

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年10月9日

【発行者名】 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

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 中川 祐子

【電話番号】 03 - 4530 - 7409

【届出の対象とした募集（売出）内国投資  
信託受益証券に係るファンドの名称】 ステート・ストリートUSボンド・オープン  
（為替ヘッジあり）

【届出の対象とした募集（売出）内国投資  
信託受益証券の金額】 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したことに伴い、2020年4月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の一部に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 【訂正箇所および訂正事項】

原届出書の該当事項を以下の内容に訂正します。

下線部\_\_\_\_\_は、訂正部分を示します。なお、図もしくは表が含まれる部分については、下線を省略する場合があります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### （3）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

<略>

ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

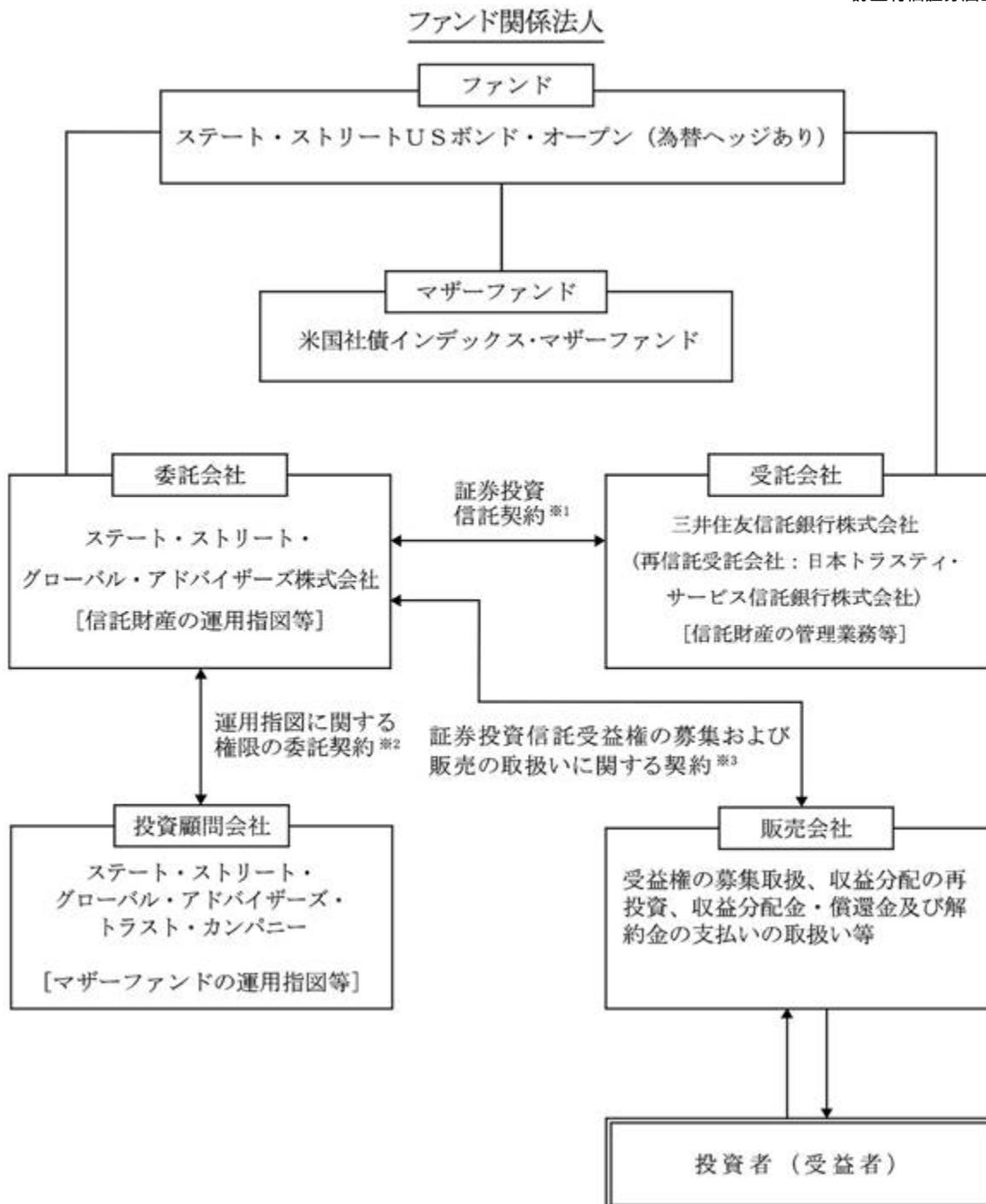
1)～2) <略>

3) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

4) <略>



1 &lt;略&gt;

2 &lt;略&gt;

3 &lt;略&gt;

&lt;略&gt;

&lt;訂正後&gt;

&lt;略&gt;

ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

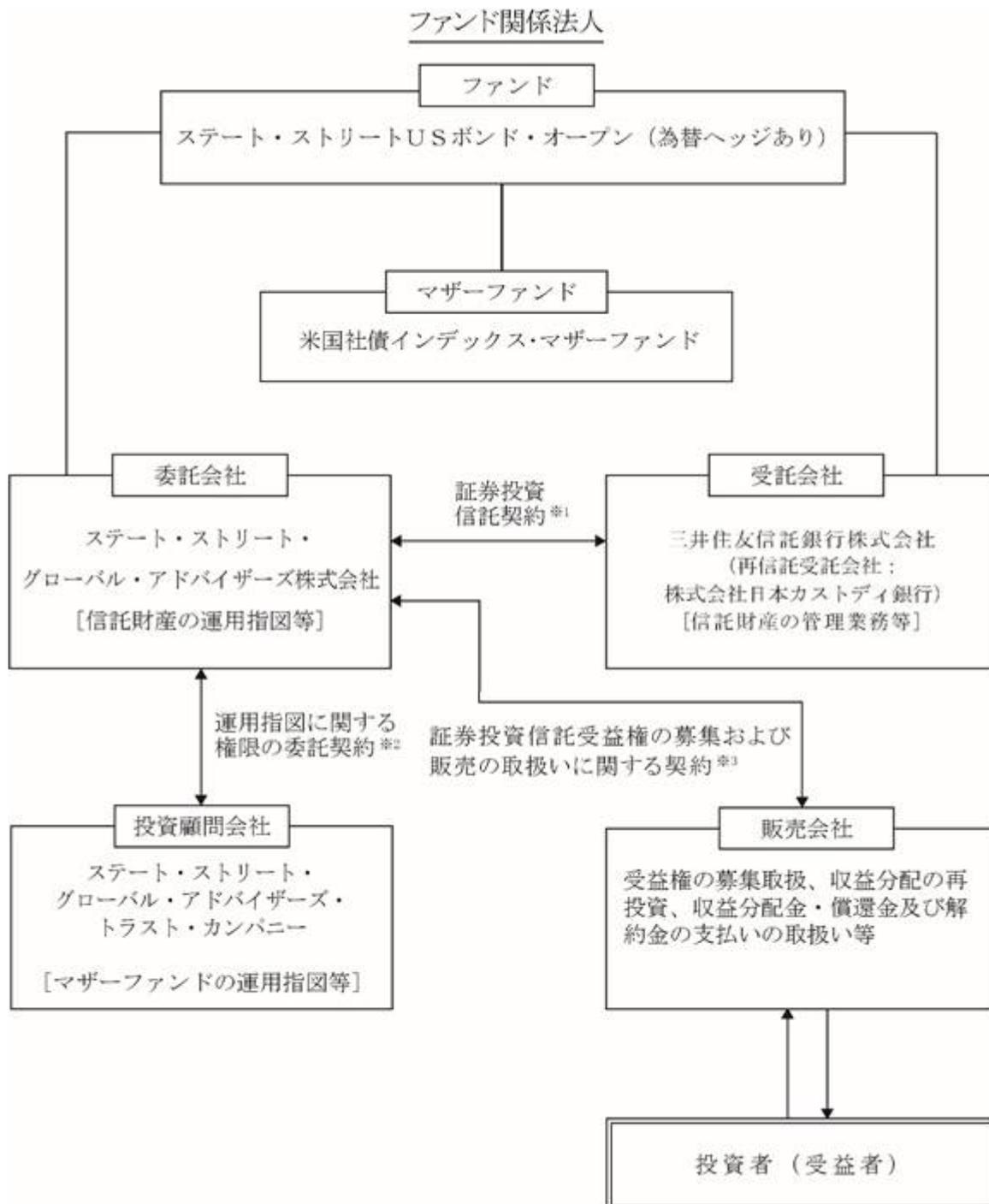
1)～2) &lt;略&gt;

3) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

4) <略>



1 <略>

2 <略>

3 <略>

<略>

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(1) ~ (3) &lt; 略 &gt;

**<参考情報> 代表的な資産クラスと騰落率の比較等**

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

<ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移> <ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較>



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
  - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
  - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
  - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
  - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
  - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

**「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数****日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)**

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

**先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)**

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

**新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)**

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

**日本国債:NOMURA-BPI国債**

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

**先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

**新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)**

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

&lt; 訂正後 &gt;

(1) ~ (3) &lt; 略 &gt;

## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ＜ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移＞



### ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
  - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
  - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
  - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
  - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
  - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

### 新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

<略>

<略>

上記は、2020年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

<訂正後>

<略>

<略>

上記は、2020年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

## 5【運用状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

## (1)【投資状況】

(2020年7月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	559,598,190	97.46
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		14,607,182	2.54
純資産総額		574,205,372	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(米国社債インデックス・マザーファンド)

(2020年7月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	701,391,195	2.75
	アメリカ	20,805,683,877	81.50
	イギリス	1,228,449,718	4.81
	カナダ	666,127,232	2.61
	オランダ	388,243,713	1.52
	ケイマン諸島	249,920,316	0.98
	オーストラリア	224,360,133	0.88
	アイルランド	187,845,554	0.73
	フランス	143,752,588	0.56
	スペイン	110,420,041	0.43
	スイス	109,481,468	0.43
	バミューダ	101,423,779	0.40
	ドイツ	70,686,817	0.28
	メキシコ	58,420,906	0.23
	ルクセンブルク	57,205,972	0.22
	スウェーデン	37,203,859	0.14
	ガーンジー	35,204,580	0.14
	オーストリア	23,064,300	0.09
	コロンビア	20,958,074	0.08
	チリ	17,803,938	0.07
シンガポール	14,765,809	0.06	
	小計	25,252,413,869	98.91
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		277,142,013	1.09
純資産総額		25,529,555,882	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## (2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2020年7月31日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
----	-------	----	-----	----	-------	---------	---------	---------	---------	---------

1	日本	親投資 信託受 益証券	米国社債インデックス・マザー ファンド		285,932,344	1.9880	568,435,465	1.9571	559,598,190	97.46
									投資比率：合計	97.46

(注1) 投資有価証券は1銘柄です。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	97.46
合計		97.46

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

#### <参考情報>

親投資信託受益証券（米国社債インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2020年7月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.004	2022/12/20	977,000	10,938.92	106,873,249	11,015.32	107,619,723	0.42
2	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & CO	3.069	2023/01/24	750,000	10,818.69	81,140,239	10,821.49	81,161,219	0.32
3	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.750	2025/05/22	600,000	11,435.42	68,612,571	11,658.98	69,953,921	0.27
4	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.419	2027/12/20	583,000	11,470.95	66,875,669	11,786.95	68,717,974	0.27
5	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.005	2025/03/13	600,000	10,568.50	63,411,030	10,895.65	65,373,910	0.26
6	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	2.900	2021/12/08	600,000	10,725.63	64,353,820	10,786.25	64,717,522	0.25
7	アメリカ	社債券	CHEVRON	2.954	2026/05/16	550,000	11,568.58	63,627,240	11,706.20	64,384,137	0.25
8	アメリカ	社債券	ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750	2029/01/23	500,000	11,953.98	59,769,930	12,847.94	64,239,716	0.25
9	アメリカ	社債券	CVS HEALTH CORP	4.300	2028/03/25	500,000	11,926.90	59,634,504	12,382.20	61,911,026	0.24
10	アメリカ	社債券	GILEAD SCIENCES INC	3.650	2026/03/01	500,000	11,792.77	58,963,856	12,069.35	60,346,789	0.24
11	アメリカ	社債券	APPLE INC	3.200	2025/05/13	500,000	11,403.63	57,018,173	11,731.52	58,657,646	0.23
12	アメリカ	社債券	BP CAP MARKETS AMERICA	3.119	2026/05/04	500,000	11,416.88	57,084,437	11,643.91	58,219,556	0.23
13	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & CO	3.000	2026/04/22	500,000	11,177.19	55,885,976	11,448.96	57,244,833	0.22
14	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	3.200	2023/01/25	500,000	11,026.79	55,133,990	11,156.78	55,783,902	0.22
15	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	3.250	2022/09/23	500,000	10,953.40	54,767,031	11,078.65	55,393,282	0.22
16	スイス	社債券	CREDIT SUISSE AG	3.000	2021/10/29	500,000	10,759.03	53,795,179	10,802.04	54,010,216	0.21
17	アメリカ	社債券	CVS HEALTH CORP	4.100	2025/03/25	450,000	11,586.61	52,139,783	11,889.70	53,503,687	0.21

18	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.700	2024/10/23	450,000	11,459.10	51,565,971	11,662.46	52,481,070	0.21
19	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.125	2026/07/27	450,000	11,291.75	50,812,893	11,646.81	52,410,660	0.21
20	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.493	2030/03/24	400,000	12,107.81	48,431,264	12,939.99	51,759,964	0.20
21	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.458	2024/03/15	450,000	11,248.76	50,619,463	11,384.27	51,229,221	0.20
22	アメリカ	社債券	BOEING CO	4.875	2025/05/01	445,000	10,767.52	47,915,481	11,305.32	50,308,701	0.20
23	アメリカ	社債券	COMCAST CORP	4.150	2028/10/15	390,000	12,304.09	47,985,982	12,816.16	49,983,044	0.20
24	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.271	2028/07/23	400,000	12,186.09	48,744,361	12,417.35	49,669,402	0.19
25	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.250	2027/10/01	400,000	11,969.16	47,876,675	12,301.58	49,206,349	0.19
26	オーストラリア	社債券	WESTPAC BANKING CORP	2.800	2022/01/11	450,000	10,770.04	48,465,221	10,837.62	48,769,333	0.19
27	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.183	2027/11/25	400,000	11,744.48	46,977,952	12,013.92	48,055,705	0.19
28	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.875	2026/01/27	400,000	11,837.61	47,350,473	12,003.30	48,013,222	0.19
29	アメリカ	社債券	ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN	3.650	2026/02/01	400,000	11,818.75	47,275,016	11,833.32	47,333,304	0.19
30	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	3.973	2029/05/22	400,000	11,567.87	46,271,512	11,826.08	47,304,337	0.19
										投資比率：合計	6.86

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 2020年7月31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ています。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
社債券	-	98.91
合計		98.91

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 2020年7月31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ています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

2020年7月31日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間・月末	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1特定期間	自2011年 2月10日 至2011年 7月11日	分配付：	12,289,979	分配付：	1.0243
		分配落：	12,247,985	分配落：	1.0208
第2特定期間	自2011年 7月12日 至2012年 1月10日	分配付：	19,090,137	分配付：	1.0050
		分配落：	19,023,657	分配落：	1.0015
第3特定期間	自2012年 1月11日 至2012年 7月10日	分配付：	46,117,549	分配付：	1.0244
		分配落：	45,959,988	分配落：	1.0209
第4特定期間	自2012年 7月11日 至2013年 1月10日	分配付：	105,121,010	分配付：	1.0325
		分配落：	104,764,679	分配落：	1.0290

第5特定期間	自2013年 1月11日 至2013年 7月10日	分配付： 152,528,696 分配落： 152,141,425	分配付： 0.9846 分配落： 0.9821
第6特定期間	自2013年 7月11日 至2014年 1月10日	分配付： 157,140,945 分配落： 156,743,048	分配付： 0.9873 分配落： 0.9848
第7特定期間	自2014年 1月11日 至2014年 7月10日	分配付： 144,333,400 分配落： 143,972,424	分配付： 0.9996 分配落： 0.9971
第8特定期間	自2014年 7月11日 至2015年 1月13日	分配付： 176,519,736 分配落： 176,078,133	分配付： 0.9993 分配落： 0.9968
第9特定期間	自2015年 1月14日 至2015年 7月10日	分配付： 1,746,909,309 分配落： 1,742,428,730	分配付： 0.9747 分配落： 0.9722
第10特定期間	自2015年 7月11日 至2016年 1月12日	分配付： 1,774,272,723 分配落： 1,770,579,465	分配付： 0.9608 分配落： 0.9588
第11特定期間	自2016年 1月13日 至2016年 7月11日	分配付： 1,841,789,217 分配落： 1,838,059,813	分配付： 0.9877 分配落： 0.9857
第12特定期間	自2016年 7月12日 至2017年 1月10日	分配付： 1,816,999,127 分配落： 1,813,167,409	分配付： 0.9484 分配落： 0.9464
第13特定期間	自2017年 1月11日 至2017年 7月10日	分配付： 1,015,061,701 分配落： 1,012,916,336	分配付： 0.9463 分配落： 0.9443
第14特定期間	自2017年 7月11日 至2018年 1月10日	分配付： 994,296,334 分配落： 992,696,548	分配付： 0.9323 分配落： 0.9308
第15特定期間	自2018年 1月11日 至2018年 7月10日	分配付： 575,846,177 分配落： 574,885,902	分配付： 0.8995 分配落： 0.8980
第16特定期間	自2018年 7月11日 至2019年 1月10日	分配付： 567,128,533 分配落： 566,168,417	分配付： 0.8860 分配落： 0.8845
第17特定期間	自2019年 1月11日 至2019年 7月10日	分配付： 551,378,844 分配落： 550,479,241	分配付： 0.9194 分配落： 0.9179
第18特定期間	自2019年 7月11日 至2020年 1月10日	分配付： 559,809,218 分配落： 558,901,918	分配付： 0.9255 分配落： 0.9240
第19特定期間	自2020年 1月11日 至2020年 7月10日	分配付： 571,138,826 分配落： 570,237,331	分配付： 0.9503 分配落： 0.9488
	2019年 7月末日	551,749,622	0.9214
	8月末日	562,237,442	0.9325
	9月末日	560,318,179	0.9268
	10月末日	558,822,347	0.9253
	11月末日	560,115,032	0.9249
	12月末日	559,289,299	0.9256
	2020年 1月末日	565,234,571	0.9330
	2月末日	563,828,978	0.9362
	3月末日	526,647,328	0.8796
	4月末日	548,260,149	0.9155
	5月末日	573,320,811	0.9285
	6月末日	568,261,664	0.9445
	7月末日	574,205,372	0.9556

## 【分配の推移】

特定期間	計算期間	一口当たりの分配金
第1特定期間	自2011年 2月10日 至2011年 7月11日	0.0140円

第2特定期間	自2011年 7月12日 至2012年 1月10日	0.0210円
第3特定期間	自2012年 1月11日 至2012年 7月10日	0.0210円
第4特定期間	自2012年 7月11日 至2013年 1月10日	0.0210円
第5特定期間	自2013年 1月11日 至2013年 7月10日	0.0200円
第6特定期間	自2013年 7月11日 至2014年 1月10日	0.0150円
第7特定期間	自2014年 1月11日 至2014年 7月10日	0.0150円
第8特定期間	自2014年 7月11日 至2015年 1月13日	0.0150円
第9特定期間	自2015年 1月14日 至2015年 7月10日	0.0150円
第10特定期間	自2015年 7月11日 至2016年 1月12日	0.0120円
第11特定期間	自2016年 1月13日 至2016年 7月11日	0.0120円
第12特定期間	自2016年 7月12日 至2017年 1月10日	0.0120円
第13特定期間	自2017年 1月11日 至2017年 7月10日	0.0120円
第14特定期間	自2017年 7月11日 至2018年 1月10日	0.0110円
第15特定期間	自2018年 1月11日 至2018年 7月10日	0.0090円
第16特定期間	自2018年 7月11日 至2019年 1月10日	0.0090円
第17特定期間	自2019年 1月11日 至2019年 7月10日	0.0090円
第18特定期間	自2019年 7月11日 至2020年 1月10日	0.0090円
第19特定期間	自2020年 1月11日 至2020年 7月10日	0.0090円

## 【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率
第1特定期間	自2011年 2月10日 至2011年 7月11日	3.5%
第2特定期間	自2011年 7月12日 至2012年 1月10日	0.2%
第3特定期間	自2012年 1月11日 至2012年 7月10日	4.1%
第4特定期間	自2012年 7月11日 至2013年 1月10日	2.9%

第5特定期間	自2013年 1月11日 至2013年 7月10日	2.7%
第6特定期間	自2013年 7月11日 至2014年 1月10日	1.8%
第7特定期間	自2014年 1月11日 至2014年 7月10日	2.8%
第8特定期間	自2014年 7月11日 至2015年 1月13日	1.5%
第9特定期間	自2015年 1月14日 至2015年 7月10日	1.0%
第10特定期間	自2015年 7月11日 至2016年 1月12日	0.1%
第11特定期間	自2016年 1月13日 至2016年 7月11日	4.1%
第12特定期間	自2016年 7月12日 至2017年 1月10日	2.8%
第13特定期間	自2017年 1月11日 至2017年 7月10日	1.1%
第14特定期間	自2017年 7月11日 至2018年 1月10日	0.3%
第15特定期間	自2018年 1月11日 至2018年 7月10日	2.6%
第16特定期間	自2018年 7月11日 至2019年 1月10日	0.5%
第17特定期間	自2019年 1月11日 至2019年 7月10日	4.8%
第18特定期間	自2019年 7月11日 至2020年 1月10日	1.6%
第19特定期間	自2020年 1月11日 至2020年 7月10日	3.7%

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

#### （４）【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1特定期間	自2011年 2月10日 至2011年 7月11日	12,542,829	544,274	11,998,555
第2特定期間	自2011年 7月12日 至2012年 1月10日	8,802,471	1,806,638	18,994,388
第3特定期間	自2012年 1月11日 至2012年 7月10日	35,301,595	9,278,374	45,017,609
第4特定期間	自2012年 7月11日 至2013年 1月10日	140,341,820	83,550,520	101,808,909
第5特定期間	自2013年 1月11日 至2013年 7月10日	125,958,316	72,858,454	154,908,771
第6特定期間	自2013年 7月11日 至2014年 1月10日	58,029,133	53,779,085	159,158,819
第7特定期間	自2014年 1月11日 至2014年 7月10日	32,039,055	46,807,086	144,390,788

第8特定期間	自2014年 7月11日 至2015年 1月13日	58,411,321	26,160,530	176,641,579
第9特定期間	自2015年 1月14日 至2015年 7月10日	1,677,214,943	61,624,789	1,792,231,733
第10特定期間	自2015年 7月11日 至2016年 1月12日	130,226,939	75,829,549	1,846,629,123
第11特定期間	自2016年 1月13日 至2016年 7月11日	53,403,447	35,330,466	1,864,702,104
第12特定期間	自2016年 7月12日 至2017年 1月10日	80,789,727	29,632,521	1,915,859,310
第13特定期間	自2017年 1月11日 至2017年 7月10日	60,312,061	903,488,515	1,072,682,856
第14特定期間	自2017年 7月11日 至2018年 1月10日	46,440,805	52,599,438	1,066,524,223
第15特定期間	自2018年 1月11日 至2018年 7月10日	39,211,070	465,551,437	640,183,856
第16特定期間	自2018年 7月11日 至2019年 1月10日	41,772,875	41,879,063	640,077,668
第17特定期間	自2019年 1月11日 至2019年 7月10日	22,055,607	62,397,885	599,735,390
第18特定期間	自2019年 7月11日 至2020年 1月10日	24,009,119	18,877,482	604,867,027
第19特定期間	自2020年 1月11日 至2020年 7月10日	51,902,134	55,772,307	600,996,854

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## (参考情報) 運用実績

(2020年7月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。分配金再投資基準価額は税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

基準価額	9,556円
純資産総額	574百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第107期 (2020年2月10日)	15円
第108期 (2020年3月10日)	15円
第109期 (2020年4月10日)	15円
第110期 (2020年5月11日)	15円
第111期 (2020年6月10日)	15円
第112期 (2020年7月10日)	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	2,610円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

(マザーファンドのデータを表示しています。)

## 上位10銘柄\*

銘柄名	比率	残存年数
BANK OF AMERICA CORP	3.004%	'22/12/20
WELLS FARGO	3.069%	'23/01/24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.750%	'25/05/22
BANK OF AMERICA CORP	3.419%	'27/12/20
JPMORGAN CHASE & CO	2.005%	'25/03/13
CITIGROUP INC	2.900%	'21/12/08
CHEVRON	2.954%	'26/05/16
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750%	'29/01/23
CVS HEALTH CORP	4.300%	'28/03/25
GILEAD SCIENCES INC	3.650%	'26/03/01

※比率はマザーファンド純資産総額対比です。

## セクター別構成比\*

セクター	ファンド	ベンチマーク	差
公益	5.52%	5.30%	0.22%
金融	38.29%	38.95%	-0.66%
産業	55.90%	55.75%	0.14%
その他	0.00%	0.00%	0.00%

## 格付別構成比\*

格付	ファンド	ベンチマーク	差
AAA格	0.88%	0.99%	-0.11%
AA格	6.60%	6.82%	-0.22%
A格	43.74%	43.49%	0.24%
BBB格	48.49%	48.70%	-0.21%
BB格以下	0.00%	0.00%	0.00%

## 残存年数別構成比\*

残存年数	ファンド	ベンチマーク	差
1年未満	0.00%	0.82%	-0.82%
1～3年	25.52%	25.60%	-0.08%
3～7年	48.53%	46.84%	1.69%
7～10年	25.64%	26.74%	-1.10%
10年以上	0.01%	0.00%	0.01%

※ファンドの比率はマザーファンド純資産総額対比です。

## ファンド特性値

	ファンド	ベンチマーク
修正デュレーション(年)	4.56	4.49
最終利回り	1.37%	1.35%
オプション調整後スプレッド	1.01%	1.01%

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2011年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2020年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から7月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

### 第3【ファンドの経理状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2020年1月11日から2020年7月10日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ステート・ストリートUSボンド・オープン(為替ヘッジあり)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 (2020年 1月10日現在)	当期 (2020年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	225	1,196
コール・ローン	486,723	478,779
親投資信託受益証券	559,058,764	568,516,977
派生商品評価勘定	5,754	1,134,799
未収入金	1,384,927	1,350,000
流動資産合計	560,936,393	571,481,751
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	765,981	8,725
未払収益分配金	907,300	901,495
未払解約金	22,877	425
未払受託者報酬	20,822	20,539
未払委託者報酬	312,300	308,108
未払利息	1	1
その他未払費用	5,194	5,127
流動負債合計	2,034,475	1,244,420
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 604,867,027	1 600,996,854
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3 45,965,109	3 30,759,523
(分配準備積立金)	13,684,039	15,331,347
元本等合計	558,901,918	570,237,331
<b>純資産合計</b>		
<b>負債純資産合計</b>		
	560,936,393	571,481,751

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期	当期
	自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日	自 2020年 1月11日 至 2020年 7月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	22,039,218	14,950,175
為替差損益	11,018,668	7,769,722
営業収益合計	11,020,550	22,719,897
営業費用		
支払利息	237	253
受託者報酬	122,576	122,341
委託者報酬	1 1,838,594	1 1,835,092
その他費用	41,382	30,531
営業費用合計	2,002,789	1,988,217
営業利益又は営業損失（ ）	9,017,761	20,731,680
経常利益又は経常損失（ ）	9,017,761	20,731,680
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,017,761	20,731,680
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	11,867	223,220
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	49,256,149	45,965,109
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,448,938	4,576,569
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,448,938	4,576,569
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,748,684	4,423,006
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,748,684	4,423,006
分配金	2 5,438,842	2 5,456,437
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	45,965,109	30,759,523

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 (2020年 1月10日現在)	当期 (2020年 7月10日現在)
1 期首元本額	599,735,390円	604,867,027円
期中追加設定元本額	24,009,119円	51,902,134円
期中一部解約元本額	18,877,482円	55,772,307円
2 受益権の総数	604,867,027口	600,996,854口
3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は45,965,109円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は30,759,523円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前期 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日	当期 自 2020年 1月11日 至 2020年 7月10日
1 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に対して年率0.11%の額	同左

## 2 分配金の計算過程

(2019年7月11日から2019年8月13日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,322,399円)、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)、収益調整金(42,862,361円)及び分配準備積立金(10,806,876円)より分配対象収益は55,991,636円(1万口当たり931円)であり、うち901,629円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(2019年8月14日から2019年9月10日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,217,606円)、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)、収益調整金(43,187,889円)及び分配準備積立金(12,172,409円)より分配対象収益は56,577,904円(1万口当たり937円)であり、うち905,665円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(2019年9月11日から2019年10月10日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,276,747円)、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)、収益調整金(43,518,420円)及び分配準備積立金(12,408,760円)より分配対象収益は57,203,927円(1万口当たり943円)であり、うち909,446円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(2020年1月11日から2020年2月10日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,509,000円)、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)、収益調整金(43,693,801円)及び分配準備積立金(13,645,600円)より分配対象収益は58,848,401円(1万口当たり972円)であり、うち908,057円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(2020年2月11日から2020年3月10日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,227,374円)、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)、収益調整金(43,535,245円)及び分配準備積立金(14,072,677円)より分配対象収益は58,835,296円(1万口当たり977円)であり、うち902,470円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(2020年3月11日から2020年4月10日までの計算期間)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,259,065円)、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)、収益調整金(43,765,189円)及び分配準備積立金(14,204,402円)より分配対象収益は59,228,656円(1万口当たり984円)であり、うち902,395円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

	<p>(2019年10月11日から2019年11月11日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,246,250円)、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)、収益調整金(43,457,355円)及び分配準備積立金(12,694,064円)より分配対象収益は57,397,669円(1万口当たり949円)であり、うち906,782円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2019年11月12日から2019年12月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,305,855円)、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)、収益調整金(43,589,600円)及び分配準備積立金(12,991,023円)より分配対象収益は57,886,478円(1万口当たり956円)であり、うち908,020円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2019年12月11日から2020年1月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,245,674円)、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)、収益調整金(43,596,583円)及び分配準備積立金(13,345,665円)より分配対象収益は58,187,922円(1万口当たり961円)であり、うち907,300円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2020年4月11日から2020年5月11日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,351,847円)、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)、収益調整金(46,341,709円)及び分配準備積立金(14,434,483円)より分配対象収益は62,128,039円(1万口当たり991円)であり、うち939,876円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2020年5月12日から2020年6月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,394,430円)、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)、収益調整金(44,615,139円)及び分配準備積立金(14,228,496円)より分配対象収益は60,238,065円(1万口当たり1,001円)であり、うち902,144円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2020年6月11日から2020年7月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,581,301円)、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)、収益調整金(44,654,092円)及び分配準備積立金(14,651,541円)より分配対象収益は60,886,934円(1万口当たり1,013円)であり、うち901,495円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
--	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
----------------	---

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、外貨建資産の為替変動リスクを回避するために利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 (2020年 1月10日現在)	当期 (2020年 7月10日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
---------------------------	--	----

## (有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	前 期 (2020年 1月10日現在)	当 期 (2020年 7月10日現在)
	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,642,905	4,341,681
合 計	7,642,905	4,341,681

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	前 期 (2020年 1月10日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,948,316		2,954,070	5,754
	売建				
	アメリカ・ドル	559,648,761		560,414,742	765,981
	合 計	562,597,077		563,368,812	760,227

(単位：円)

区 分	種 類	当 期 (2020年 7月10日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,685,725		2,677,000	8,725
	売建				
	アメリカ・ドル	568,139,764		567,004,965	1,134,799
	合 計	570,825,489		569,681,965	1,126,074

(注) 1 . 時価の算定方法

(1)特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・特定期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)特定期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当する事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	前期 ( 2020年 1月10日現在 )	当期 ( 2020年 7月10日現在 )
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	0.9240円 ( 9,240円 )	0.9488円 ( 9,488円 )

( 4 ) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	米国社債インデックス・マザーファンド	285,974,335	568,516,977	
合計		285,974,335	568,516,977	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

< 参考 >

当ファンドは「米国社債インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「米国社債インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2020年 1月10日現在)	(2020年 7月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		17,358,049	998,458,601
金銭信託		12,768	44,931
コール・ローン		27,677,397	17,980,696
社債券		25,398,598,747	24,929,086,084
派生商品評価勘定		270	35,985
未収入金		105,157,342	
未収利息		233,011,037	202,400,675
前払費用		5,889,267	3,068,227
流動資産合計		25,787,704,877	26,151,075,199
資産合計		25,787,704,877	26,151,075,199
負債の部			
流動負債			
未払金		112,536,389	959,026,442
未払解約金		9,701,927	10,498,000
未払利息		75	49
その他未払費用			8
流動負債合計		122,238,391	969,524,499
負債合計		122,238,391	969,524,499
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,244,897,064	12,666,470,993
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		12,420,569,422	12,515,079,707
元本等合計		25,665,466,486	25,181,550,700
純資産合計		25,665,466,486	25,181,550,700
負債純資産合計		25,787,704,877	26,151,075,199

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
---------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2020年 1月10日現在)	(2020年 7月10日現在)
1 期首元本額	18,489,042,336円	13,244,897,064円
期中追加設定元本額	865,403,475円	1,105,916,438円
期中一部解約元本額	6,109,548,747円	1,684,342,509円
元本の内訳		
ファンド名		
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＞	10,378,526,064円	9,096,923,766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）	288,501,788円	285,974,335円
米国社債インデックス・ファンド/ 為替ヘッジ付き＜適格機関投資家転 売制限付少人数私募投信＞	454,430,141円	454,472,890円
ステート・ストリート米国社債イン デックス・オープン（為替ヘッジあ り）	1,858,915,766円	2,590,242,493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	264,523,305円	238,857,509円
計	13,244,897,064円	12,666,470,993円
2 受益権の総数	13,244,897,064口	12,666,470,993口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p>
----------------	--

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、外貨建資産の為替変動リスクを回避するために利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2020年 1月10日現在)	(2020年 7月10日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
---------------------------	--	----

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2020年 1月10日現在)	(2020年 7月10日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
社債券	1,112,107,152	331,154,171
合計	1,112,107,152	331,154,171

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までを指しております。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 1月10日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	5,000,000		4,999,730	270
	合 計	5,000,000		4,999,730	270

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 7月10日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	2,700,000		2,700,471	471
	売建 アメリカ・ドル	7,000,000		6,964,486	35,514
	合 計	9,700,000		9,664,957	35,985

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当する事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	( 2020年 1月10日現在 )	( 2020年 7月10日現在 )
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.9378円 ( 19,378円 )	1.9880円 ( 19,880円 )

( 3 ) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカ・ドル	3M CO 1.625% 21/09/19	150,000	151,971.97	
		3M CO 3% 25/08/07	150,000	167,735.98	
		3M COMPANY 1.75% 23/02/14	100,000	103,454.58	
		3M COMPANY 2% 25/02/14	100,000	105,997.61	
		3M COMPANY 2.375% 29/08/26	100,000	108,859.41	
		3M COMPANY 3.05% 30/04/15	100,000	114,847.14	
		ABB FINANCE USA INC 2.875% 22/05/08	250,000	260,083.69	
		ABBOTT LABORATORIES 2.95% 25/03/15	100,000	110,151.27	
		ABBOTT LABORATORIES 3.75% 26/11/30	213,000	249,600.20	
		ABBVIE 3.2% 26/05/14	200,000	221,161.08	
		ABBVIE INC 2.15% 21/11/19	150,000	153,137.40	
		ABBVIE INC 2.3% 22/11/21	295,000	305,910.63	
		ABBVIE INC 2.6% 24/11/21	330,000	351,519.18	
		ABBVIE INC 2.9% 22/11/06	200,000	210,288.84	
		ABBVIE INC 2.95% 26/11/21	145,000	158,706.75	
		ABBVIE INC 3.2% 29/11/21	380,000	422,573.09	
		ABBVIE INC 3.25% 22/10/01	300,000	315,827.90	
		ABBVIE INC 3.45% 22/03/15	100,000	104,192.86	
		ABBVIE INC 3.6% 25/05/14	100,000	111,100.74	
		ABBVIE INC 3.8% 25/03/15	200,000	223,138.33	

ACTIVISION BLIZZARD 2.3% 21/09/15	65,000	66,281.79
ACTIVISION BLIZZARD 3.4% 26/09/15	100,000	114,471.42
ADOBE SYSTEMS INC 3.25% 25/02/01	200,000	222,885.06
AEP TRANSMISSION CO LLC 3.1% 26/12/01	50,000	55,967.24
AERCAP IRELAND CAP LTD/A 3.95% 22/02/01	300,000	300,014.78
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 2.875% 24/08/14	150,000	141,388.74
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.65% 27/07/21	150,000	136,928.49
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.875% 24/01/16	150,000	149,211.13
AETNA INC 2.75% 22/11/15	100,000	104,131.71
AETNA INC 3.5% 24/11/15	100,000	109,299.36
AFFILIATED MANAGERS GROU 3.3% 30/06/15	70,000	72,616.67
AFLAC INC 2.875% 26/10/15	50,000	54,326.76
AFLAC INC 3.25% 25/03/17	100,000	112,687.21
AFLAC INC 3.6% 30/04/01	65,000	76,789.59
AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.1% 30/06/04	60,000	62,433.49
AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.75% 29/09/15	10,000	10,940.67
AGILENT TECHNOLOGIES INC 3.05% 26/09/22	65,000	71,455.94
AGL CAPITAL CORP 3.5% 21/09/15	150,000	154,054.85
AIR LEASE CORP 2.3% 25/02/01	150,000	143,536.61
AIR LEASE CORP 2.75% 23/01/15	250,000	248,675.15
AIR LEASE CORP 3.625% 27/12/01	150,000	148,122.90
AIR LEASE CORP 3.75% 26/06/01	50,000	50,864.46
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 1.5% 25/10/15	40,000	41,407.10
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 2.05% 30/05/15	35,000	37,285.86
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 3.35% 24/07/31	50,000	54,610.51
AIRCASTLE LTD 4.125% 24/05/01	50,000	48,919.37
AIRCASTLE LTD 4.25% 26/06/15	65,000	60,011.70
AIRCASTLE LTD 5% 23/04/01	50,000	49,638.33
ALABAMA POWER CO 2.45% 22/03/30	100,000	103,294.77
ALBERMALE WOD PTY LTD 3.45% 29/11/15	25,000	24,309.48
ALEXANDRIA REAL ESTATE E 3.45% 25/04/30	100,000	111,219.59
ALEXANDRIA REAL ESTATE E 4% 24/01/15	100,000	110,443.06
ALIBABA GROUP HOLDING 3.125% 21/11/28	200,000	206,065.53
ALIBABA GROUP HOLDING 3.4% 27/12/06	200,000	224,615.74
ALIBABA GROUP HOLDING 3.6% 24/11/28	100,000	109,150.33
ALLEGION US HOLDING CO 3.2% 24/10/01	50,000	52,234.44
ALLEGION US HOLDING CO 3.55% 27/10/01	50,000	53,029.35
ALLIED WORLD ASSURANCE 4.35% 25/10/29	50,000	52,347.72
ALLSTATE CORP 3.15% 23/06/15	100,000	107,548.06
ALLSTATE CORP 5.75% 53/08/15	100,000	104,050.00
ALLY FINANCIAL INC 3.875% 24/05/21	250,000	259,345.16
ALPHABET INC 1.998% 26/08/15	100,000	107,495.89
ALTRIA GROUP INC 2.35% 25/05/06	40,000	42,256.42
ALTRIA GROUP INC 2.85% 22/08/09	200,000	208,620.00
ALTRIA GROUP INC 3.4% 30/05/06	25,000	27,470.95
ALTRIA GROUP INC 4.4% 26/02/14	300,000	345,670.12
ALTRIA GROUP INC 4.8% 29/02/14	150,000	177,809.70
AMAZON COM INC 5.2% 25/12/03	50,000	61,546.23

AMAZON.COM INC 0.8% 25/06/03	100,000	101,056.11
AMAZON.COM INC 1.2% 27/06/03	200,000	203,483.64
AMAZON.COM INC 1.5% 30/06/03	100,000	102,204.23
AMAZON.COM INC 2.8% 24/08/22	100,000	108,873.06
AMAZON.COM INC 3.15% 27/08/22	100,000	114,423.90
AMAZON.COM INC 3.8% 24/12/05	200,000	227,034.20
AMER AIRLN 15-1 A PTT 3.375% 28/11/01	150,476	126,479.64
AMEREN CORP 3.65% 26/02/15	100,000	112,633.82
AMEREN ILLINOIS CO 2.7% 22/09/01	100,000	103,907.63
AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.875% 30/05/07	200,000	212,602.00
AMERICAN CAMPUS CMNTYS 3.3% 26/07/15	100,000	103,581.66
AMERICAN ELECTRIC POWER 2.95% 22/12/15	150,000	157,528.57
AMERICAN EXPRESS CO 2.75% 22/05/20	200,000	207,748.89
AMERICAN EXPRESS CO 3% 24/10/30	100,000	108,555.95
AMERICAN EXPRESS CO 3.4% 23/02/27	200,000	213,738.28
AMERICAN EXPRESS CO 3.625% 24/12/05	350,000	389,544.57
AMERICAN EXPRESS CO 3.7% 21/11/05	105,000	109,120.65
AMERICAN EXPRESS CO 4.2% 25/11/06	105,000	123,297.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP 3.5% 26/08/15	50,000	53,934.01
AMERICAN HOMES 4 RENT 4.25% 28/02/15	150,000	163,771.79
AMERICAN HONDA FINANCE 0.875% 23/07/07	65,000	65,056.64
AMERICAN HONDA FINANCE 1.95% 22/05/20	30,000	30,771.09
AMERICAN HONDA FINANCE 1.95% 23/05/10	100,000	103,441.25
AMERICAN HONDA FINANCE 2.15% 24/09/10	100,000	105,196.87
AMERICAN HONDA FINANCE 3.375% 21/12/10	100,000	103,881.49
AMERICAN HONDA FINANCE 3.5% 28/02/15	100,000	114,819.46
AMERICAN HONDA FINANCE 3.625% 23/10/10	75,000	81,376.23
AMERICAN HONDA FINANCE C 1.7% 21/09/09	150,000	152,104.74
AMERICAN INTL GROUP 2.5% 25/06/30	100,000	106,572.21
AMERICAN INTL GROUP 3.4% 30/06/30	200,000	221,777.04
AMERICAN INTL GROUP 4.2% 28/04/01	75,000	86,580.59
AMERICAN INTL GROUP 5.75% 48/04/01	100,000	104,303.91
AMERICAN TOWER CORP 2.75% 27/01/15	100,000	108,266.54
AMERICAN TOWER CORP 2.9% 30/01/15	50,000	54,476.22
AMERICAN TOWER CORP 3% 23/06/15	50,000	53,444.51
AMERICAN TOWER CORP 3.55% 27/07/15	100,000	113,020.13
AMERICAN TOWER CORP 3.8% 29/08/15	100,000	114,846.94
AMERICAN TOWER CORP 3.95% 29/03/15	100,000	116,095.21
AMERICAN TOWER CORP 4% 25/06/01	200,000	227,201.64
AMERICAN TOWER CORP 5% 24/02/15	100,000	114,731.33
AMERICAN WATER CAPITAL 3.4% 25/03/01	100,000	110,897.88
AMERICAN WATER CAPITAL 3.75% 28/09/01	100,000	117,138.45
AMERIPRISE FINANCIAL INC 4% 23/10/15	150,000	166,645.28
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 30/05/15	100,000	106,738.71
AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45% 27/12/15	100,000	114,282.79
AMGEN INC 1.9% 25/02/21	65,000	68,014.09
AMGEN INC 2.2% 27/02/21	70,000	74,449.86
AMGEN INC 2.25% 23/08/19	100,000	105,392.46

AMGEN INC 2.6% 26/08/19	200,000	217,847.62
AMGEN INC 2.65% 22/05/11	50,000	51,924.20
AMGEN INC 3.625% 22/05/15	150,000	156,928.29
AMGEN INC 3.875% 21/11/15	82,857	85,943.90
AMPHENOL CORP 2.05% 25/03/01	100,000	103,957.80
ANALOG DEVICES INC 2.5% 21/12/05	30,000	30,732.60
ANALOG DEVICES INC 3.125% 23/12/05	100,000	107,855.22
ANALOG DEVICES INC 3.5% 26/12/05	100,000	113,304.77
ANALOG DEVICES INC 3.9% 25/12/15	60,000	68,317.87
ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN 3.65% 26/02/01	400,000	451,884.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4% 28/04/13	285,000	332,990.73
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% 29/01/23	500,000	611,749.92
ANTHEM INC 2.25% 30/05/15	135,000	140,164.74
ANTHEM INC 2.375% 25/01/15	100,000	106,159.32
ANTHEM INC 2.95% 22/12/01	250,000	264,034.15
ANTHEM INC 3.65% 27/12/01	200,000	228,351.55
AON PLC 3.875% 25/12/15	150,000	171,731.80
APPALACHIAN POWER CO 3.3% 27/06/01	100,000	109,272.74
APPLE INC 1.65% 30/05/11	90,000	93,186.67
APPLE INC 1.7% 22/09/11	60,000	61,798.44
APPLE INC 1.8% 24/09/11	100,000	105,057.21
APPLE INC 2.05% 26/09/11	200,000	214,390.58
APPLE INC 2.1% 22/09/12	150,000	155,538.88
APPLE INC 2.2% 29/09/11	100,000	108,399.20
APPLE INC 2.3% 22/05/11	350,000	361,836.03
APPLE INC 2.4% 23/01/13	100,000	104,894.18
APPLE INC 2.5% 22/02/09	100,000	103,205.38
APPLE INC 2.5% 25/02/09	100,000	108,341.64
APPLE INC 2.7% 22/05/13	200,000	208,644.51
APPLE INC 2.75% 25/01/13	50,000	54,473.30
APPLE INC 2.9% 27/09/12	150,000	168,877.76
APPLE INC 3% 24/02/09	150,000	162,217.03
APPLE INC 3% 27/06/20	60,000	67,805.20
APPLE INC 3.2% 25/05/13	500,000	559,124.11
APPLE INC 3.2% 27/05/11	212,000	241,403.02
APPLE INC 3.35% 27/02/09	150,000	171,590.80
APPLE INC 3.45% 24/05/06	100,000	110,714.55
APPLIED MATERIALS INC 1.75% 30/06/01	30,000	31,213.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C 2.5% 26/08/11	100,000	109,574.28
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C 3.375% 22/03/15	60,000	62,753.07
ARES CAPITAL CORP 3.25% 25/07/15	150,000	145,974.04
ARES CAPITAL CORP 3.5% 23/02/10	100,000	100,486.59
ARIZONA PUBLIC SERVICE 2.95% 27/09/15	100,000	108,672.95
ARROW ELECTRONICS INC 3.5% 22/04/01	200,000	206,233.01
ASCENSION HEALTH 2.532% 29/11/15	15,000	16,270.45
ASTRAZENECA PLC 3.375% 25/11/16	300,000	339,221.00
AT&T INC 2.3% 27/06/01	50,000	52,159.00
AT&T INC 2.625% 22/12/01	100,000	103,814.61

AT&T INC 3% 22/02/15	400,000	416,165.12
AT&T INC 3.2% 22/03/01	65,000	67,791.37
AT&T INC 3.4% 22/06/15	200,000	210,282.92
AT&T INC 3.55% 24/06/01	100,000	109,475.02
AT&T INC 3.8% 27/02/15	200,000	227,216.37
AT&T INC 3.9% 24/03/11	100,000	110,280.09
AT&T INC 4.1% 28/02/15	200,000	231,108.27
AT&T INC 4.125% 26/02/17	250,000	285,612.06
AT&T INC 4.25% 27/03/01	200,000	232,609.05
AT&T INC 4.35% 29/03/01	220,000	258,695.26
AT&T INC 4.45% 24/04/01	200,000	225,115.08
ATHENE HOLDING LTD 4.125% 28/01/12	150,000	157,114.79
ATMOS ENERGY CORP 3% 27/06/15	65,000	71,805.24
AUST & NZ BANKING GRP NY 2.625% 22/11/09	250,000	262,462.12
AUTODESK INC 4.375% 25/06/15	100,000	114,128.45
AUTOMATIC DATA PROCESSIN 3.375% 25/09/15	50,000	56,348.98
AUTONATION INC 3.5% 24/11/15	100,000	103,944.76
AUTONATION INC 4.5% 25/10/01	20,000	21,878.24
AUTOZONE INC 3.25% 25/04/15	110,000	120,243.52
AUTOZONE INC 4% 30/04/15	100,000	117,212.92
AVALONBAY COMMUNITIES 3.3% 29/06/01	65,000	74,489.02
AVALONBAY COMMUNITIES IN 2.9% 26/10/15	50,000	54,839.84
AVALONBAY COMMUNITIES IN 4.2% 23/12/15	150,000	165,556.06
AVANGRID INC 3.15% 24/12/01	100,000	108,593.52
AVANGRID INC 3.8% 29/06/01	75,000	88,431.91
AVNET INC 3.75% 21/12/01	75,000	76,916.72
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 3.9% 23/04/20	100,000	107,429.68
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 4.35% 28/04/20	100,000	114,544.11
AXIS SPECIALTY FINAN PLC 4% 27/12/06	100,000	108,047.84
BAIDU INC 3.625% 27/07/06	200,000	216,268.07
BAIDU INC 3.875% 23/09/29	200,000	213,449.82
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL 2.773% 22/12/15	100,000	104,437.12
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL 3.337% 27/12/15	150,000	162,837.50
BALTIMORE GAS & ELECTRIC 3.5% 21/11/15	100,000	103,145.58
BANCO SANTANDER SA 3.125% 23/02/23	200,000	209,380.05
BANCO SANTANDER SA 3.49% 30/05/28	200,000	218,391.70
BANCO SANTANDER SA 3.8% 28/02/23	200,000	218,281.10
BANCOLOMBIA SA 3% 25/01/29	200,000	197,684.00
BANK OF AMERICA CORP 1.319% 26/06/19	200,000	201,111.04
BANK OF AMERICA CORP 1.486% 24/05/19	200,000	203,971.59
BANK OF AMERICA CORP 2.456% 25/10/22	100,000	105,478.24
BANK OF AMERICA CORP 2.496% 31/02/13	200,000	210,920.02
BANK OF AMERICA CORP 2.592% 31/04/29	95,000	101,385.41
BANK OF AMERICA CORP 2.816% 23/07/21	100,000	103,771.37
BANK OF AMERICA CORP 3.004% 23/12/20	777,000	816,933.92
BANK OF AMERICA CORP 3.194% 30/07/23	150,000	166,970.68
BANK OF AMERICA CORP 3.366% 26/01/23	200,000	219,070.67
BANK OF AMERICA CORP 3.419% 28/12/20	583,000	649,509.63

BANK OF AMERICA CORP 3.458% 25/03/15	450,000	489,080.55
BANK OF AMERICA CORP 3.5% 26/04/19	100,000	113,136.64
BANK OF AMERICA CORP 3.55% 24/03/05	250,000	267,500.46
BANK OF AMERICA CORP 3.559% 27/04/23	250,000	280,282.67
BANK OF AMERICA CORP 3.593% 28/07/21	150,000	169,443.58
BANK OF AMERICA CORP 3.974% 30/02/07	250,000	291,934.87
BANK OF AMERICA CORP 4% 24/04/01	100,000	111,415.43
BANK OF AMERICA CORP 4% 25/01/22	100,000	110,671.87
BANK OF AMERICA CORP 4.125% 24/01/22	150,000	166,621.51
BANK OF AMERICA CORP 4.183% 27/11/25	400,000	456,940.96
BANK OF AMERICA CORP 4.2% 24/08/26	350,000	389,174.95
BANK OF AMERICA CORP 4.271% 29/07/23	400,000	473,085.96
BANK OF MONTREAL 1.9% 21/08/27	150,000	152,651.25
BANK OF MONTREAL 2.35% 22/09/11	100,000	104,119.31
BANK OF MONTREAL 2.5% 24/06/28	65,000	69,293.61
BANK OF MONTREAL 3.3% 24/02/05	350,000	380,798.24
BANK OF NEW YORK MELLON 2.2% 23/08/16	300,000	313,760.59
BANK OF NEW YORK MELLON 2.45% 26/08/17	150,000	163,436.28
BANK OF NEW YORK MELLON 3.25% 24/09/11	100,000	110,040.37
BANK OF NEW YORK MELLON 3.55% 21/09/23	100,000	103,585.43
BANK OF NOVA SCOTIA 1.3% 25/06/11	200,000	202,135.94
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2% 25/02/03	100,000	105,412.57
BANK OF NOVA SCOTIA 2.375% 23/01/18	50,000	52,001.28
BANK OF NOVA SCOTIA 2.7% 22/03/07	300,000	310,557.85
BANK OF NOVA SCOTIA 4.5% 25/12/16	100,000	114,418.14
BANK OF NY MELLON CORP 2.1% 24/10/24	305,000	322,446.20
BANK OF NY MELLON CORP 3.4% 28/01/29	100,000	115,649.62
BANKUINTEED INC 5.125% 30/06/11	100,000	103,498.30
BARCLAYS PLC 2.852% 26/05/07	200,000	210,038.95
BARCLAYS PLC 3.684% 23/01/10	250,000	259,882.52
BARCLAYS PLC 3.932% 25/05/07	250,000	271,646.59
BARCLAYS PLC 4.375% 26/01/12	200,000	225,774.00
BARCLAYS PLC 4.61% 23/02/15	350,000	368,773.66
BARCLAYS PLC 4.972% 29/05/16	200,000	236,787.88
BARCLAYS PLC 5.088% 30/06/20	200,000	228,350.26
BAT CAPITAL CORP 2.764% 22/08/15	100,000	103,925.36
BAT CAPITAL CORP 2.789% 24/09/06	70,000	74,294.07
BAT CAPITAL CORP 3.215% 26/09/06	100,000	108,087.89
BAT CAPITAL CORP 3.222% 24/08/15	200,000	214,436.13
BAT CAPITAL CORP 3.462% 29/09/06	100,000	107,348.92
BAT CAPITAL CORP 3.557% 27/08/15	100,000	109,096.12
BAT CAPITAL CORP 4.7% 27/04/02	100,000	116,203.81
BAT CAPITAL CORP 4.906% 30/04/02	100,000	118,850.04
BAXALTA INC 4% 25/06/23	30,000	34,111.46
BAXTER INTERNATIONAL INC 2.6% 26/08/15	100,000	109,912.94
BB&T CORPORATION 2.75% 22/04/01	100,000	103,623.02
BB&T CORPORATION 3.7% 25/06/05	150,000	169,718.35
BBVA USA 2.5% 24/08/27	250,000	255,913.42

BEAM INC 3.25% 22/05/15	150,000	155,581.14
BECTON DICKINSON AND CO 2.894% 22/06/06	100,000	103,694.81
BECTON DICKINSON AND CO 3.363% 24/06/06	200,000	215,875.54
BECTON DICKINSON AND CO 3.7% 27/06/06	131,000	147,601.31
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 2.8% 23/01/15	165,000	174,399.31
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 3.75% 23/11/15	100,000	109,871.28
BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75% 23/03/15	200,000	211,963.45
BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.125% 26/03/15	100,000	112,784.00
BEST BUY CO INC 4.45% 28/10/01	100,000	116,960.40
BGC PARTNERS INC 4.375% 25/12/15	60,000	59,962.20
BHP BILLITON FIN USA LTD 2.875% 22/02/24	150,000	155,385.80
BIOGEN INC 2.25% 30/05/01	35,000	36,026.59
BIOGEN INC 3.625% 22/09/15	55,000	58,741.45
BIOGEN INC 4.05% 25/09/15	100,000	115,114.62
BLACK HILLS CORP 3.05% 29/10/15	50,000	53,450.26
BLACK HILLS CORP 3.95% 26/01/15	50,000	54,912.00
BLACKROCK INC 3.25% 29/04/30	60,000	69,534.17
BLACKROCK INC 3.5% 24/03/18	100,000	110,597.79
BLOCK FINANCIAL LLC 5.5% 22/11/01	100,000	106,864.89
BOARDWALK PIPELINES LP 4.45% 27/07/15	100,000	105,855.49
BOARDWALK PIPELINES LP 4.8% 29/05/03	20,000	21,443.32
BOEING CO 2.3% 21/08/01	110,000	111,364.04
BOEING CO 2.35% 21/10/30	100,000	101,408.46
BOEING CO 2.7% 27/02/01	145,000	142,674.15
BOEING CO 2.95% 30/02/01	200,000	197,419.68
BOEING CO 4.875% 25/05/01	445,000	487,353.42
BOEING CO 5.15% 30/05/01	250,000	278,877.07
BOEING CO 8.75% 21/08/15	100,000	107,485.63
BOOKING HOLDINGS INC 4.5% 27/04/13	200,000	231,562.78
BORGWARNER INC 2.65% 27/07/01	50,000	52,021.64
BOSTON PROPERTIES INC 3.4% 29/06/21	100,000	111,168.82
BOSTON PROPERTIES LP 2.75% 26/10/01	200,000	215,092.30
BOSTON PROPERTIES LP 3.2% 25/01/15	50,000	53,746.25
BOSTON PROPERTIES LP 3.65% 26/02/01	150,000	167,251.26
BOSTON SCIENTIFIC CORP 1.9% 25/06/01	65,000	67,472.37
BOSTON SCIENTIFIC CORP 3.45% 24/03/01	200,000	217,599.28
BP CAP MARKETS AMERICA 2.112% 21/09/16	100,000	101,864.20
BP CAP MARKETS AMERICA 2.52% 22/09/19	100,000	103,987.72
BP CAP MARKETS AMERICA 3.119% 26/05/04	500,000	548,540.66
BP CAP MARKETS AMERICA 3.194% 25/04/06	100,000	108,968.46
BP CAP MARKETS AMERICA 3.224% 24/04/14	100,000	107,731.30
BP CAP MARKETS AMERICA 4.234% 28/11/06	200,000	235,477.93
BP CAPITAL MARKETS PLC 3.279% 27/09/19	200,000	221,450.98
BP CAPITAL MARKETS PLC 3.506% 25/03/17	150,000	166,701.43
BP CAPITAL MARKETS PLC 3.814% 24/02/10	100,000	109,856.51
BPCE SA 4% 24/04/15	250,000	276,921.31
BRANCH BANKING & TRUST 2.625% 22/01/15	250,000	257,717.77
BRANDYWINE OPER PARTNERS 3.95% 23/02/15	100,000	103,226.35

BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 3.7% 27/06/22	150,000	155,123.48
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.6% 22/05/16	100,000	104,207.66
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.75% 23/02/15	100,000	105,377.17
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.9% 24/07/26	100,000	108,250.02
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.2% 26/06/15	70,000	78,563.11
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 23/02/20	150,000	160,318.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 23/11/01	100,000	108,937.38
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 27/02/27	100,000	115,287.77
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.4% 29/07/26	250,000	290,514.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.45% 27/11/15	150,000	173,304.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.875% 25/08/15	100,000	114,215.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9% 28/02/20	150,000	177,307.84
BRITISH TELECOMMUNICATIO 5.125% 28/12/04	100,000	125,044.88
BRIXMOR OPERATING PART 3.65% 24/06/15	100,000	104,109.99
BRIXMOR OPERATING PART 3.9% 27/03/15	50,000	52,183.96
BROADCOM CRP / CAYMN FI 3.5% 28/01/15	150,000	159,968.02
BROADCOM CRP / CAYMN FI 2.65% 23/01/15	100,000	103,896.73
BROADCOM CRP / CAYMN FI 3.125% 25/01/15	70,000	75,110.56
BROADCOM CRP 3.875% 27/01/15	400,000	438,090.78
BROADCOM INC 2.25% 23/11/15	70,000	72,552.34
BROADCOM INC 3.15% 25/11/15	80,000	85,777.29
BROADCOM INC 3.459% 26/09/15	141,000	153,135.78
BROADCOM INC 4.11% 28/09/15	369,000	410,274.07
BROADCOM INC 4.25% 26/04/15	200,000	224,777.80
BROADCOM INC 4.75% 29/04/15	100,000	115,812.79
BROADRIDGE FINACIAL SOLU 3.4% 26/06/27	100,000	110,531.37
BROOKFIELD FINANCE INC 3.9% 28/01/25	100,000	110,952.40
BROOKFIELD FINANCE INC 4% 24/04/01	150,000	162,625.75
BUNGE LTD FINANCE CORP 3% 22/09/25	55,000	57,259.33
BUNGE LTD FINANCE CORP 3.25% 26/08/15	45,000	46,892.27
BUNGE LTD FINANCE CORP 3.75% 27/09/25	55,000	57,964.90
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3% 23/03/15	150,000	158,916.34
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.05% 22/03/15	50,000	51,988.15
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.25% 27/06/15	100,000	114,115.41
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.4% 24/09/01	100,000	110,044.03
CABOT CORP 3.7% 22/07/15	50,000	52,061.45
CAMDEN PROPERTY TRUST 4.1% 28/10/15	45,000	53,301.23
CAMPBELL SOUP CO 2.5% 22/08/02	100,000	103,294.21
CAMPBELL SOUP CO 3.95% 25/03/15	100,000	113,409.55
CANADIAN IMPERIAL BANK 0.95% 23/06/23	100,000	100,475.40
CANADIAN IMPERIAL BANK 2.606% 23/07/22	100,000	103,706.01
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.1% 24/04/02	100,000	107,754.78
CANADIAN NATIONAL RAILWA 2.75% 26/03/01	50,000	55,070.33
CANADIAN NATL RESOURCES 2.95% 23/01/15	100,000	103,274.92
CANADIAN NATURAL RESOURC 3.9% 25/02/01	150,000	161,977.76
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05% 30/03/05	155,000	161,155.73
CAPITAL ONE FINANCIAL 3.75% 26/07/28	150,000	164,562.82
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 2.6% 23/05/11	75,000	78,552.12

CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.2% 23/01/30	100,000	105,624.61
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.2% 25/02/05	150,000	161,137.95
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.3% 24/10/30	100,000	108,322.51
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.5% 23/06/15	100,000	107,559.32
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.65% 27/05/11	150,000	166,491.03
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.8% 28/01/31	150,000	169,411.74
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.75% 21/07/15	100,000	104,159.45
CARDINAL HEALTH INC 2.616% 22/06/15	100,000	103,247.48
CARDINAL HEALTH INC 3.079% 24/06/15	50,000	53,450.53
CARDINAL HEALTH INC 3.2% 23/03/15	100,000	105,616.00
CARDINAL HEALTH INC 3.41% 27/06/15	100,000	112,872.61
CARLISLE COS INC 3.5% 24/12/01	65,000	70,339.48
CARRIER GLOBAL CORP 1.923% 23/02/15	15,000	15,359.45
CARRIER GLOBAL CORP 2.242% 25/02/15	50,000	51,782.54
CARRIER GLOBAL CORP 2.493% 27/02/15	50,000	51,395.03
CARRIER GLOBAL CORP 2.722% 30/02/15	170,000	173,091.64
CATERPILLAR FINANCIAL SE 1.7% 21/08/09	100,000	101,327.82
CATERPILLAR FINANCIAL SE 2.4% 26/08/09	50,000	53,995.43
CATERPILLAR FINANCIAL SE 3.75% 23/11/24	150,000	165,409.96
CATERPILLAR FINL SERV 1.931% 21/10/01	50,000	50,907.21
CATERPILLAR FINL SERVICE 0.65% 23/07/07	100,000	100,320.90
CATERPILLAR FINL SERVICE 1.9% 22/09/06	55,000	56,695.78
CATERPILLAR FINL SERVICE 3.15% 21/09/07	80,000	82,494.30
CATERPILLAR INC 2.6% 22/06/26	100,000	103,501.28
CATERPILLAR INC 2.6% 29/09/19	100,000	110,636.59
CATERPILLAR INC 3.4% 24/05/15	100,000	109,707.28
CBOE HOLDINGS 3.65% 27/01/12	50,000	57,232.35
CBRE GROUP INC 4.875% 26/03/01	100,000	114,174.04
CBS CORP 2.9% 27/01/15	100,000	107,518.94
CENTERPOINT ENERGY INC 2.5% 22/09/01	50,000	51,752.46
CENTERPOINT ENERGY INC 3.6% 21/11/01	20,000	20,749.55
CENTERPOINT ENERGY INC 3.85% 24/02/01	50,000	54,678.32
CHARLES SCHWAB CORP 3.25% 29/05/22	100,000	113,384.52
CHARLES SCHWAB CORP 3.55% 24/02/01	100,000	109,503.30
CHARLES SCHWAB CORP 3.85% 25/05/21	100,000	114,006.13
CHARTER COMM OPT LLC 4.464% 22/07/23	300,000	319,680.00
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.5% 24/02/01	100,000	110,835.11
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.908% 25/07/23	200,000	231,249.36
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 5.05% 29/03/30	100,000	118,742.21
CHENIERE CORP CHRISTI HD 3.7% 29/11/15	100,000	103,643.36
CHENIERE CORP CHRISTI HD 5.875% 25/03/31	100,000	112,842.98
CHENIERE CORP CHRISTI HD 7% 24/06/30	100,000	114,086.25
CHEVRON 2.566% 23/05/16	100,000	105,623.81
CHEVRON 2.954% 26/05/16	300,000	335,182.29
CHEVRON CORP 1.141% 23/05/11	100,000	102,179.99
CHEVRON CORP 2.236% 30/05/11	100,000	106,520.86
CHEVRON CORP 2.895% 24/03/03	50,000	53,944.27
CHUBB INA HOLDINGS INC 3.35% 26/05/03	200,000	227,986.11

CHURCH & DWIGHT CO INC 2.45% 22/08/01	100,000	104,572.30
CIGNA CORP 2.4% 30/03/15	60,000	63,244.31
CIGNA CORP 3% 23/07/15	250,000	266,053.66
CIGNA CORP 3.05% 22/11/30	100,000	105,422.36
CIGNA CORP 3.25% 25/04/15	150,000	164,891.00
CIGNA CORP 3.4% 21/09/17	80,000	82,660.29
CIGNA CORP 3.4% 27/03/01	100,000	111,632.64
CIGNA CORP 3.75% 23/07/15	67,000	72,800.69
CIGNA CORP 4.375% 28/10/15	350,000	418,294.96
CIMAREX ENERGY CO 4.375% 24/06/01	100,000	105,901.03
CIMAREX ENERGY CO 4.375% 29/03/15	75,000	77,515.68
CINTAS CORP NO 2 2.9% 22/04/01	100,000	103,865.10
CINTAS CORP NO 2 3.7% 27/04/01	100,000	114,054.13
CISCO SYSTEMS INC 1.85% 21/09/20	100,000	101,795.42
CISCO SYSTEMS INC 2.5% 26/09/20	150,000	166,421.01
CISCO SYSTEMS INC 3.625% 24/03/04	100,000	111,805.62
CITIBANK NA 3.65% 24/01/23	250,000	274,872.21
CITIGROUP INC 1.678% 24/05/15	200,000	204,229.11
CITIGROUP INC 2.312% 22/11/04	100,000	102,041.65
CITIGROUP INC 2.572% 31/06/03	150,000	156,670.22
CITIGROUP INC 2.666% 31/01/29	250,000	263,222.63
CITIGROUP INC 2.9% 21/12/08	600,000	618,202.62
CITIGROUP INC 2.976% 30/11/05	150,000	161,746.80
CITIGROUP INC 3.106% 26/04/08	150,000	161,997.96
CITIGROUP INC 3.142% 23/01/24	150,000	155,197.17
CITIGROUP INC 3.352% 25/04/24	400,000	433,044.95
CITIGROUP INC 3.375% 23/03/01	250,000	266,328.07
CITIGROUP INC 3.5% 23/05/15	250,000	266,455.58
CITIGROUP INC 3.52% 28/10/27	150,000	167,196.23
CITIGROUP INC 3.7% 26/01/12	300,000	336,860.91
CITIGROUP INC 3.75% 24/06/16	100,000	110,512.78
CITIGROUP INC 3.887% 28/01/10	350,000	396,144.60
CITIGROUP INC 4.075% 29/04/23	250,000	287,427.16
CITIGROUP INC 4.125% 28/07/25	100,000	113,881.02
CITIGROUP INC 4.4% 25/06/10	250,000	280,964.51
CITIGROUP INC 4.45% 27/09/29	300,000	344,753.77
CITIZENS FINANCIAL GROUP 3.25% 30/04/30	30,000	32,824.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP 4.3% 25/12/03	100,000	112,481.76
CITRIX SYSTEMS INC 4.5% 27/12/01	100,000	115,086.20
CLECO CORPORATE HOLDINGS 3.375% 29/09/15	25,000	26,120.41
CLOROX CO 3.5% 24/12/15	100,000	110,918.91
CLOROX COMPANY 1.8% 30/05/15	30,000	30,727.63
CLOROX COMPANY 3.05% 22/09/15	64,000	67,316.28
CME GROUP INC 3% 22/09/15	200,000	211,150.16
CMS ENERGY CORP 5.05% 22/03/15	150,000	158,815.36
CNA FINANCIAL CORP 3.45% 27/08/15	50,000	54,568.56
CNA FINANCIAL CORP 3.9% 29/05/01	40,000	44,656.42
CNA FINANCIAL CORP 4.5% 26/03/01	100,000	113,038.70

CNA FINANCIAL CORP 5.75% 21/08/15	30,000	31,644.26
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 3.875% 21/10/15	35,000	35,843.03
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 4.2% 24/01/15	50,000	54,084.74
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 4.375% 22/04/05	40,000	42,062.10
CNH INDUSTRIAL NV 3.85% 27/11/15	70,000	74,321.81
CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25% 25/05/30	100,000	111,950.76
COACH INC 3% 22/07/15	100,000	98,422.16
COCA-COLA CO 2.25% 26/09/01	100,000	109,214.41
COCA-COLA CO/THE 2.125% 29/09/06	200,000	214,357.98
COCA-COLA CO/THE 2.95% 25/03/25	100,000	110,533.86
COCA-COLA CO/THE 3.3% 21/09/01	100,000	103,322.34
COCA-COLA CO/THE 3.375% 27/03/25	250,000	288,849.19
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75% 30/01/22	150,000	160,930.05
COLGATE-PALMOLIVE CO 2.1% 23/05/01	100,000	104,893.97
COLGATE-PALMOLIVE CO 2.45% 21/11/15	100,000	102,852.33
COLUMBIA PIPELINE GROUP 4.5% 25/06/01	100,000	114,564.72
COLUMBIA PROPERTY TRUST 3.65% 26/08/15	50,000	52,098.26
COMCAST CORP 2.35% 27/01/15	200,000	215,472.24
COMCAST CORP 2.75% 23/03/01	100,000	105,204.58
COMCAST CORP 2.85% 23/01/15	100,000	107,260.66
COMCAST CORP 3.1% 25/04/01	35,000	38,530.26
COMCAST CORP 3.3% 27/02/01	100,000	113,482.67
COMCAST CORP 3.4% 30/04/01	200,000	232,188.67
COMCAST CORP 3.6% 24/03/01	200,000	223,395.86
COMCAST CORP 3.7% 24/04/15	310,000	343,945.59
COMCAST CORP 3.95% 25/10/15	200,000	229,943.14
COMCAST CORP 4.15% 28/10/15	390,000	474,092.76
COMERICA INC 3.7% 23/07/31	75,000	81,159.25
COMERICA INC 4% 29/02/01	100,000	115,063.68
COMMONSPIRIT HEALTH 3.347% 29/10/01	100,000	103,160.72
CON EDISON CO OF NY INC 3.35% 30/04/01	20,000	22,943.56
CONAGRA BRANDS INC 4.3% 24/05/01	60,000	66,793.75
CONAGRA BRANDS INC 4.85% 28/11/01	100,000	121,996.08
CONAGRA FOODS INC 3.2% 23/01/25	157,000	165,302.83
CONCHO RESOURCES INC 3.75% 27/10/01	150,000	161,811.44
CONCHO RESOURCES INC 4.375% 25/01/15	50,000	51,638.41
CONNECTICUT LIGHT & PWR 2.5% 23/01/15	150,000	156,351.55
CONOCOPHILLIPS 4.95% 26/03/15	100,000	120,560.08
CONSOLIDATED EDISON CO 0 3.125% 27/11/15	100,000	111,530.38
CONSOLIDATED EDISON CO 0 3.8% 28/05/15	50,000	58,067.44
CONSTELLATION BRANDS INC 2.65% 22/11/07	100,000	104,503.42
CONSTELLATION BRANDS INC 3.15% 29/08/01	100,000	109,484.90
CONSTELLATION BRANDS INC 3.6% 28/02/15	50,000	55,561.19
CONSTELLATION BRANDS INC 3.7% 26/12/06	50,000	56,672.83
CONSTELLATION BRANDS INC 4.4% 25/11/15	165,000	192,275.73
CONTL AIRLINES 2012-1 A 4.15% 24/04/11	131,094	121,283.55
COOPERAT RABOBANK UA/NY 2.75% 23/01/10	250,000	263,709.74
COOPERATIEVE RABOBANK UA 3.75% 26/07/21	250,000	276,360.70

CORPORATE OFFICE PROP LP 5% 25/07/01	50,000	53,338.43
COSTCO WHOLESALE CORP 1.375% 27/06/20	100,000	102,790.33
COSTCO WHOLESALE CORP 1.6% 30/04/20	100,000	102,037.93
COSTCO WHOLESALE CORP 3% 27/05/18	150,000	170,104.61
CRANE CO 4.45% 23/12/15	50,000	53,481.62
CRED SUIS GP FUN LTD 3.8% 23/06/09	150,000	160,740.63
CREDIT SUISSE AG 3% 21/10/29	500,000	516,203.98
CREDIT SUISSE GROUP 4.55% 26/04/17	150,000	173,272.37
CREDIT SUISSE NEW YORK 1% 23/05/05	250,000	251,744.72
CREDIT SUISSE NEW YORK 3.625% 24/09/09	250,000	275,849.47
CROWN CASTLE INTERNATIONAL 3.7% 26/06/15	100,000	112,845.22
CROWN CASTLE INTERNATIONAL 4.45% 26/02/15	200,000	231,586.94
CROWN CASTLE INTL CORP 4% 27/03/01	100,000	113,923.75
CROWN CASTLE INTL CORP 5.25% 23/01/15	250,000	277,599.47
CSX CORP 3.25% 27/06/01	100,000	112,897.54
CSX CORP 3.7% 23/11/01	100,000	109,836.59
CSX CORP 4.25% 29/03/15	100,000	120,716.12
CVS CAREMARK CORP 4% 23/12/05	150,000	164,764.52
CVS HEALTH 2.875% 26/06/01	200,000	217,926.92
CVS HEALTH CORP 3.25% 29/08/15	235,000	261,973.68
CVS HEALTH CORP 3.625% 27/04/01	65,000	73,589.15
CVS HEALTH CORP 3.7% 23/03/09	300,000	322,405.65
CVS HEALTH CORP 3.75% 30/04/01	145,000	168,346.81
CVS HEALTH CORP 4.1% 25/03/25	450,000	510,383.34
CVS HEALTH CORP 4.3% 28/03/25	500,000	589,529.33
CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN 3.45% 29/11/15	60,000	62,803.80
D.R. HORTON INC 2.5% 24/10/15	200,000	209,757.45
DANAHER CORP 3.35% 25/09/15	105,000	117,417.48
DDR CORP 3.625% 25/02/01	173,000	174,415.29
DELL INT LLC / EMC CORP 4% 24/07/15	100,000	107,528.59
DELL INT LLC / EMC CORP 6.1% 27/07/15	150,000	173,398.21
DELMARVA PWR & LIGHT CO 3.5% 23/11/15	150,000	163,401.51
DELPHI CORP 4.15% 24/03/15	200,000	217,365.96
DELTA AIR LINES 2019-1AA 3.204% 24/04/25	50,000	50,088.44
DENTSPLY SIRONA INC 3.25% 30/06/01	100,000	106,686.95
DEUTSCHE BANK AG 4.25% 21/10/14	350,000	360,302.62
DEUTSCHE BANK AG LONDON 3.7% 24/05/30	200,000	209,679.14
DEUTSCHE BANK NY 3.3% 22/11/16	100,000	102,648.00
DH EUROPE FINANCE II 2.2% 24/11/15	100,000	105,578.19
DIAGEO CAPITAL PLC 2.125% 24/10/24	200,000	211,014.19
DIAGEO CAPITAL PLC 2.625% 23/04/29	100,000	105,198.99
DIAGEO INVESTMENT CORP 2.875% 22/05/11	100,000	104,408.75
DIAMOND 1 FIN 5.45% 23/06/15	200,000	219,042.61
DIAMOND 1 FIN 6.02% 26/06/15	350,000	401,052.86
DIAMONDBACK ENERGY INC 2.875% 24/12/01	115,000	115,360.34
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.25% 26/12/01	45,000	45,447.10
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5% 29/12/01	100,000	99,373.89
DIGITAL REALTY TRUST LP 2.75% 23/02/01	50,000	52,420.99

DIGITAL REALTY TRUST LP 3.7% 27/08/15	100,000	114,744.81
DISCOVER BANK 3.45% 26/07/27	250,000	273,388.74
DISCOVER FINANCIAL SVS 4.1% 27/02/09	75,000	82,689.59
DISCOVER FINANCIAL SVS 5.2% 22/04/27	83,000	88,515.18
DISCOVERY COMMUNICATIONS 2.95% 23/03/20	27,000	28,358.22
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.95% 28/03/20	100,000	112,676.02
DISCOVERY COMMUNICATIONS 4.125% 29/05/15	45,000	52,006.11
DISCOVERY COMMUNICATIONS 4.9% 26/03/11	100,000	116,209.88
DOLLAR GENERAL CORP 3.25% 23/04/15	100,000	106,629.34
DOLLAR GENERAL CORP 3.5% 30/04/03	25,000	28,545.74
DOLLAR GENERAL CORP 4.15% 25/11/01	50,000	57,855.61
DOLLAR TREE INC 4% 25/05/15	100,000	113,206.95
DOMINION ENERGY GAS HLDG 2.5% 24/11/15	100,000	106,509.10
DOMINION ENERGY GAS HLDG 3% 29/11/15	100,000	108,500.72
DOMINION ENERGY INC 3.375% 30/04/01	60,000	68,164.25
DOMINION ENERGY INC 4.25% 28/06/01	50,000	59,046.93
DOMINION GAS HOLDINGS LL 3.6% 24/12/15	25,000	27,655.26
DOMINION RESOURCES INC 5.75% 54/10/01	100,000	102,138.08
DOMINION RESOURCES INC/V 2% 21/08/15	20,000	20,283.67
DOMTAR CORP 4.4% 22/04/01	100,000	102,134.62
DOW CHEMICAL CO/THE 3.625% 26/05/15	300,000	330,726.96
DOWDUPONT INC 4.493% 25/11/15	150,000	173,070.58
DOWDUPONT INC 4.725% 28/11/15	100,000	121,900.74
DR PEPPER SNAPPLE GROUP 3.4% 25/11/15	100,000	112,397.79
DTE ENERGY 2.85% 26/10/01	100,000	107,051.37
DTE ENERGY 3.5% 24/06/01	100,000	108,273.12
DTE ENERGY CO 2.25% 22/11/01	50,000	51,706.50
DTE ENERGY CO 2.529% 24/10/01	75,000	79,194.30
DTE ENERGY CO 2.95% 30/03/01	50,000	53,057.51
DUKE ENERGY 2.65% 26/09/01	100,000	108,843.17
DUKE ENERGY CAROLINAS 2.45% 29/08/15	25,000	27,276.00
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.05% 23/03/15	200,000	212,787.79
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.95% 28/11/15	200,000	242,307.03
DUKE ENERGY CORP 3.15% 27/08/15	100,000	112,407.99
DUKE ENERGY CORP 3.4% 29/06/15	125,000	142,894.39
DUKE ENERGY CORP 3.55% 21/09/15	200,000	205,686.26
DUKE ENERGY FLORIDA LLC 1.75% 30/06/15	105,000	107,883.09
DUKE REALTY LP 3.75% 24/12/01	100,000	110,345.84
DUKE REALTY LP 4% 28/09/15	50,000	58,880.36
DUPONT DE NEMOURS INC 2.169% 23/05/01	235,000	240,205.03
DXC TECHNOLOGY CO 4.25% 24/04/15	100,000	109,206.93
E*TRADE FINANCIAL CORP 2.95% 22/08/24	50,000	52,069.34
E*TRADE FINANCIAL CORP 3.8% 27/08/24	15,000	16,612.00
E*TRADE FINANCIAL CORP 4.5% 28/06/20	50,000	58,021.34
E. I. DU PONT DE NEMOURS 1.7% 25/07/15	40,000	41,431.64
EATON CORP 2.75% 22/11/02	250,000	263,174.58
EATON VANCE CORP 3.5% 27/04/06	50,000	54,190.51
EBAY INC 1.9% 25/03/11	50,000	52,000.03

EBAY INC 2.6% 22/07/15	200,000	206,899.21
EBAY INC 2.7% 30/03/11	70,000	74,828.47
EBAY INC 3.6% 27/06/05	100,000	113,030.16
ECOLAB INC 2.375% 22/08/10	100,000	104,053.14
ECOLAB INC 2.7% 26/11/01	45,000	50,508.09
ECOLAB INC 3.25% 23/01/14	50,000	53,066.89
ECOLAB INC 4.8% 30/03/24	45,000	57,777.92
EDISON INTERNATIONAL 3.125% 22/11/15	35,000	36,353.75
EDISON INTERNATIONAL 4.95% 25/04/15	40,000	44,163.17
EDISON INTERNATIONAL 5.75% 27/06/15	160,000	185,449.37
EL PASO PIPELINE PART OP 5% 21/10/01	150,000	155,732.94
ELI LILLY & CO 3.375% 29/03/15	95,000	110,879.92
EMERA US FINANCE LP 3.55% 26/06/15	65,000	73,000.37
EMERSON ELECTRIC CO 3.15% 25/06/01	100,000	111,275.68
EMPRESA NACIONAL DE ELEC 4.25% 24/04/15	50,000	53,156.59
ENABLE MIDSTREAM PARTNER 3.9% 24/05/15	100,000	98,094.06
ENABLE MIDSTREAM PARTNER 4.4% 27/03/15	100,000	92,057.69
ENBRIDGE ENERGY PARTNERS 5.875% 25/10/15	100,000	119,276.96
ENBRIDGE INC 2.5% 25/01/15	100,000	104,758.25
ENBRIDGE INC 2.9% 22/07/15	50,000	51,819.54
ENBRIDGE INC 3.125% 29/11/15	100,000	105,949.07
ENBRIDGE INC 3.7% 27/07/15	50,000	55,301.55
ENCANA CORP 3.9% 21/11/15	100,000	100,230.90
ENEL CHILE SA 4.875% 28/06/12	100,000	112,951.00
ENERGY TRANSFER LP 3.6% 23/02/01	250,000	257,060.09
ENERGY TRANSFER OPERATNG 2.9% 25/05/15	40,000	40,489.67
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.25% 29/04/15	200,000	215,975.48
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.875% 24/01/15	250,000	274,821.77
ENERGY TRANSFER PARTNERS 4.05% 25/03/15	150,000	158,446.80
ENERGY TRANSFER PARTNERS 5.2% 22/02/01	200,000	208,860.97
ENSTAR GROUP LTD 4.95% 29/06/01	100,000	108,355.28
ENTERGY CORP 2.95% 26/09/01	30,000	33,200.76
ENTERGY CORP 4% 22/07/15	50,000	53,151.85
ENTERGY LOUISIANA LLC 2.4% 26/10/01	200,000	214,775.52
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8% 30/01/31	120,000	127,250.22
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.125% 29/07/31	200,000	217,730.18
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.5% 22/02/01	75,000	78,196.35
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.75% 25/02/15	100,000	111,007.13
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 4.875% 77/08/16	100,000	88,250.00
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 5.375% 78/02/15	100,000	89,500.00
EOG RESOURCES INC 2.625% 23/03/15	150,000	157,229.92
EOG RESOURCES INC 4.375% 30/04/15	30,000	36,368.38
EPR PROPERTIES 3.75% 29/08/15	150,000	133,867.57
EQUIFAX INC 2.6% 24/12/01	100,000	105,783.15
EQUIFAX INC 2.6% 25/12/15	50,000	53,330.83
EQUIFAX INC 3.95% 23/06/15	40,000	43,280.93
EQUINIX INC 1.25% 25/07/15	200,000	200,048.00
EQUINIX INC 2.625% 24/11/18	65,000	69,437.55

EQUINIX INC 3.2% 29/11/18	45,000	49,135.05
EQUINIX INC 5.375% 27/05/15	75,000	81,750.00
ERP OPERATING LP 3.25% 27/08/01	35,000	38,879.96
ERP OPERATING LP 4.15% 28/12/01	50,000	60,033.81
ERP OPERATING LP 4.625% 21/12/15	150,000	156,960.99
ESSENTIAL UTILITIES INC 2.704% 30/04/15	60,000	63,591.82
ESSEX PORTFOLIO LP 3.5% 25/04/01	100,000	109,275.99
ESSEX PORTFOLIO LP 3.875% 24/05/01	50,000	54,381.11
ESSEX PORTFOLIO LP 4% 29/03/01	100,000	117,271.63
ESTEE LAUDER CO INC 3.15% 27/03/15	100,000	112,994.96
EVERGY INC 2.9% 29/09/15	100,000	107,775.88
EVERSOURCE ENERGY 2.75% 22/03/15	50,000	51,781.83
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 24/10/01	50,000	53,801.56
EXELON 3.4% 26/04/15	100,000	112,935.20
EXELON CORP 3.497% 22/06/01	100,000	104,596.23
EXELON GENERATION CO LLC 3.25% 25/06/01	100,000	108,587.86
EXPEDIA GROUP INC 3.25% 30/02/15	200,000	186,394.90
EXPEDIA GROUP INC 3.6% 23/12/15	25,000	25,057.77
EXXON MOBIL CORPORATION 1.571% 23/04/15	300,000	308,707.74
EXXON MOBIL CORPORATION 1.902% 22/08/16	40,000	41,225.27
EXXON MOBIL CORPORATION 2.275% 26/08/16	100,000	107,133.88
EXXON MOBIL CORPORATION 2.44% 29/08/16	100,000	107,569.83
EXXON MOBIL CORPORATION 3.294% 27/03/19	250,000	282,330.65
EXXON MOBIL INC 2.726% 23/03/01	70,000	73,743.15
EXXON MOBIL INC 3.043% 26/03/01	300,000	331,485.76
FAIRFAX FINL HLDGS LTD 4.625% 30/04/29	100,000	109,261.27
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.2% 29/06/15	50,000	52,499.88
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.25% 27/07/15	50,000	52,784.91
FEDEX CORP 3.1% 29/08/05	100,000	109,114.49
FEDEX CORP 3.2% 25/02/01	300,000	327,817.32
FIBRIA OVERSEAS FINANCE 4% 25/01/14	100,000	103,000.00
FIBRIA OVERSEAS FINANCE 5.5% 27/01/17	50,000	53,625.50
FIDELITY NATIONAL INFORM 3.5% 23/04/15	100,000	107,071.77
FIDELITY NATIONAL INFORM 3.875% 24/06/05	28,000	30,906.86
FIDELITY NATIONAL INFORM 4.25% 28/05/15	155,000	185,229.23
FIDELITY NATL FINANCIAL 4.5% 28/08/15	100,000	112,902.03
FIFTH THIRD BANCORP 2.55% 27/05/05	60,000	64,368.26
FIFTH THIRD BANCORP 3.65% 24/01/25	100,000	109,481.60
FIFTH THIRD BANK 2.875% 21/10/01	400,000	410,706.20
FIRSTENERGY CORP 2.05% 25/03/01	5,000	5,199.34
FIRSTENERGY CORP 2.85% 22/07/15	60,000	62,191.42
FIRSTENERGY CORP 3.9% 27/07/15	65,000	74,214.15
FIRSTENERGY CORP 4.25% 23/03/15	70,000	75,647.73
FISERV INC 2.65% 30/06/01	100,000	107,201.95
FISERV INC 3.5% 29/07/01	310,000	352,318.67
FISERV INC 3.8% 23/10/01	250,000	273,921.50
FLEXTRONICS INTERNATIONA 4.75% 25/06/15	125,000	140,946.95
FLORIDA POWER & LIGHT CO 3.125% 25/12/01	200,000	222,823.36

FLOWERS FOODS INC 3.5% 26/10/01	35,000	37,706.36
FLUOR CORP 4.25% 28/09/15	100,000	84,048.00
FMC CORP 3.2% 26/10/01	100,000	109,254.40
FORTIS INC 3.055% 26/10/04	100,000	108,210.02
FORTIVE CORP 3.15% 26/06/15	50,000	55,076.84
FORTUNE BRANDS HOME & SE 4% 23/09/21	100,000	109,607.32
FOX CORP 3.05% 25/04/07	50,000	54,391.27
FOX CORP 3.5% 30/04/08	25,000	28,281.45
FOX CORP 4.03% 24/01/25	150,000	166,388.13
FOX CORP 4.709% 29/01/25	100,000	122,631.25
FRANCE TELECOM 4.125% 21/09/14	150,000	156,595.38
FS KKR CAPITAL CORP 4.125% 25/02/01	100,000	97,307.14
GATX CORP 4.7% 29/04/01	150,000	170,685.60
GE CAPITAL FUNDING LLC 4.4% 30/05/15	400,000	425,221.14
GE CAPITAL INTL FUNDING 3.373% 25/11/15	250,000	265,327.84
GENERAL DYNAMICS CORP 2.125% 26/08/15	100,000	107,750.36
GENERAL DYNAMICS CORP 2.25% 22/11/15	100,000	103,782.51
GENERAL DYNAMICS CORP 3.25% 25/04/01	100,000	111,581.84
GENERAL DYNAMICS CORP 3.375% 23/05/15	75,000	80,849.60
GENERAL DYNAMICS CORP 3.75% 28/05/15	80,000	93,997.19
GENERAL ELECTRIC CO 3.15% 22/09/07	100,000	104,740.74
GENERAL ELECTRIC CO 3.45% 24/05/15	200,000	214,110.76
GENERAL ELECTRIC CO 3.45% 27/05/01	200,000	209,195.91
GENERAL MILLS INC 2.875% 30/04/15	40,000	44,060.44
GENERAL MILLS INC 3.7% 23/10/17	140,000	153,066.04
GENERAL MILLS INC 4% 25/04/17	100,000	113,723.86
GENERAL MILLS INC 4.2% 28/04/17	100,000	118,859.70
GENERAL MOTORS CO 5.4% 23/10/02	100,000	109,348.33
GENERAL MOTORS FINANCIAL 3.2% 21/07/06	500,000	506,140.04
GENERAL MOTORS FINL CO 2.9% 25/02/26	150,000	151,836.78
GENERAL MOTORS FINL CO 3.15% 22/06/30	70,000	71,545.43
GENERAL MOTORS FINL CO 3.5% 24/11/07	200,000	204,976.12
GENERAL MOTORS FINL CO 3.6% 30/06/21	200,000	199,860.57
GENERAL MOTORS FINL CO 3.7% 23/05/09	250,000	258,956.86
GENERAL MOTORS FINL CO 3.95% 24/04/13	100,000	104,455.12
GENERAL MOTORS FINL CO 4% 26/10/06	100,000	104,636.63
GENERAL MOTORS FINL CO 4.2% 21/11/06	60,000	61,741.14
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35% 25/04/09	150,000	158,821.23
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35% 27/01/17	100,000	105,331.52
GENERAL MOTORS FINL CO 5.2% 23/03/20	70,000	75,392.10
GENERAL MOTORS FINL CO 5.65% 29/01/17	100,000	113,718.92
GEORGIA POWER CO 2.1% 23/07/30	100,000	104,511.64
GEORGIA POWER CO 2.65% 29/09/15	70,000	74,676.10
GEORGIA POWER CO 3.25% 26/04/01	50,000	55,415.40
GILEAD SCIENCES INC 1.95% 22/03/01	30,000	30,696.22
GILEAD SCIENCES INC 2.5% 23/09/01	70,000	74,045.21
GILEAD SCIENCES INC 3.65% 26/03/01	300,000	345,039.09
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.375% 23/05/15	350,000	378,396.53

GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.625% 25/05/15	55,000	61,904.81
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.875% 28/05/15	100,000	118,782.55
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL 2.875% 22/06/01	200,000	209,238.74
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9% 30/05/15	45,000	47,832.94
GLOBAL PAYMENTS INC 3.2% 29/08/15	200,000	216,625.17
GLP CAPITAL LP / FIN II 3.35% 24/09/01	55,000	55,248.05
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 23/11/01	45,000	47,987.10
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 26/04/15	85,000	92,837.85
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75% 28/06/01	45,000	50,008.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.6% 30/02/07	100,000	105,058.61
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.876% 22/10/31	200,000	205,136.09
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.908% 23/06/05	250,000	259,584.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3% 22/04/26	365,000	372,012.60
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.2% 23/02/23	250,000	265,199.01
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272% 25/09/29	350,000	378,035.15
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5% 25/04/01	240,000	263,873.07
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.625% 23/01/22	200,000	213,918.03
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.691% 28/06/05	200,000	226,194.88
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75% 25/05/22	600,000	665,710.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.8% 30/03/15	200,000	229,233.43
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 27/01/26	300,000	338,329.18
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223% 29/05/01	300,000	350,798.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.25% 25/10/21	200,000	225,977.01
GRUPO TELEVISIA SAB 6.625% 25/03/18	150,000	177,584.77
GULF POEWR CO 3.3% 27/05/30	100,000	111,526.98
HALLIBURTON CO 3.8% 25/11/15	10,000	10,816.77
HALLIBURTON COMPANY 3.25% 21/11/15	100,000	102,316.89
HANOVER INSURANCE GROUP 4.5% 26/04/15	50,000	54,843.40
HARRIS CORPORATION 4.4% 28/06/15	150,000	179,225.42
HASBRO INC 3.5% 27/09/15	30,000	31,273.28
HASBRO INC 3.55% 26/11/19	125,000	132,678.50
HCA INC 4.125% 29/06/15	100,000	113,162.78
HCA INC 4.5% 27/02/15	105,000	118,029.50
HCA INC 4.75% 23/05/01	105,000	114,635.41
HCA INC 5.25% 25/04/15	120,000	138,327.96
HCA INC 5.25% 26/06/15	130,000	150,629.94
HCP INC 3.25% 26/07/15	50,000	54,820.47
HCP INC 3.4% 25/02/01	100,000	108,205.57
HEALTH CARE REIT INC 4% 25/06/01	100,000	110,780.15
HEALTHCARE TRUST OF AMER 3.75% 27/07/01	150,000	158,949.12
HERSHEY COMPANY 1.7% 30/06/01	80,000	82,802.73
HERSHEY COMPANY 2.05% 24/11/15	100,000	106,061.91
HESS CORP 4.3% 27/04/01	100,000	104,169.54
HEXCEL CORP 3.95% 27/02/15	50,000	53,781.64
HOLLYFRONTIER CORP 5.875% 26/04/01	150,000	164,499.38
HOME DEPOT INC 2.5% 27/04/15	100,000	110,216.05
HOME DEPOT INC 2.7% 23/04/01	200,000	210,490.00
HOME DEPOT INC 2.7% 30/04/15	55,000	61,168.92

HOME DEPOT INC 2.8% 27/09/14	100,000	112,961.66
HOME DEPOT INC 2.95% 29/06/15	215,000	244,221.52
HOME DEPOT INC/THE 2.125% 26/09/15	125,000	134,620.62
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.15% 22/08/08	95,000	97,991.70
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.3% 24/08/15	100,000	106,598.83
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.5% 26/11/01	150,000	164,947.50
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.7% 29/08/15	120,000	134,918.45
HORMEL FOODS CORP 1.8% 30/06/11	55,000	56,562.06
HOST HOTELS & RESORTS LP 3.875% 24/04/01	50,000	51,382.50
HOST HOTELS + RESORTS LP 4.75% 23/03/01	100,000	104,131.75
HOWMET AEROSPACE INC 6.875% 25/05/01	255,000	278,125.90
HP ENTERPRISE CO 2.25% 23/04/01	200,000	205,726.14
HP ENTERPRISE CO 4.9% 25/10/15	200,000	231,228.34
HP INC 3% 27/06/17	100,000	105,380.42
HP INC 3.4% 30/06/17	150,000	157,162.28
HSBC HLD 4.375% 26/11/23	225,000	250,034.55
HSBC HOLDINGS PLC 2.099% 26/06/04	230,000	232,782.34
HSBC HOLDINGS PLC 2.633% 25/11/07	200,000	208,669.17
HSBC HOLDINGS PLC 2.848% 31/06/04	200,000	205,312.22
HSBC HOLDINGS PLC 3.803% 25/03/11	200,000	216,359.87
HSBC HOLDINGS PLC 3.95% 24/05/18	250,000	269,222.42
HSBC HOLDINGS PLC 3.973% 30/05/22	400,000	446,453.30
HSBC HOLDINGS PLC 4% 22/03/30	200,000	211,303.09
HSBC HOLDINGS PLC 4.041% 28/03/13	250,000	277,618.48
HSBC HOLDINGS PLC 4.25% 24/03/14	200,000	217,259.01
HSBC HOLDINGS PLC 4.583% 29/06/19	200,000	230,435.89
HUBBELL INC 3.35% 26/03/01	100,000	107,256.78
HUDSON PACIFIC PROPERTIE 3.25% 30/01/15	100,000	99,511.92
HUMANA INC 2.9% 22/12/15	50,000	52,440.12
HUMANA INC 3.85% 24/10/01	150,000	165,264.03
HUNTINGTON BANCSHARES 2.55% 30/02/04	100,000	104,208.59
HUNTINGTON BANCSHARES IN 2.3% 22/01/14	100,000	102,580.71
HUNTSMAN INTERNATIONAL L 4.5% 29/05/01	100,000	105,728.76
HUSKY ENERGY INC 3.95% 22/04/15	100,000	102,319.10
HYATT HOTELS CORP 4.375% 28/09/15	50,000	51,812.47
HYATT HOTELS CORP 4.85% 26/03/15	50,000	52,036.42
IBM 2.875% 22/11/09	100,000	105,685.92
IBM CORP 1.7% 27/05/15	220,000	225,943.50
IBM CORP 1.875% 22/08/01	150,000	154,632.63
IBM CORP 1.95% 30/05/15	100,000	103,172.86
IBM CORP 2.5% 22/01/27	100,000	103,171.03
IBM CORP 3.3% 26/05/15	200,000	225,636.59
IBM CORP 3.375% 23/08/01	250,000	270,513.98
IBM CORP 3.45% 26/02/19	200,000	226,230.67
IBM CORP 3.5% 29/05/15	100,000	116,522.50
IBM CREDIT CORP 2.2% 22/09/08	100,000	104,102.94
IBM CREDIT CORP 3% 23/02/06	100,000	106,431.77
IDEX CORP 3% 30/05/01	50,000	53,428.46

IHS MARKIT LTD 4.125% 23/08/01	100,000	109,040.00
IHS MARKIT LTD 4.25% 29/05/01	100,000	115,519.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65% 26/11/15	100,000	110,363.21
ING GROEP NV 3.95% 27/03/29	200,000	230,510.64
ING GROEP NV 4.05% 29/04/09	200,000	236,204.68
INGERSOLL-RAND GL HLD CO 4.25% 23/06/15	150,000	165,415.05
INGERSOLL-RAND LUX FINAN 3.55% 24/11/01	100,000	110,137.70
INTEL CORP 2.45% 29/11/15	35,000	38,348.46
INTEL CORP 2.6% 26/05/19	50,000	54,985.03
INTEL CORP 2.7% 22/12/15	350,000	369,932.93
INTEL CORP 2.875% 24/05/11	100,000	108,333.04
INTEL CORP 3.3% 21/10/01	100,000	103,560.42
INTEL CORP 3.7% 25/07/29	145,000	165,554.21
INTEL CORP 3.9% 30/03/25	250,000	307,767.88
INTERCONTINENTAL EXCHANG 3.75% 25/12/01	150,000	171,889.50
INTERPUBLIC GROUP COS 3.75% 21/10/01	25,000	25,939.76
INTERPUBLIC GROUP COS 4.65% 28/10/01	25,000	29,400.47
INTERPUBLIC GROUP COS 4.75% 30/03/30	100,000	120,658.74
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.25% 24/12/01	100,000	109,412.79
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.6% 29/04/01	50,000	56,411.13
INTL FLAVOR & FRAGRANCES 4.45% 28/09/26	45,000	51,342.34
INTL PAPER CO 7.5% 21/08/15	102,000	109,346.72
INTUIT INC 0.95% 25/07/15	35,000	35,212.74
INVESCO FINANCE PLC 3.75% 26/01/15	150,000	164,650.58
ITC HOLDINGS CORP 3.25% 26/06/30	60,000	65,791.93
ITC HOLDINGS CORP 3.65% 24/06/15	25,000	27,202.39
JABIL INC 3.6% 30/01/15	150,000	157,397.82
JB HUNT TRANSPORT SVCS 3.875% 26/03/01	100,000	115,521.28
JD.COM INC 3.375% 30/01/14	200,000	215,150.59
JEFFERIES GROUP 4.85% 27/01/15	90,000	100,546.35
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.55% 22/07/05	100,000	100,278.78
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.7% 23/07/05	100,000	100,443.68
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.95% 22/06/13	70,000	72,024.60
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.25% 26/09/14	100,000	108,516.16
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.45% 30/01/09	100,000	109,283.41
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.6% 24/03/07	100,000	106,961.48
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.65% 22/01/06	100,000	103,247.82
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.65% 24/06/24	50,000	53,880.44
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.7% 23/01/06	50,000	52,856.10
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8% 23/03/06	100,000	106,500.74
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8% 29/07/18	50,000	55,964.60
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.05% 28/01/06	50,000	55,571.26
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.2% 22/01/10	70,000	73,002.33
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.45% 23/06/07	50,000	54,125.55
JOHNSON & JOHNSON 2.05% 23/03/01	100,000	104,238.86
JOHNSON & JOHNSON 2.25% 22/03/03	100,000	103,086.72
JOHNSON & JOHNSON 2.45% 26/03/01	100,000	110,255.26
JOHNSON & JOHNSON 2.95% 27/03/03	100,000	112,761.85

JPMORGAN CHASE & CO 1.514% 24/06/01	200,000	203,942.35
JPMORGAN CHASE & CO 2.005% 26/03/13	400,000	415,620.46
JPMORGAN CHASE & CO 2.182% 28/06/01	200,000	208,441.10
JPMORGAN CHASE & CO 2.301% 25/10/15	300,000	316,219.86
JPMORGAN CHASE & CO 2.739% 30/10/15	275,000	296,246.59
JPMORGAN CHASE & CO 2.776% 23/04/25	113,000	116,939.47
JPMORGAN CHASE & CO 2.95% 26/10/01	200,000	219,828.00
JPMORGAN CHASE & CO 2.956% 31/05/13	50,000	53,622.99
JPMORGAN CHASE & CO 2.972% 23/01/15	300,000	310,309.49
JPMORGAN CHASE & CO 3.2% 23/01/25	500,000	532,334.78
JPMORGAN CHASE & CO 3.25% 22/09/23	500,000	528,748.41
JPMORGAN CHASE & CO 3.3% 26/04/01	200,000	223,698.60
JPMORGAN CHASE & CO 3.375% 23/05/01	200,000	213,711.20
JPMORGAN CHASE & CO 3.509% 29/01/23	250,000	282,386.98
JPMORGAN CHASE & CO 3.559% 24/04/23	150,000	161,028.09
JPMORGAN CHASE & CO 3.702% 30/05/06	125,000	144,627.77
JPMORGAN CHASE & CO 3.797% 24/07/23	200,000	217,506.80
JPMORGAN CHASE & CO 3.96% 27/01/29	200,000	228,596.55
JPMORGAN CHASE & CO 4.005% 29/04/23	100,000	116,699.88
JPMORGAN CHASE & CO 4.125% 26/12/15	250,000	292,464.83
JPMORGAN CHASE & CO 4.203% 29/07/23	200,000	236,453.99
JPMORGAN CHASE & CO 4.25% 27/10/01	400,000	466,158.43
JPMORGAN CHASE & CO 4.493% 31/03/24	400,000	494,511.20
JUNIPER NETWORKS INC 3.75% 29/08/15	50,000	57,199.84
JUNIPER NETWORKS INC 4.5% 24/03/15	50,000	55,329.86
KAISER FOUNDATION HOSPIT 3.15% 27/05/01	50,000	56,065.25
KANSAS CITY POWER & LT 3.15% 23/03/15	79,000	83,695.92
KANSAS CITY SOUTHERN 2.875% 29/11/15	65,000	68,856.78
KELLOGG CO 2.1% 30/06/01	65,000	66,649.84
KELLOGG CO 4.3% 28/05/15	100,000	118,964.96
KEMPER CORP 4.35% 25/02/15	35,000	37,751.68
KEURIG DR PEPPER INC 4.057% 23/05/25	100,000	109,327.50
KEURIG DR PEPPER INC 4.597% 28/05/25	250,000	303,003.88
KEY BANK NA 3.3% 22/02/01	250,000	260,444.11
KEY BANK NA 3.4% 26/05/20	200,000	222,216.60
KEYCORP 2.25% 27/04/06	100,000	105,576.68
KEYCORP 2.55% 29/10/01	100,000	104,574.52
KEYSIGHT TECHNOLOGIES 3% 29/10/30	50,000	55,035.43
KEYSIGHT TECHNOLOGIES 4.6% 27/04/06	60,000	70,468.76
KILROY REALTY LP 4.375% 25/10/01	100,000	109,077.05
KIMBERLY CLARK CORP 2.75% 26/02/15	150,000	163,641.77
KIMCO REALTY CORP 2.7% 24/03/01	50,000	51,421.86
KIMCO REALTY CORP 3.3% 25/02/01	80,000	84,737.94
KINDER MORGAN ENER PART 4.15% 22/03/01	100,000	105,062.98
KINDER MORGAN INC/DELAWA 4.3% 25/06/01	100,000	112,344.63
KINROSS GOLD CORP 4.5% 27/07/15	100,000	110,456.54
KINROSS GOLD CORP 5.125% 21/09/01	100,000	103,550.39
KITE REALTY GROUP LP 4% 26/10/01	50,000	46,706.56

KLA-TENCOR CORP 4.1% 29/03/15	100,000	119,032.00
KOHL'S CORPORATION 9.5% 25/05/15	55,000	64,018.11
KROGER CO 3.5% 26/02/01	150,000	169,210.36
KROGER CO 4% 24/02/01	100,000	110,306.82
KROGER CO/THE 3.4% 22/04/15	100,000	104,201.08
L3HARRIS TECH INC 3.85% 23/06/15	70,000	76,126.59
L3HARRIS TECH INC 4.4% 28/06/15	100,000	119,483.61
LABORATORY CORP OF AMER 3.6% 27/09/01	150,000	169,047.30
LABORATORY CORP OF AMERI 3.2% 22/02/01	100,000	103,811.17
LABORATORY CORP OF AMERI 4% 23/11/01	50,000	54,742.29
LAM RESEARCH CORP 3.75% 26/03/15	150,000	173,119.47
LAM RESEARCH CORP 4% 29/03/15	55,000	66,310.10
LAS VEGAS SANDS CORP 3.2% 24/08/08	110,000	110,514.10
LAS VEGAS SANDS CORP 3.5% 26/08/18	70,000	70,186.26
LAS VEGAS SANDS CORP 3.9% 29/08/08	105,000	103,934.52
LAZARD GROUP LLC 3.625% 27/03/01	100,000	106,182.17
LAZARD GROUP LLC 4.5% 28/09/19	50,000	57,348.92
LEAR CORP 4.25% 29/05/15	100,000	104,955.01
LEGGETT & PLATT INC 3.4% 22/08/15	50,000	51,504.77
LEGGETT & PLATT INC 3.5% 27/11/15	50,000	51,748.04
LEIDOS INC 2.95% 23/05/15	45,000	47,151.00
LEUCADIA NATIONAL CORP 5.5% 23/10/18	100,000	109,840.20
LIFE STORAGE LP 4% 29/06/15	100,000	112,534.00
LINCOLN NATIONAL CORP 3.35% 25/03/09	150,000	164,390.28
LLOYDS BANKING GROUP 4.582% 25/12/10	200,000	222,612.32
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.858% 23/03/17	200,000	206,361.83
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907% 23/11/07	400,000	416,173.61
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.87% 25/07/09	200,000	218,611.94
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% 25/05/08	200,000	228,323.85
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.55% 28/08/16	200,000	237,194.63
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65% 26/03/24	200,000	224,313.93
LOCKHEED MARTIN 3.55% 26/01/15	100,000	114,899.00
LOCKHEED MARTIN CORP 1.85% 30/06/15	100,000	105,080.89
LOCKHEED MARTIN CORP 3.35% 21/09/15	111,000	114,710.86
LOEWS CORP 2.625% 23/05/15	150,000	158,526.19
LOWE'S COMPANIES INC 3.12% 22/04/15	200,000	208,104.78
LOWE'S COS INC 3.1% 27/05/03	200,000	224,509.43
LOWE'S COS INC 3.65% 29/04/05	100,000	116,234.12
LYB INTERNATIONAL FINANC 3.5% 27/03/02	150,000	166,194.49
LYB INTL FINANCE BV 4% 23/07/15	60,000	65,328.31
LYONDELLBASELL IND NV 6% 21/11/15	100,000	105,874.38
MAGELLAN MISDTREAM PARTN 5% 26/03/01	50,000	58,287.92
MAGNA INTERNATIONAL INC 2.45% 30/06/15	100,000	103,159.47
MAGNA INTERNATIONAL INC 4.15% 25/10/01	50,000	56,393.67
MANULIFE FINANCIAL CORP 2.484% 27/05/19	35,000	36,808.85
MANULIFE FINANCIAL CORP 4.15% 26/03/04	100,000	118,475.53
MARATHON OIL CORP 2.8% 22/11/01	150,000	151,573.67
MARATHON PETROLEUM CORP 3.8% 28/04/01	30,000	32,166.30

MARATHON PETROLEUM CORP 4.7% 25/05/01	100,000	112,792.69
MARATHON PETROLEUM CORP 4.75% 23/12/15	100,000	109,730.26
MARATHON PETROLEUM CORP 5.125% 26/12/15	100,000	116,329.47
MARKEL CORPORATION 4.9% 22/07/01	70,000	75,403.13
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.125% 21/10/15	100,000	101,242.32
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.125% 26/06/15	100,000	97,452.25
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.6% 24/04/15	50,000	50,311.75
MARRIOTT INTERNATIONAL 4.625% 30/06/15	110,000	115,153.14
MARSH & MCLENNAN 2.75% 22/01/30	30,000	30,960.44
MARSH & MCLENNAN COS INC 3.875% 24/03/15	150,000	166,508.27
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.375% 29/03/15	95,000	116,372.84
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.8% 21/07/15	100,000	103,329.50
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.45% 27/06/01	21,000	22,947.84
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.5% 27/12/15	50,000	55,581.56
MARTIN MARIETTA MATERIAL 4.25% 24/07/02	30,000	32,832.14
MARVELL TECHNOLOGY GROUP 4.2% 23/06/22	100,000	107,906.36
MARVELL TECHNOLOGY GROUP 4.875% 28/06/22	100,000	122,537.52
MASCO CORP 4.375% 26/04/01	90,000	103,348.72
MASTERCARD INC 2.95% 29/06/01	100,000	113,562.43
MASTERCARD INC 3.375% 24/04/01	200,000	221,726.93
MASTERCARD INC 3.5% 28/02/26	30,000	34,909.74
MAXIM INTEGRATED PRODUCT 3.45% 27/06/15	100,000	108,862.28
MCCORMICK & CO 2.7% 22/08/15	50,000	52,102.17
MCCORMICK & CO 3.15% 24/08/15	50,000	54,231.74
MCDONALD'S CORP 2.625% 29/09/01	100,000	108,283.47
MCDONALD'S CORP 3.3% 25/07/01	100,000	111,482.05
MCDONALDS CORP 3.35% 23/04/01	105,000	112,588.62
MCDONALDS CORP 3.7% 26/01/30	100,000	113,783.78
MCDONALDS CORP 3.8% 28/04/01	150,000	176,138.27
MCKESSON CORP 3.796% 24/03/15	100,000	109,762.61
MEAD JOHNSON NUTRITION C 4.125% 25/11/15	60,000	70,041.74
MEDTRONIC INC 2.75% 23/04/01	200,000	211,339.24
MEDTRONIC INC 3.15% 22/03/15	79,000	82,607.14
MEDTRONIC INC 3.5% 25/03/15	201,000	227,407.38
MERCK & CO INC 0.75% 26/02/24	115,000	115,083.77
MERCK & CO INC 1.45% 30/06/24	105,000	106,643.89
MERCK & CO INC 2.75% 25/02/10	100,000	108,771.28
MERCK & CO INC 2.8% 23/05/18	200,000	213,467.89
MERCK & CO INC 3.4% 29/03/07	100,000	117,107.88
MERCY HEALTHCARE SYSTEM 4.302% 28/07/01	15,000	17,791.78
METLIFE INC 4.368% 23/09/15	100,000	111,692.87
METLIFE INC 4.55% 30/03/23	100,000	125,877.18
MICRON TECHNOLOGY INC 2.497% 23/04/24	205,000	213,390.19
MICRON TECHNOLOGY INC 4.185% 27/02/15	50,000	56,474.67
MICRON TECHNOLOGY INC 5.327% 29/02/06	50,000	60,121.00
MICROSOFT CORP 1.55% 21/08/08	200,000	202,615.78
MICROSOFT CORP 2% 23/08/08	100,000	104,747.22
MICROSOFT CORP 2.375% 22/02/12	250,000	258,110.62

MICROSOFT CORP 2.4% 26/08/08	150,000	164,310.00
MICROSOFT CORP 2.7% 25/02/12	250,000	272,861.20
MICROSOFT CORP 3.125% 25/11/03	150,000	168,740.24
MICROSOFT CORP 3.3% 27/02/06	300,000	345,854.79
MICROSOFT CORP 3.625% 23/12/15	150,000	165,574.19
MID-AMERICA APARTMENTS 3.95% 29/03/15	100,000	115,973.45
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.193% 25/02/25	200,000	207,544.09
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.623% 22/07/18	200,000	207,637.34
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 2.665% 22/07/25	200,000	207,630.83
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.195% 29/07/18	200,000	219,975.16
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.455% 23/03/02	100,000	106,812.78
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.535% 21/07/26	200,000	206,482.87
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 4.05% 28/09/11	200,000	233,499.82
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL 2.757% 26/09/13	200,000	215,764.38
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL 3.777% 25/03/02	100,000	110,812.91
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL 3.961% 28/03/02	100,000	115,820.73
MIZUHO FINANCIAL GROUP 1.241% 24/07/10	200,000	200,504.86
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.721% 23/07/16	200,000	206,841.69
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.839% 25/07/16	200,000	210,560.81
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.869% 30/09/13	200,000	212,010.41
MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018% 28/03/05	200,000	229,935.15
MOHAWK INDUSTRIES INC 3.85% 23/02/01	150,000	159,143.62
MOLSON COORS 2.1% 21/07/15	65,000	65,841.67
MOLSON COORS 3% 26/07/15	165,000	172,455.21
MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625% 22/07/01	70,000	70,269.57
MONDELEZ INTERNATIONAL 2.75% 30/04/13	65,000	70,840.82
MONDELEZ INTERNATIONAL 3.625% 26/02/13	100,000	113,397.93
MONDELEZ INTERNATIONAL 4% 24/02/01	100,000	110,271.84
MOODY'S CORPORATION 2.75% 21/12/15	50,000	51,424.30
MORGAN STANLEY 2.188% 26/04/28	50,000	52,301.33
MORGAN STANLEY 2.625% 21/11/17	200,000	205,555.32
MORGAN STANLEY 2.699% 31/01/22	300,000	322,740.98
MORGAN STANLEY 2.72% 25/07/22	315,000	335,522.88
MORGAN STANLEY 2.75% 22/05/19	250,000	259,740.48
MORGAN STANLEY 3.125% 23/01/23	250,000	265,050.36
MORGAN STANLEY 3.125% 26/07/27	450,000	498,257.43
MORGAN STANLEY 3.591% 28/07/22	200,000	226,360.17
MORGAN STANLEY 3.622% 31/04/01	200,000	230,845.93
MORGAN STANLEY 3.7% 24/10/23	450,000	499,347.34
MORGAN STANLEY 3.75% 23/02/25	200,000	215,732.45
MORGAN STANLEY 3.875% 26/01/27	400,000	456,957.58
MORGAN STANLEY 4.1% 23/05/22	300,000	325,589.52
MORGAN STANLEY 4.35% 26/09/08	250,000	289,996.49
MOSAIC CO 3.25% 22/11/15	100,000	103,080.00
MOSAIC CO 4.05% 27/11/15	100,000	106,335.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4% 24/09/01	100,000	110,524.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6% 29/05/23	100,000	116,574.69
MPLX LP 3.375% 23/03/15	50,000	52,264.38

MPLX LP 3.5% 22/12/01	235,000	244,728.98
MPLX LP 4.8% 29/02/15	100,000	111,995.82
MPLX LP 4.875% 25/06/01	250,000	280,539.58
MYLAN 3.95% 26/06/15	250,000	282,147.00
NASDAQ 3.85% 26/06/30	30,000	33,968.97
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.5% 26/07/12	250,000	270,261.22
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.375% 21/09/20	250,000	258,308.80
NATIONAL FUEL GAS CO 3.95% 27/09/15	50,000	49,182.81
NATIONAL FUEL GAS CO 4.75% 28/09/01	50,000	51,176.34
NATIONAL FUEL GAS CO 5.5% 26/01/15	15,000	16,145.27
NATIONAL OILWELL VARCO I 2.6% 22/12/01	43,000	43,515.57
NATIONAL RETAIL PROP INC 4.3% 28/10/15	65,000	71,295.04
NATIONAL RETAIL PROPERTI 4% 25/11/15	65,000	70,998.12
NATIONAL RURAL UTIL COOP 2.3% 22/09/15	70,000	72,230.97
NATIONAL RURAL UTILITIES 5.25% 46/04/20	150,000	159,445.22
NBCUNIVERSAL MEDIA LLC 2.875% 23/01/15	100,000	107,240.25
NETAPP INC 2.375% 27/06/22	100,000	102,981.27
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.25% 30/06/01	100,000	104,460.27
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.403% 21/09/01	100,000	102,208.55
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.75% 25/05/01	200,000	216,704.22
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.8% 23/01/15	50,000	52,583.95
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.9% 22/04/01	100,000	104,305.41
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65% 79/05/01	150,000	166,503.30
NIKE INC 2.25% 23/05/01	50,000	52,767.16
NIKE INC 2.375% 26/11/01	100,000	109,592.53
NIKE INC 2.85% 30/03/27	150,000	168,508.25
NISOURCE FINANCE CORP 2.65% 22/11/17	20,000	20,895.07
NISOURCE FINANCE CORP 3.49% 27/05/15	100,000	113,760.90
NISOURCE INC 3.65% 23/06/15	50,000	54,006.23
NOBLE ENERGY INC 3.9% 24/11/15	150,000	153,186.22
NOMURA HOLDINGS INC 3.103% 30/01/16	200,000	209,652.41
NORFOLK SOUTHERN 2.9% 26/06/15	65,000	72,621.33
NORFOLK SOUTHERN CORP 2.903% 23/02/15	200,000	210,484.39
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.15% 27/06/01	75,000	82,887.35
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.8% 28/08/01	50,000	58,355.05
NORTHERN TRUST CORP 3.375% 21/08/23	50,000	51,625.92
NORTHERN TRUST CORP 3.375% 32/05/08	62,000	66,777.23
NORTHERN TRUST CORP 3.65% 28/08/03	50,000	58,761.15
NORTHERN TRUST CORP 3.95% 25/10/30	100,000	115,520.22
NORTHROP GRUMMAN CORP 3.25% 23/08/01	150,000	161,915.18
NORTHROP GRUMMAN CORP 3.25% 28/01/15	200,000	226,195.55
NOVARTIS CAPITAL CORP 1.75% 25/02/14	100,000	104,608.09
NOVARTIS CAPITAL CORP 2% 27/02/14	100,000	106,422.70
NOVARTIS CAPITAL CORP 2.4% 22/05/17	150,000	155,632.86
NOVARTIS CAPITAL CORP 3.4% 24/05/06	350,000	385,521.02
NSTAR ELECTRIC CO 3.2% 27/05/15	50,000	56,673.40
NSTAR ELECTRIC CO 3.25% 29/05/15	100,000	113,875.52
NUCOR CORP 4% 23/08/01	150,000	163,412.86

NUTRIEN LTD 2.95% 30/05/13	100,000	107,645.64
NUTRIEN LTD 3% 25/04/01	100,000	107,268.46
NUTRIEN LTD 3.15% 22/10/01	150,000	156,834.24
NVIDIA CORP 2.2% 21/09/16	30,000	30,603.43
NVIDIA CORP 2.85% 30/04/01	100,000	112,701.01
NVR INC 3% 30/05/15	65,000	69,268.28
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 2.7% 25/05/01	20,000	21,043.28
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.4% 30/05/01	45,000	48,815.41
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875% 26/06/18	100,000	111,927.43
NXP BV/NXP FUNDING LLC 4.875% 24/03/01	100,000	112,291.83
NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.55% 28/12/01	100,000	123,917.69
OKLAHOMA G&E CO 3.25% 30/04/01	55,000	61,609.27
OLD REPUBLIC INTERNATION 3.875% 26/08/26	100,000	106,949.17
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.375% 23/08/01	50,000	52,888.97
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 25/01/15	50,000	51,751.80
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 27/04/01	100,000	104,590.62
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.95% 24/04/01	100,000	105,425.75
OMNICOM GROUP INC 2.45% 30/04/30	100,000	103,883.20
OMNICOM GROUP INC 3.6% 26/04/15	100,000	112,066.33
OMNICOM GROUP INC 3.625% 22/05/01	150,000	158,463.57
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 2.95% 25/04/01	100,000	109,298.29
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 3.7% 28/11/15	100,000	118,658.29
ONEOK INC 4% 27/07/13	85,000	86,593.76
ONEOK INC 4.55% 28/07/15	150,000	155,621.36
ONEOK INC 5.85% 26/01/15	65,000	73,802.77
ONEOK PARTNERS LP 3.375% 22/10/01	100,000	103,453.00
ORACLE CORP 1.9% 21/09/15	350,000	355,917.87
ORACLE CORP 2.5% 22/10/15	250,000	260,777.80
ORACLE CORP 2.5% 25/04/01	100,000	107,837.77
ORACLE CORP 2.625% 23/02/15	105,000	110,271.39
ORACLE CORP 2.8% 27/04/01	300,000	329,349.60
ORACLE CORP 2.95% 24/11/15	200,000	218,083.24
ORACLE CORP 2.95% 25/05/15	300,000	329,478.76
ORACLE CORP 2.95% 30/04/01	150,000	169,385.92
ORACLE CORP 3.25% 27/11/15	150,000	169,986.00
ORACLE CORP 3.625% 23/07/15	150,000	163,790.33
OREILLY AUTOMOTIVE INC 3.55% 26/03/15	50,000	57,232.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35% 28/06/01	150,000	176,131.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 4.625% 21/09/15	100,000	103,490.49
ORIX CORP 2.9% 22/07/18	30,000	31,125.88
ORIX CORP 3.25% 24/12/04	100,000	108,148.54
ORIX CORP 3.7% 27/07/18	50,000	55,995.13
OTIS WORLDWIDE CORP 2.056% 25/04/05	40,000	41,965.00
OTIS WORLDWIDE CORP 2.293% 27/04/05	35,000	36,840.24
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565% 30/02/15	40,000	42,243.26
OWENS CORNING 3.95% 29/08/15	180,000	197,830.82
OWL ROCK CAPITAL CORP 4% 25/03/30	100,000	99,365.49
PACCAR FINANCIAL CORP 2% 22/09/26	65,000	67,100.03

PACCAR FINANCIAL CORP 3.4% 23/08/09	50,000	54,148.21
PACIFIC GAS & ELECTRIC 1.75% 22/06/16	100,000	100,130.00
PACIFIC GAS & ELECTRIC 2.1% 27/08/01	110,000	108,269.70
PACIFICORP 3.5% 29/06/15	150,000	174,575.32
PACKAGING CORP OF AMERIC 3.4% 27/12/15	35,000	39,075.02
PACKAGING CORP OF AMERIC 3.65% 24/09/15	100,000	109,381.48
PARKER-HANNIFIN CORP 3.3% 24/11/21	150,000	163,385.50
PAYPAL HOLDINGS INC 1.35% 23/06/01	35,000	35,849.00
PAYPAL HOLDINGS INC 2.4% 24/10/01	105,000	111,765.86
PAYPAL HOLDINGS INC 2.65% 26/10/01	100,000	109,409.40
PAYPAL HOLDINGS INC 2.85% 29/10/01	200,000	221,121.91
PEPSICO INC 0.75% 23/05/01	115,000	116,221.01
PEPSICO INC 1.7% 21/10/06	300,000	304,486.48
PEPSICO INC 2.375% 26/10/06	155,000	169,130.57
PEPSICO INC 2.75% 30/03/19	200,000	225,355.03
PEPSICO INC 2.85% 26/02/24	100,000	111,522.71
PEPSICO INC 3% 27/10/15	100,000	113,525.90
PEPSICO INC 3.6% 24/03/01	100,000	110,266.92
PERKINELMER INC 3.3% 29/09/15	60,000	64,546.95
PERRIGO FINANCE UNLIMITE 4.375% 26/03/15	200,000	218,172.41
PFIZER 2.75% 26/06/03	100,000	111,639.88
PFIZER INC 0.8% 25/05/28	65,000	65,523.70
PFIZER INC 2.625% 30/04/01	200,000	222,894.80
PFIZER INC 2.8% 22/03/11	65,000	67,636.03
PFIZER INC 3% 21/09/15	75,000	77,434.14
PFIZER INC 3% 26/12/15	150,000	170,370.25
PFIZER INC 3.45% 29/03/15	200,000	236,091.26
PHILIP MORRIS INTL INC 1.125% 23/05/01	45,000	45,717.48
PHILIP MORRIS INTL INC 2.1% 30/05/01	35,000	36,551.15
PHILIP MORRIS INTL INC 2.375% 22/08/17	100,000	104,053.24
PHILIP MORRIS INTL INC 2.5% 22/11/02	100,000	104,426.30
PHILIP MORRIS INTL INC 2.75% 26/02/25	50,000	55,213.24
PHILIP MORRIS INTL INC 2.875% 24/05/01	100,000	107,893.29
PHILIP MORRIS INTL INC 3.125% 27/08/17	100,000	111,848.07
PHILIP MORTOR INTERNATIO 3.25% 24/11/10	100,000	110,988.00
PHILLIPS 66 3.7% 23/04/06	100,000	107,088.64
PHILLIPS 66 3.85% 25/04/09	100,000	111,363.00
PHILLIPS 66 4.3% 22/04/01	100,000	105,878.20
PHILLIPS 66 PARTNERS 3.55% 26/10/01	75,000	80,738.09
PHILLIPS 66 PARTNERS LP 2.45% 24/12/15	25,000	25,308.32
PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.15% 29/12/15	100,000	102,155.30
PIONEER NATURAL RESOURCE 4.45% 26/01/15	100,000	116,389.86
PLAINS ALL AMER PIPELINE 3.6% 24/11/01	200,000	206,949.13
PLAINS ALL AMER PIPELINE 4.5% 26/12/15	50,000	53,479.93
PNC BANK NA 2.028% 22/12/09	250,000	255,164.07
PNC BANK NA 2.625% 22/02/17	250,000	258,579.69
PNC BANK NA 2.7% 29/10/22	250,000	268,769.49
PNC BANK NA 3.25% 25/06/01	250,000	277,347.42

PNC BANK NA 3.5% 23/06/08	250,000	270,312.90
PNC BANK NA 4.05% 28/07/26	250,000	295,647.24
PNC FINANCIAL SERVICES 2.55% 30/01/22	100,000	109,122.05
PPG INDUSTRIES INC 2.55% 30/06/15	100,000	104,332.32
PPG INDUSTRIES INC 3.2% 23/03/15	100,000	105,524.48
PPL CAPITAL FUNDING INC 3.95% 24/03/15	100,000	109,173.57
PPL CAPITAL FUNDING INC 4.125% 30/04/15	200,000	230,888.74
PRAXAIR INC 2.2% 22/08/15	100,000	103,110.16
PRAXAIR INC 3.2% 26/01/30	50,000	55,854.96
PRECISION CASTPARTS CORP 2.5% 23/01/15	200,000	209,476.23
PRICELINE GROUP 3.6% 26/06/01	100,000	111,267.23
PRICELINE GROUP INC/THE 2.75% 23/03/15	100,000	104,800.36
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 2.125% 30/06/15	100,000	101,464.81
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 3.7% 29/05/15	50,000	57,728.54
PROCTER & GAMBLE 2.45% 26/11/03	100,000	110,370.88
PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.7% 21/11/03	150,000	152,704.44
PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.15% 22/08/11	100,000	103,873.19
PROCTER & GAMBLE CO/THE 3% 30/03/25	100,000	115,563.71
PROGRESS ENERGY CAROLINA 3% 21/09/15	100,000	102,408.86
PROGRESSIVE CORP 3.2% 30/03/26	100,000	114,713.28
PROGRESSIVE CORP 3.75% 21/08/23	50,000	51,700.90
PROLOGIS LP 2.125% 27/04/15	50,000	52,909.87
PROLOGIS LP 3.75% 25/11/01	200,000	228,820.01
PROSPECT CAPITAL CORP 5.875% 23/03/15	50,000	51,500.54
PROV ST JOSEPH HLTH OBL 2.532% 29/10/01	100,000	105,927.82
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 1.5% 26/03/10	100,000	102,303.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.5% 24/05/15	100,000	110,633.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4.5% 47/09/15	100,000	103,000.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.625% 43/06/15	250,000	265,171.87
PRUDENTIAL PLC 3.125% 30/04/14	100,000	109,060.35
PSEG 2% 21/11/15	100,000	101,583.76
PUBLIC SERVICE COLORADO 3.7% 28/06/15	50,000	58,103.88
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 2.45% 30/01/15	35,000	37,852.03
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 25/05/15	150,000	165,159.78
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 27/05/15	100,000	110,880.71
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3.25% 23/09/01	50,000	54,051.73
PUBLIC STORAGE 2.37% 22/09/15	25,000	25,920.99
PUBLIC STORAGE 3.094% 27/09/15	125,000	140,383.09
PUGET ENERGY INC 5.625% 22/07/15	100,000	106,911.43
PUGET ENERGY INC 6% 21/09/01	100,000	105,349.10
QUALCOMM INC 2.6% 23/01/30	100,000	104,919.00
QUALCOMM INC 2.9% 24/05/20	300,000	322,959.51
QUALCOMM INC 3.25% 27/05/20	100,000	113,945.82
QUALCOMM INC 3.45% 25/05/20	100,000	111,847.81
QUEST DIAGNOSTICS INC 3.5% 25/03/30	100,000	110,359.74
RABOBANK NEDERLAND 3.875% 22/02/08	250,000	263,378.61
RALPH LAUREN CORP 3.75% 25/09/15	50,000	55,903.42
RAYMOND JAMES FINANCIAL 4.65% 30/04/01	100,000	121,568.09

RAYTHEON TECH CORP 3.5% 27/03/15	200,000	225,965.09
REALTY INCOME CORP 3.25% 22/10/15	100,000	104,961.44
REALTY INCOME CORP 3.65% 28/01/15	200,000	221,607.91
REGENCY CENTERS LP 3.6% 27/02/01	30,000	32,014.51
REGENCY CENTERS LP 4.125% 28/03/15	50,000	55,119.63
REGIONS FINANCIAL CORP 3.8% 23/08/14	100,000	108,791.15
REINSURANCE GRP OF AMER 3.15% 30/06/15	35,000	36,842.43
REINSURANCE GRP OF AMER 3.9% 29/05/15	75,000	82,458.31
RELIANCE STEEL & ALUM 4.5% 23/04/15	100,000	107,349.37
RELX CAPITAL INC 3% 30/05/22	85,000	93,320.97
RENAISSANCERE FINANCE 3.45% 27/07/01	65,000	68,792.63
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6% 29/04/15	25,000	27,507.02
REPUBLIC SERVICES INC 2.5% 24/08/15	45,000	47,988.08
REPUBLIC SERVICES INC 3.375% 27/11/15	60,000	67,913.19
REPUBLIC SERVICES INC 3.95% 28/05/15	100,000	117,992.62
ROPER TECHNOLOGIES INC 2.35% 24/09/15	150,000	159,456.88
ROPER TECHNOLOGIES INC 2.8% 21/12/15	50,000	51,447.46
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.125% 22/11/15	150,000	157,602.97
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.8% 26/12/15	55,000	63,416.06
ROYAL BANK OF CANADA 2.25% 24/11/01	150,000	158,734.62
ROYAL BANK OF CANADA 3.7% 23/10/05	100,000	109,588.98
ROYAL BANK OF CANADA 4.65% 26/01/27	150,000	176,569.22
ROYAL BANK OF SCOTLAND 4.8% 26/04/05	200,000	232,335.44
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 4.269% 25/03/22	200,000	218,067.46
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 4.445% 30/05/08	200,000	233,633.73
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 5.125% 24/05/28	205,000	224,647.25
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 6.1% 23/06/10	200,000	221,549.41
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 6.125% 22/12/15	215,000	235,028.71
RPM INTERNATIONAL INC 3.75% 27/03/15	50,000	53,401.34
RPM INTERNATIONAL INC 4.55% 29/03/01	50,000	56,403.36
RYDER SYSTEM INC 2.5% 24/09/01	190,000	197,909.40
RYDER SYSTEM INC 3.65% 24/03/18	100,000	108,256.61
S&P GLOBAL INC 2.95% 27/01/22	150,000	166,889.60
S&P GLOBAL INC 4% 25/06/15	50,000	57,209.61
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.2% 28/03/15	200,000	217,762.73
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5% 30/05/15	255,000	287,919.62
SABINE PASS LIQUEFACTION 5.625% 25/03/01	225,000	259,026.22
SABINE PASS LIQUEFACTION 5.75% 24/05/15	100,000	113,217.71
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 3.9% 29/10/15	50,000	46,652.68
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 4.8% 24/06/01	50,000	50,413.47
SALESFORCE.COM INC 3.7% 28/04/11	200,000	234,200.83
SANDS CHINA LTD 4.6% 23/08/08	200,000	210,396.00
SANDS CHINA LTD 5.125% 25/08/08	200,000	216,936.00
SANOFI 3.375% 23/06/19	100,000	108,337.68
SANOFI 3.625% 28/06/19	100,000	117,897.64
SANTANDER HOLDINGS USA 3.244% 26/10/05	100,000	104,721.42
SANTANDER HOLDINGS USA 3.4% 23/01/18	200,000	209,392.12
SANTANDER HOLDINGS USA 3.45% 25/06/02	100,000	104,739.67

SANTANDER HOLDINGS USA 3.5% 24/06/07	70,000	74,144.00
SANTANDER HOLDINGS USA 4.4% 27/07/13	120,000	132,167.79
SANTANDER ISSUANCES 5.179% 25/11/19	200,000	225,422.48
SANTANDER UK GROUP HLDGS 3.571% 23/01/10	200,000	207,845.49
SANTANDER UK PLC 2.1% 23/01/13	200,000	206,905.95
SANTANDER UK PLC 2.875% 24/06/18	250,000	266,487.26
SCHLUMBERGER INVESTMENT 3.65% 23/12/01	200,000	215,578.12
SEAGATE HDD CAYMAN 4.091% 29/06/01	53,000	55,610.07
SEAGATE HDD CAYMAN 4.875% 27/06/01	51,000	55,772.58
SEMPRA ENERGY 2.875% 22/10/01	100,000	103,528.57
SEMPRA ENERGY 3.25% 27/06/15	200,000	220,521.09
SEMPRA ENERGY 3.75% 25/11/15	100,000	110,563.32
SHELL INTERNATIONAL 2.875% 26/05/10	200,000	220,220.84
SHELL INTERNATIONAL FIN 1.75% 21/09/12	100,000	101,429.58
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.375% 29/11/07	100,000	106,463.97
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.75% 30/04/06	100,000	109,767.14
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.25% 25/05/11	100,000	111,145.04
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.4% 23/08/12	250,000	270,943.42
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875% 28/11/13	150,000	176,551.51
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.125% 24/06/01	50,000	53,839.64
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45% 27/06/01	100,000	112,950.03
SHERWIN-WILLIAMS CO 4.2% 22/01/15	100,000	103,671.70
SHIRE ACQ INV IRELAND DA 2.4% 21/09/23	100,000	101,905.15
SHIRE ACQ INV IRELAND DA 2.875% 23/09/23	150,000	159,261.19
SHIRE ACQ INV IRELAND DA 3.2% 26/09/23	280,000	311,834.75
SIMON PROPERTY GROUP LP 2% 24/09/13	100,000	102,863.01
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.45% 29/09/13	100,000	99,705.45
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.75% 23/06/01	100,000	104,560.28
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.25% 26/11/30	100,000	107,510.59
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 27/12/01	100,000	107,970.23
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.5% 25/09/01	65,000	70,237.19
SKANDINAVISKA ENSKILDA B 1.875% 21/09/13	100,000	101,646.27
SL GREEN REALTY CORP 4.5% 22/12/01	50,000	51,618.42
SMUCKER (J.M.) CO 3.5% 21/10/15	150,000	155,741.35
SOUTHERN CAL EDISON 2.25% 30/06/01	35,000	35,841.12
SOUTHERN CAL EDISON 2.85% 29/08/01	130,000	139,959.88
SOUTHERN CAL EDISON 3.7% 25/08/01	30,000	33,279.90
SOUTHERN CALIF GAS CO 3.15% 24/09/15	100,000	108,849.66
SOUTHERN CO GAS CAPITAL 2.45% 23/10/01	50,000	52,552.62
SOUTHERN CO/THE 3.25% 26/07/01	150,000	167,680.99
SOUTHERN COPPER CORP 3.5% 22/11/08	67,000	70,261.99
SOUTHWEST AIRLINES CO 3% 26/11/15	100,000	99,002.39
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.125% 27/06/15	70,000	73,198.29
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.25% 25/05/04	65,000	69,441.51
SOUTHWESTERN ELEC POWER 4.1% 28/09/15	100,000	115,079.94
SOVRAN ACQUISITION 3.5% 26/07/01	50,000	53,910.44
SPECTRA ENERGY PARTNERS 4.75% 24/03/15	150,000	167,885.02
SPIRIT REALTY LP 3.2% 27/01/15	100,000	97,679.59

SSM HEALTH CARE 3.688% 23/06/01	100,000	107,455.50
STANLEY BLACK & DECKER I 2.9% 22/11/01	100,000	105,396.90
STANLEY BLACK & DECKER I 3.4% 26/03/01	70,000	78,975.05
STANLEY BLACK & DECKER I 4% 60/03/15	30,000	30,437.26
STARBUCKS CORP 1.3% 22/05/07	40,000	40,565.57
STARBUCKS CORP 2% 27/03/12	100,000	103,774.72
STARBUCKS CORP 3.1% 23/03/01	150,000	159,525.00
STARBUCKS CORP 3.5% 28/03/01	50,000	56,934.32
STARBUCKS CORP 3.8% 25/08/15	100,000	113,276.98
STEEL DYNAMICS INC 2.8% 24/12/15	150,000	157,476.78
STIFEL FIANCIAL 4.25% 24/07/18	100,000	106,913.14
STORE CAPITAL CORP 4.625% 29/03/15	50,000	53,107.14
STRYKER CORP 1.95% 30/06/15	100,000	102,106.86
STRYKER CORP 3.375% 25/11/01	150,000	168,016.00
STRYKER CORP 3.5% 26/03/15	25,000	28,324.52
SUMITOMO MITSUI FINANCIA 2.442% 21/10/19	350,000	358,028.01
SUMITOMO MITSUI FINANCIA 3.784% 26/03/09	150,000	169,586.07
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 1.474% 25/07/08	200,000	201,445.58
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.13% 30/07/08	200,000	203,230.74
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.348% 25/01/15	200,000	210,467.29
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.696% 24/07/16	200,000	212,482.96
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.04% 29/07/16	200,000	217,785.34
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.102% 23/01/17	250,000	265,225.18
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.364% 27/07/12	200,000	223,251.95
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.544% 28/01/17	100,000	112,463.73
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.944% 28/07/19	100,000	115,319.62
SUNCOR ENERGY INC 3.1% 25/05/15	40,000	42,759.38
SUNCOR ENERGY INC 3.6% 24/12/01	75,000	81,452.88
SUNOCO LOGISTICS PARTNER 4.25% 24/04/01	60,000	63,014.14
SUNTRUST BANK 2.45% 22/08/01	100,000	103,648.43
SUNTRUST BANK 2.8% 22/05/17	300,000	312,312.05
SUNTRUST BANK 3.3% 26/05/15	200,000	220,490.62
SUNTRUST BANKS INC 4% 25/05/01	150,000	170,999.50
SUZANO AUSTRIA GMBH 6% 29/01/15	200,000	215,130.00
SVB FINANCIAL GROUP 3.5% 25/01/29	150,000	159,896.16
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.875% 21/09/07	250,000	254,243.22
SYNCHRONY FINANCIAL 2.85% 22/07/25	30,000	30,489.86
SYNCHRONY FINANCIAL 3.7% 26/08/04	50,000	51,372.28
SYNCHRONY FINANCIAL 3.75% 21/08/15	200,000	203,995.93
SYNCHRONY FINANCIAL 4.5% 25/07/23	100,000	107,347.31
SYNOVUS FINANCIAL CORP 3.125% 22/11/01	30,000	30,371.40
SYSCO CORP 2.5% 21/07/15	70,000	71,159.66
SYSCO CORPORATION 2.4% 30/02/15	35,000	35,351.10
SYSCO CORPORATION 3.55% 25/03/15	150,000	163,218.06
SYSCO CORPORATION 5.95% 30/04/01	120,000	151,008.87
TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.05% 30/03/31	200,000	203,185.45
TAKEDA PHARMACEUTICAL 4% 21/11/26	200,000	208,681.75
TARGET CORP 2.25% 25/04/15	250,000	268,270.00

TARGET CORP 3.5% 24/07/01	100,000	111,724.93
TC PIPELINES LP 3.9% 27/05/25	40,000	42,619.03
TD AMERITRADE HOLDING CO 3.3% 27/04/01	60,000	67,358.48
TD AMERITRADE HOLDING CO 3.75% 24/04/01	100,000	110,923.18
TELEFONICA EMISIONES SAU 4.103% 27/03/08	150,000	174,128.69
TELUS CORP 2.8% 27/02/16	50,000	53,354.27
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.375% 25/03/12	130,000	134,390.10
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.25% 29/09/04	65,000	70,526.45
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.9% 27/11/03	70,000	78,911.61
TEXTRON INC 4% 26/03/15	25,000	26,807.36
TEXTRON INC 4.3% 24/03/01	115,000	123,027.27
THE COCA-COLA COMPANY 3.2% 23/11/01	150,000	164,170.35
THERMO FISHER SCIENTIFIC 3.2% 27/08/15	100,000	112,790.77
THERMO FISHER SCIENTIFIC 4.497% 30/03/25	200,000	252,049.49
TIME WARNER CABLE INC 4% 21/09/01	150,000	154,015.01
TIMKEN CO/THE 3.875% 24/09/01	70,000	74,062.80
TJX COS INC 3.5% 25/04/15	270,000	300,301.19
TJX COS INC 3.875% 30/04/15	55,000	65,221.49
T-MOBILE USA INC 2.05% 28/02/15	140,000	140,883.40
T-MOBILE USA INC 3.5% 25/04/15	150,000	165,087.00
T-MOBILE USA INC 3.75% 27/04/15	250,000	278,087.35
T-MOBILE USA INC 3.875% 30/04/15	350,000	391,286.00
TORCHMARK CORP 3.8% 22/09/15	75,000	78,762.63
TORONTO-DOMINION BANK 1.9% 22/12/01	150,000	155,010.89
TORONTO-DOMINION BANK 3.25% 24/03/11	100,000	108,943.31
TORONTO-DOMINION BANK 3.5% 23/07/19	200,000	218,499.43
TORONTO-DOMINION BANK 3.625% 31/09/15	125,000	140,972.23
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.218% 21/07/12	65,000	66,076.39
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.434% 25/01/10	100,000	106,520.92
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.829% 30/01/10	200,000	222,002.00
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.875% 22/02/17	100,000	103,762.28
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.7% 24/01/15	100,000	110,015.46
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.75% 24/04/10	150,000	166,139.19
TOYOTA MOTOR CORP 2.157% 22/07/02	55,000	56,725.68
TOYOTA MOTOR CORP 3.183% 21/07/20	100,000	102,557.42
TOYOTA MOTOR CORP 3.419% 23/07/20	100,000	108,061.18
TOYOTA MOTOR CORP 3.669% 28/07/20	70,000	81,714.19
TOYOTA MOTOR CREDIT 2.25% 23/10/18	200,000	210,171.71
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8% 21/10/07	200,000	203,318.29
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8% 25/02/13	200,000	208,044.26
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15% 22/09/08	100,000	103,501.98
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15% 30/02/13	100,000	106,376.13
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.65% 22/04/12	100,000	103,808.03
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.9% 23/03/30	10,000	10,627.31
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.2% 27/01/11	100,000	112,199.54
TRANS-CANADA PIPELINES 3.75% 23/10/16	150,000	162,594.09
TRANSCANADA PIPELINES 4.1% 30/04/15	100,000	116,245.52
TRANSCANADA PIPELINES 4.25% 28/05/15	150,000	175,138.60

TRANSCONT GAS PIPE LINE 3.25% 30/05/15	50,000	54,207.68
TRIMBLE INC 4.9% 28/06/15	100,000	115,310.39
TRINITY ACQUISITION PLC 3.5% 21/09/15	50,000	51,203.08
TRINITY ACQUISITION PLC 4.4% 26/03/15	50,000	56,963.23
TRUIST BANK 1.5% 25/03/10	250,000	256,872.01
TRUIST FINANCIAL CORP 1.95% 30/06/05	65,000	67,406.90
TYCO ELECTRONICS GROUP 3.7% 26/02/15	100,000	111,737.98
TYSON FOODS INC 2.25% 21/08/23	35,000	35,586.94
TYSON FOODS INC 3.9% 23/09/28	40,000	43,753.82
TYSON FOODS INC 3.95% 24/08/15	100,000	111,179.66
TYSON FOODS INC 4% 26/03/01	135,000	155,244.06
TYSON FOODS INC 4.35% 29/03/01	100,000	118,557.85
UDR INC 3.2% 30/01/15	150,000	165,527.55
UNILEVER CAPITAL CORP 2.125% 29/09/06	100,000	107,467.42
UNILEVER CAPITAL CORP 2.2% 22/05/05	100,000	103,231.41
UNILEVER CAPITAL CORP 3.1% 25/07/30	100,000	111,233.82
UNILEVER CAPITAL CORP 3.25% 24/03/07	100,000	109,060.35
UNILEVER CAPITAL CORP 3.5% 28/03/22	100,000	115,664.67
UNION ELECTRIC CO 2.95% 27/06/15	50,000	55,121.85
UNION PACIFIC CORP 3.25% 25/08/15	200,000	221,999.96
UNION PACIFIC CORP 3.5% 23/06/08	100,000	107,742.38
UNION PACIFIC CORP 3.7% 29/03/01	200,000	236,308.01
UNION PACIFIC CORP 3.75% 25/07/15	100,000	113,351.57
UNIONBANCAL CORP 3.5% 22/06/18	100,000	104,949.59
UNITED AER 2014-2 A PTT 3.75% 28/03/03	149,164	137,306.85
UNITED PARCEL SERVICE 2.2% 24/09/01	20,000	21,121.23
UNITED PARCEL SERVICE 2.35% 22/05/16	100,000	103,507.44
UNITED PARCEL SERVICE 2.5% 29/09/01	20,000	21,828.53
UNITED PARCEL SERVICE 3.05% 27/11/15	150,000	169,645.74
UNITED PARCEL SERVICE 3.9% 25/04/01	100,000	113,990.57
UNITED PARCEL SERVICE 4.45% 30/04/01	100,000	126,183.75
UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.125% 27/05/04	150,000	167,646.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95% 25/08/16	150,000	172,160.76
UNITED TECHNOLOGIES CORP 4.125% 28/11/16	100,000	119,431.13
UNITEDHEALTH GROUP INC 1.25% 26/01/15	35,000	35,780.59
UNITEDHEALTH GROUP INC 2% 30/05/15	55,000	58,275.15
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.375% 24/08/15	70,000	74,554.12
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.875% 22/03/15	250,000	258,720.05
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.875% 29/08/15	75,000	84,931.83
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.375% 21/11/15	100,000	103,089.90
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.45% 27/01/15	200,000	230,854.03
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.5% 24/02/15	20,000	22,029.88
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7% 25/12/15	20,000	22,967.96
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75% 25/07/15	150,000	171,346.08
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.875% 28/12/15	25,000	30,180.69
UNUM GROUP 4% 24/03/15	100,000	106,955.10
UPJOHN INC 2.3% 27/06/22	100,000	104,857.23
UPJOHN INC 2.7% 30/06/22	100,000	104,733.64

URD INC 2.95% 26/09/01	25,000	26,750.52
US BANCORP 2.375% 26/07/22	150,000	163,063.77
US BANCORP 2.4% 24/07/30	100,000	106,599.65
US BANCORP 2.625% 22/01/24	150,000	154,960.80
US BANCORP 3% 22/03/15	100,000	104,252.46
US BANCORP 3% 29/07/30	100,000	110,782.35
US BANCORP 3.15% 27/04/27	100,000	113,227.21
US BANCORP 3.6% 24/09/11	200,000	222,849.66
US BANK NA CINCINNATI 2.05% 25/01/21	250,000	264,718.04
US BANK NA CINCINNATI 3.4% 23/07/24	250,000	271,320.91
VALE OVERSEAS LIMITED 6.25% 26/08/10	100,000	115,875.00
VALERO ENERGY CORP 2.85% 25/04/15	55,000	58,265.97
VALERO ENERGY CORP 3.65% 25/03/15	150,000	163,712.92
VALERO ENERGY CORP 4.35% 28/06/01	70,000	80,658.89
VALERO ENERGY PARTNERS 4.375% 26/12/15	45,000	51,980.65
VENTAS REALTY LP 3.1% 23/01/15	200,000	205,137.30
VENTAS REALTY LP 3.5% 25/02/01	100,000	104,153.26
VENTAS REALTY LP 4.4% 29/01/15	100,000	110,879.24
VEREIT OPERATING PARTNER 3.95% 27/08/15	40,000	42,123.92
VEREIT OPERATING PARTNER 4.6% 24/02/06	40,000	42,956.82
VEREIT OPERATING PARTNER 4.625% 25/11/01	50,000	54,153.15
VEREIT OPERATING PARTNER 4.875% 26/06/01	50,000	55,383.91
VERIZON COMMUNICATIONS 2.625% 26/08/15	250,000	273,801.60
VERIZON COMMUNICATIONS 3.15% 30/03/22	200,000	228,244.05
VERIZON COMMUNICATIONS 3.376% 25/02/15	100,000	111,543.79
VERIZON COMMUNICATIONS 3.5% 24/11/01	400,000	443,306.06
VERIZON COMMUNICATIONS 3.875% 29/02/08	85,000	101,728.00
VERIZON COMMUNICATIONS 4.125% 27/03/16	200,000	238,211.28
VERIZON COMMUNICATIONS 4.329% 28/09/21	321,000	393,205.38
VF CORP 2.4% 25/04/23	100,000	105,813.64
VF CORP 2.95% 30/04/23	65,000	69,972.31
VIACOM INC 3.875% 24/04/01	100,000	108,920.52
VIACOMCBS INC 4.2% 29/06/01	100,000	115,397.33
VIACOMCBS INC 4.75% 25/05/15	100,000	114,729.24
VIRGINIA ELEC & POWER CO 3.1% 25/05/15	100,000	109,752.19
VIRGINIA ELEC & POWER CO 3.5% 27/03/15	100,000	115,225.55
VIRGINIA ELECTRIC & POWE 3.15% 26/01/15	200,000	223,426.36
VISA INC 1.9% 27/04/15	150,000	158,795.30
VISA INC 2.05% 30/04/15	95,000	100,795.16
VISA INC 2.15% 22/09/15	20,000	20,765.76
VISA INC 2.75% 27/09/15	50,000	55,841.34
VISA INC 2.8% 22/12/14	250,000	263,836.06
VISA INC 3.15% 25/12/14	100,000	112,294.44
VMWARE INC 2.95% 22/08/21	150,000	155,686.30
VMWARE INC 3.9% 27/08/21	100,000	107,176.28
VODAFONE GROUP PLC 3.75% 24/01/16	95,000	104,174.30
VODAFONE GROUP PLC 4.125% 25/05/30	325,000	369,500.31
VODAFONE GROUP PLC 4.375% 28/05/30	100,000	120,686.61

VORNADO REALTY LP 3.5% 25/01/15	100,000	100,356.64
VOYA FINANCIAL 3.65% 26/06/15	100,000	111,358.26
VULCAN MATERIALS CO 3.9% 27/04/01	20,000	22,041.04
VULCAN MATERIALS CO 4.5% 25/04/01	100,000	111,991.66
WABTEC 4.95% 28/09/15	150,000	168,560.18
WAL MART STORES INC 2.55% 23/04/11	200,000	211,100.72
WALGREEN CO 3.1% 22/09/15	150,000	157,389.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.2% 30/04/15	75,000	78,626.44
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.45% 26/06/01	150,000	163,847.64
WALMART INC 2.375% 29/09/24	90,000	99,351.96
WALMART INC 2.85% 24/07/08	60,000	65,102.69
WALMART INC 3.05% 26/07/08	65,000	73,402.55
WALMART INC 3.4% 23/06/26	200,000	216,851.96
WALMART INC 3.55% 25/06/26	100,000	113,478.26
WALMART INC 3.7% 28/06/26	200,000	239,743.73
WAL-MART STORES INC 2.65% 24/12/15	200,000	217,355.49
WALT DISNEY CO 3% 26/02/13	150,000	166,524.13
WALT DISNEY COMPANY/THE 1.65% 22/09/01	35,000	35,830.12
WALT DISNEY COMPANY/THE 1.75% 24/08/30	100,000	103,807.55
WALT DISNEY COMPANY/THE 1.75% 26/01/13	105,000	108,942.09
WALT DISNEY COMPANY/THE 2% 29/09/01	65,000	67,412.36
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.2% 28/01/13	70,000	74,005.96
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.35% 22/12/01	150,000	156,794.32
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.95% 27/06/15	100,000	111,972.29
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.35% 25/03/24	100,000	111,190.27
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.7% 24/09/15	100,000	111,241.96
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.8% 30/03/22	100,000	119,426.56
WASTE CONNECTIONS INC 3.5% 29/05/01	100,000	113,554.00
WASTE MANAGEMENT INC 2.9% 22/09/15	150,000	156,813.31
WASTE MANAGEMENT INC 2.95% 24/06/15	30,000	30,495.40
WASTE MANAGEMENT INC 3.2% 26/06/15	100,000	102,491.92
WASTE MANAGEMENT INC 3.45% 29/06/15	50,000	51,028.98
WEC ENERGY GROUP INC 3.1% 22/03/08	25,000	26,040.43
WELLS FARGO & CO 3% 26/04/22	500,000	547,072.59
WELLS FARGO & CO 3.55% 25/09/29	200,000	224,336.04
WELLS FARGO & COMPANY 1.654% 24/06/02	150,000	152,663.67
WELLS FARGO & COMPANY 2.164% 26/02/11	125,000	129,960.51
WELLS FARGO & COMPANY 2.188% 26/04/30	95,000	98,713.14
WELLS FARGO & COMPANY 2.393% 28/06/02	100,000	104,001.31
WELLS FARGO & COMPANY 2.406% 25/10/30	130,000	136,145.15
WELLS FARGO & COMPANY 2.572% 31/02/11	325,000	342,732.02
WELLS FARGO & COMPANY 2.879% 30/10/30	150,000	161,583.73
WELLS FARGO & COMPANY 3% 26/10/23	200,000	219,171.17
WELLS FARGO & COMPANY 3.196% 27/06/17	200,000	218,505.97
WELLS FARGO & COMPANY 3.45% 23/02/13	200,000	212,328.28
WELLS FARGO & COMPANY 3.584% 28/05/22	265,000	295,897.92
WELLS FARGO & COMPANY 3.75% 24/01/24	250,000	273,828.98
WELLS FARGO & COMPANY 4.1% 26/06/03	200,000	227,040.38

WELLS FARGO & COMPANY 4.125% 23/08/15	150,000	163,369.49
WELLS FARGO & COMPANY 4.15% 29/01/24	250,000	296,413.86
WELLS FARGO 3.069% 23/01/24	750,000	776,661.81
WELLS FARGO BANK NA 3.55% 23/08/14	250,000	271,270.39
WELLTOWER INC 2.7% 27/02/15	100,000	104,653.65
WELLTOWER INC 3.625% 24/03/15	130,000	139,118.93
WELLTOWER INC 4.25% 28/04/15	50,000	56,357.81
WESTERN UNION CO/THE 3.6% 22/03/15	50,000	52,042.10
WESTERN UNION CO/THE 4.25% 23/06/09	50,000	54,193.87
WESTLAKE CHEMICAL CORP 3.6% 26/08/15	150,000	161,069.68
WESTPAC BANKING 2.85% 26/05/13	150,000	165,920.30
WESTPAC BANKING CORP 2% 23/01/13	30,000	31,094.43
WESTPAC BANKING CORP 2.8% 22/01/11	450,000	465,867.50
WESTPAC BANKING CORP 3.35% 27/03/08	100,000	114,503.53
WESTPAC BANKING CORP 3.65% 23/05/15	100,000	108,511.18
WESTPAC BANKING CORP 4.11% 34/07/24	150,000	168,727.84
WESTPAC BANKING CORP 4.322% 31/11/23	100,000	111,877.26
WEYERHAEUSER CO 4% 29/11/15	100,000	114,346.83
WEYERHAEUSER CO 4% 30/04/15	100,000	114,452.08
WHIRLPOOL CORP 3.7% 25/05/01	100,000	109,603.50
WILLIAMS COMPANIES INC 4.55% 24/06/24	140,000	155,667.37
WILLIAMS PARTNERS LP 3.6% 22/03/15	100,000	103,626.98
WILLIAMS PARTNERS LP 4.3% 24/03/04	200,000	218,770.96
WILLIS NORTH AMERICA INC 3.6% 24/05/15	50,000	54,108.96
WILLIS NORTH AMERICA INC 4.5% 28/09/15	100,000	118,547.52
WISCONSIN PUBLIC SERVICE 3.35% 21/11/21	35,000	36,448.23
WP CAREY INC 4.6% 24/04/01	150,000	160,065.61
WPP FINANCE 2010 3.625% 22/09/07	150,000	156,405.90
WPP FINANCE 2010 3.75% 24/09/19	100,000	109,074.05
WRKCO INC 3.9% 28/06/01	100,000	112,601.93
WRKCO INC 4% 28/03/15	50,000	56,472.77
WRKCO INC 4.65% 26/03/15	150,000	174,596.30
WW GRAINGER INC 1.85% 25/02/15	50,000	52,823.83
WYETH 6.45% 24/02/01	100,000	120,175.53
XCEL ENERGY INC 4% 28/06/15	50,000	59,747.67
XLIT LTD 4.45% 25/03/31	50,000	55,818.42
XYLEM INC 3.25% 26/11/01	55,000	61,135.73
ZIMMER HOLDINGS INC 3.375% 21/11/30	100,000	102,927.26
ZIMMER HOLDINGS INC 3.55% 25/04/01	100,000	109,285.61
ZOETIS INC 2% 30/05/15	150,000	155,220.56
ZOETIS INC 3.25% 21/08/20	10,000	10,266.73
ZOETIS INC 3.9% 28/08/20	25,000	29,680.80
アメリカ・ドル 小計	214,246,591	232,699,394.05 (24,929,086,084)
社債券 小計		24,929,086,084 (24,929,086,084)
合計		24,929,086,084 (24,929,086,084)

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。  
2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
アメリカ・ドル	社債券 1,646銘柄	100.0%	100.0%

(注) 組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2020年7月31日現在)

資産総額	1,126,960,010円
負債総額	552,754,638円
純資産総額( - )	574,205,372円
発行済口数	600,903,274口
1口当たり純資産額( / )	0.9556円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（米国社債インデックス・マザーファンド）

(2020年7月31日現在)

資産総額	25,808,204,016円
負債総額	278,648,134円
純資産総額( - )	25,529,555,882円
発行済口数	13,044,647,671口
1口当たり純資産額( / )	1.9571円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間にける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

###### 2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

###### 3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2020年7月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、130本であり、その純資産総額は2,196,969百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## 1. 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資産の部)		%		%
流動資産				
預金	2,933,318		3,114,127	
有価証券	44,368		21,254	
前払金	42,741		39,342	
前払費用	15,949		9,920	
未収入金	500,748		902,862	
未収還付法人税等	2,367		-	
未収委託者報酬	617,227		660,964	
未収収益	122,922		40,244	
流動資産計	4,279,642	60.3	4,788,718	65.6
固定資産				
有形固定資産	84,968		69,492	
建物附属設備	66,820		59,016	
器具備品	18,147		10,475	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,732,068		2,445,819	
長期差入保証金	63,377		69,819	
繰延税金資産	2,662,416		2,369,725	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,817,037	39.7	2,515,312	34.4
資産合計	7,096,680	100.0	7,304,030	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金	134,522		137,851	
未払金	286,607		350,943	
未払手数料	123,825		140,557	
その他未払金	162,781		210,386	
未払費用	1,928		11,122	
未払法人税等	1,181		3,635	
未払消費税等	27,995		72,142	
賞与引当金	57,088		67,981	
流動負債計	509,323	7.2	643,675	8.8
固定負債				
退職給付引当金	67,644		96,989	
固定負債計	67,644	1.0	96,989	1.3
負債合計	576,968	8.1	740,665	10.1
(純資産の部)		%		%

株主資本		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,100,591			6,144,244		
純資産合計		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
負債・純資産合計		7,096,680	100.0		7,304,030	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日			当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
			%			%
営業収益						
委託者報酬		2,337,607		2,392,782		
投資顧問収入		2,367,856		2,907,674		
その他営業収益		17,873		66,452		
営業収益計		4,723,337	100.0	5,366,908	100.0	
営業費用						
支払手数料		502,719		520,256		
広告宣伝費		39,808		30,443		
公告費		1,140		1,140		
調査費		585,088		632,099		
調査費	353,007			369,545		
委託調査費	230,952			261,450		
図書費	1,129			1,102		
委託計算費		153,098		265,563		
営業雑経費		44,871		39,755		
通信費	4,783			4,801		
印刷費	9,076			15,648		
協会費	8,632			16,300		
諸会費	6,374			-		
その他	16,005			3,005		
営業費用計		1,326,726	28.1	1,489,258	27.7	
一般管理費						
給料		1,315,296		1,322,366		
役員報酬	211,622			197,080		
給料・手当	876,471			848,305		
賞与	192,102			253,121		
賞与引当金繰入額	35,098			23,858		
交際費		3,029		10,725		
旅費交通費		21,095		8,872		
租税公課		6,373		8,801		
不動産賃借料		104,671		97,021		
退職給付費用		79,897		106,349		
固定資産減価償却費		21,600		22,666		

福利厚生費		116,798			126,755	
事務手数料		773,947			1,057,318	
諸経費		190,123			186,258	
一般管理費計		2,632,834	55.7		2,947,135	54.9
営業利益		763,777	16.2		930,515	17.3
営業外収益						
為替差益		-			166	
有価証券運用益		1,711			3,384	
雑収入		50			63	
営業外収益計		1,762	0.0		3,614	0.1
営業外費用						
支払利息		-			-	
為替差損		46			289	
有価証券運用損		-			4,123	
雑損失		277			490	
営業外費用計		324	0.0		4,903	0.1
経常利益		765,215	16.2		929,225	17.3
特別利益						
事業再構築費用戻入		5,262			-	
特別利益計		5,262	0.1		-	0.0
特別損失						
事業再構築費用		6,296			102,351	
事務処理損失		714			-	
ゴルフ会員権売却損		2,800			-	
特別損失計		9,811	0.2		102,351	1.9
税引前当期純利益		760,665	16.1		826,874	15.4
法人税,住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		269,303	5.7		292,691	5.5
当期純利益		490,831	10.4		533,652	9.9

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	6,028,879
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期変動額合計	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			

当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(490,000)	(490,000)	(490,000)	(490,000)
当期純利益	-	-	-	533,652	533,652	533,652	533,652
当期変動額合計	-	-	-	43,652	43,652	43,652	43,652
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364

## [ 重要な会計方針 ]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備                      9～10年 器具備品                              3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。  (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (追加情報)

（新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の影響に関する仮定について）

新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の感染拡大やそれに伴う経済活動停滞による影響は今後1年程度続くものと想定し、当社が顧客から収受する投資顧問料等に一定の影響があるとの仮定を置いております。かかる仮定に基づいた今後の業績見通し及び将来収益力等を勘案し、「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」に基づき、繰延税金資産の回収可能性について慎重に検討し、繰延税金資産を計上しています。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 54,843千円 器具備品 38,003千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 68,147千円 器具備品 46,953千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

## （損益計算書関係）

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額17,341千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額773,947千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額65,925千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額1,057,318千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

該当ありません。

## 3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	利益剰余金	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

## 2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

## 3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	利益剰余金	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

2019年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	2,933,318	2,933,318	
(2) 未収入金	500,748	500,748	
(3) 未収委託者報酬	617,227	617,227	
(4) 預り金	134,522	134,522	
(5) 未払手数料	123,825	123,825	
(6) その他未払金	162,781	162,781	

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

## （1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## （2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## （注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

## （注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

2020年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

(1)預金	3,114,127	3,114,127	
(2)未収入金	902,862	902,862	
(3)未収委託者報酬	660,964	660,964	
(4)預り金	137,851	137,851	
(5)未払手数料	140,557	140,557	
(6)その他未払金	210,386	210,386	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (2) 未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

## (注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

## (有価証券関係)

前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 44,368千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,704千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 21,254千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 4,123千円

## (デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。	同左

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左

## 2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日

退職給付債務の期首残高	473,087
勤務費用	51,555
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	52,891
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
退職給付債務の期末残高	502,405

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2019年4月 1日
	至 2020年3月31日
退職給付債務の期首残高	502,405
勤務費用	57,391
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	53,802
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
退職給付債務の期末残高	420,524

## 3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度
	自 2018年4月 1日
	至 2019年3月31日
年金資産の期首残高	380,344
期待運用収益	2,814
数理計算上の差異の発生額	32,480
事業主からの拠出額	56,396
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
年金資産の期末残高	396,905

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2019年4月 1日
	至 2020年3月31日
年金資産の期首残高	396,905
期待運用収益	2,938
数理計算上の差異の発生額	28,742
事業主からの拠出額	54,241
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
年金資産の期末残高	339,872

## 4. 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度
	自 2018年4月 1日
	至 2019年3月31日

積立型制度の退職給付債務	502,405
年金資産	396,905
	<hr/>
	105,499
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	105,499
未認識数理計算上の差異	20,411
未認識過去勤務費用	17,443
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	67,644

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
積立型制度の退職給付債務	420,524
年金資産	339,872
	<hr/>
	80,651
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	80,651
未認識数理計算上の差異	25,059
未認識過去勤務費用	8,721
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	58,810
(1)勤務費用	51,555
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,814
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	1,347

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	86,784
(1)勤務費用	57,391
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,938
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,411

(6)その他	3,198
--------	-------

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（2019年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（2020年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.7%

その他 2.3%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## 7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2019年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2020年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

## 8．確定拠出制度

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,720千円であります。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,564千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
---------------------------------------	---------------------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
連結納税適用に伴う影響額	1,225,179	連結納税適用に伴う影響額	612,589
賞与引当金繰入超過額	14,373	賞与引当金繰入超過額	17,497
退職給付引当金	21,778	退職給付引当金	31,083
繰越欠損金	1,372,856	(注) 繰越欠損金	1,652,186
その他	28,228	その他	56,367
繰延税金資産 合計	2,662,416	繰延税金資産 合計	2,369,725
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	2,662,416	繰延税金資産の純額	2,369,725

(注) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856 (*2)

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,372,856千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,372,856千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186 (*2)

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,652,186千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,652,186千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度(2019年3月31日現在)	当事業年度(2020年3月31日現在)
---------------------	---------------------

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.3%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.1%
その他	0.5%	その他	0.3%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%
	=====		=====

## （資産除去債務関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

## （セグメント情報）

## 1.セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

## 2. セグメント関連情報

### 1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

### 2. 地域に関する情報

#### 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

#### 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

### 3. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

#### （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

#### （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

#### （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

#### （関連当事者情報）

##### 関連当事者との取引

#### (1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

#### (2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

前事業年度											
自 2018年4月 1日											
至 2019年3月31日											
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	229,260 164,709 135,677 17,341 773,947	前払金  未払金	8,051  30,899
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 人件費等の支払	35,235 159,558	前払金	34,689
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグリティ・キャピタル・マネジメント	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	16,146	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	531 19,937	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
---------------------------------------

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)		
						役員の 兼任等	事業上の関係						
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	309,576	前払金	694	
								ソフトウェアの使用契約	投資顧問料の支払	189,363			
								人件費等及び事務手数料の支払	人件費等の支払	129,383	未払金		18,808
								事務手数料の受取	事務手数料の支払	65,925			1,057,318
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	37,991	前払金	38,648	
								兼職社員の人件費支払等	人件費等の支払	138,065			
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	13,752	-	-	
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	526 22,050	-	-	

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

#### 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）  
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日		当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	
1株当たり純資産	1,051,566円42銭	1株当たり純資産	1,058,607円22銭
1株当たり当期純利益	79,166円44銭	1株当たり当期純利益	86,073円06銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
当期純利益（千円）	490,831	533,652
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	490,831	533,652
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

## (重要な後発事象)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。 ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

#### (1) 受託会社

名称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2020年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円 (2020年6月30日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (2020年7月27日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円 (2020年6月25日未現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200百万円 (2020年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

#### (3) 投資顧問会社（運用委託先）

名 称：ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー

資本金の額：991百万ドル（2019年12月末現在）

事業の内容：米国マサチューセッツ州法に基づき設立された信託銀行で、信託財産の管理業務、銀行業務および資産運用業務等を営んでいます。

## 独立監査人の監査報告書

2020年8月26日

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  
取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

榊原 康太

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリートUSボンド・オープン（為替ヘッジあり）の2020年1月11日から2020年7月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリートUSボンド・オープン（為替ヘッジあり）の2020年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

( ) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月29日

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  
取締役会 御中

### EY新日本 有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

伊藤雅人

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しておりません。