

○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、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)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す。</li> </ul>  |  |
| 主要運用対象 | ベビーファンド  | 米国社債インデックス・マザーファンド受益証券   |
|        | マザーファンド  | 米国社債の投資適格銘柄  |
| 組入制限   | ベビーファンド  | <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> |  |

**STATE STREET GLOBAL ADVISORS**

## ステート・ストリート USボンド・オープン(為替ヘッジあり)

第22作成期 運用報告書(全体版)  
 第125期 (決算日 2021年8月10日)  
 第126期 (決算日 2021年9月10日)  
 第127期 (決算日 2021年10月11日)  
 第128期 (決算日 2021年11月10日)  
 第129期 (決算日 2021年12月10日)  
 第130期 (決算日 2022年1月11日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申しあげます。

この度、「ステート・ストリートUSボンド・オープン(為替ヘッジあり)」は、2022年1月11日に第130期の決算を行いましたので、第125期～第130期の運用状況をまとめてご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間(営業日) 9:00～17:00

ホームページアドレス [www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5作成期の運用実績

| 決算期        |                     | 基準価額  |            |          | <ベンチマーク><br>ブルームバーグ<br>米国社債(1-10年)<br>インデックス<br>(円ヘッジベース) |          | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産額 |
|------------|---------------------|-------|------------|----------|---|----------|------------|------------|------|
|            |                     | (分配)  | 税込み<br>分配金 | 期<br>騰落率 | 期<br>騰落率  | 期<br>騰落率 |            |            |      |
|            |                     | 円     | 円          | %        |   | %        | %          | %          | 百万円  |
| 第18<br>作成期 | 第101期('19年 8月 13日)  | 9,291 | 15         | 1.4      | 12,884  | 1.3      | 95.4       | -          | 558  |
|            | 第102期('19年 9月 10日)  | 9,281 | 15         | 0.1      | 12,900  | 0.1      | 100.2      | -          | 560  |
|            | 第103期('19年 10月 10日) | 9,286 | 15         | 0.2      | 12,935  | 0.3      | 98.7       | -          | 563  |
|            | 第104期('19年 11月 11日) | 9,208 | 15         | △ 0.7    | 12,850  | △ 0.7    | 98.9       | -          | 556  |
|            | 第105期('19年 12月 10日) | 9,234 | 15         | 0.4      | 12,915  | 0.5      | 98.5       | -          | 558  |
|            | 第106期('20年 1月 10日)  | 9,240 | 15         | 0.2      | 12,953  | 0.3      | 99.0       | -          | 558  |
| 第19<br>作成期 | 第107期('20年 2月 10日)  | 9,322 | 15         | 1.0      | 13,095  | 1.1      | 99.4       | -          | 564  |
|            | 第108期('20年 3月 10日)  | 9,346 | 15         | 0.4      | 13,225  | 1.0      | 92.5       | -          | 562  |
|            | 第109期('20年 4月 10日)  | 8,999 | 15         | △ 3.6    | 12,701  | △ 4.0    | 96.9       | -          | 541  |
|            | 第110期('20年 5月 11日)  | 9,130 | 15         | 1.6      | 12,915  | 1.7      | 98.8       | -          | 572  |
|            | 第111期('20年 6月 10日)  | 9,384 | 15         | 2.9      | 13,287  | 2.9      | 98.9       | -          | 564  |
|            | 第112期('20年 7月 10日)  | 9,488 | 15         | 1.3      | 13,455  | 1.3      | 98.7       | -          | 570  |
| 第20<br>作成期 | 第113期('20年 8月 11日)  | 9,573 | 15         | 1.1      | 13,614  | 1.2      | 100.2      | -          | 575  |
|            | 第114期('20年 9月 10日)  | 9,518 | 15         | △ 0.4    | 13,563  | △ 0.4    | 98.6       | -          | 570  |
|            | 第115期('20年 10月 12日) | 9,498 | 15         | △ 0.1    | 13,564  | 0.0      | 99.0       | -          | 568  |
|            | 第116期('20年 11月 10日) | 9,494 | 15         | 0.1      | 13,596  | 0.2      | 99.8       | -          | 566  |
|            | 第117期('20年 12月 10日) | 9,533 | 15         | 0.6      | 13,667  | 0.5      | 99.1       | -          | 567  |
|            | 第118期('21年 1月 12日)  | 9,526 | 15         | 0.1      | 13,671  | 0.0      | 99.5       | -          | 185  |
| 第21<br>作成期 | 第119期('21年 2月 10日)  | 9,532 | 15         | 0.2      | 13,706  | 0.3      | 99.3       | -          | 185  |
|            | 第120期('21年 3月 10日)  | 9,341 | 15         | △ 1.8    | 13,447  | △ 1.9    | 101.6      | -          | 168  |
|            | 第121期('21年 4月 12日)  | 9,350 | 15         | 0.3      | 13,491  | 0.3      | 98.6       | -          | 169  |
|            | 第122期('21年 5月 10日)  | 9,392 | 15         | 0.6      | 13,576  | 0.6      | 98.8       | -          | 178  |
|            | 第123期('21年 6月 10日)  | 9,422 | 15         | 0.5      | 13,643  | 0.5      | 99.0       | -          | 179  |
|            | 第124期('21年 7月 12日)  | 9,436 | 15         | 0.3      | 13,691  | 0.4      | 98.4       | -          | 162  |
| 第22<br>作成期 | 第125期('21年 8月 10日)  | 9,419 | 15         | △ 0.0    | 13,687  | △ 0.0    | 99.5       | -          | 162  |
|            | 第126期('21年 9月 10日)  | 9,428 | 15         | 0.3      | 13,735  | 0.3      | 98.7       | -          | 159  |
|            | 第127期('21年 10月 11日) | 9,318 | 15         | △ 1.0    | 13,600  | △ 1.0    | 99.3       | -          | 157  |
|            | 第128期('21年 11月 10日) | 9,330 | 15         | 0.3      | 13,641  | 0.3      | 97.9       | -          | 156  |
|            | 第129期('21年 12月 10日) | 9,223 | 15         | △ 1.0    | 13,523  | △ 0.9    | 98.4       | -          | 155  |
|            | 第130期('22年 1月 11日)  | 9,118 | 15         | △ 1.0    | 13,403  | △ 0.9    | 99.2       | -          | 152  |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)※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たものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

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

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

◎ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期   | 年 月 日                 | 基 準 価 額 |       | <ベンチマーク><br>ブルームバーグ<br>米国社債(1-10年)<br>インデックス<br>(円ヘッジベース) |       | 債 券<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|-------|-----------------------|---------|-------|---|-------|-------------|-------------|
|       |                       |         | 騰 落 率 |   | 騰 落 率 |             |             |
| 第125期 | (期 首)<br>'21年 7月 12日  | 円       | %     |   | %     | %           | %           |
|       | 7月末                   | 9,436   | -     | 13,691  | -     | 98.4        | -           |
|       |                       | 9,466   | 0.3   | 13,739  | 0.4   | 98.0        | -           |
| 第126期 | (期 末)<br>'21年 8月 10日  | 9,434   | △ 0.0 | 13,687  | △ 0.0 | 99.5        | -           |
|       | (期 首)<br>'21年 8月 10日  | 9,419   | -     | 13,687  | -     | 99.5        | -           |
|       | 8月末                   | 9,443   | 0.3   | 13,733  | 0.3   | 98.2        | -           |
| 第127期 | (期 末)<br>'21年 9月 10日  | 9,443   | 0.3   | 13,735  | 0.3   | 98.7        | -           |
|       | (期 首)<br>'21年 9月 10日  | 9,428   | -     | 13,735  | -     | 98.7        | -           |
|       | 9月末                   | 9,365   | △ 0.7 | 13,651  | △ 0.6 | 100.4       | -           |
| 第128期 | (期 末)<br>'21年 10月 11日 | 9,333   | △ 1.0 | 13,600  | △ 1.0 | 99.3        | -           |
|       | (期 首)<br>'21年 10月 11日 | 9,318   | -     | 13,600  | -     | 99.3        | -           |
|       | 10月末                  | 9,296   | △ 0.2 | 13,574  | △ 0.2 | 100.8       | -           |
| 第129期 | (期 末)<br>'21年 11月 10日 | 9,345   | 0.3   | 13,641  | 0.3   | 97.9        | -           |
|       | (期 首)<br>'21年 11月 10日 | 9,330   | -     | 13,641  | -     | 97.9        | -           |
|       | 11月末                  | 9,236   | △ 1.0 | 13,528  | △ 0.8 | 98.1        | -           |
| 第130期 | (期 末)<br>'21年 12月 10日 | 9,238   | △ 1.0 | 13,523  | △ 0.9 | 98.4        | -           |
|       | (期 首)<br>'21年 12月 10日 | 9,223   | -     | 13,523  | -     | 98.4        | -           |
|       | 12月末                  | 9,220   | △ 0.0 | 13,532  | 0.1   | 99.7        | -           |
|       | (期 末)<br>'22年 1月 11日  | 9,133   | △ 1.0 | 13,403  | △ 0.9 | 99.2        | -           |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)※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たものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

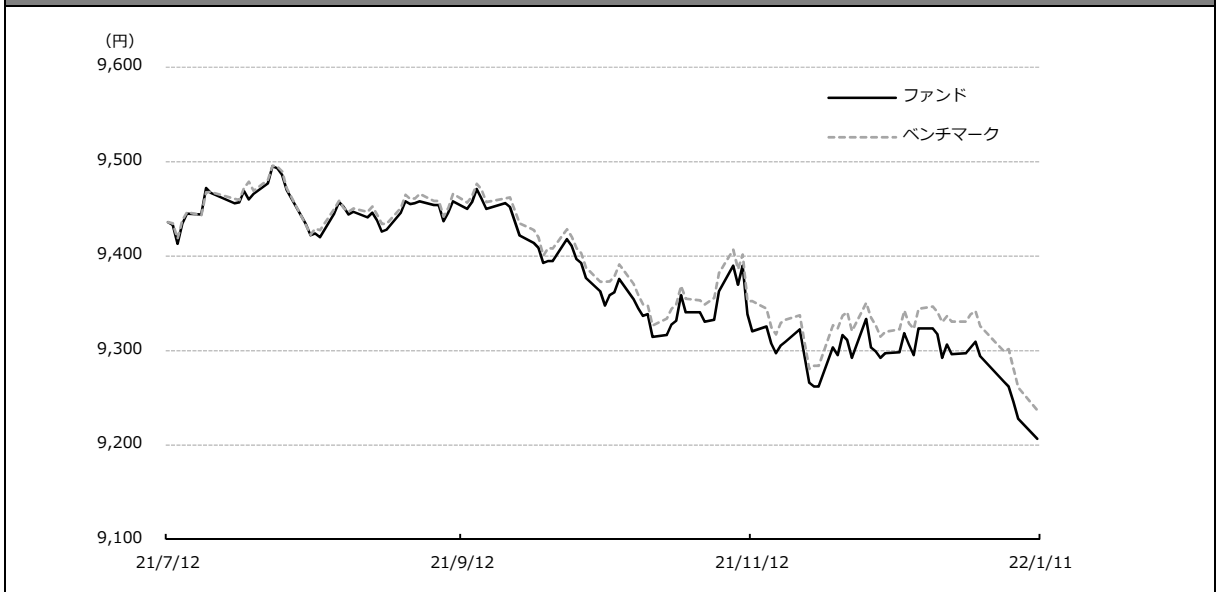
(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

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

当作成期の運用実績

(2021年7月13日から2022年1月11日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注1) ベンチマークは、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)※で、前作成期末の基準価額にあわせて指数化しています。

(注2) 基準価額は、分配金(税込み)を再投資したものと計算しています。

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

| 決算期    | 作成期首<br>基準価額<br>(分配落ち) | 作成期末<br>基準価額<br>(分配落ち) | 税込み<br>分配金累計 | 基準価額<br>騰落率 | ベンチマーク<br>騰落率 |
|--------|------------------------|------------------------|--------------|-------------|---------------|
| 第22作成期 | 9,436円                 | 9,118円                 | 90円          | -2.4%       | -2.1%         |

当作成期末の基準価額は9,118円となり、期間中の分配金を再投資したものと計算すると、当作成期首の9,436円に比べて229円の下落となりました。

## 基準価額の変動要因

### 【プラスの要因】

－国債を上回る社債利回りがインカム要因として収益向上に働き、基準価額の上昇に寄与しました。

### 【マイナスの要因】

- －米インフレ指標が上昇したことや、米国の金融緩和策の段階的縮小(テーパリング)や早期利上げ期待を背景に国債が売られ基準価額の下落に寄与しました。
- －新型コロナウイルス新変異株「オミクロン」の出現がリスク回避傾向を高めクレジットスプレッドが拡大する結果となり基準価額の下落に寄与しました。

## ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-2.4%となり、ベンチマークの騰落率(-2.1%)を0.3%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

第125期から第130期における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、1万口当たりそれぞれ15円(税込み)としております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

## 投資環境

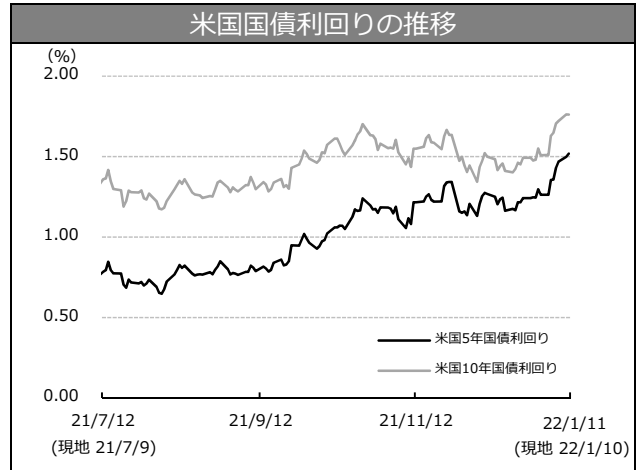
(2021年7月13日から2022年1月11日まで)

## 米国債券市場

当期の米国債券市場は、9月、米連邦公開市場委員会(FOMC)にて政策金利見通しの分布から利上げの開始時期の前倒しが示唆されるなど米連邦準備制度理事会(FRB)のタカ派的な姿勢を背景に債券が売られました。11月に消費者物価指数(CPI)が市場予想を上回ったことでインフレに対する警戒感が広がり債券が売られました。12月には個人消費支出(PCE)コアデフレーターが市場予想を上回ったことで、インフレ圧力の継続が意識されたことを背景に債券が軟調となりました。前期末の2021年7月12日(現地7月9日)に0.79%だった米国5年債利回りは、当期末の2022年1月11日(現地1月10日)には1.52%へと上昇しました(債券価格は下落)。また、同期間の米国10年債利回りは、1.36%から1.76%まで上昇(債券価格は下落)しました。

米国の社債市場は、期前半、9月のFOMCにて政策金利見通しの分布から利上げの開始時期の前倒しが示唆されるなどタカ派的な姿勢が見られたことを背景に米国債が売られましたが、クレジットセクターに対しては底堅い需要が継続しました。期後半はインフレ指標の大幅上昇からFRBのタカ派傾向が意識されたことに加え、オミクロンの出現がリスク回避傾向を高めクレジットスプレッドが拡大する結果となりました。ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックスの平均スプレッドは、前期末2021年7月12日(現地7月9日)の0.61%から当期末の2022年1月11日(現地1月10日)には0.70%まで拡大(債券価格にマイナス寄与)しました。

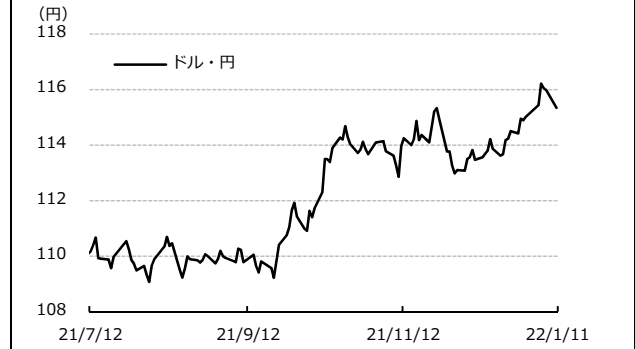
クレジットスプレッドは拡大しましたが、国債を上回る相対的に魅力的な社債利回りがインカム要因として引き続き収益向上に働き、ファンドの基準価額(分配金再投資)の上昇要因となりました。



## 為替市況

ドル・円レートは、9月、米国のテーパリングや早期利上げ期待を背景に米ドル高が主導する形で円安が進行しました。その後は変異株の感染拡大への懸念を背景にリスクオフの展開となったことで一時日本円が買われましたが、米インフレ指標の上昇が見られる中、米国の金融政策の正常化が加速するとの見方が強まったことを背景に日本円は米ドルに対して下落しました。ドル・円相場は、前期末の110円台から円安となり、2022年1月11日には115円台となりました。なお、当ファンドでは為替ヘッジを行っているため、為替レート変化の影響は限定的でした。

## ドル・円相場の推移



## 運用の概況

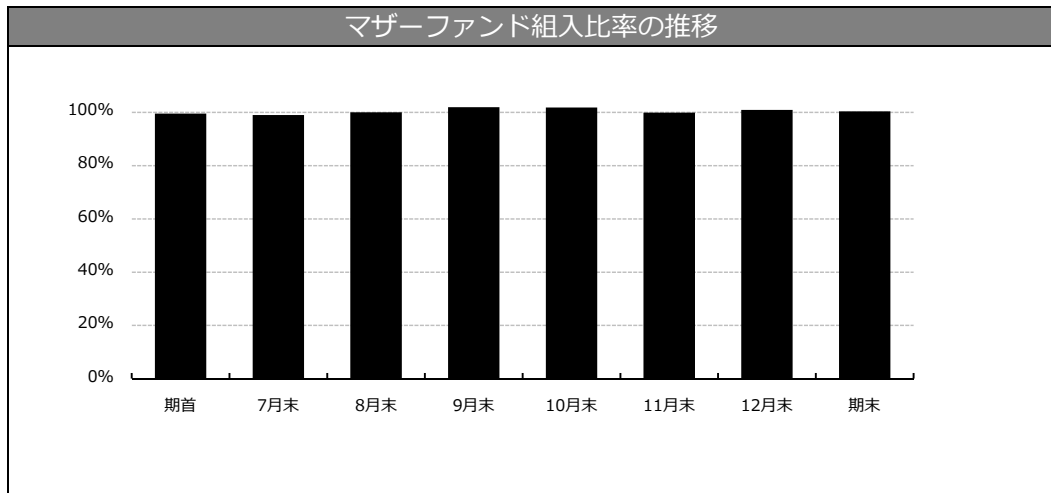
(2021年7月13日から2022年1月11日まで)

当ファンドは「米国社債インデックス・マザーファンド」受益証券(以下、マザーファンドといいます)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す。

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

### マザーファンドの組入状況

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



## 今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、主として米国社債の投資適格銘柄に投資し、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)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       | 第125期～第130期<br>(2021年7月13日～2022年1月11日) |         | 項 目 の 概 要  |
|-----------|--|---------|--|
|           | 金 額                                    | 比 率     |  |
| 平均基準価額    | 9,337円                                 | -       | 作成期中の平均基準価額です。                                     |
| (a) 信託報酬  | 33円                                    | 0.353%  | (a)信託報酬＝作成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)    | (13)                                   | (0.138) | 委託した資金の運用の対価                                       |
| (販売会社)    | (18)                                   | (0.193) | 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)    | (2)                                    | (0.022) | 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 | 2                                      | 0.017   | (b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数                   |
| (保管費用)    | (1)                                    | (0.008) | ・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)                                    | (0.005) | ・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)                                    | (0.004) | ・その他は、金銭信託手数料及びLEI支払手数料                            |
| 合 計       | 35円                                    | 0.370%  |  |

(注1) 作成期中の費用(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)を作成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。

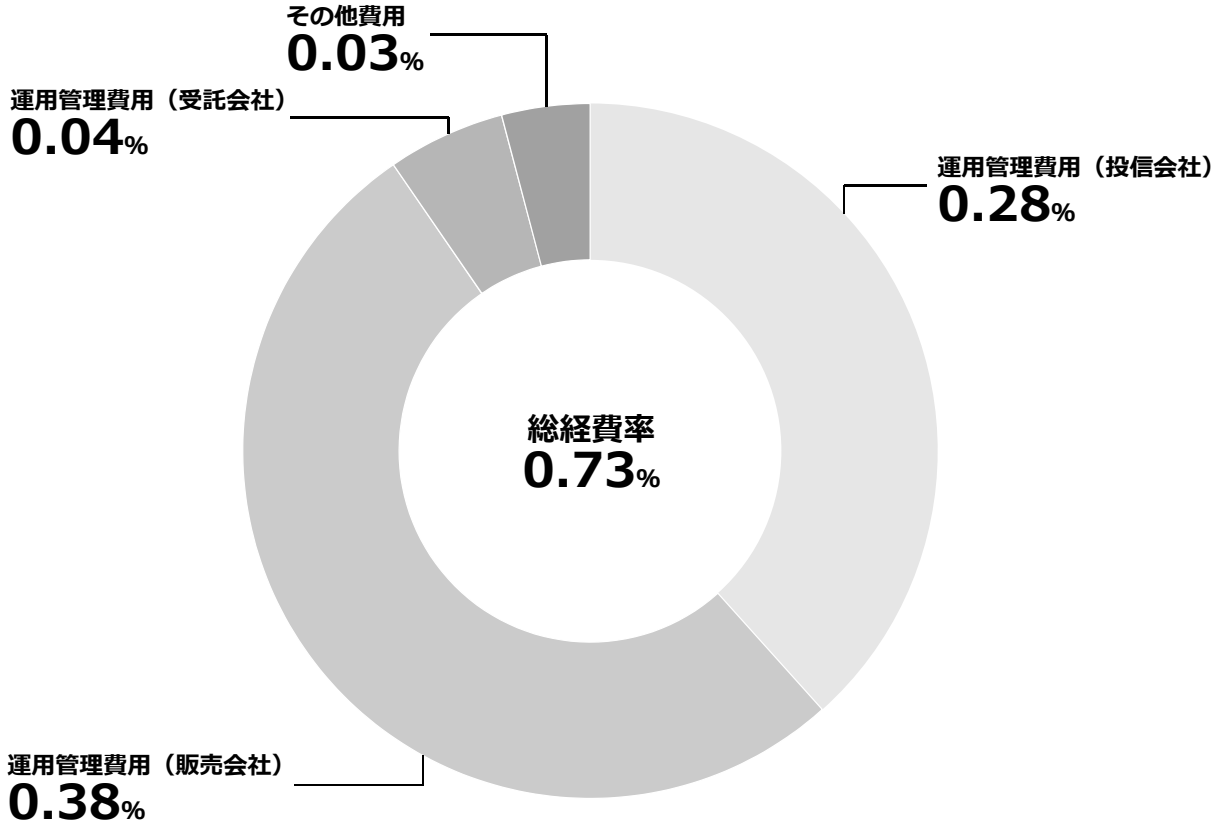
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を作成期中の平均受益権口数に作成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**0.73%**です。



(注1) 費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

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

◎売買および取引の状況('21年7月13日から'22年1月11日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 決 算 期              | 第 125 期 ~ 第 130 期 |             |              |              |
|--------------------|-------------------|-------------|--------------|--------------|
|                    | 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>4,312       | 千円<br>9,204 | 千口<br>10,379 | 千円<br>22,094 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('21年7月13日から'22年1月11日まで)

○公社債(米国社債インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

| 第 125 期 ~ 第 130 期                              |         |   |        |
|--|---------|---|--------|
| 買 付  |         | 売 付   |        |
| 銘 柄  | 金 額     | 銘 柄   | 金 額    |
|  | 千円      |   | 千円     |
| HSBC HOLDINGS PLC 2.871% 32/11/22(アメリカ)        | 114,106 | CVS HEALTH CORP 4.3% 28/3/25(アメリカ)            | 73,653 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383% 32/7/21(アメリカ)   | 79,864  | WALMART INC 3.7% 28/6/26(アメリカ)                | 51,539 |
| WALMART INC 1.5% 28/9/22(アメリカ)                 | 44,575  | LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907% 23/11/7(アメリカ) | 45,731 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC 1.322% 24/11/29(アメリカ) | 34,274  | ABBVIE INC 2.3% 22/11/21(アメリカ)                | 45,643 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES 2.875% 31/1/15(アメリカ)     | 29,439  | SHELL INTERNATIONAL FIN 3.4% 23/8/12(アメリカ)    | 42,029 |
| HP ENTERPRISE CO 2.25% 23/4/1(アメリカ)            | 28,812  | COMCAST CORP 3.6% 24/3/1(アメリカ)                | 36,192 |
| BARCLAYS PLC 2.894% 32/11/24(アメリカ)             | 28,440  | CHARTER COMM OPT LLC 4.464% 22/7/23(アメリカ)     | 33,907 |
| AVALONBAY COMMUNITIES 1.9% 28/12/1(アメリカ)       | 28,149  | HSBC HOLDINGS PLC 4.041% 28/3/13(アメリカ)        | 30,621 |
| CREDIT SUISSE NEW YORK 0.52% 23/8/9(アメリカ)      | 27,544  | BANK OF AMERICA CORP 1.734% 27/7/22(アメリカ)     | 30,087 |
| MICRON TECHNOLOGY INC 4.663% 30/2/15(アメリカ)     | 26,030  | HEALTHPEAK PROPERTIES 2.875% 31/1/15(アメリカ)    | 29,974 |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('21年7月13日から'22年1月11日まで)

当作成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('22年1月11日現在)

○親投資信託残高

| 種 類                | 前作成期末(第124期末) |               | 当作成期末(第130期末) |               |
|--------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
|                    | 口 数           | 評 価 額         | 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>77,297  | 千円<br>153,509 | 千口<br>71,230  | 千円<br>153,509 |

(注1) 単位未満は切り捨てています。

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

当作成期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('22年1月11日現在)

| 項 目                     | 当作成期末(第130期末) |       |
|-------------------------|---------------|-------|
|                         | 評 価 額         | 比 率   |
|                         | 千円            | %     |
| 米国社債インデックス・マザーファンド      | 153,509       | 99.6  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 540           | 0.4   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 154,049       | 100.0 |

(注1) 外貨建資産は、当作成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、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=115.34円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                     | (21年8月10日現在) | (21年9月10日現在) | (21年10月11日現在) | (21年11月10日現在) | (21年12月10日現在) | (22年1月11日現在) |
|-------------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|
|                         | 第125期末       | 第126期末       | 第127期末        | 第128期末        | 第129期末        | 第130期末       |
|                         | 円            | 円            | 円             | 円             | 円             | 円            |
| (A)資 産                  | 328,266,357  | 323,971,805  | 324,745,771   | 323,401,463   | 314,186,688   | 315,546,640  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等         | 152,485      | 493,443      | 150,420       | 203,169       | 146,989       | 160,935      |
| 米国社債インデックス・マザーファンド(評価額) | 163,475,263  | 159,528,805  | 158,356,806   | 154,662,355   | 154,627,987   | 153,509,525  |
| 未 収 入 金                 | 164,638,609  | 163,949,557  | 166,238,545   | 168,535,939   | 159,411,712   | 161,876,180  |
| (B)負 債                  | 165,452,895  | 164,319,793  | 167,256,505   | 167,240,717   | 158,714,705   | 162,634,261  |
| 未 払 金                   | 165,077,458  | 162,353,671  | 166,270,421   | 165,144,228   | 158,354,220   | 162,263,097  |
| 未 払 収 益 分 配 金           | 259,282      | 254,006      | 253,513       | 251,069       | 252,862       | 251,553      |
| 未 払 解 約 金               | 23,371       | 1,614,208    | 635,931       | 1,753,256     | 16,296        | 22,011       |
| 未 払 信 託 報 酬             | 91,361       | 96,411       | 95,163        | 90,754        | 89,937        | 96,104       |
| 未 払 利 息                 | -            | 1            | -             | -             | -             | -            |
| そ の 他 未 払 費 用           | 1,423        | 1,496        | 1,477         | 1,410         | 1,390         | 1,496        |
| (C)純 資 産 総 額 (A-B)      | 162,813,462  | 159,652,012  | 157,489,266   | 156,160,746   | 155,471,983   | 152,912,379  |
| 元 本                     | 172,854,920  | 169,337,500  | 169,009,319   | 167,379,817   | 168,574,815   | 167,702,345  |
| 次 期 繰 越 損 益 金           | △ 10,041,458 | △ 9,685,488  | △ 11,520,053  | △ 11,219,071  | △ 13,102,832  | △ 14,789,966 |
| (D)受 益 権 総 口 数          | 172,854,920口 | 169,337,500口 | 169,009,319口  | 167,379,817口  | 168,574,815口  | 167,702,345口 |
| 1万口当たり基準価額(C/Dx10,000)  | 9,419円       | 9,428円       | 9,318円        | 9,330円        | 9,223円        | 9,118円       |

(注1) 作成期首元本額 172,612,560円  
 作成期中追加設定元本額 11,836,468円  
 作成期中一部解約元本額 16,746,683円

(注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は第125期末10,041,458円、第126期末9,685,488円、第127期末11,520,053円、第128期末11,219,071円、第129期末13,102,832円、第130期末14,789,966円です。

◎損益の状況

第125期(自'21年 7月13日 至'21年 8月10日) 第126期(自'21年 8月11日 至'21年 9月10日) 第127期(自'21年 9月11日 至'21年10月11日)

第128期(自'21年10月12日 至'21年11月10日) 第129期(自'21年11月11日 至'21年12月10日) 第130期(自'21年12月11日 至'22年 1月11日)

| 項 目                 | 第 125 期          | 第 126 期          | 第 127 期          | 第 128 期          | 第 129 期          | 第 130 期          |
|---------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
|                     | 円                | 円                | 円                | 円                | 円                | 円                |
| (A)配 当 等 収 益        | △ 5              | △ 4              | △ 4              | △ 1              | △ 3              | △ 52             |
| 支 払 利 息             | △ 5              | △ 4              | △ 4              | △ 1              | △ 3              | △ 52             |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益  | 53,546           | 487,598          | △ 1,503,583      | 530,794          | △ 1,447,299      | △ 1,411,612      |
| 売 買 益               | 1,480,714        | 871,094          | 2,236,518        | 3,846,984        | 469,065          | 1,228,813        |
| 売 買 損               | △ 1,427,168      | △ 383,496        | △ 3,740,101      | △ 3,316,190      | △ 1,916,364      | △ 2,640,425      |
| (C)信 託 報 酬 等        | △ 98,724         | △ 97,907         | △ 96,640         | △ 92,164         | △ 91,327         | △ 97,600         |
| (D)当期損益金(A+B+C)     | △ 45,183         | 389,687          | △ 1,600,227      | 438,629          | △ 1,538,629      | △ 1,509,264      |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金    | △ 3,424,307      | △ 3,592,840      | △ 3,419,372      | △ 5,150,734      | △ 4,930,186      | △ 6,585,520      |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金  | △ 6,312,686      | △ 6,228,329      | △ 6,246,941      | △ 6,255,897      | △ 6,381,155      | △ 6,443,629      |
| ( 配 当 等 相 当 額 )     | ( 14,081,221 )   | ( 13,866,164 )   | ( 13,884,506 )   | ( 13,819,925 )   | ( 13,991,740 )   | ( 14,000,393 )   |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )   | ( △ 20,393,907 ) | ( △ 20,094,493 ) | ( △ 20,131,447 ) | ( △ 20,075,822 ) | ( △ 20,372,895 ) | ( △ 20,444,022 ) |
| (G)計 (D+E+F)        | △ 9,782,176      | △ 9,431,482      | △ 11,266,540     | △ 10,968,002     | △ 12,849,970     | △ 14,538,413     |
| (H)収 益 分 配 金        | △ 259,282        | △ 254,006        | △ 253,513        | △ 251,069        | △ 252,862        | △ 251,553        |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △ 10,041,458     | △ 9,685,488      | △ 11,520,053     | △ 11,219,071     | △ 13,102,832     | △ 14,789,966     |
| 追 加 信 託 差 損 益 金     | △ 6,312,686      | △ 6,228,329      | △ 6,246,941      | △ 6,255,897      | △ 6,381,155      | △ 6,443,629      |
| ( 配 当 等 相 当 額 )     | ( 14,086,076 )   | ( 13,869,806 )   | ( 13,889,195 )   | ( 13,823,486 )   | ( 13,998,173 )   | ( 14,005,697 )   |
| ( 売 買 損 益 相 当 額 )   | ( △ 20,398,762 ) | ( △ 20,098,135 ) | ( △ 20,136,136 ) | ( △ 20,079,383 ) | ( △ 20,379,328 ) | ( △ 20,449,326 ) |
| 分 配 準 備 積 立 金       | 5,390,623        | 5,307,145        | 5,297,790        | 5,246,698        | 5,275,768        | 5,209,257        |
| 繰 越 損 益 金           | △ 9,119,395      | △ 8,764,304      | △ 10,570,902     | △ 10,209,872     | △ 11,997,445     | △ 13,555,594     |

(注1) (B)有価証券売買損益は、各期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。期首金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注5) 分配金の計算過程

| 項 目                        | 第125期       | 第126期       | 第127期       | 第128期       | 第129期       | 第130期       |
|----------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| A 費用控除後の配当等収益              | 320,535円    | 332,917円    | 292,009円    | 308,428円    | 311,380円    | 280,752円    |
| B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円          | 0円          | 0円          | 0円          | 0円          | 0円          |
| C 収益調整金                    | 14,086,076円 | 13,869,806円 | 13,889,195円 | 13,823,486円 | 13,998,173円 | 14,005,697円 |
| D 分配準備積立金                  | 5,329,370円  | 5,228,234円  | 5,259,294円  | 5,189,339円  | 5,217,250円  | 5,180,058円  |
| E 分配対象収益(A+B+C+D)          | 19,735,981円 | 19,430,957円 | 19,440,498円 | 19,321,253円 | 19,526,803円 | 19,466,507円 |
| F 分配対象収益(1万口当たり)           | 1,141円      | 1,147円      | 1,150円      | 1,154円      | 1,158円      | 1,160円      |
| G 分配金                      | 259,282円    | 254,006円    | 253,513円    | 251,069円    | 252,862円    | 251,553円    |
| H 分配金(1万口当たり)              | 15円         | 15円         | 15円         | 15円         | 15円         | 15円         |

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

| 項 目                | 第125期<br>(2021年7月13日~<br>2021年8月10日) | 第126期<br>(2021年8月11日~<br>2021年9月10日) | 第127期<br>(2021年9月11日~<br>2021年10月11日) | 第128期<br>(2021年10月12日~<br>2021年11月10日) | 第129期<br>(2021年11月11日~<br>2021年12月10日) | 第130期<br>(2021年12月11日~<br>2022年1月11日) |
|--------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|--|--|---------------------------------------|
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 15円<br>0.159%                        | 15円<br>0.159%                        | 15円<br>0.161%                         | 15円<br>0.161%                          | 15円<br>0.162%                          | 15円<br>0.164%                         |
| 当期の収益              | 15円                                  | 15円                                  | 15円                                   | 15円                                    | 15円                                    | 15円                                   |
| 当期の収益以外            | -円                                   | -円                                   | -円                                    | -円                                     | -円                                     | -円                                    |
| 翌期繰越分配対象額          | 1,126円                               | 1,132円                               | 1,135円                                | 1,139円                                 | 1,143円                                 | 1,145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。

◎当作成期の分配金のお知らせ

| 決算期       | 第125期 | 第126期 | 第127期 | 第128期 | 第129期 | 第130期 |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金 | 15円   | 15円   | 15円   | 15円   | 15円   | 15円   |

## 米国社債インデックス・マザーファンド

### 第 12 期 運用報告書 (決算日 2021 年 3 月 5 日)

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

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

|             |   |
|-------------|---|
| 運 用 方 針     | <ul style="list-style-type: none"> <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 | 円   | 期中<br>騰落率 |            |            |               |
| 8期('17年 3月 6日)  | 17,663 | 3.9       | 17,737  | 4.0       | 98.1       | -          | 百万円<br>31,897 |
| 9期('18年 3月 5日)  | 16,632 | △ 5.8     | 16,701  | △ 5.8     | 98.7       | -          | 31,125        |
| 10期('19年 3月 5日) | 18,291 | 10.0      | 18,360  | 9.9       | 98.6       | -          | 33,532        |
| 11期('20年 3月 5日) | 19,595 | 7.1       | 19,618  | 6.9       | 98.9       | -          | 26,047        |
| 12期('21年 3月 5日) | 20,212 | 3.1       | 20,152  | 2.7       | 98.8       | -          | 22,604        |

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

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

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



## ◎当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日      | 基 準 価 額 |       | <ベンチマーク><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       | %     |   | %     | %           | %           |
| '20年 3月 5日 | 19,595  | -     | 19,618  | -     | 98.9        | -           |
| 3月末        | 18,479  | △ 5.7 | 18,519  | △ 5.6 | 100.0       | -           |
| 4月末        | 18,994  | △ 3.1 | 19,006  | △ 3.1 | 99.1        | -           |
| 5月末        | 19,438  | △ 0.8 | 19,445  | △ 0.9 | 99.2        | -           |
| 6月末        | 19,867  | 1.4   | 19,835  | 1.1   | 99.0        | -           |
| 7月末        | 19,571  | △ 0.1 | 19,544  | △ 0.4 | 98.9        | -           |
| 8月末        | 19,698  | 0.5   | 19,671  | 0.3   | 98.6        | -           |
| 9月末        | 19,783  | 1.0   | 19,759  | 0.7   | 98.4        | -           |
| 10月末       | 19,580  | △ 0.1 | 19,550  | △ 0.3 | 98.7        | -           |
| 11月末       | 19,651  | 0.3   | 19,613  | △ 0.0 | 98.9        | -           |
| 12月末       | 19,664  | 0.4   | 19,633  | 0.1   | 98.6        | -           |
| '21年 1月末   | 19,818  | 1.1   | 19,778  | 0.8   | 99.1        | -           |
| 2月末        | 19,933  | 1.7   | 19,853  | 1.2   | 99.1        | -           |
| (期 末)      |         |       |   |       |             |             |
| '21年 3月 5日 | 20,212  | 3.1   | 20,152  | 2.7   | 98.8        | -           |

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

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

当期の運用実績

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

基準価額とベンチマークの推移



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

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

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

## 基準価額の変動要因

### 【プラスの要因】

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

### 【マイナスの要因】

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

## ベンチマークとの比較

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

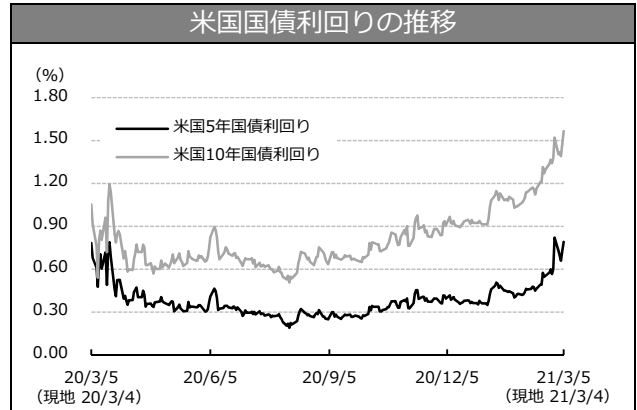
## 投資環境

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

### 米国債券市場

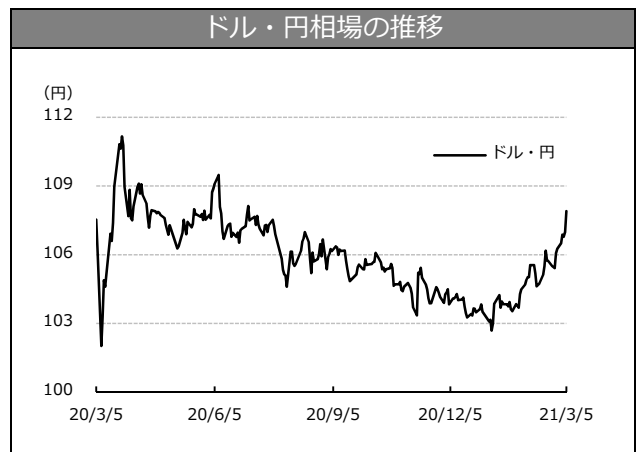
当期の米国の国債市場は、期前半、新型コロナウイルスが経済へ与える影響が懸念されたことが債券の買い材料となりました。FRBは2020年3月に2回の利下げを実施し、月間で合計1.50%の利下げを行いました。期後半に入ると雇用統計をはじめとする経済指標に底堅さが見られたことや新型コロナウイルスに対するワクチン開発の進展を背景に債券が売られました。期末にかけては財政支出の拡大見通しが債券のさらなる売り材料となりました。結果として、前期末の2020年3月5日(現地3月4日)に0.78%だった米国5年債利回りは、当期末の2021年3月5日(現地3月4日)には0.79%に小幅上昇となりました(債券価格はマイ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

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



### 為替市況

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



## 運用の概況

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

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

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

## 今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

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

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

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

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('20年3月6日から'21年3月5日まで)

○公社債

|     |                 | 買 付 額       | 売 付 額            |
|-----|-----------------|-------------|------------------|
| 外 国 | ア メ リ カ         | 千米ドル<br>811 | 千米ドル<br>811      |
|     |                 | 141,650     | 173,299<br>( 37) |
|     | 国債証券            |             |                  |
|     | 普通社債券(含む投資法人債券) |             |                  |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

(注3) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

◎主要な売買銘柄('20年3月6日から'21年3月5日まで)

○公社債

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('20年3月6日から'21年3月5日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

◎組入資産の明細('21年3月5日現在)

○外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分     | 当 期 末           |                 |                  |            |                      |           |           |           |
|---------|-----------------|-----------------|------------------|------------|----------------------|-----------|-----------|-----------|
|         | 額 面<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>192,854 | 千米ドル<br>206,988 | 千円<br>22,334,016 | %<br>98.8  | %<br>-               | %<br>49.4 | %<br>36.6 | %<br>12.6 |
| 合 計     | 192,854         | 206,988         | 22,334,016       | 98.8       | -                    | 49.4      | 36.6      | 12.6      |

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

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

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

(注4) 金額の単位未満は切り捨てています。

## ○外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('21年3月5日現在)

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('21年3月5日現在)

| 項 目                             | 当 期 末           |
|---------------------------------|-----------------|
|                                 | 円               |
| (A)資 産                          | 22,756,217,917  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                 | 201,531,426     |
| 公 社 債(評価額)                      | 22,334,016,375  |
| 未 収 入 金                         | 42,513,121      |
| 未 収 利 息                         | 169,157,314     |
| 前 払 費 用                         | 8,999,681       |
| (B)負 債                          | 152,072,238     |
| 未 払 金                           | 121,372,978     |
| 未 払 解 約 金                       | 30,699,189      |
| 未 払 利 息                         | 71              |
| (C)純 資 産 総 額(A-B)               | 22,604,145,679  |
| 元 本                             | 11,183,285,945  |
| 次 期 繰 越 損 益 金                   | 11,420,859,734  |
| (D)受 益 権 総 口 数                  | 11,183,285,945口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D×10,000) | 20,212円         |

(注1) 期首元本額 13,293,314,494円

期中追加設定元本額 5,147,124,646円

期中一部解約元本額 7,257,153,195円

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

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

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

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

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

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

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

◎損益の状況

当期 (自'20年3月6日 至'21年3月5日)

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

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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