

【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】	2021年10月8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】	鈴木 愛
【電話番号】	03 - 4530 - 7385
【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、2021年4月9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】****3【投資リスク】**

<訂正前>

(1) ~ (3) <略>

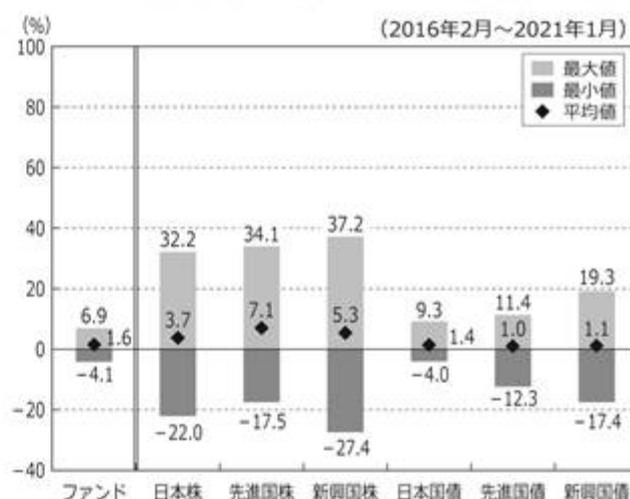
## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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エマーシング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマーシング・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。

＜訂正後＞

(1) ~ (3) <略>

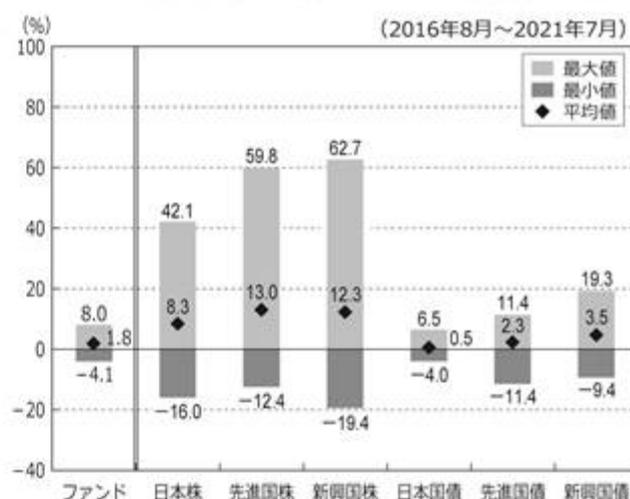
## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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<sup>®</sup>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。

※2022年4月以降、TOPIXの算出ルールは変更される予定です。

### 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。

#### 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、2021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、2021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】

(2021年7月30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	161,670,349	98.97
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,676,014	1.03
純資産総額		163,346,363	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)

(2021年7月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	557,499,262	2.88
	アメリカ	16,042,851,327	82.76
	イギリス	817,066,588	4.22
	カナダ	540,477,774	2.79
	オランダ	270,080,605	1.39
	ケイマン諸島	178,792,422	0.92
	オーストラリア	127,507,809	0.66
	スペイン	111,759,658	0.58
	フランス	95,694,349	0.49
	アイルランド	93,959,052	0.48
	スイス	68,346,589	0.35
	ドイツ	67,485,351	0.35
	バミューダ	59,807,903	0.31
	メキシコ	36,648,547	0.19
	ルクセンブルク	35,380,235	0.18
	シンガポール	26,151,670	0.13
	オーストリア	26,031,466	0.13
ガーンジー	18,628,858	0.10	
チリ	18,467,055	0.10	
	小計	19,192,636,520	99.01
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		191,548,721	0.99
純資産総額		19,384,185,241	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】

(2021年7月30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		77,276,588	2.0972	162,064,461	2.0921	161,670,349	98.97
投資比率：合計										98.97

(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	-	98.97
合計		98.97

（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）

（2021年7月30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	3.419	2027/12/20	783,000	11,994.41	93,916,232	12,025.99	94,163,513	0.49
2	アメリカ	社債券	CVS HEALTH CORP	4.300	2028/03/25	700,000	12,436.96	87,058,783	12,659.78	88,618,518	0.46
3	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.203	2028/07/23	700,000	12,527.88	87,695,216	12,602.02	88,214,181	0.46
4	アメリカ	社債券	ORACLE CORP	2.800	2027/04/01	700,000	11,710.54	81,973,830	11,697.53	81,882,777	0.42
5	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	3.750	2027/04/15	650,000	12,026.81	78,174,327	12,213.50	79,387,750	0.41
6	アメリカ	社債券	ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750	2029/01/23	550,000	12,741.35	70,077,432	13,134.99	72,242,468	0.37
7	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.005	2025/03/13	600,000	11,301.36	67,808,174	11,335.36	68,012,178	0.35
8	アメリカ	社債券	EXXON MOBIL CORPORATION	1.571	2023/04/15	600,000	11,224.91	67,349,488	11,186.10	67,116,646	0.35
9	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	4.450	2027/09/29	500,000	12,459.51	62,297,572	12,619.95	63,099,755	0.33
10	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.223	2028/05/01	500,000	12,417.75	62,088,751	12,571.92	62,859,619	0.32
11	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.875	2026/01/27	500,000	12,230.02	61,150,112	12,262.20	61,311,014	0.32
12	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.559	2026/04/23	500,000	12,054.91	60,274,559	12,045.84	60,229,229	0.31
13	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	2.099	2025/06/04	530,000	11,239.87	59,571,348	11,283.82	59,804,274	0.31
14	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.864	2023/07/23	500,000	11,795.55	58,977,767	11,649.13	58,245,692	0.30
15	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.625	2023/01/22	500,000	11,593.20	57,966,017	11,474.15	57,370,754	0.30
16	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	3.584	2027/05/22	465,000	11,983.65	55,724,004	12,143.20	56,465,917	0.29
17	アメリカ	社債券	BOEING CO	4.875	2025/05/01	445,000	12,218.61	54,372,822	12,266.59	54,586,334	0.28
18	アメリカ	社債券	APPLE INC	2.900	2027/09/12	450,000	11,914.47	53,615,147	11,985.46	53,934,584	0.28
19	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.125	2026/07/27	450,000	11,896.25	53,533,127	11,895.73	53,530,789	0.28
20	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.458	2024/03/15	450,000	11,799.70	53,098,684	11,680.89	52,564,028	0.27
21	アメリカ	社債券	IBM CORP	1.700	2027/05/15	470,000	11,005.89	51,727,695	11,181.99	52,555,375	0.27

22	イギリス	社債券	NATWEST GROUP PLC	4.892	2028/05/18	400,000	12,529.26	50,117,076	12,902.48	51,609,945	0.27
23	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.271	2028/07/23	400,000	12,505.41	50,021,645	12,603.31	50,413,253	0.26
24	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	1.678	2023/05/15	450,000	11,207.32	50,432,945	11,170.30	50,266,361	0.26
25	アメリカ	社債券	WALMART INC	3.700	2028/06/26	400,000	12,414.60	49,658,420	12,547.45	50,189,822	0.26
26	アメリカ	社債券	SABINE PASS LIQUEFACTION	4.200	2028/03/15	400,000	12,186.32	48,745,311	12,417.73	49,670,947	0.26
27	アメリカ	社債券	COMCAST CORP	4.150	2028/10/15	390,000	12,624.17	49,234,270	12,717.37	49,597,754	0.26
28	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.183	2027/11/25	400,000	12,336.11	49,344,444	12,326.58	49,306,341	0.25
29	アメリカ	社債券	BROADCOM INC	4.110	2028/09/15	369,000	12,078.58	44,569,964	12,335.35	45,517,457	0.23
30	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.182	2027/06/01	400,000	11,212.72	44,850,886	11,291.04	45,164,185	0.23
										投資比率：合計	9.45

(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) 2021年7月30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	-	99.01
合計		99.01

(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) 2021年7月30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】

2021年7月30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	分配付：	0.9846
		分配落：	152,141,425	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	分配付：	0.9873
		分配落：	156,743,048	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	分配付：	0.9996
		分配落：	143,972,424	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	分配付：	0.9993
		分配落：	176,078,133	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
第20特定期間	自2020年 7月11日 至2021年 1月12日	分配付： 185,631,240 分配落： 185,339,387	分配付： 0.9541 分配落： 0.9526
第21特定期間	自2021年 1月13日 至2021年 7月12日	分配付： 163,140,897 分配落： 162,881,979	分配付： 0.9451 分配落： 0.9436
	2020年 7月末日	574,205,372	0.9556
	8月末日	569,877,912	0.9525
	9月末日	568,408,900	0.9502
	10月末日	568,557,097	0.9488
	11月末日	568,327,453	0.9562
	12月末日	186,504,679	0.9588
	2021年 1月末日	185,080,146	0.9545
	2月末日	181,825,144	0.9416
	3月末日	168,929,336	0.9320
	4月末日	175,112,325	0.9370
	5月末日	179,761,115	0.9405
	6月末日	162,472,961	0.9419
	7月末日	163,346,363	0.9466

## 【分配の推移】

特定期間	計算期間	一口当たりの分配金
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
第20特定期間	自2020年 7月11日 至2021年 1月12日	0.0090円
第21特定期間	自2021年 1月13日 至2021年 7月12日	0.0090円

## 【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率
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%
第20特定期間	自2020年 7月11日 至2021年 1月12日	1.4%
第21特定期間	自2021年 1月13日 至2021年 7月12日	0.0%

（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
第20特定期間	自2020年 7月11日 至2021年 1月12日	19,664,816	426,092,706	194,568,964
第21特定期間	自2021年 1月13日 至2021年 7月12日	29,941,627	51,898,031	172,612,560

（注）日本国外における設定、解約はありません。

## (参考情報) 運用実績

(2021年7月30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	9,466円
純資産総額	163百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第119期 (2021年2月10日)	15円
第120期 (2021年3月10日)	15円
第121期 (2021年4月12日)	15円
第122期 (2021年5月10日)	15円
第123期 (2021年6月10日)	15円
第124期 (2021年7月12日)	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	2,790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<sup>※</sup>

銘柄名	利率	償還日	投資比率
BANK OF AMERICA CORP	3.419%	2027/12/20	0.49%
CVS HEALTH CORP	4.300%	2028/03/25	0.46%
JPMORGAN CHASE & CO	4.203%	2028/07/23	0.46%
ORACLE CORP	2.800%	2027/04/01	0.42%
T-MOBILE USA INC	3.750%	2027/04/15	0.41%
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750%	2029/01/23	0.37%
JPMORGAN CHASE & CO	2.005%	2025/03/13	0.35%
EXXON MOBIL CORPORATION	1.571%	2023/04/15	0.35%
CITIGROUP INC	4.450%	2027/09/29	0.33%
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.223%	2028/05/01	0.32%

※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<sup>※</sup>

セクター	ファンド	ベンチマーク	差
公益	5.91%	5.91%	0.00%
金融	39.07%	38.92%	0.15%
産業	54.80%	55.17%	-0.37%
その他	0.00%	0.00%	0.00%

格付別構成比<sup>※</sup>

格付	ファンド	ベンチマーク	差
AAA格	0.80%	0.88%	-0.08%
AA格	6.56%	6.97%	-0.41%
A格	41.18%	41.05%	0.13%
BBB格	51.22%	51.11%	0.11%
BB格以下	0.03%	0.00%	0.03%

残存年数別構成比<sup>※</sup>

残存年数	ファンド	ベンチマーク	差
1年未満	0.00%	0.98%	-0.98%
1～3年	27.22%	25.25%	1.97%
3～7年	47.93%	47.66%	0.27%
7～10年	24.53%	26.11%	-1.57%
10年以上	0.09%	0.00%	0.09%

※ファンドの比率はマザーファンド純資産総額対比です。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2021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(2021年1月13日から2021年7月12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 (2021年 1月12日現在)	当期 (2021年 7月12日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	275	186
コール・ローン	220,707	158,045
親投資信託受益証券	186,354,536	162,108,488
派生商品評価勘定	3,651	621,083
未収入金	329,013	399,525
流動資産合計	186,908,182	163,287,327
<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	923,807	24,266
未払収益分配金	291,853	258,918
未払解約金	195,540	15,893
未払受託者報酬	9,699	6,540
未払委託者報酬	145,478	98,105
その他未払費用	2,418	1,626
流動負債合計	1,568,795	405,348
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 194,568,964	1 172,612,560
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3 9,229,577	3 9,730,581
(分配準備積立金)	6,211,000	5,367,955
元本等合計	185,339,387	162,881,979
<b>純資産合計</b>		
負債純資産合計	186,908,182	163,287,327

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期	当期
	自 2020年 7月11日 至 2021年 1月12日	自 2021年 1月13日 至 2021年 7月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,207,985	10,986,657
為替差損益	14,918,365	10,650,220
営業収益合計	8,710,380	336,437
営業費用		
支払利息	197	55
受託者報酬	114,889	38,484
委託者報酬	1 1,723,221	1 577,217
その他費用	34,608	9,555
営業費用合計	1,872,915	625,311
営業利益又は営業損失( )	6,837,465	288,874
経常利益又は経常損失( )	6,837,465	288,874
当期純利益又は当期純損失( )	6,837,465	288,874
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( )	624,597	274,230
期首剰余金又は期首欠損金( )	30,759,523	9,229,577
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,006,888	2,935,502
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,006,888	2,935,502
剰余金減少額又は欠損金増加額	910,723	1,756,918
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	910,723	1,756,918
分配金	2 4,779,087	2 1,664,944
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,229,577	9,730,581

## (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。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 2021年7月10日が休日のため、当特定期間は2021年1月13日から2021年7月12日までとなっております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 (2021年 1月12日現在)	当期 (2021年 7月12日現在)
1 期首元本額	600,996,854円	194,568,964円
期中追加設定元本額	19,664,816円	29,941,627円
期中一部解約元本額	426,092,706円	51,898,031円
2 受益権の総数	194,568,964口	172,612,560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9,229,577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9,730,581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 2020年 7月11日 至 2021年 1月12日	当期 自 2021年 1月13日 至 2021年 7月12日
-----	--------------------------------------	--------------------------------------

<p>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</p>	<p>純資産総額に対して年率0.11%の額</p>	<p>同左</p>
<p>2 分配金の計算過程</p>	<p>(2020年7月11日から2020年8月11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(1,329,677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(44,776,071円)及び分配準備積立金(15,284,000円)より分配対象収益は61,389,748円(1万口当たり1,020円)であり、うち902,429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8月12日から2020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(1,127,146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(44,724,495円)及び分配準備積立金(15,558,530円)より分配対象収益は61,410,171円(1万口当たり1,024円)であり、うち898,998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9月11日から2020年10月12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(1,034,351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(44,763,980円)及び分配準備積立金(15,714,062円)より分配対象収益は61,512,393円(1万口当たり1,027円)であり、うち898,292円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2021年1月13日から2021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(351,498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(14,937,097円)及び分配準備積立金(6,085,072円)より分配対象収益は21,373,667円(1万口当たり1,095円)であり、うち292,604円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2021年2月11日から2021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(382,529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(13,918,729円)及び分配準備積立金(5,647,204円)より分配対象収益は19,948,462円(1万口当たり1,104円)であり、うち271,011円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2021年3月11日から2021年4月12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(388,071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(14,149,961円)及び分配準備積立金(5,637,095円)より分配対象収益は20,175,127円(1万口当たり1,111円)であり、うち272,235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10月13日から2020年11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（1,071,770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（44,658,130円）及び分配準備積立金（15,719,567円）より分配対象収益は61,449,467円（1万口当たり1,030円）であり、うち894,551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11月11日から2020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（1,238,219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（44,667,554円）及び分配準備積立金（15,795,791円）より分配対象収益は61,701,564円（1万口当たり1,036円）であり、うち892,964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12月11日から2021年1月12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（295,342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（14,740,105円）及び分配準備積立金（6,207,511円）より分配対象収益は21,242,958円（1万口当たり1,091円）であり、うち291,853円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>（2021年4月13日から2021年5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（454,401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（15,131,454円）及び分配準備積立金（5,701,409円）より分配対象収益は21,287,264円（1万口当たり1,121円）であり、うち284,594円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（2021年5月11日から2021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（415,938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（15,285,992円）及び分配準備積立金（5,808,189円）より分配対象収益は21,510,119円（1万口当たり1,129円）であり、うち285,582円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（2021年6月11日から2021年7月12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（329,594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（14,011,956円）及び分配準備積立金（5,297,279円）より分配対象収益は19,638,829円（1万口当たり1,137円）であり、うち258,918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 (2021年 1月12日現在)	当期 (2021年 7月12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 (2021年 1月12日現在)	当 期 (2021年 7月12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	179,459	1,375,895
合 計	179,459	1,375,895

## (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 (2021年 1月12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	308,949		312,600	3,651
	売建 アメリカ・ドル	186,339,518		187,263,325	923,807
	合 計	186,648,467		187,575,925	920,156

(単位：円)

区 分	種 類	当 期 (2021年 7月12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	3,768,163		3,744,768	23,395
	売建 アメリカ・ドル	165,847,494		165,227,282	620,212
	合 計	169,615,657		168,972,050	596,817

(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 ( 2021年 1月12日現在 )	当期 ( 2021年 7月12日現在 )
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	0.9526円 ( 9,526円 )	0.9436円 ( 9,436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	77,297,582	162,108,488	
合計		77,297,582	162,108,488	

( 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	(2021年 1月12日現在)	(2021年 7月12日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		622,208,728	72,445,290
金銭信託		27,640	64,126
コール・ローン		22,169,587	54,367,496
社債券		28,346,063,258	20,156,205,286
派生商品評価勘定			320
未収利息		215,863,036	165,927,178
前払費用		13,762,656	1,146,870
流動資産合計		29,220,094,905	20,450,156,566
資産合計		29,220,094,905	20,450,156,566
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		129,789	16,311
未払金		560,366,683	44,574,666
未払解約金		14,247,013	9,817,525
未払利息		60	145
その他未払費用			2
流動負債合計		574,743,545	54,408,649
負債合計		574,743,545	54,408,649
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,525,295,874	9,725,238,475
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,120,055,486	10,670,509,442
元本等合計		28,645,351,360	20,395,747,917
純資産合計		28,645,351,360	20,395,747,917
負債純資産合計		29,220,094,905	20,450,156,566

(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	<p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
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>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2021年 1月12日現在）	（2021年 7月12日現在）
1 期首元本額	12,666,470,993円	14,525,295,874円
期中追加設定元本額	3,740,827,995円	868,533,969円
期中一部解約元本額	1,882,003,114円	5,668,591,368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＞	9,086,114,151円	5,584,790,178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）	94,495,480円	77,297,582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＞	209,221,861円	288,706,443円
ステート・ストリート米国社債インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,799,258,183円	1,427,099,224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	290,994,084円	197,291,892円
米国社債インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）＜適格機関投資家限定＞	2,045,212,115円	2,150,053,156円
計	14,525,295,874円	9,725,238,475円
2 受益権の総数	14,525,295,874口	9,725,238,475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	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「（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	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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2021年 1月12日現在）	（2021年 7月12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</p> <p>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>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>同左</p>

<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>	<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>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>	<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> <p>同左</p>
----------------------------------	---	---

## (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	(2021年 1月12日現在)	(2021年 7月12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	364,956,755	94,877,771
合計	364,956,755	94,877,771

(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期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	(2021年 1月12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	2,900,000		2,899,957	43
	売建				
	アメリカ・ドル	11,000,000		11,129,746	129,746
	合 計	13,900,000		14,029,703	129,789

（単位：円）

区 分	種 類	（2021年 7月12日現在）		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,900,000	1,900,320	320
	売建 アメリカ・ドル	6,000,000	6,016,311	16,311
合 計		7,900,000	7,916,631	15,991

## (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 )

	（2021年 1月12日現在）	（2021年 7月12日現在）
1口当たり純資産額	1.9721円	2.0972円
（1万口当たり純資産額）	（19,721円）	（20,972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 3% 25/08/07	150,000	162,917.95	
		3M COMPANY 2% 25/02/14	100,000	104,450.61	
		3M COMPANY 3.05% 30/04/15	100,000	110,359.56	
		ABBOTT LABORATORIES 3.75% 26/11/30	100,000	113,043.08	
		ABBVIE 3.2% 26/05/14	200,000	217,112.06	
		ABBVIE INC 2.3% 22/11/21	395,000	405,179.15	
		ABBVIE INC 2.95% 26/11/21	145,000	156,097.15	
		ABBVIE INC 3.25% 22/10/01	250,000	256,846.71	
		ABBVIE INC 3.6% 25/05/14	100,000	109,097.91	
		ABBVIE INC 3.8% 25/03/15	300,000	328,159.17	
		ABBVIE INC 4.25% 28/11/14	200,000	232,082.08	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 2.875% 24/08/14	150,000	157,022.89	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.15% 24/02/15	150,000	157,591.82	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.65% 27/07/21	150,000	160,354.15	
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.875% 24/01/16	150,000	163,394.89	
		AFFILIATED MANAGERS GROU 3.3% 30/06/15	70,000	75,946.31	
		AFLAC INC 1.125% 26/03/15	40,000	40,059.19	
		AFLAC INC 2.875% 26/10/15	50,000	53,890.12	
		AFLAC INC 3.6% 30/04/01	65,000	73,522.51	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.1% 30/06/04	60,000	59,671.67	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.3% 31/03/12	100,000	100,481.35	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC 3.05% 26/09/22	65,000	70,337.23	
		AGREE LP 2% 28/06/15	65,000	64,866.34	
		AIR LEASE CORP 2.3% 25/02/01	150,000	155,188.87	
		AIR LEASE CORP 2.75% 23/01/15	250,000	257,768.89	
		AIR LEASE CORP 3.125% 30/12/01	100,000	102,221.84	
		AIR LEASE CORP 3.625% 27/12/01	150,000	161,639.68	
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS 2.05% 30/05/15	35,000	35,810.63	
		AIRCASTLE LTD 4.125% 24/05/01	50,000	53,459.76	
		AIRCASTLE LTD 4.25% 26/06/15	65,000	70,866.54	
		AIRCASTLE LTD 5% 23/04/01	50,000	53,465.25	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E 3.95% 28/01/15	100,000	113,780.70	
		ALIBABA GROUP HOLDING 3.4% 27/12/06	200,000	219,102.81	
		ALIBABA GROUP HOLDING 3.6% 24/11/28	100,000	108,477.37	
		ALLEGION US HOLDING CO 3.2% 24/10/01	50,000	53,219.66	
		ALLEGION US HOLDING CO 3.55% 27/10/01	50,000	54,610.61	
		ALLIED WORLD ASSURANCE 4.35% 25/10/29	50,000	54,955.17	
		ALLSTATE CORP 3.15% 23/06/15	100,000	105,174.92	
		ALLSTATE CORP 5.75% 53/08/15	100,000	108,980.00	
		ALLY FINANCIAL INC 3.875% 24/05/21	250,000	269,890.80	
		ALPHABET INC 0.8% 27/08/15	150,000	146,538.92	
		ALPHABET INC 1.1% 30/08/15	130,000	124,073.77	
ALTRIA GROUP INC 3.4% 30/05/06	25,000	26,589.45			
ALTRIA GROUP INC 4.4% 26/02/14	156,000	177,123.73			
ALTRIA GROUP INC 4.8% 29/02/14	150,000	174,489.67			
AMAZON COM INC 5.2% 25/12/03	50,000	58,693.75			
AMAZON.COM INC 0.25% 23/05/12	40,000	39,972.86			
AMAZON.COM INC 0.45% 24/05/12	45,000	44,891.93			

AMAZON.COM INC 1% 26/05/12	100,000	100,297.04	
AMAZON.COM INC 1.2% 27/06/03	200,000	200,013.64	
AMAZON.COM INC 1.65% 28/05/12	300,000	303,745.83	
AMAZON.COM INC 2.1% 31/05/12	100,000	102,501.92	
AMAZON.COM INC 2.4% 23/02/22	250,000	258,044.04	
AMAZON.COM INC 3.15% 27/08/22	100,000	110,577.36	
AMCOR FLEXIBLES NORTH AM 2.69% 31/05/25	65,000	66,722.42	
AMEREN CORP 3.65% 26/02/15	100,000	109,636.36	
AMEREN ILLINOIS CO 2.7% 22/09/01	100,000	102,120.51	
AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.875% 30/05/07	200,000	210,682.73	
AMERICAN CAMPUS CMNTYS 2.85% 30/02/01	100,000	103,522.39	
AMERICAN ELECTRIC POWER 0.75% 23/11/01	20,000	20,011.27	
AMERICAN EXPRESS CO 3% 24/10/30	100,000	107,365.28	
AMERICAN EXPRESS CO 3.625% 24/12/05	350,000	383,274.06	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 3.5% 26/08/15	50,000	54,512.92	
AMERICAN HONDA FINANCE 0.65% 23/09/08	100,000	100,436.14	
AMERICAN HONDA FINANCE 0.875% 23/07/07	65,000	65,543.55	
AMERICAN HONDA FINANCE 1.95% 23/05/10	100,000	102,874.31	
AMERICAN HONDA FINANCE 2.9% 24/02/16	200,000	211,532.29	
AMERICAN HONDA FINANCE 3.5% 28/02/15	100,000	112,571.30	
AMERICAN HONDA FINANCE 3.625% 23/10/10	75,000	80,309.17	
AMERICAN INTL GROUP 2.5% 25/06/30	100,000	105,615.89	
AMERICAN INTL GROUP 3.4% 30/06/30	200,000	220,267.83	
AMERICAN INTL GROUP 4.2% 28/04/01	75,000	86,299.19	
AMERICAN INTL GROUP 5.75% 48/04/01	100,000	112,929.19	
AMERICAN TOWER CORP 1.5% 28/01/31	100,000	97,961.75	
AMERICAN TOWER CORP 2.7% 31/04/15	100,000	103,600.54	
AMERICAN TOWER CORP 2.9% 30/01/15	50,000	52,625.58	
AMERICAN TOWER CORP 3% 23/06/15	150,000	157,013.45	
AMERICAN TOWER CORP 3.95% 29/03/15	300,000	339,033.47	
AMERICAN TOWER CORP 5% 24/02/15	100,000	110,937.27	
AMERICAN WATER CAPITAL 3.4% 25/03/01	100,000	108,888.57	
AMERICAN WATER CAPITAL 3.75% 28/09/01	100,000	113,627.07	
AMERICAN WATER CAPITAL C 2.3% 31/06/01	50,000	51,189.75	
AMERIPRISE FINANCIAL INC 4% 23/10/15	150,000	162,126.90	
AMERISOURCEBERGEN CORP 0.737% 23/03/15	100,000	100,179.32	
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 30/05/15	100,000	104,670.94	
AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45% 27/12/15	100,000	109,512.91	
AMGEN INC 1.9% 25/02/21	65,000	67,394.64	
AMGEN INC 2.2% 27/02/21	170,000	176,945.71	
AMGEN INC 2.25% 23/08/19	100,000	103,492.97	
AMPHENOL CORP 2.05% 25/03/01	100,000	103,972.53	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% 29/01/23	750,000	895,485.40	
ANTHEM INC 0.45% 23/03/15	200,000	200,117.81	
ANTHEM INC 2.25% 30/05/15	135,000	137,128.24	
ANTHEM INC 2.95% 22/12/01	100,000	103,313.07	
ANTHEM INC 3.65% 27/12/01	100,000	112,184.00	
AON CORP 2.8% 30/05/15	200,000	211,563.33	

APPALACHIAN POWER CO 3.3% 27/06/01	100,000	109,040.36	
APPLE INC 1.65% 31/02/08	200,000	197,657.97	
APPLE INC 1.7% 22/09/11	60,000	61,023.48	
APPLE INC 1.8% 24/09/11	100,000	103,725.20	
APPLE INC 2.1% 22/09/12	150,000	153,111.58	
APPLE INC 2.4% 23/01/13	100,000	103,058.56	
APPLE INC 2.4% 23/05/03	100,000	103,689.34	
APPLE INC 2.5% 25/02/09	100,000	106,113.00	
APPLE INC 2.9% 27/09/12	450,000	492,613.49	
APPLE INC 3% 24/02/09	150,000	159,328.94	
APPLE INC 3% 27/11/13	200,000	219,846.00	
APPLE INC 3.2% 27/05/11	212,000	234,136.22	
APPLE INC 3.35% 27/02/09	350,000	389,247.00	
APPLE INC 3.45% 24/05/06	100,000	108,192.69	
APPLIED MATERIALS INC 1.75% 30/06/01	130,000	128,917.85	
ARES CAPITAL CORP 2.875% 28/06/15	200,000	204,010.00	
ARES CAPITAL CORP 3.875% 26/01/15	100,000	107,610.80	
ARIZONA PUBLIC SERVICE 2.95% 27/09/15	100,000	108,724.78	
ASSURANT INC 2.65% 32/01/15	100,000	100,303.48	
ASTRAZENECA PLC 1.375% 30/08/06	200,000	190,469.38	
ASTRAZENECA PLC 3.375% 25/11/16	150,000	164,772.67	
AT&T INC 0.9% 24/03/25	100,000	100,212.72	
AT&T INC 1.7% 26/03/25	200,000	202,496.24	
AT&T INC 2.625% 22/12/01	100,000	102,531.27	
AT&T INC 4.1% 28/02/15	200,000	229,002.72	
AT&T INC 4.25% 27/03/01	100,000	113,774.03	
AT&T INC 4.35% 29/03/01	320,000	371,400.12	
AT&T INC 4.45% 24/04/01	200,000	218,334.48	
ATHENE HOLDING LTD 4.125% 28/01/12	150,000	167,144.39	
ATMOS ENERGY CORP 3% 27/06/15	65,000	70,592.57	
AUTODESK INC 4.375% 25/06/15	100,000	112,021.98	
AUTOMATIC DATA PROCESSNG 1.7% 28/05/15	160,000	161,886.86	
AUTONATION INC 3.5% 24/11/15	100,000	107,319.57	
AUTONATION INC 4.5% 25/10/01	20,000	22,218.45	
AUTOZONE INC 3.25% 25/04/15	110,000	118,494.23	
AUTOZONE INC 4% 30/04/15	200,000	228,453.09	
AVALONBAY COMMUNITIES 3.3% 29/06/01	65,000	71,373.32	
AVALONBAY COMMUNITIES IN 2.9% 26/10/15	50,000	53,836.11	
AVANGRID INC 3.8% 29/06/01	75,000	85,138.43	
AVERY DENNISON CORP 4.875% 28/12/06	100,000	120,021.87	
AVNET INC 3% 31/05/15	100,000	100,113.95	
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 3.9% 23/04/20	65,000	68,687.40	
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 4.35% 28/04/20	100,000	115,003.25	
AXIS SPECIALTY FINAN PLC 4% 27/12/06	100,000	111,261.54	
BAIDU INC 3.625% 27/07/06	200,000	221,334.40	
BAIDU INC 3.875% 23/09/29	200,000	212,710.16	
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL 3.337% 27/12/15	150,000	164,637.76	
BALTIMORE GAS & ELECTRIC 2.25% 31/06/15	200,000	203,902.75	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 1.125% 25/09/18	100,000	99,698.33	
BANCO SANTANDER 0.701% 24/06/30	200,000	200,528.15	
BANCO SANTANDER SA 2.746% 25/05/28	200,000	211,100.25	
BANCO SANTANDER SA 3.125% 23/02/23	200,000	208,203.33	
BANCO SANTANDER SA 3.8% 28/02/23	100,000	111,314.14	
BANK OF AMERICA CORP 0.523% 24/06/14	200,000	199,908.80	
BANK OF AMERICA CORP 0.976% 25/04/22	150,000	150,642.32	
BANK OF AMERICA CORP 1.658% 27/03/11	100,000	101,057.75	
BANK OF AMERICA CORP 1.734% 27/07/22	150,000	151,591.93	
BANK OF AMERICA CORP 1.898% 31/07/23	200,000	195,169.07	
BANK OF AMERICA CORP 2.087% 29/06/14	200,000	202,322.00	
BANK OF AMERICA CORP 2.496% 31/02/13	150,000	153,809.90	
BANK OF AMERICA CORP 2.592% 31/04/29	95,000	98,301.82	
BANK OF AMERICA CORP 2.651% 32/03/11	100,000	103,035.13	
BANK OF AMERICA CORP 2.687% 32/04/22	150,000	154,964.98	
BANK OF AMERICA CORP 2.816% 23/07/21	100,000	102,453.12	
BANK OF AMERICA CORP 3.004% 23/12/20	227,000	235,174.45	
BANK OF AMERICA CORP 3.194% 30/07/23	150,000	161,921.21	
BANK OF AMERICA CORP 3.419% 28/12/20	783,000	857,658.94	
BANK OF AMERICA CORP 3.458% 25/03/15	450,000	480,774.84	
BANK OF AMERICA CORP 3.559% 27/04/23	500,000	547,319.20	
BANK OF AMERICA CORP 3.593% 28/07/21	150,000	165,647.60	
BANK OF AMERICA CORP 3.864% 24/07/23	500,000	532,311.33	
BANK OF AMERICA CORP 3.974% 30/02/07	250,000	283,595.13	
BANK OF AMERICA CORP 4% 25/01/22	100,000	109,961.72	
BANK OF AMERICA CORP 4.183% 27/11/25	400,000	449,029.31	
BANK OF AMERICA CORP 4.271% 29/07/23	400,000	459,441.26	
BANK OF MONTREAL 0.625% 24/07/09	70,000	69,834.68	
BANK OF MONTREAL 1.85% 25/05/01	200,000	207,242.00	
BANK OF MONTREAL 2.35% 22/09/11	100,000	102,482.80	
BANK OF MONTREAL 3.3% 24/02/05	150,000	160,458.61	
BANK OF NEW YORK MELLON 2.2% 23/08/16	300,000	310,656.84	
BANK OF NEW YORK MELLON 3.25% 24/09/11	100,000	108,098.90	
BANK OF NOVA SCO 1.35% 26/06/24	200,000	200,621.37	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.55% 23/09/15	100,000	100,191.76	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.7% 24/04/15	250,000	250,497.30	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2% 25/02/03	100,000	104,615.78	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.375% 23/01/18	50,000	51,593.80	
BANK OF NY MELLON CORP 0.5% 24/04/26	150,000	150,104.42	
BANK OF NY MELLON CORP 1.65% 28/07/14	100,000	100,872.28	
BANK OF NY MELLON CORP 2.8% 26/05/04	100,000	108,092.19	
BANK OF NY MELLON CORP 3.4% 28/01/29	100,000	111,886.33	
BANK OF NY MELLON CORP 3.442% 28/02/07	100,000	110,470.75	
BANKUINTEG INC 5.125% 30/06/11	100,000	117,745.05	
BARCLAYS PLC 1.007% 24/12/10	200,000	200,798.52	
BARCLAYS PLC 3.684% 23/01/10	250,000	254,024.40	
BARCLAYS PLC 4.972% 29/05/16	200,000	234,865.03	
BARCLAYS PLC 5.088% 30/06/20	300,000	351,113.88	

BARCLAYS PLC 5.2% 26/05/12	200,000	230,152.00	
BAT CAPITAL CORP 2.259% 28/03/25	150,000	149,895.00	
BAT CAPITAL CORP 2.789% 24/09/06	70,000	73,559.26	
BAT CAPITAL CORP 3.215% 26/09/06	100,000	106,539.61	
BAT CAPITAL CORP 3.557% 27/08/15	100,000	107,461.46	
BAT CAPITAL CORP 4.906% 30/04/02	100,000	114,972.05	
BAXALTA INC 4% 25/06/23	30,000	33,193.71	
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.95% 30/04/01	100,000	115,357.12	
BECTON DICKINSON AND CO 1.957% 31/02/11	65,000	63,724.23	
BECTON DICKINSON AND CO 3.363% 24/06/06	200,000	214,318.26	
BEMIS COMPANY INC 2.63% 30/06/19	100,000	103,227.86	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 2.8% 23/01/15	165,000	170,626.33	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 3.25% 28/04/15	100,000	110,256.90	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 3.75% 23/11/15	100,000	106,719.31	
BERKSHIRE HATHAWAY FIN 1.45% 30/10/15	80,000	78,853.62	
BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.125% 26/03/15	200,000	218,847.83	
BERRY GLOBAL INC 1.57% 26/01/15	100,000	100,487.00	
BEST BUY CO INC 4.45% 28/10/01	100,000	116,412.62	
BIOGEN INC 2.25% 30/05/01	35,000	35,021.50	
BIOGEN INC 3.625% 22/09/15	55,000	57,067.46	
BIOGEN INC 4.05% 25/09/15	100,000	111,374.18	
BLACK HILLS CORP 3.05% 29/10/15	50,000	53,758.06	
BLACK HILLS CORP 3.95% 26/01/15	50,000	55,213.35	
BLACKROCK INC 3.2% 27/03/15	100,000	110,942.80	
BLACKROCK INC 3.25% 29/04/30	60,000	67,366.18	
BLACKROCK INC 3.5% 24/03/18	100,000	108,165.32	
BLOCK FINANCIAL 2.5% 28/07/15	45,000	45,598.83	
BLOCK FINANCIAL LLC 5.5% 22/11/01	100,000	103,753.26	
BOARDWALK PIPELINES LP 4.45% 27/07/15	100,000	113,419.10	
BOARDWALK PIPELINES LP 4.8% 29/05/03	20,000	22,984.03	
BOEING CO 1.875% 23/06/15	250,000	254,864.38	
BOEING CO 2.196% 26/02/04	300,000	302,927.98	
BOEING CO 2.7% 27/02/01	145,000	150,098.05	
BOEING CO 3.25% 28/02/01	50,000	53,188.07	
BOEING CO 4.875% 25/05/01	445,000	498,804.17	
BOEING CO 4.95% 28/09/15	100,000	115,616.88	
BOEING CO 5.15% 30/05/01	250,000	297,168.50	
BORGWARNER INC 2.65% 27/07/01	50,000	53,273.05	
BOSTON PROPERTIES INC 3.4% 29/06/21	100,000	109,259.57	
BOSTON PROPERTIES LP 3.2% 25/01/15	50,000	53,527.58	
BOSTON PROPERTIES LP 3.65% 26/02/01	150,000	165,808.85	
BOSTON SCIENTIFIC CORP 2.65% 30/06/01	100,000	103,635.58	
BOSTON SCIENTIFIC CORP 3.75% 26/03/01	100,000	111,256.00	
BP CAP MARKETS AMERICA 2.937% 23/04/06	100,000	104,276.88	
BP CAP MARKETS AMERICA 3.194% 25/04/06	100,000	107,917.00	
BP CAP MARKETS AMERICA 3.937% 28/09/21	200,000	228,556.41	
BP CAP MARKETS AMERICA 4.234% 28/11/06	400,000	465,036.67	
BP CAPITAL MARKETS PLC 2.75% 23/05/10	200,000	208,180.36	

BP CAPITAL MARKETS PLC 3.814% 24/02/10	100,000	108,208.41	
BPCE SA 4% 24/04/15	250,000	272,717.66	
BRANDYWINE OPER PARTNERS 3.95% 23/02/15	100,000	104,198.31	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 3.7% 27/06/22	150,000	164,359.70	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 1.45% 30/11/13	30,000	29,050.77	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.75% 23/02/15	100,000	103,593.85	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.9% 24/07/26	64,000	68,348.32	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 23/02/20	144,000	150,323.88	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 23/11/01	100,000	106,394.54	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 27/02/27	100,000	111,138.82	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.45% 27/11/15	150,000	168,046.76	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.625% 24/05/15	100,000	107,870.93	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.875% 25/08/15	48,000	53,395.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9% 28/02/20	150,000	171,992.98	
BRITISH TELECOMMUNICATIO 5.125% 28/12/04	200,000	237,941.40	
BRIXMOR OPERATING PART 3.65% 24/06/15	100,000	107,593.82	
BRIXMOR OPERATING PART 4.05% 30/07/01	100,000	113,000.81	
BROADCOM CRP / CAYMN FI 3.5% 28/01/15	150,000	164,324.99	
BROADCOM INC 1.95% 28/02/15	80,000	80,389.98	
BROADCOM INC 2.45% 31/02/15	350,000	346,510.12	
BROADCOM INC 4.11% 28/09/15	369,000	415,095.10	
BROADCOM INC 4.75% 29/04/15	350,000	407,692.47	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLU 3.4% 26/06/27	100,000	110,144.15	
BROADRIDGE FINANCIAL SOL 2.6% 31/05/01	100,000	102,753.28	
BROOKFIELD FINANCE INC 4% 24/04/01	150,000	162,191.15	
BUNGE LTD FINANCE CORP 2.75% 31/05/14	100,000	101,647.93	
BUNGE LTD FINANCE CORP 3% 22/09/25	55,000	56,445.39	
BUNGE LTD FINANCE CORP 3.75% 27/09/25	55,000	60,759.28	
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3% 23/03/15	150,000	156,055.78	
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.25% 27/06/15	100,000	110,684.95	
CABOT CORP 3.7% 22/07/15	50,000	51,390.24	
CAMDEN PROPERTY TRUST 4.1% 28/10/15	45,000	52,020.22	
CAMPBELL SOUP CO 2.5% 22/08/02	100,000	102,250.27	
CAMPBELL SOUP CO 3.95% 25/03/15	100,000	110,303.65	
CANADIAN IMPERIAL BANK 0.95% 23/06/23	100,000	100,835.10	
CANADIAN IMPERIAL BANK 1.25% 26/06/22	100,000	99,808.33	
CANADIAN IMPERIAL BANK 2.606% 23/07/22	100,000	102,219.64	
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.1% 24/04/02	100,000	106,444.94	
CANADIAN NATIONAL RAILWA 2.75% 26/03/01	50,000	53,792.83	
CANADIAN NATL RESOURCES 2.95% 23/01/15	100,000	103,548.33	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05% 30/03/05	155,000	155,084.36	
CAPITAL ONE FINANCIAL 3.75% 26/07/28	150,000	166,261.27	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.2% 25/02/05	150,000	161,607.53	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.5% 23/06/15	150,000	158,452.99	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.65% 27/05/11	150,000	167,715.94	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.75% 27/03/09	200,000	223,040.43	
CARDINAL HEALTH INC 3.2% 23/03/15	100,000	104,322.59	
CARLISLE COS INC 2.75% 30/03/01	100,000	104,512.52	

CARLISLE COS INC 3.5% 24/12/01	65,000	70,227.78	
CARRIER GLOBAL CORP 2.242% 25/02/15	50,000	52,072.40	
CARRIER GLOBAL CORP 2.722% 30/02/15	170,000	176,597.87	
CATERPILLAR FINANCIAL SE 2.4% 26/08/09	50,000	53,214.08	
CATERPILLAR FINANCIAL SE 3.75% 23/11/24	150,000	161,828.18	
CATERPILLAR FINL SERVICE 0.45% 23/09/14	195,000	195,625.30	
CATERPILLAR FINL SERVICE 0.45% 24/05/17	100,000	99,853.43	
CATERPILLAR FINL SERVICE 1.9% 22/09/06	55,000	56,058.07	
CATERPILLAR INC 2.6% 29/09/19	100,000	106,974.63	
CATERPILLAR INC 3.4% 24/05/15	100,000	107,386.52	
CBOE HOLDINGS 3.65% 27/01/12	50,000	55,802.51	
CELANESE US HOLDINGS LLC 4.625% 22/11/15	100,000	105,322.13	
CENOVUS ENERGY INC 5.375% 25/07/15	150,000	171,432.63	
CENTERPOINT ENERGY INC 2.5% 22/09/01	50,000	51,132.54	
CENTERPOINT ENERGY INC 4.25% 28/11/01	200,000	230,018.67	
CHARLES SCHWAB CORP 0.75% 24/03/18	200,000	201,534.88	
CHARLES SCHWAB CORP 1.15% 26/05/13	50,000	50,236.78	
CHARLES SCHWAB CORP 2% 28/03/20	100,000	102,940.11	
CHARLES SCHWAB CORP 2.3% 31/05/13	100,000	102,791.44	
CHARLES SCHWAB CORP 3.2% 28/01/25	100,000	110,799.38	
CHARLES SCHWAB CORP 4% 29/02/01	100,000	115,916.70	
CHARTER COMM OPT LLC 4.464% 22/07/23	300,000	310,183.39	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.2% 28/03/15	250,000	283,102.95	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.5% 24/02/01	100,000	108,952.23	
CHENIERE CORP CHRISTI HD 3.7% 29/11/15	100,000	109,698.37	
CHENIERE CORP CHRISTI HD 5.875% 25/03/31	100,000	114,650.00	
CHENIERE CORP CHRISTI HD 7% 24/06/30	100,000	114,593.87	
CHEVRON 2.566% 23/05/16	100,000	103,566.06	
CHEVRON 2.954% 26/05/16	300,000	325,235.16	
CHEVRON CORP 2.236% 30/05/11	100,000	103,544.58	
CHEVRON USA INC 0.426% 23/08/11	75,000	75,201.85	
CHEVRON USA INC 3.85% 28/01/15	100,000	114,210.53	
CHURCH & DWIGHT CO INC 2.45% 22/08/01	100,000	102,019.47	
CI FINANCIAL CORP 3.2% 30/12/17	100,000	103,073.99	
CIGNA CORP 2.375% 31/03/15	90,000	91,590.72	
CIGNA CORP 3% 23/07/15	100,000	104,679.72	
CIGNA CORP 3.05% 22/11/30	100,000	103,498.63	
CIGNA CORP 3.4% 27/03/01	100,000	110,183.51	
CIGNA CORP 4.375% 28/10/15	350,000	408,642.12	
CIMAREX ENERGY CO 4.375% 24/06/01	100,000	108,934.83	
CIMAREX ENERGY CO 4.375% 29/03/15	75,000	85,245.88	
CINTAS CORP NO 2 3.7% 27/04/01	100,000	112,050.11	
CISCO SYSTEMS INC 3.625% 24/03/04	100,000	108,228.17	
CITIBANK NA 3.65% 24/01/23	250,000	269,189.71	
CITIGROUP INC 0.981% 25/05/01	50,000	50,191.04	
CITIGROUP INC 1.462% 27/06/09	200,000	199,500.00	
CITIGROUP INC 1.678% 24/05/15	450,000	459,427.16	
CITIGROUP INC 2.561% 32/05/01	55,000	56,201.50	

CITIGROUP INC 3.375% 23/03/01	250,000	261,874.30	
CITIGROUP INC 3.52% 28/10/27	150,000	164,920.44	
CITIGROUP INC 3.7% 26/01/12	150,000	166,145.00	
CITIGROUP INC 3.75% 24/06/16	100,000	108,715.17	
CITIGROUP INC 3.887% 28/01/10	350,000	389,950.65	
CITIGROUP INC 4.075% 29/04/23	250,000	283,892.50	
CITIGROUP INC 4.125% 28/07/25	150,000	170,200.53	
CITIGROUP INC 4.4% 25/06/10	200,000	223,523.76	
CITIGROUP INC 4.412% 31/03/31	250,000	292,943.50	
CITIGROUP INC 4.45% 27/09/29	500,000	573,438.37	
CITIGROUP INC 4.6% 26/03/09	100,000	114,183.00	
CITIZENS BANK NA/RI 2.25% 25/04/28	100,000	104,707.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP 3.25% 30/04/30	130,000	141,712.21	
CITRIX SYSTEMS INC 4.5% 27/12/01	100,000	113,826.91	
CLOROX COMPANY 1.8% 30/05/15	30,000	29,664.85	
CLOROX COMPANY 3.05% 22/09/15	64,000	65,608.98	
CNA FINANCIAL CORP 3.45% 27/08/15	50,000	54,976.53	
CNA FINANCIAL CORP 3.9% 29/05/01	40,000	45,183.35	
CNA FINANCIAL CORP 4.5% 26/03/01	100,000	113,319.93	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 1.45% 26/07/15	100,000	99,690.76	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 4.2% 24/01/15	50,000	54,136.63	
CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25% 25/05/30	100,000	113,607.04	
COACH INC 3% 28/03/03	100,000	101,772.20	
COCA-COLA CO/THE 1% 28/03/15	60,000	58,404.44	
COCA-COLA CO/THE 1.45% 27/06/01	150,000	152,078.55	
COCA-COLA CO/THE 2% 31/03/05	165,000	167,645.52	
COCA-COLA CO/THE 3.375% 27/03/25	250,000	279,086.39	
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75% 30/01/22	150,000	157,300.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO 2.1% 23/05/01	100,000	103,137.44	
COLUMBIA PROPERTY TRUST 3.65% 26/08/15	50,000	52,859.43	
COMCAST CORP 3.3% 27/02/01	100,000	110,055.00	
COMCAST CORP 3.3% 27/04/01	100,000	110,574.35	
COMCAST CORP 3.4% 30/04/01	200,000	221,655.27	
COMCAST CORP 3.6% 24/03/01	300,000	324,247.31	
COMCAST CORP 3.7% 24/04/15	310,000	336,002.81	
COMCAST CORP 4.15% 28/10/15	390,000	451,890.00	
COMERICA INC 3.7% 23/07/31	75,000	79,793.96	
COMERICA INC 4% 29/02/01	100,000	115,425.44	
COMMONSPIRIT HEALTH 2.782% 30/10/01	15,000	15,692.10	
COMMONSPIRIT HEALTH 3.347% 29/10/01	100,000	108,923.38	
COMMONWEALTH EDISON CO 2.2% 30/03/01	100,000	102,510.96	
CON EDISON CO OF NY INC 2.4% 31/06/15	100,000	102,372.79	
CON EDISON CO OF NY INC 3.35% 30/04/01	20,000	22,141.21	
CONAGRA BRANDS INC 1.375% 27/11/01	100,000	98,054.90	
CONAGRA BRANDS INC 4.3% 24/05/01	60,000	65,833.80	
CONAGRA BRANDS INC 4.85% 28/11/01	100,000	119,601.78	
CONAGRA FOODS INC 3.2% 23/01/25	82,000	84,843.50	
CONNECTICUT LIGHT & PWR 2.5% 23/01/15	150,000	154,018.93	

CONOCOPHILLIPS 3.75% 27/10/01	150,000	169,087.59	
CONOCOPHILLIPS COMPANY 6.95% 29/04/15	100,000	136,544.39	
CONSOLIDATED EDISON CO 0 3.125% 27/11/15	100,000	108,985.04	
CONSOLIDATED EDISON CO 0 3.8% 28/05/15	50,000	56,590.91	
CONSTELLATION BRANDS INC 2.65% 22/11/07	100,000	102,684.01	
CONSTELLATION BRANDS INC 3.6% 28/02/15	50,000	55,650.34	
CONSTELLATION BRANDS INC 3.7% 26/12/06	50,000	55,793.21	
CONSTELLATION BRANDS INC 4.4% 25/11/15	165,000	186,645.08	
CONTL AIRLINES 2012-1 A 4.15% 24/04/11	121,250	128,860.79	
COOPERAT RABOBANK UA/NY 2.75% 23/01/10	100,000	103,621.92	
COOPERATIEVE RABOBANK UA 3.75% 26/07/21	250,000	276,130.45	
CORPORATE OFFICE PROP LP 5% 25/07/01	50,000	56,435.15	
COSTCO WHOLESALE CORP 1.375% 27/06/20	100,000	100,990.49	
COSTCO WHOLESALE CORP 3% 27/05/18	150,000	165,129.70	
CRANE CO 4.45% 23/12/15	50,000	53,906.10	
CREDIT SUISSE GROUP 4.55% 26/04/17	150,000	170,111.20	
CREDIT SUISSE NEW YORK 0.495% 24/02/02	100,000	99,834.56	
CREDIT SUISSE NEW YORK 1% 23/05/05	250,000	252,761.90	
CREDIT SUISSE NEW YORK 3.625% 24/09/09	250,000	271,822.75	
CROWN CASTLE INTL CORP 3.3% 30/07/01	100,000	107,859.38	
CROWN CASTLE INTL CORP 3.8% 28/02/15	200,000	223,062.00	
CROWN CASTLE INTL CORP 4% 27/03/01	100,000	112,364.87	
CSX CORP 4.25% 29/03/15	100,000	116,540.37	
CUMMINS INC 1.5% 30/09/01	100,000	96,856.41	
CVS HEALTH CORP 1.75% 30/08/21	100,000	96,699.78	
CVS HEALTH CORP 3.625% 27/04/01	65,000	72,062.35	
CVS HEALTH CORP 3.7% 23/03/09	73,000	76,773.93	
CVS HEALTH CORP 3.75% 30/04/01	145,000	163,104.15	
CVS HEALTH CORP 4.3% 28/03/25	850,000	977,797.50	
CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN 2.15% 30/11/01	100,000	96,446.00	
DANAHER CORP 3.35% 25/09/15	105,000	115,254.13	
DDR CORP 3.625% 25/02/01	173,000	183,250.55	
DELL INT LLC / EMC CORP 5.45% 23/06/15	200,000	216,614.19	
DELL INT LLC / EMC CORP 6.02% 26/06/15	300,000	359,226.04	
DELL INT LLC / EMC CORP 6.1% 27/07/15	150,000	184,463.79	
DELPHI CORP 4.15% 24/03/15	200,000	216,810.92	
DELTA AIR LINES 2019-1AA 3.204% 24/04/25	50,000	53,011.84	
DENTSPLY SIRONA INC 3.25% 30/06/01	100,000	107,381.38	
DEUTSCHE BANK NY 1.686% 26/03/19	150,000	151,833.70	
DEUTSCHE BANK NY 2.222% 24/09/18	300,000	308,163.81	
DEUTSCHE BANK NY 3.035% 32/05/28	150,000	152,995.49	
DEUTSCHE BANK NY 3.3% 22/11/16	100,000	103,552.44	
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75% 30/06/15	200,000	300,418.70	
DEVON ENERGY CORPORATION 4.5% 30/01/15	163,000	178,466.74	
DIAGEO CAPITAL PLC 2.625% 23/04/29	100,000	103,523.44	
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5% 29/12/01	100,000	107,338.13	
DIGITAL REALTY TRUST LP 4.45% 28/07/15	100,000	116,732.87	
DISCOVER BANK 3.45% 26/07/27	250,000	273,533.18	

DISCOVER BANK 4.2% 23/08/08	250,000	269,061.18	
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.8% 24/03/13	200,000	214,365.56	
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.95% 28/03/20	100,000	111,759.22	
DISCOVERY COMMUNICATIONS 4.125% 29/05/15	45,000	50,814.63	
DOLLAR GENERAL CORP 3.25% 23/04/15	200,000	208,436.18	
DOLLAR GENERAL CORP 4.15% 25/11/01	50,000	56,126.06	
DOLLAR TREE INC 4.2% 28/05/15	100,000	114,208.77	
DOMINION ENERGY INC 3.375% 30/04/01	60,000	65,630.03	
DOMINION ENERGY INC 4.25% 28/06/01	50,000	57,684.34	
DOMINION RESOURCES INC 5.75% 54/10/01	100,000	109,307.08	
DOW CHEMICAL CO/THE 7.375% 29/11/01	200,000	278,688.97	
DOWDUPONT INC 4.493% 25/11/15	100,000	113,510.04	
DOWDUPONT INC 4.725% 28/11/15	100,000	119,295.35	
DTE ELECTRIC CO 1.9% 28/04/01	15,000	15,340.80	
DTE ENERGY 2.85% 26/10/01	100,000	106,759.73	
DTE ENERGY CO 1.05% 25/06/01	70,000	70,059.82	
DTE ENERGY CO 2.25% 22/11/01	50,000	51,158.44	
DTE ENERGY CO 2.529% 24/10/01	75,000	78,926.38	
DTE ENERGY CO 2.95% 30/03/01	50,000	52,950.49	
DUKE ENERGY CAROLINAS 2.45% 29/08/15	25,000	26,186.28	
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.05% 23/03/15	200,000	208,692.51	
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.95% 28/11/15	250,000	288,621.82	
DUKE ENERGY CORP 2.55% 31/06/15	100,000	101,950.88	
DUKE ENERGY CORP 3.15% 27/08/15	100,000	108,675.66	
DUKE ENERGY FLORIDA LLC 1.75% 30/06/15	105,000	103,482.78	
DUKE REALTY LP 3.75% 24/12/01	100,000	108,756.15	
DUKE REALTY LP 4% 28/09/15	50,000	57,211.06	
DXC TECHNOLOGY CO 4.25% 24/04/15	100,000	108,982.91	
E*TRADE FINANCIAL CORP 2.95% 22/08/24	50,000	51,314.94	
E*TRADE FINANCIAL CORP 3.8% 27/08/24	15,000	16,675.33	
E*TRADE FINANCIAL CORP 4.5% 28/06/20	50,000	57,961.78	
EASTMAN CHEMICAL CO 4.5% 28/12/01	100,000	117,078.49	
EATON VANCE CORP 3.5% 27/04/06	50,000	54,405.82	
EBAY INC 1.4% 26/05/10	100,000	100,773.31	
EBAY INC 2.6% 31/05/10	100,000	102,382.37	
EBAY INC 2.7% 30/03/11	70,000	72,638.69	
EBAY INC 3.6% 27/06/05	100,000	111,234.65	
ECOLAB INC 2.375% 22/08/10	100,000	102,012.45	
ECOLAB INC 2.7% 26/11/01	45,000	48,401.01	
ECOLAB INC 3.25% 23/01/14	50,000	51,891.71	
ECOLAB INC 4.8% 30/03/24	45,000	55,414.77	
EDISON INTERNATIONAL 3.125% 22/11/15	35,000	36,031.71	
EDISON INTERNATIONAL 4.95% 25/04/15	40,000	44,290.31	
EDISON INTERNATIONAL 5.75% 27/06/15	160,000	183,204.32	
ELECTRONIC ARTS INC 1.85% 31/02/15	60,000	58,666.83	
ELI LILLY & CO 3.375% 29/03/15	195,000	219,050.95	
EMERA US FINANCE LP 0.833% 24/06/15	50,000	49,784.50	
EMERSON ELECTRIC CO 3.15% 25/06/01	100,000	108,332.19	

EMPRESA NACIONAL DE ELEC 4.25% 24/04/15	50,000	53,666.74	
ENABLE MIDSTREAM PARTNER 3.9% 24/05/15	100,000	106,471.79	
ENABLE MIDSTREAM PARTNER 4.4% 27/03/15	100,000	110,850.11	
ENBRIDGE ENERGY PARTNERS 5.875% 25/10/15	100,000	118,169.88	
ENBRIDGE INC 2.9% 22/07/15	50,000	51,123.20	
ENBRIDGE INC 3.7% 27/07/15	50,000	55,496.64	
ENEL CHILE SA 4.875% 28/06/12	100,000	115,000.00	
ENERGY TRANSFER LP 3.6% 23/02/01	250,000	259,034.65	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 4.5% 24/04/15	100,000	108,955.49	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.25% 29/04/15	200,000	236,789.83	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.875% 24/01/15	250,000	276,729.98	
ENSTAR GROUP LTD 4.95% 29/06/01	100,000	115,645.93	
ENERGY CORP 1.9% 28/06/15	85,000	85,166.74	
ENERGY CORP 4% 22/07/15	50,000	51,498.66	
ENERGY LOUISIANA LLC 2.4% 26/10/01	300,000	314,677.76	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8% 30/01/31	160,000	169,774.60	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 4.875% 77/08/16	100,000	98,953.92	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 5.375% 78/02/15	100,000	102,228.48	
EOG RESOURCES INC 4.375% 30/04/15	30,000	35,634.30	
EQUIFAX INC 3.95% 23/06/15	40,000	42,473.81	
EQUINIX INC 1% 25/09/15	100,000	99,430.56	
EQUINIX INC 2% 28/05/15	100,000	101,034.65	
EQUINIX INC 2.15% 30/07/15	100,000	99,806.01	
EQUINIX INC 3.2% 29/11/18	45,000	48,554.10	
ERP OPERATING LP 2.5% 30/02/15	100,000	104,216.82	
ERP OPERATING LP 3.25% 27/08/01	35,000	38,197.07	
ERP OPERATING LP 4.15% 28/12/01	50,000	57,790.27	
ESSENTIAL UTILITIES INC 2.704% 30/04/15	60,000	62,762.86	
ESSEX PORTFOLIO LP 1.7% 28/03/01	85,000	84,084.48	
ESSEX PORTFOLIO LP 3.5% 25/04/01	100,000	108,399.77	
ESSEX PORTFOLIO LP 3.875% 24/05/01	50,000	53,882.48	
ESTEE LAUDER CO INC 1.95% 31/03/15	45,000	45,314.35	
ESTEE LAUDER CO INC 3.15% 27/03/15	100,000	110,156.52	
EVERGY INC 2.9% 29/09/15	100,000	106,290.42	
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 24/10/01	50,000	53,043.47	
EXELON 3.4% 26/04/15	100,000	109,397.90	
EXPEDIA GROUP INC 3.25% 30/02/15	200,000	209,467.62	
EXPEDIA GROUP INC 3.6% 23/12/15	25,000	26,558.39	
EXPEDIA GROUP INC 4.625% 27/08/01	75,000	85,015.50	
EXXON MOBIL CORPORATION 1.571% 23/04/15	600,000	612,860.38	
EXXON MOBIL CORPORATION 2.275% 26/08/16	100,000	105,516.28	
EXXON MOBIL CORPORATION 2.44% 29/08/16	100,000	105,423.06	
EXXON MOBIL CORPORATION 3.294% 27/03/19	150,000	166,261.35	
FAIRFAX FINL HLDGS LTD 4.625% 30/04/29	100,000	115,160.62	
FEDERAL REALTY INVESTMEN 1.25% 26/02/15	100,000	99,734.86	
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.2% 29/06/15	50,000	53,979.73	
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.25% 27/07/15	50,000	53,957.46	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 5.25% 23/04/15	200,000	215,470.00	

FIBRIA OVERSEAS FINANCE 5.5% 27/01/17	50,000	58,187.50	
FIDELITY NATL FINANCIAL 4.5% 28/08/15	100,000	115,771.94	
FIDELITY NATL INFO SERV 0.375% 23/03/01	20,000	19,987.15	
FIDELITY NATL INFO SERV 0.6% 24/03/01	15,000	14,991.42	
FIDELITY NATL INFO SERV 1.65% 28/03/01	20,000	19,974.14	
FIDELITY NATL INFO SERV 2.25% 31/03/01	100,000	100,271.06	
FIFTH THIRD BANCORP 2.55% 27/05/05	60,000	63,588.72	
FIFTH THIRD BANCORP 3.65% 24/01/25	100,000	107,375.15	
FIFTH THIRD BANK 2.25% 27/02/01	250,000	262,966.45	
FISERV INC 2.65% 30/06/01	100,000	104,119.18	
FISERV INC 3.2% 26/07/01	250,000	271,387.43	
FISERV INC 3.8% 23/10/01	250,000	267,289.27	
FLEX LTD 4.875% 30/05/12	85,000	98,752.62	
FLEXTRONICS INTERNATIONAL 4.75% 25/06/15	125,000	140,084.49	
FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.85% 25/04/01	100,000	107,131.33	
FLOWERS FOODS INC 3.5% 26/10/01	35,000	38,239.75	
FORTUNE BRANDS HOME & SE 4% 23/09/21	100,000	107,227.58	
FOX CORP 3.5% 30/04/08	25,000	27,628.70	
FOX CORP 4.03% 24/01/25	150,000	162,541.87	
FOX CORP 4.709% 29/01/25	100,000	117,866.87	
FS KKR CAPITAL CORP 3.4% 26/01/15	100,000	103,770.23	
FS KKR CAPITAL CORP 4.125% 25/02/01	100,000	106,083.20	
GATX CORP 1.9% 31/06/01	100,000	95,674.03	
GE CAPITAL FUNDING LLC 4.4% 30/05/15	200,000	233,516.55	
GENERAL DYNAMICS CORP 2.125% 26/08/15	100,000	104,963.07	
GENERAL DYNAMICS CORP 2.25% 22/11/15	100,000	102,132.60	
GENERAL DYNAMICS CORP 3.25% 25/04/01	100,000	108,506.99	
GENERAL DYNAMICS CORP 3.75% 28/05/15	80,000	91,185.98	
GENERAL ELECTRIC CO 3.45% 24/05/15	200,000	214,337.82	
GENERAL ELECTRIC CO 3.45% 27/05/01	200,000	220,216.50	
GENERAL MILLS INC 3.7% 23/10/17	140,000	149,502.14	
GENERAL MILLS INC 4.2% 28/04/17	100,000	115,252.21	
GENERAL MOTORS CO 5% 28/10/01	200,000	234,777.27	
GENERAL MOTORS CO 5.4% 23/10/02	100,000	109,836.60	
GENERAL MOTORS FINL CO 1.05% 24/03/08	50,000	50,383.45	
GENERAL MOTORS FINL CO 1.5% 26/06/10	250,000	249,374.30	
GENERAL MOTORS FINL CO 2.4% 28/04/10	100,000	101,877.69	
GENERAL MOTORS FINL CO 3.7% 23/05/09	250,000	262,244.98	
GENERAL MOTORS FINL CO 3.85% 28/01/05	100,000	110,182.30	
GENERAL MOTORS FINL CO 3.95% 24/04/13	100,000	107,694.30	
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35% 27/01/17	100,000	112,918.50	
GENERAL MOTORS FINL CO 5.1% 24/01/17	200,000	220,243.17	
GENERAL MOTORS FINL CO 5.65% 29/01/17	100,000	122,255.43	
GEORGIA POWER CO 2.65% 29/09/15	70,000	73,708.44	
GEORGIA POWER CO 3.25% 26/04/01	50,000	54,147.25	
GILEAD SCIENCES INC 1.65% 30/10/01	60,000	58,168.90	
GILEAD SCIENCES INC 2.5% 23/09/01	70,000	72,819.62	
GILEAD SCIENCES INC 3.65% 26/03/01	200,000	221,113.64	

GILEAD SCIENCES INC 3.7% 24/04/01	250,000	268,526.55	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.375% 23/05/15	350,000	369,409.22	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.625% 25/05/15	55,000	60,813.81	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.875% 28/05/15	100,000	114,890.59	
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9% 30/05/15	45,000	47,150.63	
GLOBAL PAYMENTS INC 4% 23/06/01	100,000	106,201.88	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 23/11/01	145,000	158,326.95	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 26/04/15	85,000	97,937.11	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75% 28/06/01	45,000	53,839.35	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.657% 24/09/10	200,000	199,611.96	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.431% 27/03/09	160,000	160,113.60	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.542% 27/09/10	100,000	99,995.41	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615% 32/04/22	105,000	107,983.47	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.2% 23/02/23	250,000	260,505.74	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.625% 23/01/22	500,000	524,415.99	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.691% 28/06/05	200,000	221,660.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75% 25/05/22	100,000	109,614.12	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.8% 30/03/15	100,000	112,939.45	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 24/07/08	300,000	324,732.96	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 27/01/26	300,000	330,932.76	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223% 29/05/01	500,000	573,061.96	
GOLUB CAPITAL BDC 2.5% 26/08/24	60,000	60,584.38	
GRUPO TELEVISIA SAB 6.625% 25/03/18	150,000	178,310.45	
GULF POEWR CO 3.3% 27/05/30	100,000	109,965.49	
HANOVER INSURANCE GROUP 4.5% 26/04/15	50,000	56,703.34	
HARRIS CORPORATION 4.4% 28/06/15	150,000	174,804.06	
HASBRO INC 3.5% 27/09/15	30,000	32,859.53	
HASBRO INC 3.55% 26/11/19	125,000	137,237.98	
HCA INC 4.125% 29/06/15	100,000	112,983.94	
HCA INC 4.5% 27/02/15	105,000	119,123.72	
HCA INC 4.75% 23/05/01	105,000	112,588.42	
HCA INC 5% 24/03/15	200,000	221,234.72	
HEALTHPEAK PROPERTIES 3% 30/01/15	100,000	107,023.66	
HERSHEY COMPANY 1.7% 30/06/01	80,000	79,870.94	
HERSHEY COMPANY 2.05% 24/11/15	100,000	104,470.66	
HESS CORP 4.3% 27/04/01	100,000	111,587.26	
HIGHWOODS REALTY LP 3.05% 30/02/15	100,000	105,189.48	
HOLLYFRONTIER CORP 5.875% 26/04/01	100,000	115,542.22	
HOME DEPOT INC 0.9% 28/03/15	30,000	29,251.66	
HOME DEPOT INC 2.5% 27/04/15	100,000	106,945.32	
HOME DEPOT INC 2.7% 30/04/15	55,000	59,061.84	
HOME DEPOT INC 2.8% 27/09/14	100,000	108,734.00	
HOME DEPOT INC 3.9% 28/12/06	300,000	348,618.90	
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.15% 22/08/08	95,000	96,774.15	
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.7% 29/08/15	120,000	128,807.06	
HORMEL FOODS CORP 1.7% 28/06/03	170,000	172,086.49	
HOST HOTELS & RESORTS LP 3.875% 24/04/01	50,000	53,395.42	
HOST HOTELS & RESORTS LP 4.5% 26/02/01	150,000	165,327.34	

HP ENTERPRISE CO 1.45% 24/04/01	100,000	101,799.73	
HP ENTERPRISE CO 2.25% 23/04/01	100,000	102,879.62	
HP ENTERPRISE CO 4.9% 25/10/15	200,000	228,388.14	
HP INC 2.65% 31/06/17	200,000	200,171.94	
HP INC 3.4% 30/06/17	150,000	160,678.94	
HSBC HOLDINGS PLC 1.589% 27/05/24	200,000	200,893.63	
HSBC HOLDINGS PLC 2.099% 26/06/04	530,000	545,995.20	
HSBC HOLDINGS PLC 2.804% 32/05/24	200,000	206,362.16	
HSBC HOLDINGS PLC 2.848% 31/06/04	200,000	208,743.95	
HSBC HOLDINGS PLC 3.95% 24/05/18	300,000	318,448.79	
HSBC HOLDINGS PLC 3.973% 30/05/22	200,000	224,805.31	
HSBC HOLDINGS PLC 4.041% 28/03/13	250,000	279,116.78	
HSBC HOLDINGS PLC 4.25% 24/03/14	200,000	216,379.92	
HSBC HOLDINGS PLC 4.583% 29/06/19	200,000	231,954.74	
HUBBELL INC 3.35% 26/03/01	100,000	108,418.05	
HUDSON PACIFIC PROPERTIE 3.25% 30/01/15	100,000	107,019.62	
HUMANA INC 2.9% 22/12/15	50,000	51,632.53	
HUMANA INC 3.85% 24/10/01	150,000	162,801.69	
HUNTINGTON BANCSHARES 2.55% 30/02/04	100,000	104,978.71	
HUNTSMAN INTERNATIONAL L 4.5% 29/05/01	100,000	114,090.64	
HYATT HOTELS CORP 4.375% 28/09/15	50,000	55,365.27	
HYATT HOTELS CORP 4.85% 26/03/15	50,000	55,819.82	
IBM 2.875% 22/11/09	100,000	103,455.65	
IBM CORP 1.7% 27/05/15	470,000	477,741.09	
IBM CORP 1.875% 22/08/01	150,000	152,641.70	
IBM CORP 3.375% 23/08/01	250,000	265,180.94	
IBM CORP 3.5% 29/05/15	100,000	111,970.94	
IDEX CORP 3% 30/05/01	50,000	53,008.05	
ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65% 26/11/15	100,000	107,649.51	
ING GROEP NV 1.726% 27/04/01	200,000	202,442.03	
ING GROEP NV 4.1% 23/10/02	200,000	215,511.59	
INGERSOLL-RAND GL HLD CO 4.25% 23/06/15	150,000	160,564.60	
INGREDION INC 2.9% 30/06/01	100,000	105,258.35	
INTEL CORP 2.875% 24/05/11	100,000	106,358.67	
INTEL CORP 3.7% 25/07/29	145,000	160,298.54	
INTEL CORP 3.75% 27/03/25	100,000	113,220.33	
INTEL CORP 3.9% 30/03/25	250,000	291,719.16	
INTERCONTINENTALEXCHANGE 0.7% 23/06/15	45,000	45,195.30	
INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.1% 27/09/15	100,000	109,275.00	
INTERPUBLIC GROUP COS 4.65% 28/10/01	25,000	29,527.46	
INTERPUBLIC GROUP COS 4.75% 30/03/30	100,000	119,696.06	
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.25% 24/12/01	100,000	107,597.15	
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.6% 29/04/01	50,000	55,772.93	
INTL FLAVOR & FRAGRANCES 4.45% 28/09/26	45,000	52,444.30	
INTUIT INC 0.65% 23/07/15	100,000	100,636.55	
INVESCO FINANCE PLC 3.75% 26/01/15	150,000	166,654.82	
IPALCO ENTERPRISES INC 3.7% 24/09/01	100,000	107,813.01	
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25% 30/05/01	100,000	112,969.20	

ITC HOLDINGS CORP 3.25% 26/06/30	60,000	65,150.30	
ITC HOLDINGS CORP 3.65% 24/06/15	25,000	26,837.06	
JABIL INC 3.6% 30/01/15	150,000	162,619.27	
JD.COM INC 3.375% 30/01/14	100,000	107,590.06	
JEFFERIES GROUP 4.85% 27/01/15	90,000	105,189.28	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.45% 24/06/07	65,000	64,845.49	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.7% 23/07/05	100,000	100,625.18	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.05% 26/06/17	100,000	99,998.52	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75% 27/03/09	200,000	205,271.11	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.45% 30/01/09	200,000	211,490.15	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.65% 24/06/24	50,000	53,195.23	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.7% 23/01/06	50,000	51,747.98	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8% 29/07/18	50,000	54,355.43	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.05% 28/01/06	50,000	55,127.97	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.45% 23/06/07	50,000	52,940.84	
JOHNSON & JOHNSON 0.55% 25/09/01	50,000	49,557.46	
JOHNSON & JOHNSON 0.95% 27/09/01	65,000	64,121.56	
JOHNSON & JOHNSON 1.3% 30/09/01	100,000	97,157.59	
JOHNSON & JOHNSON 2.05% 23/03/01	100,000	102,545.19	
JOHNSON & JOHNSON 2.45% 26/03/01	100,000	106,626.04	
JOHNSON & JOHNSON 2.95% 27/03/03	100,000	109,531.46	
JPMORGAN CHASE & CO 0.969% 25/06/23	400,000	400,834.83	
JPMORGAN CHASE & CO 0.563% 25/02/16	90,000	89,554.58	
JPMORGAN CHASE & CO 0.653% 24/09/16	135,000	135,114.62	
JPMORGAN CHASE & CO 0.824% 25/06/01	65,000	64,976.17	
JPMORGAN CHASE & CO 1.04% 27/02/04	200,000	196,995.48	
JPMORGAN CHASE & CO 1.514% 24/06/01	200,000	203,660.49	
JPMORGAN CHASE & CO 1.578% 27/04/22	65,000	65,530.62	
JPMORGAN CHASE & CO 2.005% 26/03/13	600,000	620,996.67	
JPMORGAN CHASE & CO 2.069% 29/06/01	55,000	55,592.90	
JPMORGAN CHASE & CO 2.182% 28/06/01	400,000	410,908.00	
JPMORGAN CHASE & CO 2.58% 32/04/22	75,000	77,283.87	
JPMORGAN CHASE & CO 2.739% 30/10/15	100,000	105,066.88	
JPMORGAN CHASE & CO 2.956% 31/05/13	150,000	158,037.35	
JPMORGAN CHASE & CO 2.972% 23/01/15	300,000	303,895.63	
JPMORGAN CHASE & CO 3.22% 25/03/01	200,000	212,359.48	
JPMORGAN CHASE & CO 3.375% 23/05/01	200,000	210,376.48	
JPMORGAN CHASE & CO 3.509% 29/01/23	250,000	276,527.64	
JPMORGAN CHASE & CO 3.559% 24/04/23	150,000	157,954.49	
JPMORGAN CHASE & CO 3.797% 24/07/23	200,000	212,872.96	
JPMORGAN CHASE & CO 3.96% 27/01/29	200,000	223,025.12	
JPMORGAN CHASE & CO 4.005% 29/04/23	100,000	113,160.88	
JPMORGAN CHASE & CO 4.203% 29/07/23	700,000	805,039.56	
JPMORGAN CHASE & CO 4.25% 27/10/01	100,000	114,037.66	
JUNIPER NETWORKS INC 2% 30/12/10	100,000	96,632.02	
JUNIPER NETWORKS INC 3.75% 29/08/15	50,000	55,914.46	
KAISER FOUNDATION HOSPIT 3.15% 27/05/01	50,000	54,777.88	
KANSAS CITY POWER & LT 3.15% 23/03/15	79,000	82,049.72	

KANSAS CITY SOUTHERN 2.875% 29/11/15	65,000	68,614.75	
KELLOGG CO 4.3% 28/05/15	100,000	116,465.20	
KEMPER CORP 2.4% 30/09/30	100,000	100,914.09	
KEMPER CORP 4.35% 25/02/15	35,000	38,342.57	
KEURIG DR PEPPER INC 3.13% 23/12/15	100,000	106,045.12	
KEURIG DR PEPPER INC 4.057% 23/05/25	50,000	53,235.47	
KEURIG DR PEPPER INC 4.597% 28/05/25	250,000	294,241.32	
KEY BANK NA 3.4% 26/05/20	200,000	219,066.25	
KEYCORP 2.25% 27/04/06	100,000	104,265.11	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES 4.6% 27/04/06	60,000	69,976.65	
KILROY REALTY LP 3.05% 30/02/15	100,000	105,572.76	
KILROY REALTY LP 4.375% 25/10/01	100,000	111,056.37	
KIMBERLY CLARK CORP 2.75% 26/02/15	150,000	162,797.84	
KIMBERLY-CLARK CORP 1.05% 27/09/15	100,000	98,439.97	
KIMCO REALTY CORP 1.9% 28/03/01	50,000	50,202.60	
KIMCO REALTY CORP 2.7% 24/03/01	50,000	52,266.13	
KIMCO REALTY CORP 3.3% 25/02/01	80,000	86,248.56	
KINDER MORGAN ENER PART 4.3% 24/05/01	200,000	218,085.17	
KINDER MORGAN INC 4.3% 28/03/01	200,000	229,173.00	
KITE REALTY GROUP LP 4% 26/10/01	50,000	54,309.73	
KLA-TENCOR CORP 4.1% 29/03/15	100,000	115,585.61	
KROGER CO 3.5% 26/02/01	150,000	165,210.34	
KROGER CO 4% 24/02/01	100,000	107,567.01	
L3HARRIS TECH INC 3.85% 23/06/15	70,000	74,400.74	
L3HARRIS TECH INC 4.4% 28/06/15	100,000	116,536.04	
LABORATORY CORP OF AMER 1.55% 26/06/01	70,000	70,743.80	
LABORATORY CORP OF AMER 3.6% 27/09/01	150,000	166,686.30	
LABORATORY CORP OF AMERI 4% 23/11/01	50,000	53,421.83	
LAM RESEARCH CORP 4% 29/03/15	55,000	64,176.23	
LAS VEGAS SANDS CORP 3.5% 26/08/18	70,000	74,540.36	
LAS VEGAS SANDS CORP 3.9% 29/08/08	105,000	112,256.45	
LAZARD GROUP LLC 3.625% 27/03/01	100,000	109,548.17	
LAZARD GROUP LLC 4.5% 28/09/19	50,000	57,961.85	
LEAR CORP 4.25% 29/05/15	100,000	112,933.92	
LEGGETT & PLATT INC 3.4% 22/08/15	50,000	51,135.44	
LEGGETT & PLATT INC 3.5% 27/11/15	50,000	54,244.81	
LEIDOS INC 2.95% 23/05/15	45,000	46,795.95	
LENNAR CORP 4.875% 23/12/15	200,000	217,700.00	
LENOX INTERNATIONAL INC 1.35% 25/08/01	25,000	25,252.77	
LEUCADIA NATIONAL CORP 5.5% 23/10/18	100,000	107,424.84	
LIFE STORAGE LP 4% 29/06/15	100,000	112,724.03	
LINCOLN NATIONAL CORP 3.35% 25/03/09	150,000	162,550.26	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907% 23/11/07	400,000	411,984.58	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% 25/05/08	200,000	224,721.20	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.55% 28/08/16	200,000	234,122.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65% 26/03/24	200,000	226,785.87	
LOCKHEED MARTIN CORP 1.85% 30/06/15	100,000	100,878.91	
LOEWS CORP 2.625% 23/05/15	150,000	155,234.81	

LOWE'S COS INC 1.3% 28/04/15	145,000	141,581.21	
LOWE'S COS INC 2.625% 31/04/01	150,000	155,911.60	
LOWE'S COS INC 3.1% 27/05/03	100,000	109,200.66	
LOWE'S COS INC 4% 25/04/15	100,000	110,737.69	
LYB INT FINANCE III 1.25% 25/10/01	20,000	20,007.55	
LYB INT FINANCE III 2.25% 30/10/01	125,000	125,666.49	
MAGELLAN MISDREAM PARTN 3.9% 24/11/15	50,000	57,544.44	
MAGNA INTERNATIONAL INC 2.45% 30/06/15	100,000	102,890.81	
MAGNA INTERNATIONAL INC 4.15% 25/10/01	50,000	56,028.45	
MAIN STREET CAPITAL CORP 3% 26/07/14	85,000	87,685.88	
MANULIFE FINANCIAL CORP 2.484% 27/05/19	35,000	37,170.49	
MARATHON PETROLEUM CORP 3.8% 28/04/01	30,000	33,465.86	
MARATHON PETROLEUM CORP 4.75% 23/12/15	100,000	108,892.08	
MARKEL CORPORATION 4.9% 22/07/01	70,000	72,871.72	
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.6% 24/04/15	50,000	53,355.18	
MARRIOTT INTERNATIONAL 4.625% 30/06/15	110,000	126,802.22	
MARRIOTT INTERNATIONAL 5.75% 25/05/01	50,000	57,730.12	
MARSH & MCLENNAN COS INC 3.875% 24/03/15	100,000	108,373.55	
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.375% 29/03/15	95,000	111,718.75	
MARTIN MARIETTA 2.4% 31/07/15	50,000	50,538.25	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.45% 27/06/01	21,000	23,043.32	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.5% 27/12/15	50,000	55,317.15	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 4.25% 24/07/02	30,000	32,723.67	
MARVELL TECHNOLOGY INC 4.2% 23/06/22	100,000	106,273.91	
MARVELL TECHNOLOGY INC 4.875% 28/06/22	100,000	116,217.21	
MASCO CORP 1.5% 28/02/15	50,000	49,216.07	
MASCO CORP 2% 30/10/01	15,000	14,757.25	
MASTERCARD INC 2.95% 29/06/01	100,000	109,821.01	
MASTERCARD INC 3.35% 30/03/26	100,000	112,955.71	
MASTERCARD INC 3.375% 24/04/01	200,000	215,574.89	
MASTERCARD INC 3.5% 28/02/26	30,000	33,824.61	
MAXIM INTEGRATED PRODUCT 3.45% 27/06/15	100,000	110,639.64	
MCCORMICK & CO 2.5% 30/04/15	100,000	103,368.82	
MCCORMICK & CO 2.7% 22/08/15	50,000	51,173.40	
MCDONALDS CORP 3.35% 23/04/01	205,000	214,774.35	
MCDONALD'S CORP 3.5% 27/07/01	100,000	110,998.00	
MCDONALD'S CORP 3.6% 30/07/01	100,000	112,622.84	
MCDONALDS CORP 3.8% 28/04/01	150,000	170,807.64	
MCKESSON CORP 3.796% 24/03/15	100,000	107,535.63	
MCKESSON CORP 3.95% 28/02/16	200,000	227,124.40	
MEAD JOHNSON NUTRITION C 4.125% 25/11/15	60,000	67,611.97	
MEDTRONIC INC 3.5% 25/03/15	141,000	154,886.41	
MERCK & CO INC 2.8% 23/05/18	200,000	209,079.35	
MERCK & CO INC 3.4% 29/03/07	300,000	337,528.56	
MERCY HEALTHCARE SYSTEM 4.302% 28/07/01	15,000	17,470.30	
METLIFE INC 4.368% 23/09/15	100,000	108,261.80	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.333% 23/06/01	100,000	106,474.88	
MICRON TECHNOLOGY INC 5.327% 29/02/06	50,000	60,612.20	

MICROSOFT CORP 2% 23/08/08	200,000	206,297.77	
MICROSOFT CORP 2.375% 23/05/01	100,000	103,243.59	
MICROSOFT CORP 2.4% 26/08/08	150,000	159,880.65	
MICROSOFT CORP 2.7% 25/02/12	100,000	106,849.13	
MICROSOFT CORP 3.3% 27/02/06	300,000	334,212.40	
MICROSOFT CORP 3.625% 23/12/15	150,000	160,717.57	
MID-AMERICA APARTMENTS 3.95% 29/03/15	100,000	114,402.69	
mitsubishi UFJ FIN GRP 0.848% 24/09/15	200,000	200,885.43	
mitsubishi UFJ FIN GRP 2.665% 22/07/25	200,000	204,812.94	
mitsubishi UFJ FIN GRP 3.195% 29/07/18	200,000	217,987.95	
mitsubishi UFJ FIN GRP 3.407% 24/03/07	200,000	214,328.47	
mitsubishi UFJ FIN GRP 3.455% 23/03/02	100,000	104,996.64	
mitsubishi UFJ FIN GRP 4.05% 28/09/11	200,000	231,722.77	
mitsubishi UFJ FINANCIAL 2.757% 26/09/13	200,000	212,946.71	
mitsubishi UFJ FINANCIAL 3.961% 28/03/02	100,000	114,416.66	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.849% 24/09/08	200,000	201,039.63	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 1.554% 27/07/09	200,000	200,329.04	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.721% 23/07/16	200,000	204,603.24	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.869% 30/09/13	200,000	211,446.51	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018% 28/03/05	200,000	229,409.95	
MONDELEZ INTERNATIONAL 0.625% 22/07/01	70,000	70,265.89	
MOODY'S CORPORATION 4.5% 22/09/01	200,000	207,391.92	
MORGAN STANLEY 0.529% 24/01/25	200,000	199,853.70	
MORGAN STANLEY 0.56% 23/11/10	115,000	115,158.09	
MORGAN STANLEY 0.731% 24/04/05	190,000	190,421.18	
MORGAN STANLEY 0.79% 25/05/30	200,000	199,450.73	
MORGAN STANLEY 1.593% 27/05/04	245,000	247,275.20	
MORGAN STANLEY 2.188% 26/04/28	50,000	51,941.26	
MORGAN STANLEY 2.699% 31/01/22	300,000	314,248.30	
MORGAN STANLEY 3.125% 23/01/23	250,000	260,285.70	
MORGAN STANLEY 3.125% 26/07/27	450,000	487,266.50	
MORGAN STANLEY 3.591% 28/07/22	200,000	221,540.32	
MORGAN STANLEY 3.622% 31/04/01	200,000	224,133.54	
MORGAN STANLEY 3.737% 24/04/24	100,000	105,679.16	
MORGAN STANLEY 3.75% 23/02/25	200,000	210,578.72	
MORGAN STANLEY 3.772% 29/01/24	200,000	224,226.59	
MORGAN STANLEY 3.875% 26/01/27	500,000	559,339.06	
MORGAN STANLEY 3.95% 27/04/23	100,000	111,971.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 2.75% 31/05/24	50,000	51,312.55	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4% 24/09/01	91,000	99,556.51	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6% 29/05/23	100,000	117,245.88	
MPLX LP 2.65% 30/08/15	45,000	45,567.23	
MPLX LP 3.375% 23/03/15	50,000	52,312.73	
MPLX LP 4.8% 29/02/15	100,000	117,627.40	
MPLX LP 4.875% 25/06/01	250,000	282,556.88	
MYLAN 3.95% 26/06/15	100,000	110,401.50	
NASDAQ 3.85% 26/06/30	30,000	33,653.95	
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.5% 26/07/12	100,000	106,739.65	

NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3% 23/01/20	250,000	259,977.21	
NATIONAL FUEL GAS CO 3.95% 27/09/15	50,000	54,182.77	
NATIONAL FUEL GAS CO 4.75% 28/09/01	50,000	56,708.45	
NATIONAL FUEL GAS CO 5.5% 26/01/15	15,000	17,424.54	
NATIONAL HEALTH INVESTOR 3% 31/02/01	25,000	24,492.57	
NATIONAL RETAIL PROP INC 4.3% 28/10/15	65,000	74,015.53	
NATIONAL RETAIL PROPERTI 4% 25/11/15	65,000	72,009.02	
NATIONAL RURAL UTIL COOP 3.4% 23/11/15	100,000	106,136.79	
NATIONAL RURAL UTILITIES 5.25% 46/04/20	150,000	163,135.53	
NATWEST GROUP PLC 4.892% 29/05/18	400,000	470,592.86	
NATWEST GROUP PLC 6% 23/12/19	200,000	223,987.52	
NETAPP INC 2.375% 27/06/22	100,000	105,205.89	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 1.9% 28/06/15	65,000	65,984.46	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.75% 25/05/01	200,000	212,828.76	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.8% 23/01/15	50,000	51,663.51	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65% 79/05/01	150,000	174,304.81	
NIKE INC 2.25% 23/05/01	50,000	51,495.82	
NIKE INC 2.375% 26/11/01	100,000	106,645.51	
NIKE INC 2.85% 30/03/27	50,000	54,551.40	
NISOURCE FINANCE CORP 3.49% 27/05/15	100,000	110,499.41	
NOMURA HOLDINGS INC 1.653% 26/07/14	100,000	99,940.35	
NOMURA HOLDINGS INC 3.103% 30/01/16	200,000	210,216.37	
NORFOLK SOUTHERN 2.9% 26/06/15	65,000	70,246.10	
NORFOLK SOUTHERN CORP 2.903% 23/02/15	100,000	103,601.87	
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.15% 27/06/01	75,000	81,851.70	
NORTHERN TRUST CORP 3.375% 32/05/08	62,000	67,746.40	
NORTHERN TRUST CORP 3.65% 28/08/03	50,000	56,779.31	
NORTHERN TRUST CORP 3.95% 25/10/30	100,000	113,152.68	
NORTHROP GRUMMAN CORP 3.25% 28/01/15	200,000	218,681.25	
NOVARTIS CAPITAL CORP 1.75% 25/02/14	100,000	103,403.06	
NOVARTIS CAPITAL CORP 2% 27/02/14	200,000	208,485.20	
NSTAR ELECTRIC CO 3.2% 27/05/15	50,000	54,880.99	
NSTAR ELECTRIC CO 3.25% 29/05/15	100,000	110,212.35	
NUTRIEN LTD 3% 25/04/01	100,000	106,568.46	
NUTRIEN LTD 3.15% 22/10/01	150,000	153,920.44	
NVIDIA CORP 0.309% 23/06/15	85,000	85,069.11	
NVIDIA CORP 0.584% 24/06/14	75,000	75,318.42	
NVIDIA CORP 1.55% 28/06/15	100,000	100,182.49	
NVIDIA CORP 2% 31/06/15	100,000	100,006.87	
NVIDIA CORP 2.85% 30/04/01	100,000	108,422.80	
NVR INC 3% 30/05/15	65,000	69,205.87	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.4% 30/05/01	45,000	49,405.05	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875% 26/06/18	100,000	111,118.70	
NXP BV/NXP FUNDING LLC 4.875% 24/03/01	100,000	110,129.44	
NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.55% 28/12/01	100,000	123,119.73	
OAKTREE SPECIALTY LEND 1.007% 24/12/10	50,000	50,242.88	
OFFICE PPTY INCOME TRST 4.5% 25/02/01	100,000	108,688.04	
OKLAHOMA G&E CO 3.25% 30/04/01	55,000	59,962.04	

OLD REPUBLIC INTERNATION 3.875% 26/08/26	100,000	112,145.82	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 25/01/15	50,000	54,681.55	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 27/04/01	100,000	112,048.51	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.95% 24/04/01	100,000	108,663.24	
OMNICOM GROUP INC 2.45% 30/04/30	100,000	102,367.88	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 3.7% 28/11/15	100,000	113,301.70	
ONE GAS INC 1.1% 24/03/11	100,000	100,068.09	
ONE GAS INC 2% 30/05/15	100,000	99,146.78	
ONEOK INC 4% 27/07/13	85,000	94,008.44	
ONEOK INC 4.55% 28/07/15	150,000	171,213.15	
ONEOK INC 5.85% 26/01/15	65,000	76,920.01	
ORACLE CORP 2.3% 28/03/25	105,000	108,364.96	
ORACLE CORP 2.5% 22/10/15	150,000	153,876.68	
ORACLE CORP 2.625% 23/02/15	105,000	108,500.58	
ORACLE CORP 2.8% 27/04/01	700,000	744,052.47	
ORACLE CORP 2.875% 31/03/25	95,000	99,431.67	
ORACLE CORP 3.25% 27/11/15	150,000	162,968.17	
ORACLE CORP 3.25% 30/05/15	100,000	107,648.28	
ORACLE CORP 3.625% 23/07/15	150,000	159,258.67	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35% 28/06/01	150,000	174,090.91	
ORIX CORP 2.9% 22/07/18	30,000	30,775.02	
ORIX CORP 3.25% 24/12/04	100,000	107,890.45	
ORIX CORP 3.7% 27/07/18	50,000	56,072.59	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.293% 27/04/05	35,000	36,464.55	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565% 30/02/15	40,000	41,684.37	
OWENS CORNING 3.95% 29/08/15	180,000	204,506.35	
OWL ROCK CAPITAL CORP 2.875% 28/06/11	100,000	99,966.58	
OWL ROCK CAPITAL CORP 3.4% 26/07/15	100,000	104,556.43	
OWL ROCK CAPITAL CORP 4% 25/03/30	100,000	106,735.80	
PACCAR FINANCIAL CORP 2% 22/09/26	65,000	66,310.74	
PACCAR FINANCIAL CORP 3.4% 23/08/09	50,000	53,108.60	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 1.367% 23/03/10	65,000	64,944.96	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.25% 31/06/01	40,000	39,360.61	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.45% 25/07/01	300,000	314,316.88	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.75% 28/07/01	100,000	105,421.45	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.55% 30/07/01	300,000	322,249.63	
PACKAGING CORP OF AMERIC 3.4% 27/12/15	35,000	38,357.89	
PARKER-HANNIFIN CORP 3.3% 24/11/21	150,000	161,615.06	
PAYPAL HOLDINGS INC 1.35% 23/06/01	35,000	35,619.64	
PAYPAL HOLDINGS INC 2.4% 24/10/01	105,000	110,538.17	
PAYPAL HOLDINGS INC 2.85% 29/10/01	200,000	216,771.46	
PEPSICO INC 0.75% 23/05/01	115,000	115,875.31	
PEPSICO INC 2.25% 25/03/19	100,000	105,356.70	
PEPSICO INC 2.75% 30/03/19	200,000	216,295.90	
PEPSICO INC 2.85% 26/02/24	100,000	108,399.54	
PEPSICO INC 3% 27/10/15	100,000	110,236.24	
PERRIGO FINANCE UNLIMITE 4.375% 26/03/15	200,000	220,609.30	
PFIZER INC 2.625% 30/04/01	200,000	213,830.22	

PFIZER INC 3% 23/06/15	250,000	263,039.92	
PFIZER INC 3.45% 29/03/15	100,000	112,800.21	
PHILIP MORRIS INTL INC 1.5% 25/05/01	100,000	102,269.18	
PHILIP MORRIS INTL INC 2.1% 30/05/01	35,000	35,044.85	
PHILIP MORRIS INTL INC 2.5% 22/11/02	100,000	102,583.44	
PHILIP MORRIS INTL INC 2.75% 26/02/25	150,000	160,032.17	
PHILIP MORRIS INTL INC 3.125% 27/08/17	100,000	109,254.57	
PHILLIPS 66 0.9% 24/02/15	100,000	99,930.37	
PHILLIPS 66 3.7% 23/04/06	100,000	105,440.31	
PHILLIPS 66 PARTNERS 3.55% 26/10/01	75,000	81,744.00	
PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.15% 29/12/15	100,000	105,386.24	
PIEDMONT NATURAL GAS CO 2.5% 31/03/15	155,000	158,097.69	
PIEDMONT OPERATING PARTN 3.15% 30/08/15	100,000	102,911.50	
PIONEER NATURAL RESOURCE 0.55% 23/05/15	150,000	150,152.83	
PIONEER NATURAL RESOURCE 2.15% 31/01/15	70,000	68,791.89	
PLAINS ALL AMER PIPELINE 3.6% 24/11/01	100,000	107,207.05	
PLAINS ALL AMER PIPELINE 4.5% 26/12/15	50,000	56,244.25	
PLAINS ALL AMER PIPELINE 4.65% 25/10/15	200,000	223,920.72	
PNC BANK NA 2.7% 29/10/22	100,000	106,456.78	
PNC BANK NA 3.25% 25/06/01	250,000	272,379.63	
PNC BANK NA 3.5% 23/06/08	250,000	264,511.24	
PNC BANK NA 4.05% 28/07/26	250,000	289,876.84	
PPG INDUSTRIES INC 2.55% 30/06/15	100,000	104,553.41	
PPG INDUSTRIES INC 3.2% 23/03/15	100,000	104,468.89	
PRAXAIR INC 1.1% 30/08/10	100,000	94,429.24	
PRAXAIR INC 3.2% 26/01/30	50,000	54,870.73	
PRECISION CASTPARTS CORP 2.5% 23/01/15	200,000	205,514.89	
PRICELINE GROUP 3.6% 26/06/01	100,000	110,934.32	
PRICELINE GROUP INC/THE 2.75% 23/03/15	100,000	103,791.23	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 2.125% 30/06/15	100,000	100,566.86	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 3.7% 29/05/15	50,000	56,655.85	
PROCTER & GAMBLE 2.45% 26/11/03	100,000	107,157.75	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 1% 26/04/23	45,000	45,399.09	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.8% 27/03/25	200,000	217,184.40	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 3% 30/03/25	100,000	110,703.66	
PROGRESSIVE CORP 3.2% 30/03/26	100,000	110,365.99	
PROLOGIS LP 2.125% 27/04/15	50,000	52,128.26	
PROSPECT CAPITAL CORP 3.364% 26/11/15	55,000	55,370.05	
PROV ST JOSEPH HLTH OBL 2.532% 29/10/01	100,000	105,286.43	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4.5% 47/09/15	100,000	109,244.23	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.625% 43/06/15	300,000	321,491.85	
PRUDENTIAL PLC 3.125% 30/04/14	100,000	108,094.13	
PUBLIC SERVICE COLORADO 3.7% 28/06/15	50,000	56,842.90	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 2.45% 30/01/15	35,000	36,803.01	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 25/05/15	150,000	160,571.55	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 27/05/15	100,000	108,560.59	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3.25% 23/09/01	50,000	52,716.73	
PUBLIC STORAGE 3.094% 27/09/15	125,000	137,258.40	

PUGET ENERGY INC 5.625% 22/07/15	100,000	103,916.33	
QUALCOMM INC 2.9% 24/05/20	100,000	106,291.71	
QUALCOMM INC 3.25% 27/05/20	100,000	110,372.36	
QUEST DIAGNOSTICS INC 3.5% 25/03/30	100,000	108,686.36	
RALPH LAUREN CORP 3.75% 25/09/15	50,000	55,240.38	
RAYTHEON TECH CORP 2.25% 30/07/01	200,000	203,601.17	
RAYTHEON TECH CORP 2.5% 22/12/15	250,000	256,292.87	
REALTY INCOME CORP 0.75% 26/03/15	80,000	78,630.94	
REALTY INCOME CORP 3.65% 28/01/15	200,000	223,794.58	
REGENCY CENTERS LP 3.6% 27/02/01	30,000	33,400.97	
REGENCY CENTERS LP 4.125% 28/03/15	50,000	56,472.95	
REGENERON PHARMACEUTICAL 1.75% 30/09/15	135,000	128,675.46	
REINSURANCE GRP OF AMER 3.15% 30/06/15	35,000	37,673.43	
REINSURANCE GRP OF AMER 3.9% 29/05/15	75,000	84,486.59	
RELIANCE STEEL & ALUM 4.5% 23/04/15	100,000	105,800.96	
RELX CAPITAL INC 3% 30/05/22	85,000	91,226.01	
RENAISSANCERE FINANCE 3.45% 27/07/01	65,000	71,385.45	
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6% 29/04/15	25,000	27,657.53	
REPUBLIC SERVICES INC 2.5% 24/08/15	45,000	47,249.95	
REPUBLIC SERVICES INC 3.375% 27/11/15	60,000	66,229.48	
REPUBLIC SERVICES INC 3.95% 28/05/15	100,000	114,314.45	
REYNOLDS AMERICAN INC 4.45% 25/06/12	250,000	277,686.85	
RIO TINTO FIN USA LTD 7.125% 28/07/15	100,000	135,846.00	
ROGERS COMMUNICATIONS IN 2.9% 26/11/15	200,000	214,278.26	
ROPER TECHNOLOGIES INC 2% 30/06/30	100,000	98,686.10	
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.125% 22/11/15	150,000	154,417.74	
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.8% 26/12/15	55,000	61,490.90	
ROYAL BANK OF CANADA 1.15% 26/07/14	100,000	99,818.78	
ROYAL BANK OF CANADA 1.2% 26/04/27	100,000	100,205.70	
ROYAL BANK OF CANADA 1.95% 23/01/17	100,000	102,490.73	
ROYAL BANK OF CANADA 2.25% 24/11/01	150,000	157,331.62	
ROYAL BANK OF CANADA 3.7% 23/10/05	100,000	107,202.86	
ROYAL BANK OF CANADA 4.65% 26/01/27	150,000	172,178.02	
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 4.445% 30/05/08	200,000	230,494.43	
ROYALTY PHARMA PLC 0.75% 23/09/02	105,000	105,316.77	
ROYALTY PHARMA PLC 2.2% 30/09/02	65,000	64,160.54	
RPM INTERNATIONAL INC 4.55% 29/03/01	50,000	57,932.53	
RYDER SYSTEM INC 3.65% 24/03/18	100,000	107,595.06	
S&P GLOBAL INC 4% 25/06/15	50,000	55,711.57	
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.2% 28/03/15	400,000	453,306.84	
SABINE PASS LIQUEFACTION 5.75% 24/05/15	100,000	112,093.76	
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 3.9% 29/10/15	50,000	53,202.22	
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 4.8% 24/06/01	50,000	54,854.41	
SALESFORCE.COM INC 0.625% 24/07/15	55,000	55,059.78	
SALESFORCE.COM INC 1.95% 31/07/15	80,000	80,678.41	
SALESFORCE.COM INC 3.7% 28/04/11	200,000	227,731.35	
SANDS CHINA LTD 4.6% 23/08/08	200,000	211,860.00	
SANDS CHINA LTD 5.125% 25/08/08	200,000	223,828.00	

SANOFI 3.625% 28/06/19	100,000	114,623.48	
SANTANDER HOLDINGS USA 3.45% 25/06/02	100,000	107,685.00	
SANTANDER HOLDINGS USA 3.5% 24/06/07	70,000	74,955.05	
SANTANDER HOLDINGS USA 4.4% 27/07/13	120,000	135,069.55	
SANTANDER ISSUANCES 5.179% 25/11/19	200,000	228,967.08	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 1.673% 27/06/14	200,000	200,274.49	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 4.796% 24/11/15	200,000	218,517.55	
SCHLUMBERGER INVESTMENT 3.65% 23/12/01	200,000	213,376.96	
SEMPRA ENERGY 2.875% 22/10/01	100,000	102,234.14	
SEMPRA ENERGY 3.4% 28/02/01	100,000	110,210.43	
SHELL INTERNATIONAL 2.875% 26/05/10	200,000	216,656.81	
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.375% 29/11/07	100,000	104,091.82	
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.4% 23/08/12	350,000	372,069.94	
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875% 28/11/13	150,000	173,005.93	
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.125% 24/06/01	50,000	53,394.32	
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45% 27/06/01	100,000	110,417.56	
SHIRE ACQ INV IRELAND DA 2.875% 23/09/23	150,000	156,929.42	
SIGNATURE BANK NEW YORK 4% 30/10/15	100,000	106,495.69	
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.45% 29/09/13	100,000	103,450.40	
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.65% 30/07/15	100,000	104,696.45	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.25% 26/11/30	100,000	109,581.61	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 24/10/01	100,000	107,598.33	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 27/12/01	100,000	109,962.00	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.5% 25/09/01	65,000	71,209.06	
SIXTH STREET SPECIALTY 2.5% 26/08/01	65,000	65,983.05	
SL GREEN REALTY CORP 4.5% 22/12/01	50,000	52,018.97	
SMITH & NEPHEW PLC 2.032% 30/10/14	50,000	49,194.51	
SOUTHERN CAL EDISON 2.25% 30/06/01	35,000	34,775.94	
SOUTHERN CAL EDISON 2.5% 31/06/01	50,000	50,040.50	
SOUTHERN CAL EDISON 3.5% 23/10/01	100,000	105,513.78	
SOUTHERN CALIF GAS CO 3.15% 24/09/15	100,000	107,037.32	
SOUTHERN CO 3.7% 30/04/30	250,000	277,182.19	
SOUTHERN CO 3.75% 51/09/15	100,000	100,660.00	
SOUTHERN CO 4% 51/01/15	100,000	105,995.00	
SOUTHERN CO GAS CAPITAL 2.45% 23/10/01	50,000	51,907.21	
SOUTHERN COPPER CORP 3.5% 22/11/08	67,000	69,345.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO 3% 26/11/15	100,000	106,886.78	
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.125% 27/06/15	170,000	200,436.48	
SOUTHWESTERN ELEC POWER 1.65% 26/03/15	100,000	101,644.20	
SOUTHWESTERN ELEC POWER 4.1% 28/09/15	100,000	114,570.36	
SPECTRA ENERGY PARTNERS 4.75% 24/03/15	150,000	164,652.46	
SPIRIT REALTY LP 3.2% 27/01/15	100,000	107,517.31	
SPIRIT REALTY LP 3.4% 30/01/15	100,000	107,342.69	
SSM HEALTH CARE 3.688% 23/06/01	100,000	105,177.00	
STANLEY BLACK & DECKER I 3.4% 26/03/01	70,000	77,111.37	
STANLEY BLACK & DECKER I 4% 60/03/15	30,000	31,986.00	
STARBUCKS CORP 2% 27/03/12	200,000	206,134.52	
STARBUCKS CORP 3.5% 28/03/01	50,000	56,212.94	

STARBUCKS CORP 3.8% 25/08/15	100,000	110,963.90	
STEEL DYNAMICS INC 2.8% 24/12/15	150,000	158,547.35	
STIFEL FIANCIAL 4.25% 24/07/18	100,000	109,663.32	
STORE CAPITAL CORP 4.625% 29/03/15	50,000	57,396.59	
STRYKER CORP 1.95% 30/06/15	100,000	99,454.84	
STRYKER CORP 3.5% 26/03/15	25,000	27,615.53	
SUMITOMO MITSUI FINANCIA 3.784% 26/03/09	150,000	167,438.17	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.948% 26/01/12	200,000	198,692.09	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 1.71% 31/01/12	200,000	195,595.20	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.448% 24/09/27	200,000	210,317.42	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.04% 29/07/16	200,000	215,222.34	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.102% 23/01/17	250,000	260,207.80	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.364% 27/07/12	200,000	221,135.27	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.544% 28/01/17	100,000	111,279.92	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.944% 28/07/19	100,000	114,267.56	
SUNCOR ENERGY INC 3.1% 25/05/15	40,000	42,854.93	
SUNOCO LOGISTICS PARTNER 4.25% 24/04/01	60,000	64,634.56	
SUNTRUST BANK 2.45% 22/08/01	100,000	102,108.86	
SUNTRUST BANK 3.3% 26/05/15	200,000	219,349.19	
SUNTRUST BANKS INC 4% 25/05/01	150,000	166,713.86	
SUTTER HEALTH 2.294% 30/08/15	100,000	101,883.62	
SUZANO AUSTRIA GMBH 6% 29/01/15	200,000	238,500.00	
SVB FINANCIAL GROUP 3.5% 25/01/29	150,000	162,352.13	
SYNCHRONY FINANCIAL 2.85% 22/07/25	30,000	30,680.25	
SYNCHRONY FINANCIAL 3.7% 26/08/04	150,000	164,292.70	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 3.125% 22/11/01	30,000	30,840.81	
SYSCO CORPORATION 3.55% 25/03/15	150,000	163,530.42	
SYSCO CORPORATION 5.95% 30/04/01	120,000	154,444.99	
TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.05% 30/03/31	200,000	198,515.36	
TAKEDA PHARMACEUTICAL 4.4% 23/11/26	200,000	216,961.04	
TARGET CORP 2.25% 25/04/15	250,000	263,163.39	
TARGET CORP 2.65% 30/09/15	100,000	107,637.35	
TC PIPELINES LP 3.9% 27/05/25	40,000	44,272.00	
TD AMERITRADE HOLDING CO 3.75% 24/04/01	100,000	108,441.24	
TECK RESOURCES LIMITED 3.9% 30/07/15	100,000	108,490.99	
TELEDYNE TECHNOLOGIES IN 0.65% 23/04/01	100,000	100,037.58	
TELEFONICA EMISIONES SAU 4.103% 27/03/08	150,000	169,044.00	
TELUS CORP 2.8% 27/02/16	50,000	53,699.59	
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.375% 25/03/12	130,000	132,760.96	
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.25% 29/09/04	65,000	67,949.74	
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.9% 27/11/03	70,000	76,353.31	
TEXTRON INC 3% 30/06/01	100,000	106,475.54	
TEXTRON INC 4% 26/03/15	25,000	28,025.49	
TEXTRON INC 4.3% 24/03/01	115,000	124,460.88	
THERMO FISHER SCIENTIFIC 3.2% 27/08/15	200,000	218,865.32	
TIMKEN CO/THE 3.875% 24/09/01	70,000	74,992.08	
T-MOBILE USA INC 3.75% 27/04/15	650,000	722,182.50	
T-MOBILE USA INC 3.875% 30/04/15	200,000	224,134.00	

TORCHMARK CORP 3.8% 22/09/15	75,000	77,871.80	
TORONTO-DOMINION BANK 0.55% 24/03/04	250,000	250,006.49	
TORONTO-DOMINION BANK 1.2% 26/06/03	100,000	100,549.18	
TORONTO-DOMINION BANK 3.5% 23/07/19	200,000	212,751.67	
TORONTO-DOMINION BANK 3.625% 31/09/15	125,000	139,116.88	
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.829% 30/01/10	200,000	214,928.24	
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.7% 24/01/15	100,000	107,801.99	
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.75% 24/04/10	150,000	163,873.91	
TOYOTA MOTOR CORP 0.681% 24/03/25	200,000	200,386.34	
TOYOTA MOTOR CORP 2.157% 22/07/02	55,000	56,035.23	
TOYOTA MOTOR CORP 3.419% 23/07/20	100,000	106,156.92	
TOYOTA MOTOR CORP 3.669% 28/07/20	70,000	79,644.99	
TOYOTA MOTOR CREDIT 2.25% 23/10/18	200,000	208,358.34	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.4% 23/04/06	55,000	55,016.91	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.5% 23/08/14	155,000	155,317.89	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.125% 26/06/18	100,000	100,005.66	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8% 25/02/13	200,000	206,824.84	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.9% 28/04/06	100,000	102,552.40	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15% 30/02/13	100,000	103,559.32	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.9% 23/03/30	10,000	10,436.24	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.2% 27/01/11	100,000	110,176.26	
TRANSCANADA PIPELINES 4.1% 30/04/15	100,000	114,933.51	
TRANSCANADA PIPELINES 4.25% 28/05/15	150,000	172,907.04	
TRANSCONT GAS PIPE LINE 3.25% 30/05/15	150,000	161,785.48	
TRANSCONT GAS PIPE LINE 7.85% 26/02/01	100,000	127,156.21	
TRIMBLE INC 4.9% 28/06/15	100,000	117,723.45	
TRUIST BANK 1.5% 25/03/10	250,000	256,245.00	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.267% 27/03/02	60,000	60,174.89	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.887% 29/06/07	225,000	227,673.68	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.95% 30/06/05	65,000	65,428.87	
TYCO ELECTRONICS GROUP 3.7% 26/02/15	100,000	109,928.42	
TYSON FOODS INC 3.9% 23/09/28	40,000	42,833.10	
TYSON FOODS INC 3.95% 24/08/15	100,000	108,817.17	
TYSON FOODS INC 4.35% 29/03/01	100,000	117,049.84	
UNILEVER CAPITAL CORP 3.1% 25/07/30	100,000	108,767.45	
UNILEVER CAPITAL CORP 3.25% 24/03/07	100,000	106,792.74	
UNILEVER CAPITAL CORP 3.5% 28/03/22	100,000	112,822.45	
UNION ELECTRIC CO 2.95% 27/06/15	50,000	54,218.33	
UNION PACIFIC CORP 2.75% 26/03/01	100,000	107,037.01	
UNION PACIFIC CORP 3.25% 25/08/15	200,000	217,785.42	
UNION PACIFIC CORP 3.5% 23/06/08	100,000	105,877.15	
UNION PACIFIC CORP 3.75% 25/07/15	100,000	110,908.32	
UNITED AIR 2020-1 A PTT 5.875% 27/10/15	237,913	264,246.73	
UNITED AIR 2020-1 B PTT 4.875% 26/01/15	97,050	102,148.64	
UNITED PARCEL SERVICE 2.2% 24/09/01	20,000	20,945.64	
UNITED PARCEL SERVICE 2.5% 29/09/01	20,000	21,334.72	
UNITED PARCEL SERVICE 3.05% 27/11/15	150,000	167,016.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.125% 27/05/04	150,000	163,508.55	

UNITEDHEALTH GROUP INC 0.55% 24/05/15	65,000	65,031.68	
UNITEDHEALTH GROUP INC 1.15% 26/05/15	100,000	100,315.05	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.375% 24/08/15	70,000	73,718.10	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.875% 29/08/15	75,000	81,238.46	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.45% 27/01/15	200,000	222,888.40	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.5% 23/06/15	250,000	265,139.13	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.5% 24/02/15	20,000	21,537.57	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7% 25/12/15	20,000	22,329.67	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.875% 28/12/15	25,000	28,724.91	
UNUM GROUP 4% 24/03/15	100,000	107,877.08	
UPJOHN INC 2.3% 27/06/22	100,000	102,379.44	
UPJOHN INC 2.7% 30/06/22	100,000	101,501.98	
URD INC 2.95% 26/09/01	25,000	26,815.61	
US BANCORP 2.375% 26/07/22	150,000	159,310.07	
US BANCORP 2.4% 24/07/30	100,000	105,474.17	
US BANCORP 3.15% 27/04/27	100,000	109,947.94	
US BANK NA CINCINNATI 2.05% 25/01/21	250,000	261,567.60	
US BANK NA CINCINNATI 3.4% 23/07/24	250,000	264,974.94	
VALE OVERSEAS LIMITED 3.75% 30/07/08	100,000	106,823.00	
VALE OVERSEAS LIMITED 6.25% 26/08/10	100,000	120,701.00	
VALERO ENERGY CORP 2.15% 27/09/15	150,000	152,615.82	
VALERO ENERGY CORP 3.65% 25/03/15	150,000	163,454.44	
VALERO ENERGY CORP 4.35% 28/06/01	70,000	79,935.73	
VALERO ENERGY PARTNERS 4.375% 26/12/15	45,000	50,961.92	
VENTAS REALTY LP 3.5% 25/02/01	100,000	108,109.96	
VENTAS REALTY LP 4.4% 29/01/15	100,000	115,640.19	
VEREIT OPERATING PARTNER 3.95% 27/08/15	40,000	45,285.65	
VEREIT OPERATING PARTNER 4.6% 24/02/06	40,000	43,584.57	
VEREIT OPERATING PARTNER 4.875% 26/06/01	50,000	57,812.04	
VERISIGN INC 2.7% 31/06/15	100,000	101,803.62	
VERISK ANALYTICS INC 4% 25/06/15	100,000	110,816.66	
VERIZON COMMUNICATIONS 0.75% 24/03/22	250,000	250,925.10	
VERIZON COMMUNICATIONS 1.68% 30/10/30	397,000	381,830.92	
VERIZON COMMUNICATIONS 2.1% 28/03/22	300,000	307,324.53	
VERIZON COMMUNICATIONS 3.376% 25/02/15	300,000	325,786.48	
VERIZON COMMUNICATIONS 4.125% 27/03/16	200,000	228,423.68	
VERIZON COMMUNICATIONS 4.329% 28/09/21	321,000	373,211.57	
VF CORP 2.95% 30/04/23	65,000	69,159.41	
VIACOM INC 3.875% 24/04/01	100,000	107,568.87	
VIACOMCBS INC 3.7% 28/06/01	200,000	223,569.21	
VIRGINIA ELEC & POWER CO 3.1% 25/05/15	100,000	107,238.78	
VIRGINIA ELECTRIC & POWE 3.15% 26/01/15	200,000	218,113.71	
VISA INC 1.9% 27/04/15	350,000	362,506.15	
VISA INC 2.05% 30/04/15	95,000	98,121.39	
VISA INC 2.15% 22/09/15	20,000	20,424.01	
VISA INC 2.75% 27/09/15	50,000	54,313.68	
VMWARE INC 3.9% 27/08/21	100,000	111,937.37	
VODAFONE GROUP PLC 4.375% 28/05/30	100,000	116,722.84	

VORNADO REALTY LP 3.5% 25/01/15	100,000	106,365.43	
VOYA FINANCIAL 3.65% 26/06/15	100,000	111,015.66	
VULCAN MATERIALS CO 3.9% 27/04/01	20,000	22,601.97	
VULCAN MATERIALS CO 4.5% 25/04/01	100,000	112,009.89	
WABTEC 4.95% 28/09/15	150,000	175,272.77	
WAL MART STORES INC 2.55% 23/04/11	200,000	206,768.39	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.2% 30/04/15	75,000	80,449.38	
WALMART INC 2.375% 29/09/24	90,000	95,735.53	
WALMART INC 3.55% 25/06/26	100,000	110,513.21	
WALMART INC 3.7% 28/06/26	400,000	456,162.96	
WALT DISNEY COMPANY/THE 1.65% 22/09/01	35,000	35,524.31	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2% 29/09/01	65,000	65,861.83	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.2% 28/01/13	270,000	280,659.87	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.35% 22/12/01	150,000	154,080.15	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.95% 27/06/15	100,000	109,521.40	
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.7% 24/09/15	100,000	108,811.43	
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.8% 30/03/22	100,000	114,578.56	
WASTE CONNECTIONS INC 3.5% 29/05/01	100,000	110,639.08	
WASTE MANAGEMENT INC 2% 29/06/01	100,000	101,534.16	
WASTE MANAGEMENT INC 2.9% 22/09/15	150,000	153,513.80	
WEC ENERGY GROUP INC 0.55% 23/09/15	100,000	100,010.66	
WEIBO CORP 3.375% 30/07/08	200,000	204,836.16	
WELLS FARGO & CO 3.55% 25/09/29	200,000	220,336.52	
WELLS FARGO & COMPANY 0.805% 25/05/19	85,000	84,956.50	
WELLS FARGO & COMPANY 1.654% 24/06/02	150,000	153,134.95	
WELLS FARGO & COMPANY 2.164% 26/02/11	325,000	337,612.69	
WELLS FARGO & COMPANY 2.188% 26/04/30	95,000	98,727.43	
WELLS FARGO & COMPANY 2.393% 28/06/02	200,000	208,366.32	
WELLS FARGO & COMPANY 3.196% 27/06/17	200,000	216,206.01	
WELLS FARGO & COMPANY 3.584% 28/05/22	465,000	514,293.78	
WELLS FARGO & COMPANY 3.75% 24/01/24	250,000	268,695.41	
WELLS FARGO & COMPANY 4.1% 26/06/03	200,000	224,874.98	
WELLS FARGO & COMPANY 4.125% 23/08/15	250,000	268,521.56	
WELLS FARGO & COMPANY 4.15% 29/01/24	250,000	287,972.95	
WELLTOWER INC 2.05% 29/01/15	60,000	60,425.53	
WELLTOWER INC 2.7% 27/02/15	100,000	106,507.93	
WELLTOWER INC 3.625% 24/03/15	130,000	139,537.97	
WELLTOWER INC 4.25% 28/04/15	50,000	57,627.18	
WESTERN UNION CO/THE 4.25% 23/06/09	50,000	53,383.12	
WESTPAC BANKING CORP 2% 23/01/13	30,000	30,788.31	
WESTPAC BANKING CORP 2.15% 31/06/03	100,000	101,892.80	
WESTPAC BANKING CORP 2.668% 35/11/15	85,000	84,151.70	
WESTPAC BANKING CORP 2.894% 30/02/04	250,000	259,637.50	
WESTPAC BANKING CORP 3.35% 27/03/08	100,000	110,993.29	
WESTPAC BANKING CORP 3.65% 23/05/15	100,000	106,135.06	
WESTPAC BANKING CORP 4.11% 34/07/24	150,000	165,235.50	
WESTPAC BANKING CORP 4.322% 31/11/23	100,000	111,329.03	
WHIRLPOOL CORP 3.7% 25/05/01	100,000	109,582.69	

	WILLIAMS COMPANIES INC 4.55% 24/06/24	140,000	154,212.47	
	WILLIAMS PARTNERS LP 4.3% 24/03/04	200,000	217,127.31	
	WILLIS NORTH AMERICA INC 3.6% 24/05/15	50,000	53,792.72	
	WILLIS NORTH AMERICA INC 4.5% 28/09/15	100,000	116,019.89	
	WISCONSIN ELECTRIC POWER 1.7% 28/06/15	65,000	65,437.88	
	WPP FINANCE 2010 3.625% 22/09/07	150,000	155,081.63	
	WRKCO INC 4% 28/03/15	50,000	56,666.26	
	WRKCO INC 4.9% 29/03/15	200,000	240,877.96	
	WW GRAINGER INC 1.85% 25/02/15	50,000	51,778.00	
	WYETH 6.45% 24/02/01	100,000	115,132.81	
	XCEL ENERGY INC 0.5% 23/10/15	100,000	100,045.36	
	XCEL ENERGY INC 4% 28/06/15	50,000	57,046.07	
	XLIT LTD 4.45% 25/03/31	50,000	56,114.65	
	XYLEM INC 3.25% 26/11/01	55,000	60,489.11	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS 3.05% 26/01/15	100,000	107,915.31	
	ZIMMER HOLDINGS INC 3.55% 25/04/01	100,000	108,649.40	
	ZOETIS INC 2% 30/05/15	100,000	99,880.37	
	ZOETIS INC 3.9% 28/08/20	25,000	28,593.69	
	アメリカ・ドル 小計	169,843,213	182,955,480.50 (20,156,205,286)	
社債券	小計		20,156,205,286 (20,156,205,286)	
合計			20,156,205,286 (20,156,205,286)	

(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 1,314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】

(2021年7月30日現在)

資産総額	325,489,842円
負債総額	162,143,479円
純資産総額( - )	163,346,363円
発行済口数	172,569,286口
1口当たり純資産額( / )	0.9466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）

(2021年7月30日現在)

資産総額	21,841,978,209円
負債総額	2,457,792,968円
純資産総額( - )	19,384,185,241円
発行済口数	9,265,638,235口
1口当たり純資産額( / )	2.0921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。

2021年7月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、128本であり、その純資産総額は2,531,033百万円です（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（2020年4月1日から2021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 (2020年3月31日現在)		当事業年度 (2021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	3,114,127		3,455,294	
有価証券	21,254		22,281	
前払金	39,342		59,450	
前払費用	9,920		20,090	
未収入金	902,862		795,709	
未収還付法人税等	-		592	
未収委託者報酬	660,964		651,298	
未収収益	40,244		41,992	
流動資産計	4,788,718	65.6	5,046,710	70.1
固定資産				
有形固定資産	69,492		4,695	
建物附属設備	59,016		-	
器具備品	10,475		4,695	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,445,819		2,149,769	
長期差入保証金	69,819		55,283	
繰延税金資産	2,369,725		2,088,211	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,515,312	34.4	2,154,465	29.9
資産合計	7,304,030	100.0	7,201,176	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2020年3月31日現在)		当事業年度 (2021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	137,851		141,855	
未払金	350,943		300,612	
未払手数料	140,557		163,883	
その他未払金	210,386		136,728	
未払費用	11,122		11,026	
未払法人税等	3,635		-	
未払消費税等	72,142		79,008	
賞与引当金	67,981		76,891	
流動負債計	643,675	8.8	609,394	8.5
固定負債				
退職給付引当金	96,989		81,500	
固定負債計	96,989	1.3	81,500	1.1
負債合計	740,665	10.1	690,894	9.6

(純資産の部)			%			%
株主資本		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
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	6,144,244			6,091,161		
純資産合計		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
負債・純資産合計		7,304,030	100.0		7,201,176	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別	前事業年度		当事業年度	
	自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日		自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	
科 目	金 額	構成比	金 額	構成比
		%		%
営業収益				
委託者報酬	2,392,782		2,468,063	
投資顧問収入	2,907,674		2,871,928	
その他営業収益	66,452		78,227	
営業収益計	5,366,908	100.0	5,418,219	100.0
営業費用				
支払手数料	520,256		631,100	
広告宣伝費	30,443		28,458	
公告費	1,140		1,140	
調査費	632,099		527,766	
調査費	369,545		268,033	
委託調査費	261,450		259,021	
図書費	1,102		711	
委託計算費	265,563		242,239	
営業雑経費	39,755		38,381	
通信費	4,801		4,038	
印刷費	15,648		11,238	
協会費	16,300		18,183	
諸会費	-		5	
その他	3,005		4,915	
営業費用計	1,489,258	27.7	1,469,086	27.1
一般管理費				
給料	1,322,366		1,307,873	
役員報酬	197,080		235,947	
給料・手当	848,305		800,039	
賞与	253,121		210,310	
賞与引当金繰入額	23,858		61,576	
交際費	10,725		728	
旅費交通費	8,872		801	
租税公課	8,801		6,244	
不動産賃借料	97,021		91,686	
退職給付費用	106,349		71,604	

固定資産減価償却費		22,666			20,149	
福利厚生費		126,755			126,174	
事務手数料		1,057,318			1,306,329	
諸経費		186,258			202,081	
一般管理費計		2,947,135	54.9		3,133,675	57.8
営業利益		930,515	17.3		815,458	15.1
営業外収益						
為替差益		166			123	
有価証券運用益		3,384			1,026	
雑収入		63			36	
営業外収益計		3,614	0.1		1,186	0.0
営業外費用						
為替差損		289			656	
有価証券運用損		4,123			-	
雑損失		490			193	
営業外費用計		4,903	0.1		849	0.0
経常利益		929,225	17.3		815,794	15.1
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			102	
特別利益計		-	0.0		102	0.0
特別損失						
事業再構築費用		102,351			-	
事務処理損失		-			8,806	
固定資産除却損		-			45,130	
特別損失計		102,351	1.9		53,937	1.0
税引前当期純利益		826,874	15.4		761,960	14.1
法人税,住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		292,691	5.5		281,513	5.2
当期純利益		533,652	9.9		479,916	8.9

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	利益剰余金			利益剰余金 合計		
		利益準備金	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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	利益剰余金			利益剰余金 合計		
		利益準備金	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	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364
当期変動額							

剰余金の配当	-	-	-	(533,000)	(533,000)	(533,000)	(533,000)
当期純利益	-	-	-	479,916	479,916	479,916	479,916
当期変動額合計	-	-	-	53,083	53,083	53,083	53,083
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281

## [ 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。

## 表示方法の変更

(会計上の見積りの開示に関する会計基準の適用)

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日）を当事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、個別注記表に重要な会計上の見積りに関する注記を記載しております。

## 会計上の見積りに関する注記

会計上の見積りにより、当事業年度に係る財務諸表にその額を計上した項目であって、翌事業年度に係る財務諸表に重要な影響を及ぼす可能性があるものは、次のとおりです。

繰延税金資産 2,088,211千円

繰延税金資産の認識は、将来の事業計画に基づく課税所得の発生および金額によって見積もっております。

当該見積りは、将来の不確実な経済条件の変動などによって影響を受ける可能性があり、実際に発生した課税所得の時期および金額が見積りと異なった場合や将来の税法の改正等により、翌事業年度の財務諸表において、繰延税金資産の金額に重要な影響を与える可能性があります。

(追加情報)

繰延税金資産の回収可能性については、新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の収束時期が不透明であることから、当社が顧客から収受する等顧問料等に一定の影響があるとの仮定を基に今後の業績見通し等を勘案し、繰延税金資産を計上しております。

なお、当該金額は現時点での最善の見積もりではあるものの、新型コロナウイルス感染症の感染拡大の状況や経済への影響等により、翌事業年度以降の財務諸表に影響を及ぼす可能性があります。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2020年3月31日現在)	当事業年度 (2021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 68,147千円 器具備品 46,953千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 - 千円 器具備品 52,734千円
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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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。	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77,977千円は、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1,306,329千円は、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 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25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
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	利益剰余金	77,258.06円	2021年3月31日	2021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。

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。

2021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	3,455,294	3,455,294	
(2) 未収入金	795,709	795,709	
(3) 未収委託者報酬	651,298	651,298	
(4) 預り金	141,855	141,855	
(5) 未払手数料	163,883	163,883	
(6) その他未払金	136,728	136,728	

## (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 (2020年3月31日現在)	当事業年度 (2021年3月31日現在)
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	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 22,281千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,026千円

## (デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
退職給付債務の期首残高	420,524
勤務費用	55,967
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	25,944
退職給付の支払額	<u>51,930</u>
退職給付債務の期末残高	450,505

## 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 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

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
年金資産の期首残高	339,872
期待運用収益	2,511
数理計算上の差異の発生額	25,875
事業主からの拠出額	52,607
退職給付の支払額	51,930
年金資産の期末残高	368,935

## 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 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	399,872
	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
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
積立型制度の退職給付債務	450,505
年金資産	368,935
	81,570
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	81,570
未認識数理計算上の差異	69
未認識過去勤務費用	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	81,500

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度
	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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	52,417
(1)勤務費用	55,966
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,510
(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	25,059
(6)その他	15,300

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2021年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.9%

その他 2.1%

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 (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
	当事業年度 (2021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 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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,186千円であります。

## (税効果会計関係)

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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	連結納税適用に伴う影響額
賞与引当金繰入超過額	賞与引当金繰入超過額
退職給付引当金	退職給付引当金
繰越欠損金	(注) 繰越欠損金
その他	その他
繰延税金資産 合計	繰延税金資産 合計
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	繰延税金資産の純額

(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（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

(\*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。

## 当事業年度（2021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)	-	-	-	-	-	1,987,863	1,987,863
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,987,863	1,987,863 (*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1,987,863千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,987,863千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（2020年3月31日現在）	当事業年度（2021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 5.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目 6.8%
その他 0.3%	その他 0.4%
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 37.0%
=====	=====

#### （資産除去債務関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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 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	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	210,494	前払金	170
								投資顧問料の支払	182,861		
								ソフトウェアの使用契約	178,279	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	77,977		
							事務手数料の支払	1,306,329			
	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	38,231	前払金	59,280	
							兼職社員の人件費支払等	122,715			
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・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	投資顧問サービスの受入れ	17,282		-	-
	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 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 249 投資顧問料の支払 21,878		-	-

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
1株当たり純資産 1,058,607円22銭	1株当たり純資産 1,050,045円38銭
1株当たり当期純利益 86,073円06銭	1株当たり当期純利益 77,405円89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、記載しておりません。	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、記載しておりません。

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
当期純利益 (千円)	533,652	479,916
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)	533,652	479,916
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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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（2021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（2021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。

#### (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 (2021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。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (2021年6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。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円 (2021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。
マネックス証券株式会社	12,200百万円 (2021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：1,010百万ドル（2020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

2021年8月25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 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員**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2021年1月13日から2021年7月12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2021年7月12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、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、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。

**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

- 
- (注) 1. 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す。
2. 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

2021年6月30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 公認会計士 伊藤雅人  
業務執行社員

### 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第24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2021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、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。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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。