6 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 4.35  | 100  | 95    | 10,691 | 2027/ 1/17 |
| GENERAL MOTORS FINL CO  | 普通社債券 | 5.65  | 100  | 101   | 11,393 | 2029/ 1/17 |
| GEORGIA POWER CO        | 普通社債券 | 2.0   | 100  | 98    | 11,070 | 2020/ 3/30 |
| GEORGIA POWER CO        | 普通社債券 | 3.25  | 50   | 47    | 5,330  | 2026/ 4/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 2.55  | 200  | 199   | 22,285 | 2020/ 9/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,496 | 2021/ 4/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 1.95  | 30   | 29    | 3,263  | 2022/ 3/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 3.25  | 65   | 65    | 7,319  | 2022/ 9/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 2.5   | 70   | 68    | 7,626  | 2023/ 9/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 250   | 28,071 | 2025/ 2/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 199   | 22,344 | 2026/ 3/ 1 |
| GILEAD SCIENCES INC     | 普通社債券 | 2.95  | 150  | 141   | 15,884 | 2027/ 3/ 1 |
| GLAXOSMITHKLINE CAP INC | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 101   | 11,322 | 2023/ 5/15 |
| GLAXOSMITHKLINE CAP INC | 普通社債券 | 3.625 | 55   | 55    | 6,260  | 2025/ 5/15 |
| GLAXOSMITHKLINE CAP INC | 普通社債券 | 3.875 | 100  | 102   | 11,507 | 2028/ 5/15 |
| GLAXOSMITHKLINE CAPITAL | 普通社債券 | 3.125 | 70   | 70    | 7,883  | 2021/ 5/14 |
| GLAXOSMITHKLINE CAPITAL | 普通社債券 | 2.85  | 300  | 298   | 33,418 | 2022/ 5/ 8 |
| GLP CAPITAL LP / FIN II | 普通社債券 | 4.875 | 120  | 121   | 13,630 | 2020/11/ 1 |
| GLP CAPITAL LP / FIN II | 普通社債券 | 5.375 | 45   | 46    | 5,212  | 2023/11/ 1 |
| GLP CAPITAL LP / FIN II | 普通社債券 | 5.25  | 45   | 46    | 5,192  | 2025/ 6/ 1 |
| GLP CAPITAL LP / FIN II | 普通社債券 | 5.375 | 85   | 87    | 9,755  | 2026/ 4/15 |
| GLP CAPITAL LP / FIN II | 普通社債券 | 5.75  | 45   | 46    | 5,216  | 2028/ 6/ 1 |
| GM FINANCIAL            | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 200   | 22,492 | 2020/11/24 |
| GM FINANCIAL            | 普通社債券 | 4.2   | 100  | 101   | 11,325 | 2021/ 3/ 1 |
| GM FINANCIAL            | 普通社債券 | 5.25  | 100  | 101   | 11,353 | 2026/ 3/ 1 |
| GOLDCORP INC            | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 201   | 22,562 | 2023/ 3/15 |
| GOLDMAN SACHS BANK USA  | 普通社債券 | 3.2   | 35   | 35    | 3,931  | 2020/ 6/ 5 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.875 | 300  | 298   | 33,453 | 2021/ 2/25 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.625 | 350  | 346   | 38,776 | 2021/ 4/25 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.6   | 150  | 149   | 16,712 | 2020/ 4/23 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 49    | 5,568  | 2020/ 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     |            |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.6   | 200  | 197   | 22,157 | 2020/12/27 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 5.25  | 400  | 418   | 46,826 | 2021/ 7/27 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 5.75  | 400  | 426   | 47,763 | 2022/ 1/24 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.0   | 365  | 362   | 40,616 | 2022/ 4/26 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.876 | 400  | 394   | 44,191 | 2021/10/31 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.625 | 300  | 302   | 33,867 | 2023/ 1/22 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.2   | 250  | 247   | 27,748 | 2023/ 2/23 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 2.908 | 250  | 245   | 27,432 | 2022/ 6/ 5 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.625 | 180  | 180   | 20,196 | 2024/ 2/20 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.5   | 350  | 345   | 38,633 | 2025/ 1/23 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.75  | 600  | 597   | 66,912 | 2025/ 5/22 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 201   | 22,549 | 2025/10/21 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 197   | 22,100 | 2026/ 2/25 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 144   | 16,177 | 2026/11/16 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.85  | 300  | 294   | 33,006 | 2027/ 1/26 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.691 | 200  | 193   | 21,683 | 2027/ 6/ 5 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 3.814 | 200  | 194   | 21,762 | 2028/ 4/23 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 普通社債券 | 4.223 | 300  | 300   | 33,663 | 2028/ 5/ 1 |
| GRUPO TELEVISIA SAB     | 普通社債券 | 6.625 | 150  | 166   | 18,579 | 2025/ 3/18 |
| GULF POEWR CO           | 普通社債券 | 3.3   | 100  | 98    | 10,968 | 2027/ 5/30 |
| HALFMOON PARENT INC     | 普通社債券 | 3.4   | 80   | 80    | 9,001  | 2021/ 9/17 |
| HALFMOON PARENT INC     | 普通社債券 | 3.75  | 390  | 394   | 44,198 | 2023/ 7/15 |
| HALFMOON PARENT INC     | 普通社債券 | 4.375 | 390  | 396   | 44,330 | 2028/10/15 |
| HALLIBURTON CO          | 普通社債券 | 3.8   | 150  | 150   | 16,882 | 2025/11/15 |
| HALLIBURTON CO          | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 100   | 11,230 | 2021/11/15 |
| HANOVER INSURANCE GROUP | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 49    | 5,592  | 2026/ 4/15 |
| HARRIS CORPORATION      | 普通社債券 | 2.7   | 200  | 198   | 22,249 | 2020/ 4/27 |
| HARRIS CORPORATION      | 普通社債券 | 4.4   | 150  | 154   | 17,292 | 2028/ 6/15 |
| HARTFORD FINL SVCS GRP  | 普通社債券 | 5.5   | 100  | 102   | 11,487 | 2020/ 3/30 |
| HARTFORD FINL SVCS GRP  | 普通社債券 | 5.125 | 200  | 210   | 23,542 | 2022/ 4/15 |
| HASBRO INC              | 普通社債券 | 3.15  | 50   | 49    | 5,564  | 2021/ 5/15 |
| HASBRO INC              | 普通社債券 | 3.5   | 30   | 27    | 3,110  | 2027/ 9/15 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 5.875 | 150  | 159   | 17,859 | 2022/ 3/15 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 4.75  | 105  | 108   | 12,165 | 2023/ 5/ 1 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 5.0   | 170  | 177   | 19,909 | 2024/ 3/15 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 5.25  | 120  | 127   | 14,240 | 2025/ 4/15 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 5.25  | 130  | 137   | 15,380 | 2026/ 6/15 |
| HCA INC                 | 普通社債券 | 4.5   | 105  | 106   | 11,879 | 2027/ 2/15 |
| HCP INC                 | 普通社債券 | 3.4   | 300  | 292   | 32,680 | 2025/ 2/ 1 |
| HEALTH CARE REIT INC    | 普通社債券 | 5.25  | 100  | 104   | 11,697 | 2022/ 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     |            |
| HEALTH CARE REIT INC     | 普通社債券 | 4.0   | 250  | 251   | 28,198 | 2025/ 6/ 1 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMER | 普通社債券 | 3.375 | 50   | 49    | 5,575  | 2021/ 7/15 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMER | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 144   | 16,157 | 2027/ 7/ 1 |
| HEINZ                    | 普通社債券 | 3.0   | 110  | 101   | 11,353 | 2026/ 6/ 1 |
| HERSHEY COMPANY          | 普通社債券 | 4.125 | 100  | 102   | 11,448 | 2020/12/ 1 |
| HESS CORP                | 普通社債券 | 4.3   | 100  | 97    | 10,880 | 2027/ 4/ 1 |
| HEWLETT-PACKARD CO       | 普通社債券 | 3.75  | 25   | 25    | 2,824  | 2020/12/ 1 |
| HEXCEL CORP              | 普通社債券 | 3.95  | 50   | 48    | 5,474  | 2027/ 2/15 |
| HIGHWOODS REALTY LP      | 普通社債券 | 3.2   | 150  | 148   | 16,602 | 2021/ 6/15 |
| HJ HEINZ CO              | 普通社債券 | 2.8   | 50   | 49    | 5,561  | 2020/ 7/ 2 |
| HJ HEINZ CO              | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 149   | 16,747 | 2022/ 7/15 |
| HJ HEINZ CO              | 普通社債券 | 3.95  | 150  | 148   | 16,630 | 2025/ 7/15 |
| HOLLYFRONTIER CORP       | 普通社債券 | 5.875 | 150  | 158   | 17,695 | 2026/ 4/ 1 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 1.8   | 141  | 139   | 15,608 | 2020/ 6/ 5 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 4.4   | 100  | 102   | 11,518 | 2021/ 4/ 1 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 2.0   | 200  | 197   | 22,072 | 2021/ 4/ 1 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 2.7   | 100  | 99    | 11,174 | 2023/ 4/ 1 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 208   | 23,299 | 2024/ 2/15 |
| HOME DEPOT INC           | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 96    | 10,773 | 2027/ 9/14 |
| HOME DEPOT INC/THE       | 普通社債券 | 2.125 | 125  | 115   | 12,962 | 2026/ 9/15 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL  | 普通社債券 | 1.85  | 200  | 195   | 21,847 | 2021/11/ 1 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL  | 普通社債券 | 2.5   | 150  | 143   | 16,039 | 2026/11/ 1 |
| HOSPITALITY PROPERTIES T | 普通社債券 | 4.5   | 150  | 144   | 16,177 | 2025/ 3/15 |
| HOST HOTELS & RESORTS LP | 普通社債券 | 3.875 | 50   | 49    | 5,514  | 2024/ 4/ 1 |
| HOST HOTELS + RESORTS LP | 普通社債券 | 4.75  | 200  | 205   | 23,005 | 2023/ 3/ 1 |
| HP ENTERPRISE CO         | 普通社債券 | 3.6   | 400  | 402   | 45,038 | 2020/10/15 |
| HP ENTERPRISE CO         | 普通社債券 | 4.9   | 200  | 208   | 23,330 | 2025/10/15 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 200   | 22,491 | 2021/ 3/ 8 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.3   | 200  | 204   | 22,853 | 2026/ 3/ 8 |
| HSBC BANK USA NA         | 普通社債券 | 4.875 | 150  | 153   | 17,206 | 2020/ 8/24 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 2.95  | 350  | 348   | 39,005 | 2021/ 5/25 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.375 | 225  | 226   | 25,302 | 2026/11/23 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 2.65  | 250  | 245   | 27,521 | 2022/ 1/ 5 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.0   | 400  | 409   | 45,861 | 2022/ 3/30 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 3.262 | 400  | 396   | 44,427 | 2022/ 3/13 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 3.6   | 300  | 301   | 33,703 | 2023/ 5/25 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 202   | 22,624 | 2024/ 3/14 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 3.95  | 250  | 252   | 28,278 | 2023/ 5/18 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 202   | 22,619 | 2025/ 8/18 |
| HSBC HOLDINGS PLC        | 普通社債券 | 4.292 | 200  | 202   | 22,651 | 2025/ 9/12 |

| 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     |            |
| HSBC HOLDINGS PLC             | 普通社債券 | 4.041 | 250  | 247   | 27,737 | 2027/ 3/13 |
| HSBC HOLDINGS PLC             | 普通社債券 | 4.583 | 200  | 205   | 22,978 | 2028/ 6/19 |
| HSBC USA INC                  | 普通社債券 | 2.35  | 400  | 397   | 44,529 | 2020/ 3/ 5 |
| HUBBELL INC                   | 普通社債券 | 3.35  | 100  | 94    | 10,585 | 2026/ 3/ 1 |
| HUMANA INC                    | 普通社債券 | 2.5   | 50   | 49    | 5,526  | 2020/12/15 |
| HUMANA INC                    | 普通社債券 | 2.9   | 50   | 49    | 5,492  | 2022/12/15 |
| HUMANA INC                    | 普通社債券 | 3.85  | 150  | 150   | 16,801 | 2024/10/ 1 |
| HUNTINGTON BANCSHARES IN      | 普通社債券 | 2.3   | 100  | 97    | 10,923 | 2022/ 1/14 |
| HUNTINGTON NATIONAL BANK      | 普通社債券 | 2.375 | 250  | 248   | 27,831 | 2020/ 3/10 |
| HUNTINGTON NATIONAL BANK      | 普通社債券 | 2.4   | 250  | 248   | 27,807 | 2020/ 4/ 1 |
| HUSKY ENERGY INC              | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 101   | 11,315 | 2022/ 4/15 |
| HYATT HOTELS CORP             | 普通社債券 | 4.85  | 50   | 51    | 5,770  | 2026/ 3/15 |
| HYATT HOTELS CORP             | 普通社債券 | 4.375 | 50   | 49    | 5,556  | 2028/ 9/15 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 99    | 11,120 | 2022/11/ 9 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 1.625 | 200  | 197   | 22,063 | 2020/ 5/15 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 98    | 11,031 | 2022/ 1/27 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 1.875 | 150  | 144   | 16,146 | 2022/ 8/ 1 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 3.375 | 250  | 252   | 28,238 | 2023/ 8/ 1 |
| IBM CORP                      | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 199   | 22,354 | 2026/ 2/19 |
| IBM CREDIT CORP               | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 99    | 11,143 | 2021/ 2/ 5 |
| IBM CREDIT CORP               | 普通社債券 | 2.2   | 100  | 96    | 10,854 | 2022/ 9/ 8 |
| IBM CREDIT CORP               | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 99    | 11,149 | 2023/ 2/ 6 |
| IHS MARKIT LTD                | 普通社債券 | 4.125 | 100  | 100   | 11,223 | 2023/ 8/ 1 |
| ING GROEP NV                  | 普通社債券 | 3.15  | 200  | 198   | 22,239 | 2022/ 3/29 |
| ING GROEP NV                  | 普通社債券 | 3.95  | 200  | 197   | 22,060 | 2027/ 3/29 |
| INGERSOLL-RAND GL HLD CO      | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 155   | 17,445 | 2023/ 6/15 |
| INGERSOLL-RAND LUX FINAN      | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 99    | 11,189 | 2024/11/ 1 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 1.85  | 150  | 148   | 16,613 | 2020/ 5/11 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 2.45  | 115  | 114   | 12,825 | 2020/ 7/29 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 3.3   | 350  | 355   | 39,750 | 2021/10/ 1 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 3.1   | 100  | 101   | 11,311 | 2022/ 7/29 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 2.7   | 350  | 348   | 38,996 | 2022/12/15 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 99    | 11,090 | 2024/ 5/11 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 3.7   | 145  | 149   | 16,706 | 2025/ 7/29 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 2.6   | 50   | 48    | 5,383  | 2026/ 5/19 |
| INTEL CORP                    | 普通社債券 | 3.15  | 200  | 198   | 22,197 | 2027/ 5/11 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 153   | 17,199 | 2025/12/ 1 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 普通社債券 | 2.35  | 200  | 195   | 21,845 | 2022/ 9/15 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 104   | 11,639 | 2023/10/15 |
| INTERNATIONAL PAPER CO        | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 101   | 11,330 | 2024/ 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     |            |
| INTERNATIONAL PAPER CO   | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 93    | 10,454 | 2027/ 2/15 |
| INTERPUBLIC GROUP COS    | 普通社債券 | 3.75  | 25   | 25    | 2,824  | 2021/10/ 1 |
| INTERPUBLIC GROUP COS    | 普通社債券 | 4.65  | 25   | 25    | 2,833  | 2028/10/ 1 |
| INTERSTATE POWER & LIGHT | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 98    | 11,060 | 2024/12/ 1 |
| INTL FLAVOR & FRAGRANCES | 普通社債券 | 4.45  | 45   | 46    | 5,155  | 2028/ 9/26 |
| INTL PAPER CO            | 普通社債券 | 7.5   | 204  | 223   | 25,064 | 2021/ 8/15 |
| INVESCO FINANCE PLC      | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 147   | 16,544 | 2026/ 1/15 |
| ITC HOLDINGS CORP        | 普通社債券 | 3.65  | 25   | 24    | 2,781  | 2024/ 6/15 |
| ITC HOLDINGS CORP        | 普通社債券 | 3.25  | 60   | 57    | 6,452  | 2026/ 6/30 |
| JABIL CIRCUIT INC        | 普通社債券 | 5.625 | 200  | 205   | 23,035 | 2020/12/15 |
| JB HUNT TRANSPORT SVCS   | 普通社債券 | 3.875 | 100  | 99    | 11,171 | 2026/ 3/ 1 |
| JEFFERIES GROUP          | 普通社債券 | 4.85  | 90   | 87    | 9,799  | 2027/ 1/15 |
| JM SMUCKER CO            | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 97    | 10,958 | 2025/ 3/15 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.05  | 150  | 148   | 16,665 | 2020/ 3/10 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 1.95  | 20   | 19    | 2,214  | 2020/ 6/22 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.35  | 50   | 49    | 5,546  | 2021/ 1/ 8 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 99    | 11,183 | 2021/ 3/ 4 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 3.15  | 200  | 200   | 22,491 | 2021/10/15 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 99    | 11,093 | 2022/ 1/ 6 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 3.2   | 70   | 70    | 7,903  | 2022/ 1/10 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.15  | 100  | 97    | 10,908 | 2022/ 9/ 8 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.7   | 50   | 49    | 5,544  | 2023/ 1/ 6 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 99    | 11,128 | 2023/ 3/ 6 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 3.45  | 50   | 50    | 5,671  | 2023/ 6/ 7 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 3.35  | 150  | 151   | 16,921 | 2024/ 6/12 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.65  | 50   | 48    | 5,451  | 2024/ 6/24 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 95    | 10,686 | 2027/ 9/ 8 |
| JOHN DEERE CAPITAL CORP  | 普通社債券 | 3.05  | 50   | 48    | 5,433  | 2028/ 1/ 6 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 1.65  | 100  | 97    | 10,956 | 2021/ 3/ 1 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 98    | 11,031 | 2022/ 3/ 3 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 2.05  | 100  | 97    | 10,898 | 2023/ 3/ 1 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 95    | 10,682 | 2026/ 3/ 1 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 97    | 10,953 | 2027/ 3/ 3 |
| JOHNSON & JOHNSON        | 普通社債券 | 2.9   | 250  | 242   | 27,093 | 2028/ 1/15 |
| JOHNSON CONTROLS INC     | 普通社債券 | 5.0   | 100  | 101   | 11,378 | 2020/ 3/30 |
| JOHNSON CONTROLS INC     | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 201   | 22,563 | 2021/12/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.875 | 400  | 404   | 45,313 | 2024/ 9/10 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.95  | 200  | 204   | 22,844 | 2020/ 3/25 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.4   | 250  | 254   | 28,489 | 2020/ 7/22 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.55  | 505  | 501   | 56,079 | 2020/10/29 |

| 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     |            |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.55  | 250  | 247   | 27,729 | 2021/ 3/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.4   | 150  | 147   | 16,546 | 2021/ 6/ 7 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.295 | 600  | 589   | 66,026 | 2021/ 8/15 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.25  | 500  | 502   | 56,283 | 2022/ 9/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.972 | 300  | 298   | 33,360 | 2023/ 1/15 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.2   | 500  | 500   | 55,981 | 2023/ 1/25 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.776 | 113  | 111   | 12,484 | 2022/ 4/25 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.375 | 250  | 249   | 27,973 | 2023/ 5/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.7   | 250  | 245   | 27,431 | 2023/ 5/18 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.559 | 150  | 150   | 16,874 | 2023/ 4/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.797 | 200  | 203   | 22,720 | 2023/ 7/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.023 | 300  | 307   | 34,462 | 2023/12/ 5 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.125 | 250  | 245   | 27,463 | 2025/ 1/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 153   | 17,197 | 2025/ 7/15 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.3   | 200  | 196   | 21,941 | 2026/ 4/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.2   | 200  | 195   | 21,849 | 2026/ 6/15 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 2.95  | 200  | 191   | 21,395 | 2026/10/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.125 | 250  | 253   | 28,369 | 2026/12/15 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.25  | 400  | 405   | 45,416 | 2027/10/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.782 | 300  | 299   | 33,486 | 2027/ 2/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.54  | 150  | 147   | 16,517 | 2027/ 5/ 1 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 3.509 | 250  | 243   | 27,262 | 2028/ 1/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.005 | 100  | 101   | 11,309 | 2028/ 4/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.203 | 200  | 205   | 22,977 | 2028/ 7/23 |
| JPMORGAN CHASE & CO      | 普通社債券 | 4.452 | 300  | 314   | 35,142 | 2028/12/ 5 |
| JUNIPER NETWORKS INC     | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 51    | 5,748  | 2024/ 3/15 |
| KAISER FOUNDATION HOSPIT | 普通社債券 | 3.15  | 50   | 48    | 5,476  | 2027/ 5/ 1 |
| KANSAS CITY POWER & LT   | 普通社債券 | 3.15  | 79   | 77    | 8,696  | 2023/ 3/15 |
| KELLOGG CO               | 普通社債券 | 4.0   | 132  | 134   | 15,006 | 2020/12/15 |
| KELLOGG CO               | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 143   | 16,026 | 2026/ 4/ 1 |
| KELLOGG CO               | 普通社債券 | 4.3   | 100  | 100   | 11,280 | 2028/ 5/15 |
| KEMPER CORP              | 普通社債券 | 4.35  | 35   | 34    | 3,895  | 2025/ 2/15 |
| KEY BANK NA              | 普通社債券 | 2.25  | 250  | 248   | 27,793 | 2020/ 3/16 |
| KEY BANK NA              | 普通社債券 | 2.3   | 300  | 291   | 32,632 | 2022/ 9/14 |
| KEY BANK NA              | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 193   | 21,629 | 2026/ 5/20 |
| KEYCORP                  | 普通社債券 | 2.9   | 120  | 119   | 13,426 | 2020/ 9/15 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES    | 普通社債券 | 4.6   | 60   | 60    | 6,737  | 2027/ 4/ 6 |
| KILROY REALTY LP         | 普通社債券 | 4.375 | 100  | 101   | 11,336 | 2025/10/ 1 |
| KIMBERLY CLARK CORP      | 普通社債券 | 2.75  | 150  | 144   | 16,163 | 2026/ 2/15 |
| KIMCO REALTY CORP        | 普通社債券 | 2.7   | 50   | 47    | 5,332  | 2024/ 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     |            |
| KIMCO REALTY CORP          | 普通社債券 | 3.3   | 80   | 77    | 8,705  | 2025/ 2/ 1 |
| KIMCO REALTY CORP          | 普通社債券 | 2.8   | 200  | 184   | 20,630 | 2026/10/ 1 |
| KINDER MORGAN ENER PART    | 普通社債券 | 3.5   | 40   | 40    | 4,505  | 2021/ 3/ 1 |
| KINDER MORGAN ENER PART    | 普通社債券 | 4.15  | 100  | 102   | 11,431 | 2022/ 3/ 1 |
| KINDER MORGAN ENER PART    | 普通社債券 | 3.95  | 250  | 254   | 28,480 | 2022/ 9/ 1 |
| KINDER MORGAN INC/DELAWA   | 普通社債券 | 4.3   | 450  | 460   | 51,534 | 2025/ 6/ 1 |
| KINROSS GOLD CORP          | 普通社債券 | 5.125 | 100  | 102   | 11,459 | 2021/ 9/ 1 |
| KINROSS GOLD CORP          | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 93    | 10,491 | 2027/ 7/15 |
| KITE REALTY GROUP LP       | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 44    | 5,015  | 2026/10/ 1 |
| KLA-TENCOR CORP            | 普通社債券 | 4.125 | 229  | 233   | 26,114 | 2021/11/ 1 |
| KOHL'S CORP                | 普通社債券 | 4.25  | 200  | 196   | 22,027 | 2025/ 7/17 |
| KRAFT FOODS GROUP INC      | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 99    | 11,170 | 2022/ 6/ 6 |
| KRAFT HEINZ FOODS CO       | 普通社債券 | 3.375 | 25   | 24    | 2,792  | 2021/ 6/15 |
| KRAFT HEINZ FOODS CO       | 普通社債券 | 4.0   | 300  | 302   | 33,907 | 2023/ 6/15 |
| KRAFT HEINZ FOODS CO       | 普通社債券 | 4.625 | 200  | 200   | 22,446 | 2029/ 1/30 |
| KROGER CO                  | 普通社債券 | 2.6   | 50   | 49    | 5,554  | 2021/ 2/ 1 |
| KROGER CO                  | 普通社債券 | 2.8   | 100  | 98    | 10,996 | 2022/ 8/ 1 |
| KROGER CO                  | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,338 | 2024/ 2/ 1 |
| KROGER CO                  | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 145   | 16,292 | 2026/ 2/ 1 |
| KROGER CO/THE              | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 100   | 11,214 | 2022/ 4/15 |
| L-3 COMMUNICATIONS CORP    | 普通社債券 | 4.95  | 200  | 205   | 22,957 | 2021/ 2/15 |
| L-3 TECHNOLOGIES INC       | 普通社債券 | 3.85  | 70   | 70    | 7,945  | 2023/ 6/15 |
| L-3 TECHNOLOGIES INC       | 普通社債券 | 4.4   | 100  | 102   | 11,504 | 2028/ 6/15 |
| LABORATORY CORP OF AMERICA | 普通社債券 | 3.6   | 150  | 144   | 16,214 | 2027/ 9/ 1 |
| LABORATORY CORP OF AMERICA | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 99    | 11,146 | 2022/ 2/ 1 |
| LABORATORY CORP OF AMERICA | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 50    | 5,633  | 2023/11/ 1 |
| LAM RESEARCH CORP          | 普通社債券 | 2.75  | 150  | 149   | 16,759 | 2020/ 3/15 |
| LAM RESEARCH CORP          | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 100   | 11,198 | 2026/ 3/15 |
| LAM RESEARCH CORP          | 普通社債券 | 4.0   | 55   | 54    | 6,123  | 2029/ 3/15 |
| LAZARD GROUP LLC           | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 95    | 10,711 | 2027/ 3/ 1 |
| LAZARD GROUP LLC           | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 50    | 5,663  | 2028/ 9/19 |
| LEAR CORP                  | 普通社債券 | 5.25  | 120  | 123   | 13,776 | 2025/ 1/15 |
| LEGGETT & PLATT INC        | 普通社債券 | 3.4   | 50   | 49    | 5,519  | 2022/ 8/15 |
| LEGGETT & PLATT INC        | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 46    | 5,254  | 2027/11/15 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP     | 普通社債券 | 5.5   | 330  | 343   | 38,445 | 2023/10/18 |
| LIBERTY PROPERTY LP        | 普通社債券 | 4.4   | 150  | 154   | 17,339 | 2024/ 2/15 |
| LINCOLN NATIONAL CORP      | 普通社債券 | 3.35  | 150  | 146   | 16,431 | 2025/ 3/ 9 |
| LINCOLN NATIONAL CORP      | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 97    | 10,963 | 2026/12/12 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC   | 普通社債券 | 2.7   | 200  | 199   | 22,301 | 2020/ 8/17 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC   | 普通社債券 | 3.0   | 245  | 242   | 27,094 | 2022/ 1/11 |

| 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     |            |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 4.582 | 200  | 198   | 22,263 | 2025/12/10 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 2.907 | 200  | 194   | 21,713 | 2022/11/ 7 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 4.45  | 200  | 204   | 22,900 | 2025/ 5/ 8 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 4.65  | 200  | 197   | 22,151 | 2026/ 3/24 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 4.55  | 200  | 203   | 22,813 | 2028/ 8/16 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 普通社債券 | 3.574 | 200  | 188   | 21,135 | 2027/11/ 7 |
| LLOYDS TSB BANK PLC      | 普通社債券 | 6.375 | 100  | 105   | 11,831 | 2021/ 1/21 |
| LOCKHEED MARTIN CORP     | 普通社債券 | 3.55  | 250  | 253   | 28,391 | 2026/ 1/15 |
| LOCKHEED MARTIN CORP     | 普通社債券 | 3.35  | 200  | 202   | 22,635 | 2021/ 9/15 |
| LOEWS CORP               | 普通社債券 | 2.625 | 150  | 146   | 16,429 | 2023/ 5/15 |
| LOWE'S COS INC           | 普通社債券 | 4.625 | 250  | 252   | 28,276 | 2020/ 4/15 |
| LOWE'S COS INC           | 普通社債券 | 3.12  | 200  | 199   | 22,329 | 2022/ 4/15 |
| LOWE'S COS INC           | 普通社債券 | 2.5   | 200  | 183   | 20,536 | 2026/ 4/15 |
| LYB INTL FINANCE BV      | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 140   | 15,753 | 2027/ 3/ 2 |
| LYB INTL FINANCE BV      | 普通社債券 | 4.0   | 60   | 60    | 6,772  | 2023/ 7/15 |
| LYONDELLBASELL IND NV    | 普通社債券 | 6.0   | 300  | 317   | 35,545 | 2021/11/15 |
| MACYS RETAIL HLDGS INC   | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 93    | 10,474 | 2023/ 2/15 |
| MACYS RETAIL HLDGS INC   | 普通社債券 | 4.375 | 60   | 59    | 6,603  | 2023/ 9/ 1 |
| MACYS RETAIL HLDGS INC   | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 94    | 10,537 | 2024/ 6/ 1 |
| MAGELLAN MISDTREAM PARTN | 普通社債券 | 5.0   | 50   | 53    | 5,966  | 2026/ 3/ 1 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC  | 普通社債券 | 4.15  | 50   | 51    | 5,753  | 2025/10/ 1 |
| MANUF & TRADERS TRUST CO | 普通社債券 | 2.625 | 250  | 248   | 27,817 | 2021/ 1/25 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP  | 普通社債券 | 4.15  | 100  | 103   | 11,585 | 2026/ 3/ 4 |
| MAPLE ESCROW SUB         | 普通社債券 | 3.551 | 150  | 150   | 16,871 | 2021/ 5/25 |
| MAPLE ESCROW SUB         | 普通社債券 | 4.057 | 200  | 202   | 22,631 | 2023/ 5/25 |
| MAPLE ESCROW SUB         | 普通社債券 | 4.597 | 250  | 252   | 28,311 | 2028/ 5/25 |
| MARATHON OIL CORP        | 普通社債券 | 2.8   | 150  | 146   | 16,343 | 2022/11/ 1 |
| MARATHON OIL CORP        | 普通社債券 | 4.4   | 150  | 151   | 16,930 | 2027/ 7/15 |
| MARATHON PETROLEUM CORP  | 普通社債券 | 3.4   | 150  | 150   | 16,866 | 2020/12/15 |
| MARATHON PETROLEUM CORP  | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 103   | 11,636 | 2023/12/15 |
| MARATHON PETROLEUM CORP  | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 99    | 11,104 | 2024/ 9/15 |
| MARATHON PETROLEUM CORP  | 普通社債券 | 5.125 | 100  | 104   | 11,743 | 2026/12/15 |
| MARATHON PETROLEUM CORP  | 普通社債券 | 3.8   | 30   | 29    | 3,256  | 2028/ 4/ 1 |
| MARKEL CORPORATION       | 普通社債券 | 4.9   | 70   | 72    | 8,111  | 2022/ 7/ 1 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 99    | 11,127 | 2021/10/15 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,089 | 2022/ 9/15 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 99    | 11,086 | 2025/ 3/15 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 94    | 10,559 | 2026/ 6/15 |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 普通社債券 | 2.75  | 30   | 29    | 3,320  | 2022/ 1/30 |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 普通社債券 | 2.35  | 100  | 99    | 11,137 | 2020/ 3/ 6 |

| 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     |            |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 普通社債券 | 4.8   | 100  | 103   | 11,566 | 2021/ 7/15 |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 普通社債券 | 3.875 | 150  | 153   | 17,158 | 2024/ 3/15 |
| MARTIN MARIETTA MATERIAL | 普通社債券 | 4.25  | 30   | 30    | 3,407  | 2024/ 7/ 2 |
| MARTIN MARIETTA MATERIAL | 普通社債券 | 3.45  | 21   | 19    | 2,185  | 2027/ 6/ 1 |
| MARTIN MARIETTA MATERIAL | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 46    | 5,250  | 2027/12/15 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 普通社債券 | 4.2   | 100  | 100   | 11,231 | 2023/ 6/22 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 普通社債券 | 4.875 | 100  | 100   | 11,257 | 2028/ 6/22 |
| MASCO CORP               | 普通社債券 | 3.5   | 115  | 115   | 12,879 | 2021/ 4/ 1 |
| MASCO CORP               | 普通社債券 | 4.375 | 90   | 90    | 10,083 | 2026/ 4/ 1 |
| MASTERCARD INC           | 普通社債券 | 3.375 | 200  | 204   | 22,838 | 2024/ 4/ 1 |
| MASTERCARD INC           | 普通社債券 | 3.5   | 30   | 30    | 3,411  | 2028/ 2/26 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCT | 普通社債券 | 3.45  | 100  | 93    | 10,460 | 2027/ 6/15 |
| MCCORMICK & CO           | 普通社債券 | 2.7   | 50   | 48    | 5,474  | 2022/ 8/15 |
| MCCORMICK & CO           | 普通社債券 | 3.15  | 50   | 48    | 5,444  | 2024/ 8/15 |
| MCCORMICK & CO           | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 95    | 10,721 | 2027/ 8/15 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 148   | 16,588 | 2027/ 3/ 1 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 199   | 22,356 | 2020/12/ 9 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 2.625 | 100  | 99    | 11,097 | 2022/ 1/15 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,158 | 2024/ 6/10 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 3.35  | 105  | 105   | 11,849 | 2023/ 4/ 1 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 100   | 11,293 | 2026/ 1/30 |
| MCDONALD'S CORP          | 普通社債券 | 3.8   | 150  | 149   | 16,776 | 2028/ 4/ 1 |
| MCKESSON CORP            | 普通社債券 | 3.796 | 100  | 100   | 11,285 | 2024/ 3/15 |
| MCKESSON CORP            | 普通社債券 | 4.75  | 200  | 205   | 23,005 | 2029/ 5/30 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION C | 普通社債券 | 3.0   | 60   | 59    | 6,708  | 2020/11/15 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION C | 普通社債券 | 4.125 | 60   | 62    | 7,006  | 2025/11/15 |
| MEDTRONIC INC            | 普通社債券 | 2.5   | 200  | 200   | 22,382 | 2020/ 3/15 |
| MEDTRONIC INC            | 普通社債券 | 3.15  | 200  | 201   | 22,537 | 2022/ 3/15 |
| MEDTRONIC INC            | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 198   | 22,167 | 2023/ 4/ 1 |
| MEDTRONIC INC            | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 102   | 11,458 | 2024/ 3/15 |
| MEDTRONIC INC            | 普通社債券 | 3.5   | 450  | 457   | 51,199 | 2025/ 3/15 |
| MERCK & CO INC           | 普通社債券 | 3.875 | 250  | 254   | 28,479 | 2021/ 1/15 |
| MERCK & CO INC           | 普通社債券 | 2.4   | 300  | 295   | 33,043 | 2022/ 9/15 |
| MERCK & CO INC           | 普通社債券 | 2.8   | 200  | 199   | 22,290 | 2023/ 5/18 |
| MERCK & CO INC           | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 98    | 10,972 | 2025/ 2/10 |
| MERCY HEALTHCARE SYSTEM  | 普通社債券 | 4.302 | 15   | 15    | 1,727  | 2028/ 7/ 1 |
| METLIFE INC              | 普通社債券 | 4.75  | 155  | 159   | 17,878 | 2021/ 2/ 8 |
| METLIFE INC              | 普通社債券 | 4.368 | 100  | 105   | 11,761 | 2023/ 9/15 |
| MICRON TECHNOLOGY INC    | 普通社債券 | 5.327 | 150  | 149   | 16,766 | 2029/ 2/ 6 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 100   | 11,251 | 2020/10/ 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     |            |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 1.55  | 200  | 194   | 21,792 | 2021/ 8/ 8 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.4   | 200  | 198   | 22,202 | 2022/ 2/ 6 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.375 | 250  | 247   | 27,745 | 2022/ 2/12 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.65  | 350  | 348   | 39,027 | 2022/11/ 3 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.0   | 100  | 96    | 10,826 | 2023/ 8/ 8 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 155   | 17,391 | 2023/12/15 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.875 | 185  | 184   | 20,687 | 2024/ 2/ 6 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.7   | 250  | 246   | 27,572 | 2025/ 2/12 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 3.125 | 250  | 251   | 28,157 | 2025/11/ 3 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 2.4   | 300  | 285   | 31,945 | 2026/ 8/ 8 |
| MICROSOFT CORP           | 普通社債券 | 3.3   | 300  | 302   | 33,801 | 2027/ 2/ 6 |
| MID-AMERICA APARTMENTS   | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,349 | 2025/11/15 |
| MID-AMERICA APARTMENTS   | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 99    | 11,105 | 2029/ 3/15 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 3.535 | 200  | 201   | 22,552 | 2021/ 7/26 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 3.218 | 250  | 249   | 27,950 | 2022/ 3/ 7 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 2.665 | 200  | 195   | 21,906 | 2022/ 7/25 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 3.455 | 100  | 100   | 11,208 | 2023/ 3/ 2 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 3.287 | 100  | 97    | 10,899 | 2027/ 7/25 |
| MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 普通社債券 | 4.05  | 200  | 206   | 23,111 | 2028/ 9/11 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 2.95  | 200  | 198   | 22,269 | 2021/ 3/ 1 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 2.527 | 200  | 192   | 21,533 | 2023/ 9/13 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 3.777 | 100  | 101   | 11,341 | 2025/ 3/ 2 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 3.85  | 200  | 202   | 22,703 | 2026/ 3/ 1 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 2.757 | 200  | 187   | 21,029 | 2026/ 9/13 |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL | 普通社債券 | 3.961 | 100  | 102   | 11,432 | 2028/ 3/ 2 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP   | 普通社債券 | 3.549 | 200  | 200   | 22,459 | 2023/ 3/ 5 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP   | 普通社債券 | 3.663 | 200  | 200   | 22,467 | 2027/ 2/28 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP   | 普通社債券 | 4.018 | 200  | 205   | 22,943 | 2028/ 3/ 5 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP   | 普通社債券 | 2.273 | 200  | 195   | 21,827 | 2021/ 9/13 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC    | 普通社債券 | 3.85  | 150  | 151   | 16,936 | 2023/ 2/ 1 |
| MOLSON COORS BREWING CO  | 普通社債券 | 2.1   | 65   | 63    | 7,083  | 2021/ 7/15 |
| MOLSON COORS BREWING CO  | 普通社債券 | 3.0   | 165  | 152   | 17,045 | 2026/ 7/15 |
| MOLSON COORS BREWING CO  | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 99    | 11,091 | 2020/ 3/15 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 99    | 11,189 | 2020/ 5/ 7 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,409 | 2024/ 2/ 1 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL   | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 98    | 11,025 | 2026/ 2/13 |
| MOODY'S CORPORATION      | 普通社債券 | 5.5   | 100  | 103   | 11,560 | 2020/ 9/ 1 |
| MOODY'S CORPORATION      | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,180 | 2021/ 6/ 7 |
| MOODY'S CORPORATION      | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 49    | 5,530  | 2021/12/15 |
| MORGAN STANLEY           | 普通社債券 | 5.5   | 250  | 258   | 28,889 | 2020/ 7/24 |

| 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 | 5.75  | 350  | 366   | 41,046 | 2021/ 1/25 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 2.5   | 500  | 494   | 55,286 | 2021/ 4/21 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 2.625 | 200  | 197   | 22,102 | 2021/11/17 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 246   | 27,551 | 2022/ 5/19 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.125 | 250  | 248   | 27,771 | 2023/ 1/23 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 202   | 22,700 | 2023/ 2/25 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 4.1   | 300  | 305   | 34,236 | 2023/ 5/22 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.737 | 370  | 373   | 41,815 | 2023/ 4/24 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.7   | 450  | 452   | 50,629 | 2024/10/23 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 4.0   | 435  | 442   | 49,499 | 2025/ 7/23 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.875 | 200  | 200   | 22,486 | 2026/ 1/27 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.125 | 450  | 429   | 48,059 | 2026/ 7/27 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 4.35  | 250  | 251   | 28,176 | 2026/ 9/ 8 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.625 | 350  | 343   | 38,385 | 2027/ 1/20 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.591 | 200  | 194   | 21,796 | 2027/ 7/22 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 3.772 | 250  | 246   | 27,603 | 2028/ 1/24 |
| MORGAN STANLEY              | 普通社債券 | 4.431 | 300  | 309   | 34,640 | 2029/ 1/23 |
| MOSAIC CO                   | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,086 | 2022/11/15 |
| MOSAIC CO                   | 普通社債券 | 4.25  | 100  | 102   | 11,510 | 2023/11/15 |
| MOSAIC CO                   | 普通社債券 | 4.05  | 100  | 97    | 10,933 | 2027/11/15 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC      | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 197   | 22,156 | 2023/ 3/ 1 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC      | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 99    | 11,179 | 2024/ 9/ 1 |
| MPLX LP                     | 普通社債券 | 3.375 | 50   | 49    | 5,543  | 2023/ 3/15 |
| MPLX LP                     | 普通社債券 | 4.875 | 250  | 260   | 29,125 | 2025/ 6/ 1 |
| MPLX LP                     | 普通社債券 | 4.125 | 200  | 196   | 21,982 | 2027/ 3/ 1 |
| MYLAN NV                    | 普通社債券 | 3.15  | 150  | 148   | 16,590 | 2021/ 6/15 |
| MYLAN NV                    | 普通社債券 | 3.95  | 250  | 236   | 26,510 | 2026/ 6/15 |
| MYLAN NV                    | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 200   | 22,471 | 2020/12/15 |
| NASDAQ                      | 普通社債券 | 3.85  | 30   | 29    | 3,289  | 2026/ 6/30 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 普通社債券 | 2.625 | 250  | 248   | 27,853 | 2020/ 7/23 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 普通社債券 | 2.8   | 250  | 247   | 27,701 | 2022/ 1/10 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 231   | 25,948 | 2026/ 7/12 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 普通社債券 | 2.125 | 250  | 247   | 27,706 | 2020/ 5/22 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 普通社債券 | 3.375 | 200  | 200   | 22,469 | 2021/ 9/20 |
| NATIONAL FUEL GAS CO        | 普通社債券 | 5.2   | 150  | 153   | 17,201 | 2025/ 7/15 |
| NATIONAL FUEL GAS CO        | 普通社債券 | 3.95  | 50   | 46    | 5,201  | 2027/ 9/15 |
| NATIONAL FUEL GAS CO        | 普通社債券 | 4.75  | 50   | 49    | 5,527  | 2028/ 9/ 1 |
| NATIONAL OILWELL VARCO I    | 普通社債券 | 2.6   | 150  | 145   | 16,261 | 2022/12/ 1 |
| NATIONAL RETAIL PROP INC    | 普通社債券 | 4.3   | 65   | 66    | 7,395  | 2028/10/15 |
| NATIONAL RETAIL PROPRTI     | 普通社債券 | 4.0   | 65   | 65    | 7,290  | 2025/11/15 |

| 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     |            |
| NATIONAL RURAL UTILITIES | 普通社債券 | 2.3   | 70   | 68    | 7,620  | 2022/ 9/15 |
| NATIONAL RURAL UTILITIES | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 197   | 22,145 | 2028/ 2/ 7 |
| NATIONAL RURAL UTILITIES | 普通社債券 | 5.25  | 150  | 147   | 16,452 | 2026/ 4/20 |
| NATL RETAIL PROPERTIES   | 普通社債券 | 3.8   | 100  | 100   | 11,298 | 2022/10/15 |
| NBCUNIVERSAL MEDIA LLC   | 普通社債券 | 4.375 | 250  | 256   | 28,748 | 2021/ 4/ 1 |
| NBCUNIVERSAL MEDIA LLC   | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 99    | 11,082 | 2023/ 1/15 |
| NETAPP INC               | 普通社債券 | 3.375 | 200  | 200   | 22,414 | 2021/ 6/15 |
| NEWELL RUBBERMAID INC    | 普通社債券 | 3.85  | 40   | 39    | 4,366  | 2023/ 4/ 1 |
| NEWELL RUBBERMAID INC    | 普通社債券 | 4.2   | 250  | 235   | 26,381 | 2026/ 4/ 1 |
| NEWMONT MINING CORP      | 普通社債券 | 3.5   | 300  | 301   | 33,706 | 2022/ 3/15 |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL   | 普通社債券 | 2.8   | 50   | 48    | 5,460  | 2023/ 1/15 |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL   | 普通社債券 | 3.55  | 150  | 146   | 16,401 | 2027/ 5/ 1 |
| NIKE INC                 | 普通社債券 | 2.25  | 50   | 49    | 5,505  | 2023/ 5/ 1 |
| NIKE INC                 | 普通社債券 | 2.375 | 100  | 94    | 10,590 | 2026/11/ 1 |
| NISOURCE FINANCE CORP    | 普通社債券 | 2.65  | 20   | 19    | 2,170  | 2022/11/17 |
| NISOURCE FINANCE CORP    | 普通社債券 | 3.49  | 100  | 97    | 10,855 | 2027/ 5/15 |
| NISOURCE INC             | 普通社債券 | 3.65  | 50   | 50    | 5,648  | 2023/ 6/15 |
| NOBLE ENERGY INC         | 普通社債券 | 4.15  | 100  | 101   | 11,398 | 2021/12/15 |
| NOBLE ENERGY INC         | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 148   | 16,589 | 2024/11/15 |
| NORDSTROM INC            | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 101   | 11,402 | 2020/ 5/ 1 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP    | 普通社債券 | 2.9   | 65   | 62    | 6,969  | 2026/ 6/15 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP    | 普通社債券 | 2.903 | 200  | 197   | 22,128 | 2023/ 2/15 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP    | 普通社債券 | 3.15  | 75   | 72    | 8,076  | 2027/ 6/ 1 |
| NORTHERN TRUST CORP      | 普通社債券 | 3.375 | 50   | 50    | 5,649  | 2021/ 8/23 |
| NORTHERN TRUST CORP      | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 103   | 11,611 | 2025/10/30 |
| NORTHERN TRUST CORP      | 普通社債券 | 3.65  | 50   | 51    | 5,716  | 2028/ 8/ 3 |
| NORTHERN TRUST CORP      | 普通社債券 | 3.375 | 62   | 59    | 6,609  | 2027/ 5/ 8 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP    | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 202   | 22,622 | 2021/ 3/15 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP    | 普通社債券 | 2.55  | 150  | 147   | 16,488 | 2022/10/15 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP    | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 150   | 16,817 | 2023/ 8/ 1 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP    | 普通社債券 | 2.93  | 200  | 194   | 21,734 | 2025/ 1/15 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP    | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 191   | 21,432 | 2028/ 1/15 |
| NOVARTIS CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 2.4   | 150  | 148   | 16,582 | 2022/ 5/17 |
| NOVARTIS CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 3.4   | 350  | 358   | 40,162 | 2024/ 5/ 6 |
| NSTAR ELECTRIC CO        | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 48    | 5,467  | 2027/ 5/15 |
| NUCOR CORP               | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 154   | 17,276 | 2023/ 8/ 1 |
| NUTRIEN LTD              | 普通社債券 | 3.15  | 150  | 147   | 16,469 | 2022/10/ 1 |
| NUTRIEN LTD              | 普通社債券 | 3.375 | 50   | 47    | 5,351  | 2025/ 3/15 |
| NUTRIEN LTD              | 普通社債券 | 3.0   | 200  | 187   | 20,972 | 2025/ 4/ 1 |
| NVIDIA CORP              | 普通社債券 | 2.2   | 30   | 29    | 3,297  | 2021/ 9/16 |

| 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     |            |
| NVIDIA CORP              | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 48    | 5,455  | 2026/ 9/16 |
| NXP BV/NXP FUNDING LLC   | 普通社債券 | 4.875 | 250  | 257   | 28,780 | 2024/ 3/ 1 |
| NXP BV/NXP FUNDING LLC   | 普通社債券 | 5.55  | 100  | 105   | 11,803 | 2028/12/ 1 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC  | 普通社債券 | 4.625 | 100  | 103   | 11,563 | 2021/ 9/15 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC  | 普通社債券 | 4.35  | 150  | 153   | 17,148 | 2028/ 6/ 1 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 普通社債券 | 4.1   | 200  | 204   | 22,888 | 2021/ 2/ 1 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 151   | 16,966 | 2025/ 6/15 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 普通社債券 | 3.4   | 145  | 145   | 16,251 | 2026/ 4/15 |
| OLD REPUBLIC INTERNATION | 普通社債券 | 3.875 | 100  | 95    | 10,736 | 2026/ 8/26 |
| OMEGA HLTHCARE INVESTORS | 普通社債券 | 4.375 | 50   | 50    | 5,624  | 2023/ 8/ 1 |
| OMEGA HLTHCARE INVESTORS | 普通社債券 | 4.95  | 100  | 101   | 11,388 | 2024/ 4/ 1 |
| OMEGA HLTHCARE INVESTORS | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 49    | 5,564  | 2025/ 1/15 |
| OMEGA HLTHCARE INVESTORS | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 98    | 10,990 | 2027/ 4/ 1 |
| OMNICOM GROUP INC        | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 151   | 16,914 | 2022/ 5/ 1 |
| OMNICOM GROUP INC        | 普通社債券 | 3.6   | 250  | 241   | 27,013 | 2026/ 4/15 |
| ONCOR ELECTRIC DELIVERY  | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 97    | 10,963 | 2025/ 4/ 1 |
| ONCOR ELECTRIC DELIVERY  | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 101   | 11,325 | 2028/11/15 |
| ONEOK INC                | 普通社債券 | 4.0   | 85   | 83    | 9,338  | 2027/ 7/13 |
| ONEOK INC                | 普通社債券 | 4.55  | 150  | 152   | 17,036 | 2028/ 7/15 |
| ONEOK PARTNERS LP        | 普通社債券 | 3.375 | 200  | 200   | 22,385 | 2022/10/ 1 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.8   | 150  | 150   | 16,787 | 2021/ 7/ 8 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 1.9   | 350  | 342   | 38,297 | 2021/ 9/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.5   | 300  | 296   | 33,143 | 2022/ 5/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 246   | 27,543 | 2022/10/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.625 | 105  | 103   | 11,602 | 2023/ 2/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 153   | 17,211 | 2023/ 7/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.95  | 200  | 197   | 22,129 | 2024/11/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.95  | 300  | 294   | 32,961 | 2025/ 5/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 2.65  | 250  | 237   | 26,619 | 2026/ 7/15 |
| ORACLE CORP              | 普通社債券 | 3.25  | 250  | 246   | 27,605 | 2027/11/15 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC  | 普通社債券 | 3.55  | 50   | 48    | 5,453  | 2026/ 3/15 |
| ORIX CORP                | 普通社債券 | 2.9   | 30   | 29    | 3,303  | 2022/ 7/18 |
| ORIX CORP                | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 97    | 10,946 | 2024/12/ 4 |
| ORIX CORP                | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 49    | 5,504  | 2027/ 7/18 |
| OWENS CORNING            | 普通社債券 | 4.2   | 150  | 151   | 16,948 | 2022/12/15 |
| PACCAR FINANCIAL CORP    | 普通社債券 | 2.05  | 100  | 98    | 11,036 | 2020/11/13 |
| PACCAR FINANCIAL CORP    | 普通社債券 | 3.4   | 50   | 50    | 5,598  | 2023/ 8/ 9 |
| PACIFICORP               | 普通社債券 | 3.85  | 300  | 305   | 34,170 | 2021/ 6/15 |
| PACKAGING CORP OF AMERIC | 普通社債券 | 2.45  | 35   | 34    | 3,869  | 2020/12/15 |
| PACKAGING CORP OF AMERIC | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 198   | 22,213 | 2024/ 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     |            |
| PACKAGING CORP OF AMERIC | 普通社債券 | 3.4   | 35   | 33    | 3,714  | 2027/12/15 |
| PARKER-HANNIFIN CORP     | 普通社債券 | 3.3   | 150  | 148   | 16,665 | 2024/11/21 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 1.85  | 100  | 99    | 11,090 | 2020/ 4/30 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 2.15  | 150  | 148   | 16,631 | 2020/10/14 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 2.0   | 100  | 98    | 11,042 | 2021/ 4/15 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 3.0   | 300  | 301   | 33,763 | 2021/ 8/25 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 1.7   | 100  | 97    | 10,894 | 2021/10/ 6 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 103   | 11,567 | 2024/ 3/ 1 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 245   | 27,522 | 2025/ 4/30 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 2.85  | 100  | 96    | 10,842 | 2026/ 2/24 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 2.375 | 55   | 51    | 5,769  | 2026/10/ 6 |
| PEPSICO INC              | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 97    | 10,908 | 2027/10/15 |
| PERRIGO FINANCE UNLIMITE | 普通社債券 | 4.375 | 200  | 187   | 21,025 | 2026/ 3/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 1.95  | 100  | 98    | 11,006 | 2021/ 6/ 3 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 96    | 10,817 | 2026/ 6/ 3 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 3.0   | 75   | 75    | 8,450  | 2021/ 9/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 2.2   | 100  | 98    | 11,057 | 2021/12/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 2.8   | 65   | 65    | 7,280  | 2022/ 3/11 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 205   | 22,955 | 2024/ 5/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 146   | 16,370 | 2026/12/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 3.6   | 150  | 152   | 17,024 | 2028/ 9/15 |
| PFIZER INC               | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 199   | 22,359 | 2029/ 3/15 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 4.5   | 300  | 305   | 34,136 | 2020/ 3/26 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 1.875 | 50   | 49    | 5,485  | 2021/ 2/25 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 2.375 | 100  | 97    | 10,922 | 2022/ 8/17 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 244   | 27,360 | 2022/ 8/22 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 97    | 10,961 | 2022/11/ 2 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 2.75  | 50   | 47    | 5,287  | 2026/ 2/25 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 95    | 10,677 | 2027/ 8/17 |
| PHILIP MORRIS INTL INC   | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,095 | 2024/11/10 |
| PHILLIPS 66              | 普通社債券 | 4.3   | 100  | 103   | 11,587 | 2022/ 4/ 1 |
| PHILLIPS 66              | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 149   | 16,687 | 2028/ 3/15 |
| PHILLIPS 66 PARTNERS     | 普通社債券 | 3.55  | 75   | 72    | 8,116  | 2026/10/ 1 |
| PIONEER NATURAL RESOURCE | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 101   | 11,363 | 2022/ 7/15 |
| PIONEER NATURAL RESOURCE | 普通社債券 | 4.45  | 100  | 103   | 11,603 | 2026/ 1/15 |
| PLAINS ALL AMER PIPELINE | 普通社債券 | 5.0   | 100  | 102   | 11,440 | 2021/ 2/ 1 |
| PLAINS ALL AMER PIPELINE | 普通社債券 | 3.6   | 200  | 195   | 21,873 | 2024/11/ 1 |
| PLAINS ALL AMER PIPELINE | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 50    | 5,608  | 2026/12/15 |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 2.45  | 250  | 247   | 27,729 | 2020/11/ 5 |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 2.625 | 250  | 247   | 27,733 | 2022/ 2/17 |



| 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     |            |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 2.7   | 300  | 294   | 32,957 | 2022/11/ 1 |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 253   | 28,373 | 2023/ 6/ 8 |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 3.25  | 250  | 249   | 27,892 | 2025/ 6/ 1 |
| PNC BANK NA              | 普通社債券 | 4.05  | 250  | 258   | 28,878 | 2028/ 7/26 |
| PNC FINANCIAL SERVICES   | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 252   | 28,272 | 2024/ 1/23 |
| PNC FINANCIAL SERVICES   | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 152   | 17,059 | 2024/ 4/29 |
| PPG INDUSTRIES INC       | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 99    | 11,111 | 2023/ 3/15 |
| PPL CAPITAL FUNDING INC  | 普通社債券 | 4.2   | 150  | 152   | 17,086 | 2022/ 6/15 |
| PPL CAPITAL FUNDING INC  | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 100   | 11,250 | 2024/ 3/15 |
| PPL ELECTRIC UTILITIES   | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 150   | 16,788 | 2021/ 9/15 |
| PRAXAIR INC              | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 150   | 16,806 | 2021/ 9/ 1 |
| PRAXAIR INC              | 普通社債券 | 2.2   | 100  | 97    | 10,916 | 2022/ 8/15 |
| PRAXAIR INC              | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 49    | 5,569  | 2026/ 1/30 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 普通社債券 | 2.5   | 200  | 196   | 22,011 | 2023/ 1/15 |
| PRICELINE GROUP          | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 98    | 11,023 | 2026/ 6/ 1 |
| PRICELINE GROUP INC/THE  | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 97    | 10,922 | 2023/ 3/15 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GRO  | 普通社債券 | 4.7   | 100  | 97    | 10,855 | 2020/ 5/15 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE  | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 95    | 10,696 | 2026/11/ 3 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE  | 普通社債券 | 2.15  | 100  | 98    | 10,970 | 2022/ 8/11 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE  | 普通社債券 | 3.1   | 200  | 203   | 22,730 | 2023/ 8/15 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE  | 普通社債券 | 2.85  | 100  | 98    | 11,002 | 2027/ 8/11 |
| PROGRESS ENERGY CAROLINA | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 100   | 11,236 | 2021/ 9/15 |
| PROGRESSIVE CORP         | 普通社債券 | 3.75  | 50   | 50    | 5,671  | 2021/ 8/23 |
| PROLOGIS LP              | 普通社債券 | 4.25  | 100  | 104   | 11,680 | 2023/ 8/15 |
| PROSPECT CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 5.875 | 50   | 50    | 5,622  | 2023/ 3/15 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 普通社債券 | 4.5   | 250  | 259   | 29,012 | 2021/11/16 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 102   | 11,462 | 2024/ 5/15 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 普通社債券 | 5.625 | 250  | 260   | 29,099 | 2023/ 6/15 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 92    | 10,351 | 2027/ 9/15 |
| PSEG                     | 普通社債券 | 2.0   | 100  | 96    | 10,784 | 2021/11/15 |
| PUBLIC SERVICE COLORADO  | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 100   | 11,232 | 2020/11/15 |
| PUBLIC SERVICE COLORADO  | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 50    | 5,701  | 2028/ 6/15 |
| PUBLIC SERVICE ELECTRIC  | 普通社債券 | 3.25  | 50   | 50    | 5,660  | 2023/ 9/ 1 |
| PUBLIC SERVICE ELECTRIC  | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 146   | 16,442 | 2025/ 5/15 |
| PUBLIC SERVICE ELECTRIC  | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 96    | 10,761 | 2027/ 5/15 |
| PUBLIC SERVICE ELECTRIC  | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 101   | 11,340 | 2028/ 5/ 1 |
| PUBLIC STORAGE           | 普通社債券 | 2.37  | 25   | 24    | 2,728  | 2022/ 9/15 |
| PUBLIC STORAGE           | 普通社債券 | 3.094 | 125  | 119   | 13,325 | 2027/ 9/15 |
| PUGET ENERGY INC         | 普通社債券 | 6.0   | 100  | 105   | 11,802 | 2021/ 9/ 1 |
| PUGET ENERGY INC         | 普通社債券 | 5.625 | 100  | 105   | 11,777 | 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     |            |
| QUALCOMM INC           | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 99    | 11,098 | 2020/ 5/20 |
| QUALCOMM INC           | 普通社債券 | 2.6   | 350  | 340   | 38,083 | 2023/ 1/30 |
| QUALCOMM INC           | 普通社債券 | 2.9   | 300  | 290   | 32,477 | 2024/ 5/20 |
| QUALCOMM INC           | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 196   | 21,960 | 2025/ 5/20 |
| QUALCOMM INC           | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 94    | 10,616 | 2027/ 5/20 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC  | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 196   | 22,008 | 2025/ 3/30 |
| QVC INC                | 普通社債券 | 4.85  | 200  | 201   | 22,564 | 2024/ 4/ 1 |
| RABOBANK NEDERLAND     | 普通社債券 | 3.875 | 500  | 511   | 57,193 | 2022/ 2/ 8 |
| RABOBANK NEDERLAND     | 普通社債券 | 4.625 | 250  | 258   | 28,875 | 2023/12/ 1 |
| RALPH LAUREN CORP      | 普通社債券 | 3.75  | 50   | 50    | 5,627  | 2025/ 9/15 |
| RAYNOLDS AMERICAN INC  | 普通社債券 | 4.45  | 200  | 201   | 22,585 | 2025/ 6/12 |
| RAYTHEON COMPANY       | 普通社債券 | 3.125 | 150  | 150   | 16,894 | 2020/10/15 |
| RAYTHEON COMPANY       | 普通社債券 | 2.5   | 100  | 98    | 11,046 | 2022/12/15 |
| REALTY INCOME CORP     | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 201   | 22,524 | 2022/10/15 |
| REALTY INCOME CORP     | 普通社債券 | 3.875 | 150  | 152   | 17,013 | 2024/ 7/15 |
| REALTY INCOME CORP     | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 197   | 22,053 | 2028/ 1/15 |
| REGENCY CENTERS LP     | 普通社債券 | 3.6   | 30   | 29    | 3,262  | 2027/ 2/ 1 |
| REGENCY CENTERS LP     | 普通社債券 | 4.125 | 50   | 50    | 5,605  | 2028/ 3/15 |
| REGIONS BANK           | 普通社債券 | 2.75  | 250  | 247   | 27,691 | 2021/ 4/ 1 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 普通社債券 | 3.2   | 50   | 50    | 5,602  | 2021/ 2/ 8 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 普通社債券 | 3.8   | 100  | 101   | 11,343 | 2023/ 8/14 |
| RELIANCE STEEL & ALUM  | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 101   | 11,353 | 2023/ 4/15 |
| RELX CAPITAL INC       | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 196   | 22,003 | 2022/10/15 |
| RENAISSANCERE FINANCE  | 普通社債券 | 3.45  | 65   | 62    | 6,981  | 2027/ 7/ 1 |
| REPUBLIC SERVICES INC  | 普通社債券 | 3.55  | 150  | 152   | 17,018 | 2022/ 6/ 1 |
| REPUBLIC SERVICES INC  | 普通社債券 | 3.2   | 200  | 196   | 21,991 | 2025/ 3/15 |
| REPUBLIC SERVICES INC  | 普通社債券 | 3.375 | 60   | 58    | 6,584  | 2027/11/15 |
| REPUBLIC SERVICES INC  | 普通社債券 | 3.95  | 100  | 102   | 11,452 | 2028/ 5/15 |
| REYNOLDS AMERICAN INC  | 普通社債券 | 4.0   | 200  | 202   | 22,613 | 2022/ 6/12 |
| REYNOLDS AMERICAN INC  | 普通社債券 | 6.875 | 100  | 104   | 11,644 | 2020/ 5/ 1 |
| REYNOLDS AMERICAN INC  | 普通社債券 | 3.25  | 33   | 32    | 3,689  | 2020/ 6/12 |
| RIO TINTO FIN USA      | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 205   | 23,047 | 2025/ 6/15 |
| ROCK-TENN CO           | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 200   | 22,428 | 2020/ 3/ 1 |
| ROCKWELL AUTOMATION    | 普通社債券 | 2.875 | 150  | 144   | 16,207 | 2025/ 3/ 1 |
| ROCKWELL COLLINS INC   | 普通社債券 | 2.8   | 200  | 197   | 22,048 | 2022/ 3/15 |
| ROCKWELL COLLINS INC   | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 192   | 21,586 | 2027/ 3/15 |
| ROGERS COMMUNICATIONS  | 普通社債券 | 3.625 | 190  | 189   | 21,193 | 2025/12/15 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 普通社債券 | 2.8   | 50   | 49    | 5,520  | 2021/12/15 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 普通社債券 | 3.125 | 150  | 147   | 16,559 | 2022/11/15 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 普通社債券 | 3.8   | 55   | 54    | 6,072  | 2026/12/15 |

| 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     |            |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 2.125 | 150  | 149   | 16,686 | 2020/ 3/ 2 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 2.15  | 100  | 99    | 11,115 | 2020/ 3/ 6 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 2.15  | 260  | 256   | 28,738 | 2020/10/26 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 2.35  | 100  | 99    | 11,089 | 2020/10/30 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 248   | 27,754 | 2021/ 1/19 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 101   | 11,384 | 2023/10/ 5 |
| ROYAL BANK OF CANADA     | 普通社債券 | 4.65  | 150  | 157   | 17,584 | 2026/ 1/27 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND   | 普通社債券 | 4.8   | 200  | 203   | 22,822 | 2026/ 4/ 5 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND   | 普通社債券 | 3.875 | 200  | 199   | 22,328 | 2023/ 9/12 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND   | 普通社債券 | 3.498 | 200  | 197   | 22,063 | 2022/ 5/15 |
| ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 普通社債券 | 6.125 | 215  | 226   | 25,376 | 2022/12/15 |
| ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 普通社債券 | 6.1   | 95   | 99    | 11,156 | 2023/ 6/10 |
| ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 普通社債券 | 6.0   | 190  | 200   | 22,415 | 2023/12/19 |
| ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 普通社債券 | 5.125 | 205  | 208   | 23,315 | 2024/ 5/28 |
| ROYAL BK SCOTLND GRP PLC | 普通社債券 | 4.892 | 200  | 203   | 22,762 | 2028/ 5/18 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES  | 普通社債券 | 2.65  | 40   | 39    | 4,426  | 2020/11/28 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES  | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 93    | 10,461 | 2028/ 3/15 |
| RPM INTERNATIONAL INC    | 普通社債券 | 3.75  | 50   | 47    | 5,278  | 2027/ 3/15 |
| RPM INTERNATIONAL INC    | 普通社債券 | 4.55  | 50   | 49    | 5,549  | 2029/ 3/ 1 |
| RYDER SYSTEM INC         | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 99    | 11,145 | 2020/ 3/ 2 |
| RYDER SYSTEM INC         | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 248   | 27,769 | 2020/ 5/11 |
| RYDER SYSTEM INC         | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 99    | 11,166 | 2024/ 3/18 |
| S&P GLOBAL INC           | 普通社債券 | 3.3   | 50   | 50    | 5,614  | 2020/ 8/14 |
| S&P GLOBAL INC           | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 51    | 5,764  | 2025/ 6/15 |
| S&P GLOBAL INC           | 普通社債券 | 2.95  | 150  | 142   | 15,932 | 2027/ 1/22 |
| SABINE PASS LIQUEFACTION | 普通社債券 | 5.625 | 365  | 377   | 42,233 | 2021/ 2/ 1 |
| SABINE PASS LIQUEFACTION | 普通社債券 | 5.75  | 225  | 243   | 27,216 | 2024/ 5/15 |
| SABINE PASS LIQUEFACTION | 普通社債券 | 5.625 | 225  | 242   | 27,167 | 2025/ 3/ 1 |
| SABINE PASS LIQUEFACTION | 普通社債券 | 5.0   | 150  | 155   | 17,394 | 2027/ 3/15 |
| SABINE PASS LIQUEFACTION | 普通社債券 | 4.2   | 200  | 197   | 22,065 | 2028/ 3/15 |
| SABRA HEALTH/CAPTL CORP  | 普通社債券 | 5.5   | 50   | 50    | 5,677  | 2021/ 2/ 1 |
| SALESFORCE.COM INC       | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 204   | 22,919 | 2028/ 4/11 |
| SANDS CHINA LTD          | 普通社債券 | 4.6   | 200  | 202   | 22,700 | 2023/ 8/ 8 |
| SANDS CHINA LTD          | 普通社債券 | 5.125 | 200  | 204   | 22,908 | 2025/ 8/ 8 |
| SANDS CHINA LTD          | 普通社債券 | 5.4   | 200  | 203   | 22,826 | 2028/ 8/ 8 |
| SANOFI-AVENTIS           | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 101   | 11,364 | 2023/ 6/19 |
| SANOFI-AVENTIS           | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 101   | 11,400 | 2028/ 6/19 |
| SANOFI-AVENTIS           | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 102   | 11,460 | 2021/ 3/29 |
| SANTANDER HOLDINGS USA   | 普通社債券 | 2.65  | 100  | 99    | 11,153 | 2020/ 4/17 |
| SANTANDER HOLDINGS USA   | 普通社債券 | 3.7   | 250  | 249   | 27,928 | 2022/ 3/28 |

| 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     |            |
| SANTANDER HOLDINGS USA   | 普通社債券 | 3.4   | 100  | 98    | 10,998 | 2023/ 1/18 |
| SANTANDER HOLDINGS USA   | 普通社債券 | 4.4   | 120  | 116   | 13,090 | 2027/ 7/13 |
| SANTANDER ISSUANCES      | 普通社債券 | 5.179 | 200  | 206   | 23,088 | 2025/11/19 |
| SANTANDER UK             | 普通社債券 | 2.375 | 200  | 198   | 22,252 | 2020/ 3/16 |
| SANTANDER UK GROUP HLDGS | 普通社債券 | 3.125 | 200  | 198   | 22,192 | 2021/ 1/ 8 |
| SANTANDER UK GROUP HLDGS | 普通社債券 | 3.571 | 200  | 197   | 22,149 | 2023/ 1/10 |
| SANTANDER UK GROUP HLDGS | 普通社債券 | 3.823 | 200  | 189   | 21,240 | 2027/11/ 3 |
| SANTANDER UK PLC         | 普通社債券 | 3.4   | 250  | 250   | 28,015 | 2021/ 6/ 1 |
| SASOL FINANCING USA LLC  | 普通社債券 | 5.875 | 200  | 207   | 23,223 | 2024/ 3/27 |
| SCHLUMBERGER INVESTMENT  | 普通社債券 | 3.65  | 200  | 205   | 23,021 | 2023/12/ 1 |
| SEAGATE HDD CAYMAN       | 普通社債券 | 4.75  | 100  | 100   | 11,241 | 2023/ 6/ 1 |
| SEAGATE HDD CAYMAN       | 普通社債券 | 4.875 | 200  | 186   | 20,838 | 2027/ 6/ 1 |
| SEMPRA ENERGY            | 普通社債券 | 2.4   | 150  | 148   | 16,664 | 2020/ 3/15 |
| SEMPRA ENERGY            | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 97    | 10,876 | 2022/10/ 1 |
| SEMPRA ENERGY            | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 97    | 10,955 | 2025/11/15 |
| SEMPRA ENERGY            | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 186   | 20,902 | 2027/ 6/15 |
| SENIOR HOUSING PROPRTIE  | 普通社債券 | 4.75  | 150  | 134   | 15,050 | 2028/ 2/15 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 1.875 | 100  | 98    | 10,980 | 2021/ 5/10 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 2.875 | 100  | 97    | 10,867 | 2026/ 5/10 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 4.375 | 150  | 152   | 17,059 | 2020/ 3/25 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 2.125 | 150  | 149   | 16,679 | 2020/ 5/11 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 1.75  | 100  | 97    | 10,899 | 2021/ 9/12 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 2.375 | 50   | 49    | 5,497  | 2022/ 8/21 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 3.4   | 250  | 254   | 28,509 | 2023/ 8/12 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 3.25  | 300  | 300   | 33,664 | 2025/ 5/11 |
| SHELL INTERNATIONAL FIN  | 普通社債券 | 3.875 | 250  | 259   | 29,034 | 2028/11/13 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO      | 普通社債券 | 2.25  | 150  | 148   | 16,626 | 2020/ 5/15 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO      | 普通社債券 | 4.2   | 100  | 102   | 11,427 | 2022/ 1/15 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO      | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 98    | 11,003 | 2022/ 6/ 1 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO      | 普通社債券 | 3.125 | 50   | 48    | 5,438  | 2024/ 6/ 1 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO      | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 190   | 21,317 | 2027/ 6/ 1 |
| SHIRE ACQ INV IRELAND DA | 普通社債券 | 2.4   | 300  | 293   | 32,801 | 2021/ 9/23 |
| SHIRE ACQ INV IRELAND DA | 普通社債券 | 2.875 | 150  | 145   | 16,236 | 2023/ 9/23 |
| SHIRE ACQ INV IRELAND DA | 普通社債券 | 3.2   | 280  | 263   | 29,531 | 2026/ 9/23 |
| SIMON PROPERTY GROUP LP  | 普通社債券 | 4.125 | 200  | 205   | 22,956 | 2021/12/ 1 |
| SIMON PROPERTY GROUP LP  | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 98    | 11,013 | 2023/ 6/ 1 |
| SIMON PROPERTY GROUP LP  | 普通社債券 | 3.75  | 250  | 256   | 28,652 | 2024/ 2/ 1 |
| SIMON PROPERTY GROUP LP  | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 195   | 21,852 | 2026/11/30 |
| SIMON PROPERTY GROUP LP  | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 97    | 10,954 | 2027/12/ 1 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA   | 普通社債券 | 2.3   | 250  | 248   | 27,802 | 2020/ 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     |            |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA B | 普通社債券 | 1.875 | 300  | 290   | 32,471 | 2021/ 9/13 |
| SL GREEN REALTY CORP     | 普通社債券 | 4.5   | 50   | 51    | 5,721  | 2022/12/ 1 |
| SMUCKER (J.M.) CO        | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 150   | 16,896 | 2021/10/15 |
| SOUTHERN CAL EDISON      | 普通社債券 | 2.9   | 50   | 49    | 5,542  | 2021/ 3/ 1 |
| SOUTHERN CAL EDISON      | 普通社債券 | 2.4   | 200  | 193   | 21,627 | 2022/ 2/ 1 |
| SOUTHERN CAL EDISON      | 普通社債券 | 3.7   | 30   | 29    | 3,295  | 2025/ 8/ 1 |
| SOUTHERN CALIF GAS CO    | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 97    | 10,922 | 2024/ 9/15 |
| SOUTHERN CO              | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 99    | 11,157 | 2020/ 6/15 |
| SOUTHERN CO              | 普通社債券 | 2.35  | 100  | 98    | 11,013 | 2021/ 7/ 1 |
| SOUTHERN CO              | 普通社債券 | 2.95  | 250  | 245   | 27,432 | 2023/ 7/ 1 |
| SOUTHERN CO GAS CAPITAL  | 普通社債券 | 2.45  | 50   | 47    | 5,301  | 2023/10/ 1 |
| SOUTHERN CO/THE          | 普通社債券 | 3.25  | 150  | 143   | 16,014 | 2026/ 7/ 1 |
| SOUTHERN COPPER CORP     | 普通社債券 | 3.5   | 67   | 66    | 7,482  | 2022/11/ 8 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO    | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 94    | 10,566 | 2026/11/15 |
| SOUTHWESTERN ELEC POWER  | 普通社債券 | 4.1   | 100  | 101   | 11,316 | 2028/ 9/15 |
| SOVRAN ACQUISITION       | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 47    | 5,295  | 2026/ 7/ 1 |
| SPECTRA ENERGY PARTNERS  | 普通社債券 | 4.75  | 150  | 157   | 17,615 | 2024/ 3/15 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS INC   | 普通社債券 | 3.85  | 25   | 23    | 2,685  | 2026/ 6/15 |
| SSM HEALTH CARE          | 普通社債券 | 3.688 | 100  | 101   | 11,359 | 2023/ 6/ 1 |
| STANLEY BLACK & DECKER I | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 98    | 11,025 | 2022/11/ 1 |
| STANLEY BLACK & DECKER I | 普通社債券 | 3.4   | 70   | 69    | 7,784  | 2026/ 3/ 1 |
| STARBUCKS CORP           | 普通社債券 | 2.2   | 40   | 39    | 4,430  | 2020/11/22 |
| STARBUCKS CORP           | 普通社債券 | 3.1   | 150  | 149   | 16,773 | 2023/ 3/ 1 |
| STARBUCKS CORP           | 普通社債券 | 3.8   | 100  | 101   | 11,372 | 2025/ 8/15 |
| STARBUCKS CORP           | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 48    | 5,458  | 2028/ 3/ 1 |
| STARBUCKS CORP           | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,385 | 2028/11/15 |
| STIFEL FIANCIAL          | 普通社債券 | 4.25  | 100  | 100   | 11,273 | 2024/ 7/18 |
| STORE CAPITAL CORP       | 普通社債券 | 4.625 | 50   | 49    | 5,545  | 2029/ 3/15 |
| STRYKER CORP             | 普通社債券 | 2.625 | 50   | 49    | 5,555  | 2021/ 3/15 |
| STRYKER CORP             | 普通社債券 | 3.375 | 150  | 150   | 16,820 | 2025/11/ 1 |
| STRYKER CORP             | 普通社債券 | 3.5   | 25   | 24    | 2,772  | 2026/ 3/15 |
| STRYKER CORP             | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 99    | 11,181 | 2028/ 3/ 7 |
| SUMITOMO MITSUI BANKING  | 普通社債券 | 2.65  | 250  | 248   | 27,808 | 2020/ 7/23 |
| SUMITOMO MITSUI BANKING  | 普通社債券 | 3.4   | 150  | 149   | 16,770 | 2024/ 7/11 |
| SUMITOMO MITSUI BANKING  | 普通社債券 | 3.65  | 250  | 250   | 28,055 | 2025/ 7/23 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCIA | 普通社債券 | 2.934 | 150  | 149   | 16,702 | 2021/ 3/ 9 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCIA | 普通社債券 | 2.442 | 350  | 343   | 38,419 | 2021/10/19 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCIA | 普通社債券 | 3.784 | 150  | 151   | 16,950 | 2026/ 3/ 9 |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 2.784 | 200  | 197   | 22,057 | 2022/ 7/12 |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 3.102 | 250  | 247   | 27,681 | 2023/ 1/17 |

| 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     |            |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 3.446 | 200  | 197   | 22,069 | 2027/ 1/11 |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 3.364 | 200  | 195   | 21,923 | 2027/ 7/12 |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 3.544 | 100  | 99    | 11,098 | 2028/ 1/17 |
| SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 普通社債券 | 3.944 | 100  | 102   | 11,437 | 2028/ 7/19 |
| SUNCOR ENERGY INC        | 普通社債券 | 3.6   | 75   | 75    | 8,472  | 2024/12/ 1 |
| SUNOCO LOGISTICS PARTNER | 普通社債券 | 4.4   | 50   | 50    | 5,694  | 2021/ 4/ 1 |
| SUNOCO LOGISTICS PARTNER | 普通社債券 | 4.25  | 60   | 60    | 6,814  | 2024/ 4/ 1 |
| SUNOCO LOGISTICS PARTNER | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 146   | 16,375 | 2026/ 7/15 |
| SUNTRUST BANK            | 普通社債券 | 2.45  | 100  | 97    | 10,958 | 2022/ 8/ 1 |
| SUNTRUST BANK            | 普通社債券 | 3.502 | 250  | 251   | 28,161 | 2021/ 8/ 2 |
| SUNTRUST BANK            | 普通社債券 | 3.3   | 200  | 194   | 21,796 | 2026/ 5/15 |
| SUNTRUST BANK            | 普通社債券 | 4.0   | 150  | 154   | 17,299 | 2025/ 5/ 1 |
| SUZANO AUSTRIA GMBH      | 普通社債券 | 6.0   | 200  | 213   | 23,836 | 2029/ 1/15 |
| SVB FINANCIAL GROUP      | 普通社債券 | 3.5   | 150  | 145   | 16,263 | 2025/ 1/29 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB | 普通社債券 | 2.45  | 250  | 246   | 27,637 | 2021/ 3/30 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB | 普通社債券 | 1.875 | 250  | 243   | 27,226 | 2021/ 9/ 7 |
| SYNCHRONY FINANCIAL      | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 200   | 22,415 | 2021/ 8/15 |
| SYNCHRONY FINANCIAL      | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 97    | 10,951 | 2025/ 7/23 |
| SYNCHRONY FINANCIAL      | 普通社債券 | 3.7   | 50   | 45    | 5,120  | 2026/ 8/ 4 |
| SYNCHRONY FINANCIAL      | 普通社債券 | 3.95  | 200  | 183   | 20,527 | 2027/12/ 1 |
| SYNGENTA FINANCE NV      | 普通社債券 | 3.125 | 100  | 97    | 10,905 | 2022/ 3/28 |
| SYNOVUS FINANCIAL CORP   | 普通社債券 | 3.125 | 30   | 28    | 3,243  | 2022/11/ 1 |
| SYSCO CORP               | 普通社債券 | 2.5   | 70   | 69    | 7,726  | 2021/ 7/15 |
| SYSCO CORP               | 普通社債券 | 3.55  | 150  | 149   | 16,708 | 2025/ 3/15 |
| SYSCO CORP               | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 191   | 21,472 | 2027/ 7/15 |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL    | 普通社債券 | 4.0   | 200  | 203   | 22,735 | 2021/11/26 |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL    | 普通社債券 | 4.4   | 100  | 103   | 11,597 | 2023/11/26 |
| TAKEDA PHARMACEUTICAL    | 普通社債券 | 5.0   | 300  | 316   | 35,370 | 2028/11/26 |
| TARGET CORP              | 普通社債券 | 3.875 | 300  | 304   | 34,086 | 2020/ 7/15 |
| TARGET CORP              | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 205   | 22,946 | 2024/ 7/ 1 |
| TC PIPELINES LP          | 普通社債券 | 3.9   | 40   | 38    | 4,301  | 2027/ 5/25 |
| TD AMERITRADE HOLDING CO | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 101   | 11,389 | 2024/ 4/ 1 |
| TD AMERITRADE HOLDING CO | 普通社債券 | 3.625 | 100  | 101   | 11,312 | 2025/ 4/ 1 |
| TD AMERITRADE HOLDING CO | 普通社債券 | 3.3   | 60   | 58    | 6,576  | 2027/ 4/ 1 |
| TECO FINANCE INC         | 普通社債券 | 5.15  | 100  | 102   | 11,415 | 2020/ 3/15 |
| TELEFONICA EMISIONES SAU | 普通社債券 | 5.134 | 300  | 306   | 34,310 | 2020/ 4/27 |
| TELEFONICA EMISIONES SAU | 普通社債券 | 4.103 | 250  | 245   | 27,525 | 2027/ 3/ 8 |
| TELUS CORP               | 普通社債券 | 2.8   | 50   | 46    | 5,225  | 2027/ 2/16 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC    | 普通社債券 | 1.75  | 200  | 197   | 22,107 | 2020/ 5/ 1 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC    | 普通社債券 | 2.9   | 70   | 67    | 7,573  | 2027/11/ 3 |

| 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     |            |
| TEXTRON INC              | 普通社債券 | 4.3   | 115  | 117   | 13,106 | 2024/ 3/ 1 |
| TEXTRON INC              | 普通社債券 | 4.0   | 25   | 24    | 2,758  | 2026/ 3/15 |
| THE COCA-COLA COMPANY    | 普通社債券 | 3.2   | 150  | 152   | 17,059 | 2023/11/ 1 |
| THE KROGER CO.           | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 99    | 11,134 | 2021/11/ 1 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 102   | 11,499 | 2021/ 3/ 1 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 普通社債券 | 3.6   | 350  | 353   | 39,593 | 2021/ 8/15 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 普通社債券 | 3.3   | 50   | 50    | 5,613  | 2022/ 2/15 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 普通社債券 | 2.95  | 200  | 188   | 21,136 | 2026/ 9/19 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 95    | 10,643 | 2027/ 8/15 |
| TIME WARNER CABLE INC    | 普通社債券 | 4.0   | 250  | 252   | 28,297 | 2021/ 9/ 1 |
| TIME WARNER INC          | 普通社債券 | 4.75  | 300  | 310   | 34,722 | 2021/ 3/29 |
| TIME WARNER INC          | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 200   | 22,424 | 2022/ 6/15 |
| TIME WARNER INC          | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 99    | 11,144 | 2024/ 6/ 1 |
| TIME WARNER INC          | 普通社債券 | 3.6   | 150  | 147   | 16,507 | 2025/ 7/15 |
| TIME WARNER INC          | 普通社債券 | 3.8   | 200  | 194   | 21,771 | 2027/ 2/15 |
| TIMKEN CO/THE            | 普通社債券 | 3.875 | 70   | 69    | 7,751  | 2024/ 9/ 1 |
| TJX COS INC              | 普通社債券 | 2.75  | 200  | 199   | 22,359 | 2021/ 6/15 |
| TORCHMARK CORP           | 普通社債券 | 3.8   | 75   | 75    | 8,469  | 2022/ 9/15 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 100   | 11,236 | 2020/ 9/17 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 2.5   | 150  | 148   | 16,662 | 2020/12/14 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 2.125 | 100  | 98    | 11,005 | 2021/ 4/ 7 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 201   | 22,542 | 2021/ 6/11 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 1.8   | 200  | 195   | 21,828 | 2021/ 7/13 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 203   | 22,759 | 2023/ 7/19 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,186 | 2024/ 3/11 |
| TORONTO-DOMINION BANK    | 普通社債券 | 3.625 | 125  | 120   | 13,506 | 2026/ 9/15 |
| TOTAL CAPITAL INTL SA    | 普通社債券 | 2.875 | 350  | 349   | 39,159 | 2022/ 2/17 |
| TOTAL CAPITAL INTL SA    | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 102   | 11,483 | 2024/ 1/15 |
| TOTAL CAPITAL INTL SA    | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 154   | 17,247 | 2024/ 4/10 |
| TOTAL CAPITAL INTL SA    | 普通社債券 | 3.455 | 150  | 149   | 16,736 | 2029/ 2/19 |
| TOTAL CAPITAL SA         | 普通社債券 | 4.45  | 100  | 102   | 11,424 | 2020/ 6/24 |
| TOTAL CAPITAL SA         | 普通社債券 | 3.883 | 50   | 51    | 5,785  | 2028/10/11 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES    | 普通社債券 | 4.8   | 200  | 204   | 22,908 | 2026/ 4/ 1 |
| TOYOTA MOTOR CORP        | 普通社債券 | 3.183 | 100  | 100   | 11,276 | 2021/ 7/20 |
| TOYOTA MOTOR CORP        | 普通社債券 | 3.419 | 100  | 101   | 11,350 | 2023/ 7/20 |
| TOYOTA MOTOR CORP        | 普通社債券 | 3.669 | 70   | 71    | 8,018  | 2028/ 7/20 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT      | 普通社債券 | 2.25  | 200  | 192   | 21,584 | 2023/10/18 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 2.15  | 250  | 248   | 27,816 | 2020/ 3/12 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 1.95  | 150  | 148   | 16,629 | 2020/ 4/17 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 153   | 17,213 | 2021/ 1/11 |

| 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     |            |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 2.75  | 100  | 99    | 11,165 | 2021/ 5/17 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 3.3   | 200  | 202   | 22,652 | 2022/ 1/12 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 2.15  | 100  | 97    | 10,893 | 2022/ 9/ 8 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 203   | 22,735 | 2023/ 9/20 |
| TOYOTA MOTOR CREDIT CORP | 普通社債券 | 3.2   | 100  | 99    | 11,118 | 2027/ 1/11 |
| TRANS-CANADA PIPELINES   | 普通社債券 | 3.8   | 350  | 354   | 39,633 | 2020/10/ 1 |
| TRANS-CANADA PIPELINES   | 普通社債券 | 3.75  | 150  | 152   | 17,077 | 2023/10/16 |
| TRANSCANADA PIPELINES    | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 152   | 17,116 | 2028/ 5/15 |
| TRANSCONT GAS PIPE LINE  | 普通社債券 | 7.85  | 150  | 184   | 20,600 | 2026/ 2/ 1 |
| TRIMBLE INC              | 普通社債券 | 4.9   | 100  | 99    | 11,109 | 2028/ 6/15 |
| TRINITY ACQUISITION PLC  | 普通社債券 | 3.5   | 50   | 50    | 5,602  | 2021/ 9/15 |
| TRINITY ACQUISITION PLC  | 普通社債券 | 4.4   | 50   | 50    | 5,668  | 2026/ 3/15 |
| TYCO ELECTRONICS GROUP   | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 98    | 11,048 | 2026/ 2/15 |
| TYSON FOODS INC          | 普通社債券 | 2.25  | 35   | 34    | 3,816  | 2021/ 8/23 |
| TYSON FOODS INC          | 普通社債券 | 3.9   | 40   | 40    | 4,556  | 2023/ 9/28 |
| TYSON FOODS INC          | 普通社債券 | 3.95  | 250  | 251   | 28,143 | 2024/ 8/15 |
| TYSON FOODS INC          | 普通社債券 | 4.0   | 35   | 35    | 3,935  | 2026/ 3/ 1 |
| TYSON FOODS INC          | 普通社債券 | 4.35  | 45   | 45    | 5,066  | 2029/ 3/ 1 |
| UBS AG STAMFORD CT       | 普通社債券 | 2.35  | 250  | 248   | 27,809 | 2020/ 3/26 |
| UDR INC                  | 普通社債券 | 4.625 | 100  | 103   | 11,530 | 2022/ 1/10 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 1.8   | 100  | 98    | 11,061 | 2020/ 5/ 5 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 4.25  | 150  | 154   | 17,240 | 2021/ 2/10 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 100   | 11,205 | 2022/ 3/ 7 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 2.2   | 100  | 97    | 10,954 | 2022/ 5/ 5 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 100   | 11,242 | 2024/ 3/ 7 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 3.1   | 100  | 98    | 11,073 | 2025/ 7/30 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 2.9   | 100  | 96    | 10,801 | 2027/ 5/ 5 |
| UNILEVER CAPITAL CORP    | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,248 | 2028/ 3/22 |
| UNION ELECTRIC CO        | 普通社債券 | 2.95  | 50   | 48    | 5,400  | 2027/ 6/15 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 2.25  | 100  | 99    | 11,101 | 2020/ 6/19 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 101   | 11,387 | 2021/ 2/ 1 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 101   | 11,315 | 2023/ 6/ 8 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 3.25  | 200  | 197   | 22,143 | 2025/ 1/15 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 102   | 11,431 | 2025/ 7/15 |
| UNION PACIFIC CORP       | 普通社債券 | 3.25  | 100  | 99    | 11,147 | 2025/ 8/15 |
| UNIONBANCAL CORP         | 普通社債券 | 3.5   | 100  | 100   | 11,229 | 2022/ 6/18 |
| UNITED AER 2014-2 A PTT  | 普通社債券 | 3.75  | 160  | 158   | 17,729 | 2026/ 9/ 3 |
| UNITED PARCEL SERVICE    | 普通社債券 | 3.125 | 150  | 151   | 16,909 | 2021/ 1/15 |
| UNITED PARCEL SERVICE    | 普通社債券 | 2.35  | 100  | 98    | 11,001 | 2022/ 5/16 |
| UNITED PARCEL SERVICE    | 普通社債券 | 2.5   | 200  | 197   | 22,082 | 2023/ 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     |            |
| UNITED PARCEL SERVICE    | 普通社債券 | 3.05  | 150  | 146   | 16,445 | 2027/11/15 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 4.5   | 300  | 304   | 34,121 | 2020/ 4/15 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 3.35  | 30   | 30    | 3,383  | 2021/ 8/16 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 3.1   | 300  | 299   | 33,519 | 2022/ 6/ 1 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 3.65  | 75   | 75    | 8,503  | 2023/ 8/16 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 3.95  | 300  | 306   | 34,303 | 2025/ 8/16 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 3.125 | 150  | 142   | 15,953 | 2027/ 5/ 4 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 普通社債券 | 4.125 | 250  | 254   | 28,441 | 2028/11/16 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 2.7   | 200  | 199   | 22,375 | 2020/ 7/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 2.125 | 150  | 147   | 16,533 | 2021/ 3/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 101   | 11,316 | 2021/11/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 2.875 | 250  | 249   | 27,965 | 2022/ 3/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 2.375 | 200  | 196   | 21,956 | 2022/10/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.5   | 20   | 20    | 2,270  | 2024/ 2/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 205   | 23,003 | 2025/ 7/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.7   | 20   | 20    | 2,293  | 2025/12/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.45  | 200  | 199   | 22,338 | 2027/ 1/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.85  | 150  | 153   | 17,189 | 2028/ 6/15 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC   | 普通社債券 | 3.875 | 25   | 25    | 2,872  | 2028/12/15 |
| UNUM GROUP               | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 100   | 11,192 | 2024/ 3/15 |
| URD INC                  | 普通社債券 | 2.95  | 25   | 23    | 2,625  | 2026/ 9/ 1 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 2.625 | 150  | 148   | 16,665 | 2022/ 1/24 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 3.0   | 100  | 99    | 11,189 | 2022/ 3/15 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 2.95  | 150  | 149   | 16,713 | 2022/ 7/15 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 3.6   | 200  | 203   | 22,734 | 2024/ 9/11 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 2.375 | 150  | 140   | 15,741 | 2026/ 7/22 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 3.15  | 100  | 98    | 11,009 | 2027/ 4/27 |
| US BANCORP               | 普通社債券 | 3.9   | 150  | 156   | 17,504 | 2028/ 4/26 |
| US BANK NA CINCINNATI    | 普通社債券 | 2.05  | 250  | 246   | 27,628 | 2020/10/23 |
| US BANK NA CINCINNATI    | 普通社債券 | 3.15  | 400  | 401   | 44,949 | 2021/ 4/26 |
| US BANK NA CINCINNATI    | 普通社債券 | 3.4   | 250  | 252   | 28,296 | 2023/ 7/24 |
| VALE OVERSEAS LIMITED    | 普通社債券 | 4.375 | 64   | 63    | 7,144  | 2022/ 1/11 |
| VALE OVERSEAS LIMITED    | 普通社債券 | 6.25  | 250  | 263   | 29,446 | 2026/ 8/10 |
| VALERO ENERGY CORP       | 普通社債券 | 3.65  | 150  | 148   | 16,620 | 2025/ 3/15 |
| VALERO ENERGY CORP       | 普通社債券 | 4.35  | 70   | 71    | 7,955  | 2028/ 6/ 1 |
| VALERO ENERGY PARTNERS   | 普通社債券 | 4.375 | 45   | 45    | 5,104  | 2026/12/15 |
| VENTAS REALTY LP         | 普通社債券 | 3.1   | 200  | 197   | 22,092 | 2023/ 1/15 |
| VENTAS REALTY LP         | 普通社債券 | 3.5   | 200  | 196   | 22,020 | 2025/ 2/ 1 |
| VENTAS REALTY LP         | 普通社債券 | 4.4   | 200  | 203   | 22,790 | 2029/ 1/15 |
| VEREIT OPERATING PARTNER | 普通社債券 | 4.125 | 35   | 35    | 3,939  | 2021/ 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      |            |
| VEREIT OPERATING PARTNER | 普通社債券 | 4.6   | 40    | 40    | 4,545   | 2024/ 2/ 6 |
| VEREIT OPERATING PARTNER | 普通社債券 | 4.625 | 50    | 50    | 5,694   | 2025/11/ 1 |
| VEREIT OPERATING PARTNER | 普通社債券 | 4.875 | 50    | 51    | 5,713   | 2026/ 6/ 1 |
| VEREIT OPERATING PARTNER | 普通社債券 | 3.95  | 40    | 38    | 4,293   | 2027/ 8/15 |
| VERISK ANALYTICS INC     | 普通社債券 | 4.0   | 150   | 152   | 17,016  | 2025/ 6/15 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 3.5   | 250   | 254   | 28,440  | 2021/11/ 1 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 3.5   | 400   | 404   | 45,252  | 2024/11/ 1 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 3.376 | 100   | 99    | 11,190  | 2025/ 2/15 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 4.125 | 200   | 204   | 22,918  | 2027/ 3/16 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 4.329 | 1,021 | 1,056 | 118,274 | 2028/ 9/21 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 3.875 | 85    | 85    | 9,513   | 2029/ 2/ 8 |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 普通社債券 | 2.625 | 250   | 234   | 26,204  | 2026/ 8/15 |
| VF CORP                  | 普通社債券 | 3.5   | 70    | 70    | 7,934   | 2021/ 9/ 1 |
| VIACOM INC               | 普通社債券 | 4.25  | 150   | 153   | 17,167  | 2023/ 9/ 1 |
| VIACOM INC               | 普通社債券 | 3.875 | 200   | 199   | 22,377  | 2024/ 4/ 1 |
| VIRGINIA ELEC & POWER CO | 普通社債券 | 2.75  | 100   | 98    | 11,018  | 2023/ 3/15 |
| VIRGINIA ELEC & POWER CO | 普通社債券 | 3.1   | 100   | 98    | 10,998  | 2025/ 5/15 |
| VIRGINIA ELEC & POWER CO | 普通社債券 | 3.5   | 100   | 99    | 11,147  | 2027/ 3/15 |
| VIRGINIA ELECTRIC & POWE | 普通社債券 | 3.15  | 100   | 98    | 11,018  | 2026/ 1/15 |
| VISA INC                 | 普通社債券 | 2.2   | 150   | 148   | 16,650  | 2020/12/14 |
| VISA INC                 | 普通社債券 | 2.15  | 20    | 19    | 2,193   | 2022/ 9/15 |
| VISA INC                 | 普通社債券 | 2.8   | 250   | 249   | 27,962  | 2022/12/14 |
| VISA INC                 | 普通社債券 | 3.15  | 350   | 350   | 39,196  | 2025/12/14 |
| VISA INC                 | 普通社債券 | 2.75  | 50    | 48    | 5,393   | 2027/ 9/15 |
| VMWARE INC               | 普通社債券 | 2.3   | 100   | 98    | 11,049  | 2020/ 8/21 |
| VMWARE INC               | 普通社債券 | 2.95  | 150   | 147   | 16,474  | 2022/ 8/21 |
| VMWARE INC               | 普通社債券 | 3.9   | 100   | 94    | 10,532  | 2027/ 8/21 |
| VODAFONE GROUP PLC       | 普通社債券 | 2.5   | 300   | 292   | 32,787  | 2022/ 9/26 |
| VODAFONE GROUP PLC       | 普通社債券 | 3.75  | 95    | 94    | 10,585  | 2024/ 1/16 |
| VODAFONE GROUP PLC       | 普通社債券 | 4.125 | 75    | 75    | 8,436   | 2025/ 5/30 |
| VODAFONE GROUP PLC       | 普通社債券 | 4.375 | 335   | 331   | 37,128  | 2028/ 5/30 |
| VORNADO REALTY LP        | 普通社債券 | 3.5   | 100   | 96    | 10,804  | 2025/ 1/15 |
| VOYA FINANCIAL INC       | 普通社債券 | 3.65  | 100   | 96    | 10,839  | 2026/ 6/15 |
| VOYA FINANCIAL INC       | 普通社債券 | 3.125 | 100   | 96    | 10,821  | 2024/ 7/15 |
| VULCAN MATERIALS CO      | 普通社債券 | 4.5   | 100   | 101   | 11,369  | 2025/ 4/ 1 |
| VULCAN MATERIALS CO      | 普通社債券 | 3.9   | 20    | 19    | 2,166   | 2027/ 4/ 1 |
| WABTEC                   | 普通社債券 | 4.15  | 150   | 149   | 16,779  | 2024/ 3/15 |
| WABTEC                   | 普通社債券 | 4.7   | 150   | 149   | 16,692  | 2028/ 9/15 |
| WAL MART STORES INC      | 普通社債券 | 2.55  | 200   | 197   | 22,155  | 2023/ 4/11 |
| WAL-MART STORES INC      | 普通社債券 | 3.3   | 300   | 305   | 34,202  | 2024/ 4/22 |

| 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     |            |
| WAL-MART STORES INC      | 普通社債券 | 2.65  | 200  | 196   | 22,015 | 2024/12/15 |
| WALGREEN CO              | 普通社債券 | 3.1   | 150  | 149   | 16,724 | 2022/ 9/15 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 普通社債券 | 3.8   | 200  | 200   | 22,434 | 2024/11/18 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 普通社債券 | 3.45  | 150  | 143   | 16,106 | 2026/ 6/ 1 |
| WALMART INC              | 普通社債券 | 2.85  | 300  | 300   | 33,652 | 2020/ 6/23 |
| WALMART INC              | 普通社債券 | 3.125 | 150  | 151   | 16,932 | 2021/ 6/23 |
| WALMART INC              | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 203   | 22,812 | 2023/ 6/26 |
| WALMART INC              | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 102   | 11,495 | 2025/ 6/26 |
| WALMART INC              | 普通社債券 | 3.7   | 200  | 205   | 22,962 | 2028/ 6/26 |
| WALT DISNEY CO           | 普通社債券 | 2.3   | 350  | 347   | 38,868 | 2021/ 2/12 |
| WALT DISNEY CO           | 普通社債券 | 3.0   | 150  | 148   | 16,636 | 2026/ 2/13 |
| WALT DISNEY COMPANY/THE  | 普通社債券 | 1.8   | 50   | 49    | 5,533  | 2020/ 6/ 5 |
| WALT DISNEY COMPANY/THE  | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 102   | 11,426 | 2021/ 6/ 1 |
| WALT DISNEY COMPANY/THE  | 普通社債券 | 2.35  | 150  | 147   | 16,539 | 2022/12/ 1 |
| WALT DISNEY COMPANY/THE  | 普通社債券 | 2.95  | 100  | 98    | 10,971 | 2027/ 6/15 |
| WASTE MANAGEMENT INC     | 普通社債券 | 2.9   | 150  | 149   | 16,708 | 2022/ 9/15 |
| WASTE MANAGEMENT INC     | 普通社債券 | 3.15  | 200  | 193   | 21,700 | 2027/11/15 |
| WEC ENERGY GROUP INC     | 普通社債券 | 3.375 | 35   | 35    | 3,941  | 2021/ 6/15 |
| WEC ENERGY GROUP INC     | 普通社債券 | 3.1   | 25   | 25    | 2,799  | 2022/ 3/ 8 |
| WELLPOINT INC            | 普通社債券 | 4.35  | 100  | 101   | 11,391 | 2020/ 8/15 |
| WELLPOINT INC            | 普通社債券 | 3.5   | 250  | 249   | 27,927 | 2024/ 8/15 |
| WELLS FARGO              | 普通社債券 | 3.069 | 500  | 497   | 55,666 | 2023/ 1/24 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 2.6   | 300  | 298   | 33,409 | 2020/ 7/22 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 2.55  | 150  | 148   | 16,650 | 2020/12/ 7 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 2.5   | 250  | 247   | 27,711 | 2021/ 3/ 4 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.55  | 200  | 199   | 22,368 | 2025/ 9/29 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.0   | 500  | 479   | 53,639 | 2026/ 4/22 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.5   | 500  | 505   | 56,550 | 2022/ 3/ 8 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 2.625 | 335  | 329   | 36,835 | 2022/ 7/22 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 4.125 | 150  | 153   | 17,128 | 2023/ 8/15 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.75  | 250  | 254   | 28,527 | 2024/ 1/24 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.3   | 150  | 149   | 16,728 | 2024/ 9/ 9 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.0   | 350  | 341   | 38,193 | 2025/ 2/19 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.0   | 200  | 190   | 21,356 | 2026/10/23 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 4.3   | 300  | 305   | 34,181 | 2027/ 7/22 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 3.584 | 265  | 261   | 29,236 | 2027/ 5/22 |
| WELLS FARGO & CO         | 普通社債券 | 4.15  | 250  | 256   | 28,662 | 2029/ 1/24 |
| WELLS FARGO BANK NA      | 普通社債券 | 2.6   | 300  | 297   | 33,347 | 2021/ 1/15 |
| WELLS FARGO BANK NA      | 普通社債券 | 3.325 | 250  | 250   | 28,053 | 2020/ 7/23 |
| WELLS FARGO BANK NA      | 普通社債券 | 3.625 | 250  | 253   | 28,336 | 2021/10/22 |

| 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     |            |
| WELLS FARGO BANK NA      | 普通社債券 | 3.55  | 250  | 253   | 28,373 | 2023/ 8/14 |
| WELLTOWER INC            | 普通社債券 | 3.95  | 50   | 50    | 5,706  | 2023/ 9/ 1 |
| WELLTOWER INC            | 普通社債券 | 3.625 | 50   | 50    | 5,602  | 2024/ 3/15 |
| WELLTOWER INC            | 普通社債券 | 4.25  | 50   | 50    | 5,651  | 2028/ 4/15 |
| WESTERN GAS PARTNERS     | 普通社債券 | 4.0   | 250  | 250   | 28,072 | 2022/ 7/ 1 |
| WESTERN GAS PARTNERS     | 普通社債券 | 4.65  | 25   | 24    | 2,786  | 2026/ 7/ 1 |
| WESTERN UNION CO/THE     | 普通社債券 | 3.6   | 50   | 50    | 5,639  | 2022/ 3/15 |
| WESTERN UNION CO/THE     | 普通社債券 | 4.25  | 50   | 50    | 5,695  | 2023/ 6/ 9 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP   | 普通社債券 | 3.6   | 150  | 141   | 15,887 | 2026/ 8/15 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.85  | 150  | 142   | 15,991 | 2026/ 5/13 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.15  | 100  | 99    | 11,109 | 2020/ 3/ 6 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 3.05  | 100  | 100   | 11,205 | 2020/ 5/15 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.3   | 200  | 198   | 22,224 | 2020/ 5/26 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.6   | 150  | 149   | 16,689 | 2020/11/23 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.8   | 200  | 198   | 22,223 | 2022/ 1/11 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 2.5   | 300  | 293   | 32,888 | 2022/ 6/28 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 3.65  | 100  | 101   | 11,352 | 2023/ 5/15 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 3.35  | 100  | 98    | 10,997 | 2027/ 3/ 8 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 3.4   | 200  | 196   | 22,036 | 2028/ 1/25 |
| WESTPAC BANKING CORP     | 普通社債券 | 4.322 | 100  | 97    | 10,896 | 2026/11/23 |
| WEYERHAEUSER CO          | 普通社債券 | 4.625 | 100  | 102   | 11,520 | 2023/ 9/15 |
| WHIRLPOOL CORP           | 普通社債券 | 4.85  | 100  | 102   | 11,517 | 2021/ 6/15 |
| WHIRLPOOL CORP           | 普通社債券 | 3.7   | 100  | 98    | 11,025 | 2025/ 5/ 1 |
| WILLIAMS COMPANIES INC   | 普通社債券 | 3.7   | 40   | 40    | 4,494  | 2023/ 1/15 |
| WILLIAMS COMPANIES INC   | 普通社債券 | 4.55  | 140  | 145   | 16,260 | 2024/ 6/24 |
| WILLIAMS COMPANIES INC   | 普通社債券 | 3.75  | 200  | 193   | 21,651 | 2027/ 6/15 |
| WILLIAMS PARTNERS LP     | 普通社債券 | 5.25  | 150  | 153   | 17,142 | 2020/ 3/15 |
| WILLIAMS PARTNERS LP     | 普通社債券 | 3.6   | 100  | 100   | 11,264 | 2022/ 3/15 |
| WILLIAMS PARTNERS LP     | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 103   | 11,553 | 2023/11/15 |
| WILLIAMS PARTNERS LP     | 普通社債券 | 4.3   | 200  | 205   | 22,983 | 2024/ 3/ 4 |
| WILLIAMS PARTNERS LP     | 普通社債券 | 4.0   | 100  | 100   | 11,206 | 2025/ 9/15 |
| WILLIS NORTH AMERICA INC | 普通社債券 | 3.6   | 50   | 49    | 5,536  | 2024/ 5/15 |
| WILLIS NORTH AMERICA INC | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 101   | 11,347 | 2028/ 9/15 |
| WISCONSIN ENERGY CORP    | 普通社債券 | 2.45  | 50   | 49    | 5,548  | 2020/ 6/15 |
| WISCONSIN ENERGY CORP    | 普通社債券 | 3.55  | 50   | 50    | 5,609  | 2025/ 6/15 |
| WISCONSIN PUBLIC SERVICE | 普通社債券 | 3.35  | 35   | 35    | 3,952  | 2021/11/21 |
| WP CAREY INC             | 普通社債券 | 4.6   | 150  | 154   | 17,235 | 2024/ 4/ 1 |
| WPP FINANCE 2010         | 普通社債券 | 3.625 | 150  | 147   | 16,511 | 2022/ 9/ 7 |
| WPP FINANCE 2010         | 普通社債券 | 3.75  | 100  | 96    | 10,778 | 2024/ 9/19 |
| WRKCO INC                | 普通社債券 | 3.75  | 50   | 49    | 5,497  | 2025/ 3/15 |

| 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         |            |
| WRKCO INC           | 普通社債券 | 4.65  | 150  | 154   | 17,290     | 2026/ 3/15 |
| WRKCO INC           | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 49    | 5,499      | 2028/ 3/15 |
| WYETH               | 普通社債券 | 6.45  | 100  | 115   | 12,912     | 2024/ 2/ 1 |
| XCEL ENERGY INC     | 普通社債券 | 3.3   | 250  | 247   | 27,734     | 2025/ 6/ 1 |
| XCEL ENERGY INC     | 普通社債券 | 4.0   | 50   | 51    | 5,722      | 2028/ 6/15 |
| XLIT LTD            | 普通社債券 | 4.45  | 150  | 153   | 17,199     | 2025/ 3/31 |
| XYLEM INC           | 普通社債券 | 3.25  | 55   | 52    | 5,898      | 2026/11/ 1 |
| YAMANA GOLD INC     | 普通社債券 | 4.625 | 100  | 94    | 10,591     | 2027/12/15 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 普通社債券 | 2.7   | 250  | 248   | 27,838     | 2020/ 4/ 1 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 普通社債券 | 3.375 | 100  | 99    | 11,177     | 2021/11/30 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 普通社債券 | 3.55  | 100  | 97    | 10,867     | 2025/ 4/ 1 |
| ZOETIS INC          | 普通社債券 | 3.25  | 10   | 9     | 1,117      | 2021/ 8/20 |
| ZOETIS INC          | 普通社債券 | 4.5   | 100  | 103   | 11,587     | 2025/11/13 |
| ZOETIS INC          | 普通社債券 | 3.0   | 200  | 186   | 20,881     | 2027/ 9/12 |
| ZOETIS INC          | 普通社債券 | 3.9   | 25   | 24    | 2,788      | 2028/ 8/20 |
| 合 計                 |       |       |      |       | 33,054,958 |            |

(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('19年3月5日現在)

| 項 目                     | 当 期 末            |           |
|-------------------------|------------------|-----------|
|                         | 評 価 額            | 比 率       |
| 公 社 債                   | 千円<br>33,054,958 | %<br>98.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 617,375          | 1.8       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 33,672,333       | 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=111.91円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(33,524,304千円)の投資信託財産総額(33,672,333千円)に対する比率は99.6%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

(19年3月5日現在)

| 項 目                              | 当 期 末           |
|----------------------------------|-----------------|
| (A)資 産                           | 33,802,995,523  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                  | 326,135,118     |
| 公 社 債(評価額)                       | 33,054,958,653  |
| 未 収 入 金                          | 130,662,939     |
| 未 収 利 息                          | 283,316,557     |
| 前 払 費 用                          | 7,922,256       |
| (B)負 債                           | 270,978,152     |
| 未 払 金                            | 268,650,531     |
| 未 払 解 約 金                        | 2,327,558       |
| 未 払 利 息                          | 26              |
| そ の 他 未 払 費 用                    | 37              |
| (C)純 資 産 総 額(A-B)                | 33,532,017,371  |
| 元 本                              | 18,332,728,878  |
| 次 期 繰 越 損 益 金                    | 15,199,288,493  |
| (D)受 益 権 総 口 数                   | 18,332,728,878口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D×10,000) | 18,291円         |

- (注1) 期首元本額 18,713,757,853円  
 期中追加設定元本額 775,624,846円  
 期中一部解約元本額 1,156,653,821円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベ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〉 16,303,308,723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) 1,250,250,139円  
 米国社債インデックス・ファンド(為替ヘッジなく)〈適格機関投資家限定(個人投資家可)〉 470,832,988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) 302,715,193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 5,621,835円

◎損益の状況

当期 (自'18年3月6日 至'19年3月5日)

| 項 目                 | 当 期            |
|---------------------|----------------|
| (A)配 当 等 収 益        | 1,128,163,443  |
| 受 取 利 息             | 1,128,007,156  |
| そ の 他 収 益 金         | 179,056        |
| 支 払 利 息             | △ 22,769       |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益  | 1,945,351,848  |
| 売 買 益               | 2,121,798,169  |
| 売 買 損               | △ 176,446,321  |
| (C)そ の 他 費 用        | △ 4,071,038    |
| (D)当 期 損 益 金(A+B+C) | 3,069,444,253  |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金    | 12,411,728,412 |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金  | 585,938,875    |
| (G)解 約 差 損 益 金      | △ 867,823,047  |
| (H) 計 (D+E+F+G)     | 15,199,288,493 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 ( H ) | 15,199,288,493 |

- (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。