

【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】 2022年10月7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】 菅野 真人

【電話番号】 03-4530-7171

【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、2022年4月8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】

(1) ~ (3) <略>

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>

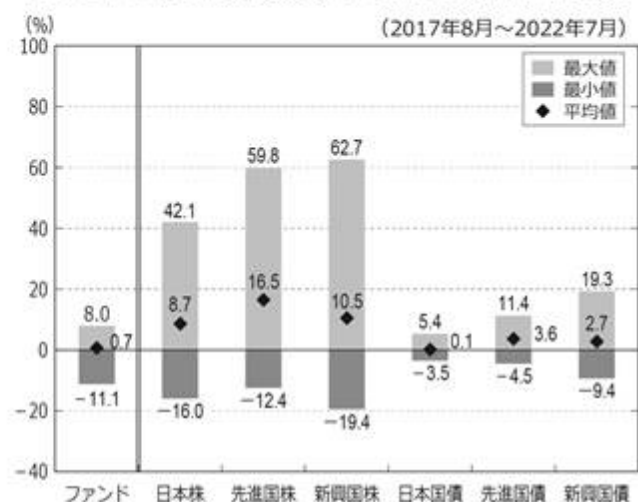
<参考情報> 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

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

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

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

日本国債:NOMURA-BPI国債

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

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(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、2022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、2022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】

(2022年7月29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	135,370,809	99.04
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,306,073	0.96
純資産総額		136,676,882	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<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)

(2022年7月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	712,570,449	3.25
	アメリカ	17,787,006,482	81.20
	イギリス	977,435,818	4.46
	カナダ	848,081,856	3.87
	オランダ	249,968,468	1.14
	アイルランド	155,443,675	0.71
	スペイン	146,530,378	0.67
	オーストラリア	144,795,339	0.66
	ケイマン諸島	130,349,166	0.59
	ドイツ	107,633,560	0.49
	スイス	79,100,027	0.36
	フランス	77,842,100	0.36
	メキシコ	60,512,982	0.28
	バミューダ	56,995,039	0.26
	ルクセンブルク	40,638,517	0.19
	シンガポール	27,929,100	0.13
	オーストリア	27,191,220	0.12
ガンジー	19,754,751	0.09	
チリ	19,523,497	0.09	
	小計	21,669,302,424	98.92
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		235,702,794	1.08
純資産総額		21,905,005,218	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】

(2022年7月29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		57,222,306	2.3468	134,292,115	2.3657	135,370,809	99.04

(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	-	99.04
合計		99.04

（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）

（2022年7月29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	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	2.871	2032/11/22	1,000,000	12,706.46	127,064,678	11,246.83	112,468,312	0.51
2	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.419	2028/12/20	783,000	13,750.00	107,662,553	12,809.69	100,299,948	0.46
3	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.203	2029/07/23	700,000	14,330.28	100,311,964	13,270.85	92,896,014	0.42
4	アメリカ	社債券	ORACLE CORP	2.800	2027/04/01	700,000	13,390.70	93,734,918	12,642.36	88,496,535	0.40
5	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	3.750	2027/04/15	650,000	13,952.26	90,689,696	13,187.65	85,719,767	0.39
6	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	2.383	2032/07/21	715,000	12,457.18	89,068,871	11,288.24	80,710,943	0.37
7	アメリカ	社債券	ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750	2029/01/23	550,000	15,006.57	82,536,138	14,125.96	77,692,829	0.35
8	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.005	2026/03/13	600,000	13,215.41	79,292,483	12,730.45	76,382,712	0.35
9	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	4.450	2027/09/29	500,000	14,335.35	71,676,761	13,515.13	67,575,679	0.31
10	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.500	2025/04/01	500,000	13,837.88	69,189,432	13,385.73	66,928,660	0.31
11	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	2.099	2026/06/04	530,000	13,092.40	69,389,760	12,535.45	66,437,902	0.30
12	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	4.412	2031/03/31	500,000	14,500.42	72,502,130	13,250.72	66,253,635	0.30
13	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.223	2029/05/01	500,000	14,259.77	71,298,878	13,243.11	66,215,555	0.30
14	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.559	2027/04/23	500,000	13,843.71	69,218,582	13,109.27	65,546,379	0.30
15	アメリカ	社債券	BOEING CO	4.875	2025/05/01	445,000	14,293.52	63,606,191	13,624.82	60,630,477	0.28
16	アメリカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	3.584	2028/05/22	465,000	13,910.26	64,682,748	13,000.85	60,453,978	0.28
17	アメリカ	社債券	APPLE INC	2.900	2027/09/12	450,000	13,930.18	62,685,824	13,299.66	59,848,485	0.27
18	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.458	2025/03/15	450,000	13,703.26	61,664,695	13,297.96	59,840,863	0.27
19	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.963	2033/01/25	500,000	13,313.14	66,565,742	11,907.11	59,535,585	0.27

20	アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY	3.125	2026/07/27	450,000	13,753.43	61,890,452	13,118.18	59,031,819	0.27
21	アメリカ	社債券	IBM CORP	1.700	2027/05/15	470,000	13,014.91	61,170,088	12,369.14	58,134,976	0.27
22	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	4.140	2025/05/24	400,000	13,445.82	53,783,290	13,470.70	53,882,832	0.25
23	アメリカ	社債券	COMCAST CORP	4.150	2028/10/15	390,000	14,602.49	56,949,723	13,773.36	53,716,115	0.25
24	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.271	2029/07/23	400,000	14,374.29	57,497,175	13,325.87	53,303,489	0.24
25	アメリカ	社債券	APPLE INC	2.500	2025/02/09	400,000	13,660.35	54,641,404	13,320.60	53,282,420	0.24
26	イギリス	社債券	NATWEST GROUP PLC	4.892	2029/05/18	400,000	14,547.28	58,189,123	13,203.33	52,813,331	0.24
27	アメリカ	社債券	SABINE PASS LIQUEFACTION	4.200	2028/03/15	400,000	14,194.82	56,779,316	13,119.56	52,478,250	0.24
28	日本	社債券	TOYOTA MOTOR CORP	0.681	2024/03/25	400,000	12,990.53	51,962,154	12,923.91	51,695,675	0.24
29	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE &	0.969	2025/06/23	400,000	13,005.57	52,022,301	12,660.80	50,643,219	0.23
30	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.182	2028/06/01	400,000	13,011.09	52,044,373	12,210.13	48,840,555	0.22

(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) 2022年7月29日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
社債券	-	98.92
合計		98.92

(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) 2022年7月29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】

2022年7月29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
第22特定期間	自2021年 7月13日 至2022年 1月11日	分配付： 153,163,932 分配落： 152,912,379	分配付： 0.9133 分配落： 0.9118
第23特定期間	自2022年 1月12日 至2022年 7月11日	分配付： 133,054,331 分配落： 132,811,496	分配付： 0.8219 分配落： 0.8204
	2021年 7月末日	163,346,363	0.9466
	8月末日	160,692,463	0.9443
	9月末日	158,658,950	0.9365
	10月末日	156,644,263	0.9296
	11月末日	155,502,857	0.9236
	12月末日	156,744,533	0.9220
	2022年 1月末日	148,556,966	0.9041
	2月末日	137,713,426	0.8866
	3月末日	135,528,469	0.8660
	4月末日	131,985,576	0.8441
	5月末日	133,765,880	0.8441
	6月末日	132,491,077	0.8205
	7月末日	136,676,882	0.8370

【分配の推移】

特定期間	計算期間	一口当たりの分配金
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
第22特定期間	自2021年 7月13日 至2022年 1月11日	0.0090円
第23特定期間	自2022年 1月12日 至2022年 7月11日	0.0090円

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率
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%
第22特定期間	自2021年 7月13日 至2022年 1月11日	2.4%
第23特定期間	自2022年 1月12日 至2022年 7月11日	9.1%

（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を控除した額を、前期末の分配落基準価額で除して得た数に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
第22特定期間	自2021年 7月13日 至2022年 1月11日	11,836,468	16,746,683	167,702,345
第23特定期間	自2022年 1月12日 至2022年 7月11日	14,920,103	20,731,787	161,890,661

（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

(2022年7月29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。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	8,370円
純資産総額	137百万円

分配の推移

決算期	分配金
第131期 (2022年2月10日)	15円
第132期 (2022年3月10日)	15円
第133期 (2022年4月11日)	15円
第134期 (2022年5月10日)	15円
第135期 (2022年6月10日)	15円
第136期 (2022年7月11日)	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	2,970円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

(マザーファンドのデータを表示しています。)

上位10銘柄*

銘柄名	利率	償還日	投資比率
HSBC HOLDINGS PLC	2.871%	2032/11/22	0.52%
BANK OF AMERICA CORP	3.419%	2028/12/20	0.46%
JPMORGAN CHASE & CO	4.203%	2029/07/23	0.42%
ORACLE CORP	2.800%	2027/04/01	0.41%
T-MOBILE USA INC	3.750%	2027/04/15	0.40%
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2.383%	2032/07/21	0.37%
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.750%	2029/01/23	0.35%
JPMORGAN CHASE & CO	2.005%	2026/03/13	0.35%
CITIGROUP INC	4.450%	2027/09/29	0.31%
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.500%	2025/04/01	0.31%

※比率はマザーファンド純資産総額対比です。

ファンド特性値

	ファンド	ベンチマーク
修正デュレーション(年)	4.38	4.29
最終利回り	4.13%	4.08%
オプション調整後スプレッド	1.31%	1.26%

セクター別構成比*

セクター	ファンド	ベンチマーク	差
公益	6.17%	6.19%	-0.01%
金融	41.67%	41.58%	0.09%
産業	51.92%	52.23%	-0.31%
その他	0.00%	0.00%	0.00%

格付別構成比*

格付	ファンド	ベンチマーク	差
AAA格	0.74%	0.81%	-0.07%
AA格	5.38%	5.74%	-0.36%
A格	44.06%	43.97%	0.09%
BBB格	49.58%	49.48%	0.10%
BB格以下	0.00%	0.00%	0.00%

残存年数別構成比*

残存年数	ファンド	ベンチマーク	差
1年未満	0.00%	0.82%	-0.81%
1～3年	29.53%	29.35%	0.19%
3～7年	45.68%	44.08%	1.59%
7～10年	24.55%	25.76%	-1.20%
10年以上	0.00%	0.00%	0.00%

※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)



※2022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（2022年1月12日から2022年7月11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 (2022年1月11日現在)	当期 (2022年7月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	12,490	661
コール・ローン	148,445	116,483
親投資信託受益証券	153,509,525	133,133,762
派生商品評価勘定	5,151	52,425
未収入金	374,000	330,000
流動資産合計	154,049,611	133,633,331
資産合計	154,049,611	133,633,331
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	766,068	498,879
未払収益分配金	251,553	242,835
未払解約金	22,011	35
未払受託者報酬	6,007	4,929
未払委託者報酬	90,097	73,934
その他未払費用	1,496	1,223
流動負債合計	1,137,232	821,835
負債合計	1,137,232	821,835
純資産の部		
元本等		
元本	1 167,702,345	1 161,890,661
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3 14,789,966	3 29,079,165
（分配準備積立金）	5,209,257	4,938,687
元本等合計	152,912,379	132,811,496
純資産合計	152,912,379	132,811,496
負債純資産合計	154,049,611	133,633,331

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期	当期
	自 2021年7月13日 至 2022年1月11日	自 2022年1月12日 至 2022年7月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,291,310	11,553,109
為替差損益	7,597,030	24,179,564
営業収益合計	3,305,720	12,626,455
営業費用		
支払利息	69	11
受託者報酬	34,982	29,851
委託者報酬	524,748	447,799
その他費用	14,632	7,401
営業費用合計	574,431	485,062
営業利益又は営業損失（ ）	3,880,151	13,111,517
経常利益又は経常損失（ ）	3,880,151	13,111,517
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,880,151	13,111,517
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（ ）	15,164	127,890
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,730,581	14,789,966
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,117,896	2,326,726
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,117,896	2,326,726
剰余金減少額又は欠損金増加額	790,009	2,203,683
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	790,009	2,203,683
分配金	2 1,522,285	2 1,428,615
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,789,966	29,079,165

(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礎となる事項	計算期間 2022年7月10日が休日のため、当特定期間は2022年1月12日から2022年7月11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)

前期 (2022年1月11日現在)	当期 (2022年7月11日現在)
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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 (2022年1月11日現在)	当期 (2022年7月11日現在)
1 期首元本額	172,612,560円	167,702,345円
期中追加設定元本額	11,836,468円	14,920,103円
期中一部解約元本額	16,746,683円	20,731,787円
2 受益権の総数	167,702,345口	161,890,661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14,789,966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29,079,165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 2021年7月13日 至 2022年1月11日	当期 自 2022年1月12日 至 2022年7月11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>(2021年7月13日から2021年8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(320,535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(14,086,076円)及び分配準備積立金(5,329,370円)より分配対象収益は19,735,981円(1万口当たり1,141円)であり、うち259,282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8月11日から2021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(332,917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(13,869,806円)及び分配準備積立金(5,228,234円)より分配対象収益は19,430,957円(1万口当たり1,147円)であり、うち254,006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9月11日から2021年10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(292,009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(13,889,195円)及び分配準備積立金(5,259,294円)より分配対象収益は19,440,498円(1万口当たり1,150円)であり、うち253,513円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2022年1月12日から2022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(299,834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(13,619,085円)及び分配準備積立金(5,013,636円)より分配対象収益は18,932,555円(1万口当たり1,165円)であり、うち243,677円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2022年2月11日から2022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(242,381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(13,121,045円)及び分配準備積立金(4,821,692円)より分配対象収益は18,185,118円(1万口当たり1,167円)であり、うち233,621円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(2022年3月11日から2022年4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(302,161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(13,310,921円)及び分配準備積立金(4,808,667円)より分配対象収益は18,421,749円(1万口当たり1,172円)であり、うち235,730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10月12日から2021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(308,428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(13,823,486円)及び分配準備積立金(5,189,339円)より分配対象収益は19,321,253円(1万口当たり1,154円)であり、うち251,069円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2022年4月12日から2022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(271,534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(13,305,534円)及び分配準備積立金(4,791,985円)より分配対象収益は18,369,053円(1万口当たり1,175円)であり、うち234,453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11月11日から2021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(311,380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(13,998,173円)及び分配準備積立金(5,217,250円)より分配対象収益は19,526,803円(1万口当たり1,158円)であり、うち252,862円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2022年5月11日から2022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(323,151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(13,637,173円)及び分配準備積立金(4,803,045円)より分配対象収益は18,763,369円(1万口当たり1,181円)であり、うち238,299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12月11日から2022年1月11日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(280,752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(14,005,697円)及び分配準備積立金(5,180,058円)より分配対象収益は19,466,507円(1万口当たり1,160円)であり、うち251,553円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2022年6月11日から2022年7月11日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(315,397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(14,024,415円)及び分配準備積立金(4,866,125円)より分配対象収益は19,205,937円(1万口当たり1,186円)であり、うち242,835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

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

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(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 (2022年1月11日現在)	当期 (2022年7月11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 (2022年1月11日現在)	当 期 (2022年7月11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	1,175,137	878,949
合 計	1,175,137	878,949

(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 (2022年 1月11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	3,574,923		3,574,698	225
	売建				
	アメリカ・ドル	157,927,482		158,688,174	760,692
	合 計	161,502,405		162,262,872	760,917

(単位：円)

区 分	種 類	当 期 (2022年7月11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	12,484,966		12,537,382	52,416
	売建				
	アメリカ・ドル	144,655,790		145,154,660	498,870
	合 計	157,140,756		157,692,042	446,454

(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。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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 (2022年1月11日現在)	当期 (2022年7月11日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9118円 (9,118円)	0.8204円 (8,204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	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	56,734,749	133,133,762	
合 計		56,734,749	133,133,762	

(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	(2022年1月11日現在)	(2022年7月11日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		64,372,946	63,712,349
金銭信託		3,167,755	116,175
コール・ローン		37,650,250	20,467,708
社債券		20,010,775,443	21,282,281,954
派生商品評価勘定		46,955	748,937
未収入金			26,847,640
未収利息		161,388,578	191,176,788
前払費用		3,123,300	11,253,848
流動資産合計		20,280,525,227	21,596,605,399
資産合計		20,280,525,227	21,596,605,399
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			4,845,058
未払金		20,126,772	
未払解約金		9,046,335	8,398,014
未払利息		101	55
その他未払費用		34	151
流動負債合計		29,173,242	13,243,278
負債合計		29,173,242	13,243,278
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,396,783,355	9,197,839,446
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,854,568,630	12,385,522,675
元本等合計		20,251,351,985	21,583,362,121
純資産合計		20,251,351,985	21,583,362,121
負債純資産合計		20,280,525,227	21,596,605,399

(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礎となる事項	<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）

（2022年1月11日現在）	（2022年7月11日現在）
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。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2022年1月11日現在）	（2022年7月11日現在）
1 期首元本額	9,725,238,475円	9,396,783,355円
期中追加設定元本額	464,169,777円	603,128,032円
期中一部解約元本額	792,624,897円	802,071,941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＞	5,578,329,955円	5,571,777,220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）	71,230,813円	56,734,749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 売制限付少数人数私募投信＞	319,820,254円	390,379,358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）	921,553,051円	1,014,320,034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	454,641,516円	450,628,355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＞	2,051,207,766円	1,713,999,730円
計	9,396,783,355円	9,197,839,446円
2 受益権の総数	9,396,783,355口	9,197,839,446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	（2022年1月11日現在）	（2022年7月11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	(2022年1月11日現在)	(2022年7月11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	581,779,895	1,657,481,728
合計	581,779,895	1,657,481,728

(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	(2022年1月11日現在)		
		契 約 額 等		時 価
		うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	8,300,000	8,253,045	46,955
	合 計	8,300,000	8,253,045	46,955

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年7月11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	1,022,902,101	1,023,651,038	748,937
	売建 アメリカ・ドル	1,030,489,101	1,035,334,159	4,845,058
	合 計	2,053,391,202	2,058,985,197	4,096,121

(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。
- (3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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)

	(2022年1月11日現在)	(2022年7月11日現在)
1口当たり純資産額	2.1551円	2.3466円
(1万口当たり純資産額)	(21,551円)	(23,466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	147,573.48
		3M COMPANY 2% 25/02/14	100,000	96,415.94
		3M COMPANY 3.05% 30/04/15	100,000	92,258.35
		ABBOTT LABORATORIES 2.95% 25/03/15	200,000	197,811.39
		ABBOTT LABORATORIES 3.75% 26/11/30	100,000	100,761.83
		ABBVIE INC 2.6% 24/11/21	100,000	97,407.15
		ABBVIE INC 2.95% 26/11/21	145,000	138,391.18
		ABBVIE INC 3.2% 29/11/21	200,000	184,227.20
		ABBVIE INC 3.6% 25/05/14	100,000	98,779.10
		ABBVIE INC 3.8% 25/03/15	300,000	298,650.60
		ABBVIE INC 4.25% 28/11/14	200,000	198,036.32
		ADOBE INC 2.3% 30/02/01	100,000	87,843.89
		ADVANCE AUTO PARTS 3.5% 32/03/15	40,000	34,407.36
		ADVANCED MICRO DEVICES 3.924% 32/06/01	100,000	98,574.09
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.15% 23/10/29	150,000	142,840.45
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.65% 24/10/29	150,000	138,123.50
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75% 24/10/29	150,000	138,259.58
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 2.45% 26/10/29	150,000	130,736.07
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.15% 24/02/15	150,000	145,392.03
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.3% 32/01/30	200,000	160,397.95
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.65% 27/07/21	150,000	135,146.67
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.875% 24/01/16	150,000	149,545.62
		AFFILIATED MANAGERS GROU 3.3% 30/06/15	70,000	63,139.50
		AFLAC INC 1.125% 26/03/15	40,000	36,088.54
		AFLAC INC 2.875% 26/10/15	50,000	48,045.00
		AFLAC INC 3.6% 30/04/01	65,000	61,436.84
		AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.1% 30/06/04	60,000	48,683.52
		AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.3% 31/03/12	100,000	81,132.64
		AGREE LP 2% 28/06/15	65,000	55,302.20
		AIR LEASE CORP 0.8% 24/08/18	40,000	36,586.33
		AIR LEASE CORP 2.3% 25/02/01	150,000	140,276.61
		AIR LEASE CORP 2.875% 32/01/15	300,000	233,242.51
		AIR LEASE CORP 3.125% 30/12/01	100,000	81,143.68
		AIR LEASE CORP 3.625% 27/12/01	150,000	133,642.30
		AIR PRODUCTS & CHEMICALS 2.05% 30/05/15	35,000	30,174.99
		AIRCASTLE LTD 4.125% 24/05/01	50,000	48,305.19
		AIRCASTLE LTD 4.25% 26/06/15	65,000	59,856.22
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E 3.95% 28/01/15	100,000	96,674.09
		ALIBABA GROUP HOLDING 3.4% 27/12/06	200,000	190,009.90
		ALIBABA GROUP HOLDING 3.6% 24/11/28	100,000	98,719.44
		ALLEGION US HOLDING CO 3.2% 24/10/01	50,000	48,523.14
		ALLEGION US HOLDING CO 3.55% 27/10/01	50,000	45,430.44
		ALLIED WORLD ASSURANCE 4.35% 25/10/29	50,000	49,008.05
		ALLSTATE CORP 5.75% 23/08/15	100,000	88,000.00
		ALLY FINANCIAL INC 4.75% 27/06/09	100,000	95,727.90
ALLY FINANCIAL INC 8% 31/11/01	200,000	221,204.01		
ALPHABET INC 0.8% 27/08/15	150,000	130,688.51		
ALPHABET INC 1.1% 30/08/15	130,000	107,216.76		
ALTRIA GROUP INC 3.4% 30/05/06	25,000	21,072.38		
ALTRIA GROUP INC 4.4% 26/02/14	156,000	153,281.70		
ALTRIA GROUP INC 4.8% 29/02/14	150,000	142,120.14		
AMAZON COM INC 5.2% 25/12/03	50,000	52,225.84		
AMAZON.COM INC 0.45% 24/05/12	45,000	42,838.35		
AMAZON.COM INC 1% 26/05/12	100,000	91,297.10		
AMAZON.COM INC 1.2% 27/06/03	200,000	178,031.46		
AMAZON.COM INC 1.65% 28/05/12	200,000	177,582.88		
AMAZON.COM INC 2.73% 24/04/13	200,000	198,784.25		
AMAZON.COM INC 3% 25/04/13	200,000	198,815.92		
AMAZON.COM INC 3.15% 27/08/22	100,000	97,565.51		

AMAZON.COM INC 3.6% 32/04/13	200,000	193,537.79
AMCOR FLEXIBLES NORTH AM 2.69% 31/05/25	65,000	52,816.08
AMEREN CORP 3.65% 26/02/15	100,000	97,455.07
AMERICAN CAMPUS CMNTYS 2.25% 29/01/15	150,000	138,158.43
AMERICAN ELECTRIC POWER 0.75% 23/11/01	20,000	19,202.78
AMERICAN EXPRESS CO 3% 24/10/30	100,000	98,149.89
AMERICAN EXPRESS CO 3.375% 24/05/03	155,000	154,102.38
AMERICAN EXPRESS CO 3.4% 24/02/22	200,000	199,469.76
AMERICAN EXPRESS CO 3.625% 24/12/05	350,000	347,083.87
AMERICAN EXPRESS CO 4.989% 33/05/26	100,000	99,589.23
AMERICAN HOMES 4 RENT 2.375% 31/07/15	100,000	79,507.23
AMERICAN HONDA FINANCE 2.9% 24/02/16	200,000	197,646.54
AMERICAN HONDA FINANCE 3.5% 28/02/15	300,000	288,527.73
AMERICAN HONDA FINANCE 3.625% 23/10/10	75,000	75,195.39
AMERICAN INTL GROUP 2.5% 25/06/30	100,000	95,164.87
AMERICAN TOWER CORP 2.7% 31/04/15	100,000	82,307.80
AMERICAN TOWER CORP 2.9% 30/01/15	50,000	42,721.79
AMERICAN TOWER CORP 2.95% 25/01/15	200,000	193,462.65
AMERICAN TOWER CORP 3.95% 29/03/15	300,000	280,985.04
AMERICAN TOWER CORP 5% 24/02/15	100,000	101,332.46
AMERICAN WATER CAPITAL 3.4% 25/03/01	100,000	98,501.39
AMERICAN WATER CAPITAL 3.75% 28/09/01	100,000	96,321.81
AMERIPRISE FINANCIAL INC 4% 23/10/15	150,000	150,741.59
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 30/05/15	100,000	87,310.23
AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45% 27/12/15	100,000	95,774.32
AMGEN INC 1.65% 28/08/15	200,000	171,828.18
AMGEN INC 1.9% 25/02/21	65,000	61,807.43
AMGEN INC 2.2% 27/02/21	170,000	156,384.49
AMGEN INC 2.25% 23/08/19	100,000	98,806.49
AMGEN INC 3.35% 32/02/22	90,000	82,819.06
AMPHENOL CORP 2.05% 25/03/01	100,000	95,392.00
AMPHENOL CORP 2.2% 31/09/15	60,000	48,792.18
ANALOG DEVICES INC 1.7% 28/10/01	45,000	39,434.76
ANALOG DEVICES INC 2.1% 31/10/01	60,000	51,021.50
ANGLOGOLD HOLDINGS PLC 3.375% 28/11/01	200,000	168,565.48
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% 29/01/23	550,000	560,701.75
ANTHEM INC 2.25% 30/05/15	135,000	114,921.52
ANTHEM INC 3.65% 27/12/01	100,000	97,295.93
ANTHEM INC 4.1% 32/05/15	100,000	96,948.79
AON CORP 2.8% 30/05/15	200,000	175,159.78
AON CORP/AON GLOBAL HOLD 2.05% 31/08/23	100,000	80,091.27
APPALACHIAN POWER CO 3.3% 27/06/01	100,000	95,031.75
APPLE INC 1.4% 28/08/05	100,000	87,656.39
APPLE INC 1.65% 31/02/08	200,000	167,799.62
APPLE INC 1.8% 24/09/11	100,000	97,249.94
APPLE INC 2.2% 29/09/11	100,000	89,810.35
APPLE INC 2.5% 25/02/09	400,000	391,375.26
APPLE INC 2.9% 27/09/12	450,000	435,048.92
APPLE INC 3% 24/02/09	150,000	149,677.90
APPLE INC 3.35% 27/02/09	350,000	347,202.31
APPLIED MATERIALS INC 1.75% 30/06/01	130,000	109,536.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C 3.25% 30/03/27	100,000	93,552.94
ARES CAPITAL CORP 2.875% 27/06/15	100,000	83,772.90
ARES CAPITAL CORP 2.875% 28/06/15	200,000	159,969.33
ARES CAPITAL CORP 3.875% 26/01/15	100,000	91,216.08
ARIZONA PUBLIC SERVICE 2.95% 27/09/15	100,000	93,244.68
ASTRAZENECA PLC 1.375% 30/08/06	200,000	164,526.26
ASTRAZENECA PLC 3.375% 25/11/16	150,000	147,755.30
ASTRAZENECA PLC 4% 29/01/17	200,000	199,369.28

AT&T INC 0.9% 24/03/25	100,000	95,372.28
AT&T INC 1.7% 26/03/25	200,000	183,362.83
AT&T INC 4.1% 28/02/15	200,000	197,113.56
AT&T INC 4.25% 27/03/01	100,000	99,672.24
AT&T INC 4.3% 30/02/15	200,000	194,887.73
AT&T INC 4.35% 29/03/01	320,000	316,218.38
ATHENE HOLDING LTD 4.125% 28/01/12	150,000	139,456.34
ATMOS ENERGY CORP 3% 27/06/15	65,000	62,064.62
AUTODESK INC 4.375% 25/06/15	100,000	101,081.96
AUTOMATIC DATA PROCESSNG 1.7% 28/05/15	160,000	143,415.42
AUTONATION INC 1.95% 28/08/01	30,000	24,835.58
AUTONATION INC 3.5% 24/11/15	100,000	96,261.44
AUTONATION INC 4.5% 25/10/01	20,000	19,885.47
AUTOZONE INC 3.25% 25/04/15	110,000	107,528.59
AUTOZONE INC 4% 30/04/15	100,000	94,742.85
AVALONBAY COMMUNITIES 3.3% 29/06/01	65,000	59,907.26
AVALONBAY COMMUNITIES IN 2.9% 26/10/15	50,000	47,037.92
AVANGRID INC 3.8% 29/06/01	75,000	69,795.98
VERY DENNISON CORP 0.85% 24/08/15	40,000	37,481.17
VERY DENNISON CORP 4.875% 28/12/06	100,000	99,913.14
AVNET INC 3% 31/05/15	100,000	82,259.24
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 4.35% 28/04/20	100,000	97,432.89
AXIS SPECIALTY FINAN PLC 4% 27/12/06	100,000	96,169.88
BAIDU INC 1.625% 27/02/23	200,000	177,992.01
BAIDU INC 3.625% 27/07/06	200,000	193,755.17
BAIDU INC 3.875% 23/09/29	100,000	100,337.41
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL 3.337% 27/12/15	150,000	141,208.45
BALTIMORE GAS & ELECTRIC 2.25% 31/06/15	200,000	169,863.11
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 1.125% 25/09/18	100,000	90,391.91
BANCO SANTANDER SA 2.746% 25/05/28	200,000	188,842.09
BANCO SANTANDER SA 2.958% 31/03/25	200,000	166,067.93
BANCO SANTANDER SA 3.8% 28/02/23	100,000	93,266.16
BANK OF AMERICA CORP 0.976% 25/04/22	150,000	141,082.06
BANK OF AMERICA CORP 1.658% 27/03/11	100,000	89,997.65
BANK OF AMERICA CORP 1.898% 31/07/23	200,000	160,210.63
BANK OF AMERICA CORP 2.087% 29/06/14	200,000	171,858.55
BANK OF AMERICA CORP 2.299% 32/07/21	200,000	162,180.84
BANK OF AMERICA CORP 2.482% 36/09/21	100,000	77,401.60
BANK OF AMERICA CORP 2.496% 31/02/13	150,000	127,062.69
BANK OF AMERICA CORP 2.572% 32/10/20	100,000	82,554.11
BANK OF AMERICA CORP 2.592% 31/04/29	95,000	80,700.16
BANK OF AMERICA CORP 2.651% 32/03/11	100,000	84,055.09
BANK OF AMERICA CORP 2.687% 32/04/22	200,000	168,130.26
BANK OF AMERICA CORP 3.194% 30/07/23	150,000	134,459.08
BANK OF AMERICA CORP 3.384% 26/04/02	100,000	96,942.49
BANK OF AMERICA CORP 3.419% 28/12/20	783,000	728,400.19
BANK OF AMERICA CORP 3.458% 25/03/15	450,000	443,728.15
BANK OF AMERICA CORP 3.559% 27/04/23	500,000	480,451.25
BANK OF AMERICA CORP 3.593% 28/07/21	150,000	141,779.14
BANK OF AMERICA CORP 3.864% 24/07/23	500,000	497,489.05
BANK OF AMERICA CORP 3.974% 30/02/07	250,000	235,743.42
BANK OF AMERICA CORP 4% 25/01/22	100,000	99,729.30
BANK OF AMERICA CORP 4.183% 27/11/25	200,000	195,433.99
BANK OF AMERICA CORP 4.271% 29/07/23	400,000	386,211.59
BANK OF AMERICA CORP 4.376% 28/04/27	150,000	147,694.20
BANK OF AMERICA CORP 4.571% 33/04/27	300,000	292,236.36
BANK OF MONTREAL 0.625% 24/07/09	70,000	65,743.41
BANK OF MONTREAL 1.5% 25/01/10	200,000	188,283.55
BANK OF MONTREAL 1.85% 25/05/01	200,000	187,998.47

BANK OF MONTREAL 3.3% 24/02/05	150,000	149,259.34
BANK OF MONTREAL 3.7% 25/06/07	200,000	197,709.35
BANK OF NEW YORK MELLON 2.2% 23/08/16	200,000	197,247.06
BANK OF NEW YORK MELLON 3.25% 24/09/11	100,000	99,074.08
BANK OF NOVA SCO 1.35% 26/06/24	200,000	179,426.85
BANK OF NOVA SCOTIA 0.55% 23/09/15	100,000	96,632.85
BANK OF NOVA SCOTIA 1.3% 26/09/15	100,000	88,426.11
BANK OF NOVA SCOTIA 1.95% 27/02/02	140,000	125,949.26
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2% 25/02/03	300,000	287,201.19
BANK OF NOVA SCOTIA 3.45% 25/04/11	100,000	98,403.37
BANK OF NY MELLON CORP 0.5% 24/04/26	150,000	142,073.33
BANK OF NY MELLON CORP 1.8% 31/07/28	100,000	80,680.36
BANK OF NY MELLON CORP 2.8% 26/05/04	100,000	96,145.01
BANK OF NY MELLON CORP 3.4% 28/01/29	100,000	95,400.11
BANK OF NY MELLON CORP 3.442% 28/02/07	100,000	95,722.27
BANK OF NY MELLON CORP 4.289% 33/06/13	100,000	97,828.23
BANKUINTEED INC 5.125% 30/06/11	100,000	95,904.04
BARCLAYS PLC 1.007% 24/12/10	200,000	189,859.76
BARCLAYS PLC 3.564% 35/09/23	200,000	160,793.08
BARCLAYS PLC 3.65% 25/03/16	200,000	195,039.13
BARCLAYS PLC 4.972% 29/05/16	200,000	194,731.03
BARCLAYS PLC 5.088% 30/06/20	300,000	280,903.68
BARCLAYS PLC 5.2% 26/05/12	100,000	99,760.00
BAT CAPITAL CORP 2.259% 28/03/25	150,000	124,576.83
BAT CAPITAL CORP 2.789% 24/09/06	70,000	67,470.11
BAT CAPITAL CORP 3.215% 26/09/06	100,000	92,675.06
BAT CAPITAL CORP 3.557% 27/08/15	100,000	90,988.84
BAT CAPITAL CORP 4.906% 30/04/02	100,000	92,314.10
BAXALTA INC 4% 25/06/23	30,000	29,722.99
BAXTER INTERNATIONAL INC 1.322% 24/11/29	300,000	281,308.21
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.95% 30/04/01	100,000	95,606.16
BECTON DICKINSON AND CO 1.957% 31/02/11	65,000	52,551.38
BECTON DICKINSON AND CO 3.363% 24/06/06	91,000	90,056.40
BEMIS COMPANY INC 2.63% 30/06/19	100,000	81,500.47
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 3.25% 28/04/15	100,000	94,629.92
BERKSHIRE HATHAWAY ENERG 3.75% 23/11/15	100,000	100,388.69
BERKSHIRE HATHAWAY FIN 1.45% 30/10/15	80,000	64,734.67
BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.125% 26/03/15	200,000	196,900.33
BERRY GLOBAL INC 1.57% 26/01/15	100,000	89,242.65
BEST BUY CO INC 4.45% 28/10/01	100,000	98,589.43
BIOGEN INC 2.25% 30/05/01	35,000	28,811.41
BIOGEN INC 4.05% 25/09/15	100,000	99,059.58
BLACK HILLS CORP 3.05% 29/10/15	50,000	43,833.52
BLACK HILLS CORP 3.95% 26/01/15	50,000	49,453.50
BLACKROCK INC 3.2% 27/03/15	100,000	97,691.02
BLACKROCK INC 3.25% 29/04/30	60,000	56,605.39
BLACKROCK INC 3.5% 24/03/18	100,000	100,373.86
BLACKSTONE PRIVATE CRE 1.75% 24/09/15	100,000	90,989.26
BLACKSTONE PRIVATE CRE 2.7% 25/01/15	75,000	68,444.42
BLACKSTONE SECURED LEND 2.125% 27/02/15	150,000	124,476.73
BLOCK FINANCIAL 2.5% 28/07/15	45,000	39,031.61
BOARDWALK PIPELINES LP 4.45% 27/07/15	100,000	96,682.63
BOARDWALK PIPELINES LP 4.8% 29/05/03	20,000	19,239.74
BOEING CO 2.196% 26/02/04	300,000	270,610.03
BOEING CO 3.25% 28/02/01	50,000	44,607.01
BOEING CO 4.875% 25/05/01	445,000	443,465.45
BOEING CO 5.15% 30/05/01	250,000	240,673.04
BORGWARNER INC 2.65% 27/07/01	50,000	45,526.66
BOSTON PROPERTIES INC 3.4% 29/06/21	100,000	88,722.20

BOSTON PROPERTIES LP 3.2% 25/01/15	50,000	48,615.97
BOSTON PROPERTIES LP 3.65% 26/02/01	150,000	145,341.19
BP CAP MARKETS AMERICA 3.194% 25/04/06	100,000	98,631.84
BP CAP MARKETS AMERICA 3.937% 28/09/21	200,000	195,273.56
BP CAP MARKETS AMERICA 4.234% 28/11/06	250,000	246,785.76
BPCE SA 4% 24/04/15	250,000	249,267.19
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 3.7% 27/06/22	150,000	139,830.99
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 1.45% 30/11/13	30,000	24,632.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.9% 24/07/26	64,000	63,420.82
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.95% 32/03/15	200,000	184,077.97
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 23/11/01	100,000	99,873.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.625% 24/05/15	100,000	99,935.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9% 28/02/20	150,000	149,906.04
BRITISH TELECOMMUNICATIO 5.125% 28/12/04	200,000	197,901.70
BRIXMOR OPERATING PART 2.5% 31/08/16	50,000	39,047.95
BRIXMOR OPERATING PART 3.65% 24/06/15	100,000	98,134.57
BRIXMOR OPERATING PART 4.05% 30/07/01	100,000	89,548.76
BROADCOM INC 1.95% 28/02/15	80,000	67,979.15
BROADCOM INC 4.11% 28/09/15	169,000	159,858.85
BROADCOM INC 4.15% 32/04/15	40,000	36,023.88
BROADCOM INC 4.75% 29/04/15	350,000	339,896.35
BROADRIDGE FINACIAL SOLU 3.4% 26/06/27	100,000	96,592.06
BROOKFIELD FINANCE INC 4% 24/04/01	150,000	149,022.08
BUNGE LTD FINANCE CORP 2.75% 31/05/14	100,000	81,801.14
BUNGE LTD FINANCE CORP 3.75% 27/09/25	55,000	52,763.57
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.25% 27/06/15	100,000	97,815.53
CABOT CORP 5% 32/06/30	100,000	96,501.28
CAMDEN PROPERTY TRUST 4.1% 28/10/15	45,000	44,031.65
CAMPBELL SOUP CO 3.95% 25/03/15	100,000	99,789.10
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.1% 24/04/02	100,000	98,797.58
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.3% 25/04/07	200,000	195,621.64
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.45% 27/04/07	90,000	86,355.71
CANADIAN NATIONAL RAILWA 2.75% 26/03/01	50,000	47,678.72
CANADIAN NATL RESOURCES 7.2% 32/01/15	100,000	112,428.10
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.35% 24/12/02	200,000	187,919.74
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05% 30/03/05	155,000	130,432.14
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 1.878% 27/11/02	150,000	131,196.14
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 2.359% 32/07/29	100,000	76,030.99
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.2% 25/02/05	150,000	146,353.16
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.273% 30/03/01	100,000	88,272.02
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.75% 27/03/09	200,000	190,720.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.927% 28/05/10	100,000	98,686.59
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 5.268% 33/05/10	100,000	98,126.07
CARLISLE COS INC 2.75% 30/03/01	100,000	84,700.58
CARLISLE COS INC 3.5% 24/12/01	65,000	63,911.39
CARRIER GLOBAL CORP 2.242% 25/02/15	50,000	47,399.42
CARRIER GLOBAL CORP 2.722% 30/02/15	170,000	146,264.74
CATERPILLAR FINANCIAL SE 2.4% 26/08/09	50,000	47,351.56
CATERPILLAR FINANCIAL SE 3.75% 23/11/24	150,000	150,817.21
CATERPILLAR FINL SERVICE 0.45% 24/05/17	100,000	95,120.42
CATERPILLAR FINL SERVICE 1.15% 26/09/14	100,000	89,916.75
CATERPILLAR FINL SERVICE 3.4% 25/05/13	200,000	199,267.80
CATERPILLAR INC 2.6% 29/09/19	100,000	91,063.82
CATERPILLAR INC 3.4% 24/05/15	100,000	100,277.61
CBOE HOLDINGS 3.65% 27/01/12	50,000	48,698.53
CDW LLC/CDW FINANCE 3.569% 31/12/01	100,000	80,894.29
CDW LLC/CDW FINANCE 4.25% 28/04/01	100,000	90,750.00
CELANESE US HOLDINGS LLC 1.4% 26/08/05	50,000	41,784.63
CENOVUS ENERGY INC 5.375% 25/07/15	83,000	85,326.49

CENTERPOINT ENERGY RES 4.4% 32/07/01	200,000	197,731.18
CGI INC 2.3% 31/09/14	100,000	80,003.28
CHARLES SCHWAB CORP 0.75% 24/03/18	200,000	191,705.91
CHARLES SCHWAB CORP 1.15% 26/05/13	50,000	45,063.36
CHARLES SCHWAB CORP 2.3% 31/05/13	100,000	83,813.53
CHARLES SCHWAB CORP 2.45% 27/03/03	40,000	37,426.95
CHARLES SCHWAB CORP 3.2% 28/01/25	100,000	95,224.73
CHARLES SCHWAB CORP 3.75% 24/04/01	100,000	100,213.74
CHARLES SCHWAB CORP 4% 29/02/01	100,000	98,357.26
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 2.8% 31/04/01	100,000	80,971.35
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.75% 28/02/15	100,000	91,996.95
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.2% 28/03/15	250,000	234,930.79
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.5% 24/02/01	100,000	100,381.94
CHENIERE CORP CHRISTI HD 3.7% 29/11/15	100,000	91,244.65
CHENIERE CORP CHRISTI HD 5.875% 25/03/31	100,000	102,262.03
CHENIERE CORP CHRISTI HD 7% 24/06/30	100,000	103,201.27
CHEVRON 2.954% 26/05/16	100,000	97,478.10
CHEVRON USA INC 0.426% 23/08/11	75,000	72,873.29
CHEVRON USA INC 3.85% 28/01/15	100,000	99,126.79
CHEVRON USA INC 3.9% 24/11/15	200,000	201,945.09
CHURCH & DWIGHT CO INC 2.3% 31/12/15	100,000	83,932.75
CI FINANCIAL CORP 3.2% 30/12/17	100,000	76,128.46
CIGNA CORP 2.375% 31/03/15	290,000	246,136.65
CIGNA CORP 3% 23/07/15	100,000	99,410.15
CIGNA CORP 3.25% 25/04/15	100,000	98,023.90
CIGNA CORP 3.4% 27/03/01	100,000	95,969.96
CIGNA CORP 4.375% 28/10/15	200,000	198,100.01
CINTAS CORP NO 2 3.7% 27/04/01	100,000	98,409.23
CISCO SYSTEMS INC 3.625% 24/03/04	100,000	100,555.31
CITIGROUP INC 0.981% 25/05/01	50,000	46,910.75
CITIGROUP INC 1.462% 27/06/09	100,000	88,320.24
CITIGROUP INC 2.014% 26/01/25	145,000	136,242.94
CITIGROUP INC 2.52% 32/11/03	145,000	118,105.04
CITIGROUP INC 2.561% 32/05/01	55,000	45,284.18
CITIGROUP INC 3.057% 33/01/25	135,000	114,579.97
CITIGROUP INC 3.52% 28/10/27	150,000	140,169.95
CITIGROUP INC 3.75% 24/06/16	100,000	100,500.54
CITIGROUP INC 3.785% 33/03/17	200,000	180,217.59
CITIGROUP INC 3.887% 28/01/10	350,000	336,584.29
CITIGROUP INC 4.075% 29/04/23	250,000	238,112.57
CITIGROUP INC 4.125% 28/07/25	150,000	143,580.96
CITIGROUP INC 4.14% 25/05/24	400,000	398,523.33
CITIGROUP INC 4.4% 25/06/10	200,000	199,898.14
CITIGROUP INC 4.412% 31/03/31	500,000	478,217.53
CITIGROUP INC 4.45% 27/09/29	500,000	487,045.37
CITIGROUP INC 4.6% 26/03/09	100,000	100,183.89
CITIGROUP INC 4.91% 33/05/24	200,000	197,257.14
CITIZENS BANK NA/RI 2.25% 25/04/28	100,000	94,681.98
CITIZENS FINANCIAL GROUP 3.25% 30/04/30	130,000	115,030.85
CITRIX SYSTEMS INC 4.5% 27/12/01	100,000	99,420.75
CLOROX COMPANY 1.8% 30/05/15	30,000	24,479.01
CLOROX COMPANY 4.4% 29/05/01	100,000	99,519.94
CME GROUP INC 2.65% 32/03/15	200,000	176,450.33
CNA FINANCIAL CORP 3.45% 27/08/15	50,000	47,126.09
CNA FINANCIAL CORP 3.9% 29/05/01	40,000	37,390.22
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 1.45% 26/07/15	100,000	88,411.16
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 4.2% 24/01/15	50,000	50,020.50
CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25% 25/05/30	100,000	100,698.95
COCA-COLA CO/THE 1% 28/03/15	60,000	51,965.35

COCA-COLA CO/THE 2% 31/03/05	165,000	142,063.06
COCA-COLA CO/THE 3.375% 27/03/25	250,000	248,236.51
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75% 30/01/22	150,000	133,153.50
COMCAST CORP 3.375% 25/02/15	100,000	99,258.20
COMCAST CORP 3.4% 30/04/01	200,000	187,975.68
COMCAST CORP 3.7% 24/04/15	310,000	311,734.85
COMCAST CORP 4.15% 28/10/15	390,000	390,101.28
COMCAST CORP 4.25% 30/10/15	200,000	198,579.52
COMERICA INC 4% 29/02/01	100,000	96,606.07
COMMONSPIRIT HEALTH 2.782% 30/10/01	15,000	12,824.04
COMMONSPIRIT HEALTH 3.347% 29/10/01	100,000	90,642.57
COMMONWEALTH EDISON CO 2.2% 30/03/01	100,000	87,214.10
CON EDISON CO OF NY INC 3.35% 30/04/01	20,000	18,614.98
CONAGRA BRANDS INC 1.375% 27/11/01	100,000	83,451.44
CONAGRA BRANDS INC 4.3% 24/05/01	60,000	60,126.08
CONAGRA BRANDS INC 4.85% 28/11/01	100,000	98,271.00
CONOCOPHILLIPS COMPANY 2.4% 25/03/07	100,000	96,705.94
CONOCOPHILLIPS COMPANY 6.95% 29/04/15	100,000	113,889.24
CONSOLIDATED EDISON CO O 3.125% 27/11/15	100,000	94,952.00
CONSOLIDATED EDISON CO O 3.8% 28/05/15	50,000	48,466.36
CONSTELLATION BRANDS INC 3.7% 26/12/06	50,000	48,719.68
CONSTELLATION BRANDS INC 4.4% 25/11/15	165,000	165,319.90
CONSTELLATION BRANDS INC 4.75% 32/05/09	100,000	99,150.69
CONTL AIRLINES 2012-1 A 4.15% 24/04/11	111,406	108,893.68
COOPERATIVE RABOBANK UA 3.75% 26/07/21	250,000	239,278.03
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.5% 25/04/04	100,000	96,990.87
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.9% 32/04/05	100,000	89,469.99
COSTCO WHOLESALE CORP 3% 27/05/18	150,000	145,587.08
COTERRA ENERGY INC 4.375% 29/03/15	75,000	73,136.09
CRANE CO 4.45% 23/12/15	50,000	50,374.66
CREDIT SUISSE GROUP 4.55% 26/04/17	150,000	146,179.59
CREDIT SUISSE NEW YORK 0.495% 24/02/02	100,000	94,533.44
CREDIT SUISSE NEW YORK 3.625% 24/09/09	250,000	244,908.70
CROWN CASTLE INTL CORP 2.9% 27/03/15	110,000	101,503.88
CROWN CASTLE INTL CORP 3.3% 30/07/01	100,000	88,161.24
CROWN CASTLE INTL CORP 3.8% 28/02/15	200,000	188,774.67
CROWN CASTLE INTL CORP 4% 27/03/01	100,000	97,316.77
CSX CORP 4.25% 29/03/15	100,000	99,668.49
CUMMINS INC 1.5% 30/09/01	100,000	80,748.35
CVS HEALTH CORP 1.75% 30/08/21	100,000	80,188.92
CVS HEALTH CORP 2.125% 31/09/15	200,000	162,201.17
CVS HEALTH CORP 3.25% 29/08/15	200,000	183,320.76
CVS HEALTH CORP 3.375% 24/08/12	100,000	99,237.70
CVS HEALTH CORP 3.75% 30/04/01	145,000	135,944.34
CVS HEALTH CORP 4.3% 28/03/25	272,000	269,655.19
D.R. HORTON INC 1.3% 26/10/15	150,000	129,159.86
DANAHER CORP 3.35% 25/09/15	105,000	103,204.57
DDR CORP 3.625% 25/02/01	173,000	167,866.64
DELL INT LLC / EMC CORP 6.02% 26/06/15	300,000	311,584.65
DELL INT LLC / EMC CORP 6.1% 27/07/15	150,000	157,010.94
DELTA AIR LINES 2019-1AA 3.204% 24/04/25	50,000	48,195.64
DENTSPLY SIRONA INC 3.25% 30/06/01	100,000	83,438.12
DEUTSCHE BANK NY 0.962% 23/11/08	150,000	143,746.87
DEUTSCHE BANK NY 1.686% 26/03/19	50,000	44,807.85
DEUTSCHE BANK NY 2.222% 24/09/18	300,000	288,828.06
DEUTSCHE BANK NY 3.035% 32/05/28	150,000	116,857.56
DEUTSCHE BANK NY 4.162% 25/05/13	200,000	198,587.20
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75% 30/06/15	200,000	248,656.14
DEVON ENERGY CORPORATION 4.5% 30/01/15	163,000	153,110.18

DIAGEO CAPITAL PLC 2.125% 32/04/29	200,000	167,973.07
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5% 29/12/01	100,000	91,110.31
DIGITAL REALTY TRUST LP 4.45% 28/07/15	100,000	96,934.13
DISCOVER BANK 3.45% 26/07/27	150,000	141,489.41
DISCOVER BANK 4.2% 23/08/08	250,000	250,417.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.8% 24/03/13	200,000	198,641.44
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.95% 28/03/20	100,000	93,385.90
DISCOVERY COMMUNICATIONS 4.125% 29/05/15	45,000	41,293.19
DOLLAR GENERAL CORP 4.15% 25/11/01	50,000	49,964.68
DOLLAR TREE INC 2.65% 31/12/01	100,000	82,393.78
DOLLAR TREE INC 4.2% 28/05/15	100,000	97,135.62
DOMINION ENERGY INC 3.375% 30/04/01	60,000	54,714.09
DOMINION ENERGY INC 4.25% 28/06/01	50,000	49,102.94
DOMINION RESOURCES INC 5.75% 24/10/01	100,000	92,485.40
DOW CHEMICAL CO/THE 7.375% 29/11/01	92,000	105,426.05
DOWDUPONT INC 4.493% 25/11/15	100,000	101,077.00
DOWDUPONT INC 4.725% 28/11/15	100,000	100,223.97
DTE ELECTRIC CO 1.9% 28/04/01	15,000	13,314.63
DTE ENERGY 2.85% 26/10/01	100,000	94,443.48
DTE ENERGY CO 1.05% 25/06/01	70,000	64,103.47
DTE ENERGY CO 2.529% 24/10/01	75,000	72,582.34
DTE ENERGY CO 2.95% 30/03/01	50,000	44,157.62
DUKE ENERGY CAROLINAS 2.45% 29/08/15	25,000	22,205.40
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.95% 28/11/15	250,000	245,953.86
DUKE ENERGY CORP 2.55% 31/06/15	100,000	83,415.97
DUKE ENERGY FLORIDA LLC 1.75% 30/06/15	105,000	86,699.26
DUKE ENERGY FLORIDA LLC 2.4% 31/12/15	100,000	85,003.44
DUKE ENERGY PROGRESS LLC 2% 31/08/15	100,000	82,555.09
DUKE REALTY LP 4% 28/09/15	50,000	48,375.24
DXC TECHNOLOGY CO 1.8% 26/09/15	100,000	88,346.44
E*TRADE FINANCIAL CORP 3.8% 27/08/24	15,000	14,421.29
E*TRADE FINANCIAL CORP 4.5% 28/06/20	50,000	49,699.91
EAGLE MATERIALS 2.5% 31/07/01	100,000	77,859.51
EASTMAN CHEMICAL CO 4.5% 28/12/01	100,000	97,648.40
EATON VANCE CORP 3.5% 27/04/06	50,000	48,070.97
EBAY INC 1.4% 26/05/10	100,000	89,679.56
EBAY INC 2.7% 30/03/11	70,000	59,460.34
EBAY INC 3.6% 27/06/05	100,000	96,221.08
ECOLAB INC 1.65% 27/02/01	100,000	90,814.04
ECOLAB INC 2.7% 26/11/01	45,000	42,998.92
ECOLAB INC 4.8% 30/03/24	45,000	46,491.48
EDISON INTERNATIONAL 4.95% 25/04/15	40,000	40,146.37
EDISON INTERNATIONAL 5.75% 27/06/15	160,000	162,597.77
ELECTRONIC ARTS INC 1.85% 31/02/15	60,000	48,552.13
ELI LILLY & CO 3.375% 29/03/15	80,000	77,809.17
EMERA US FINANCE LP 0.833% 24/06/15	50,000	46,503.50
EMERSON ELECTRIC CO 3.15% 25/06/01	100,000	98,430.48
EMPRESA NACIONAL DE ELEC 4.25% 24/04/15	50,000	49,325.00
ENABLE MIDSTREAM PARTNER 3.9% 24/05/15	100,000	98,578.26
ENBRIDGE ENERGY PARTNERS 5.875% 25/10/15	100,000	104,285.15
ENBRIDGE INC 2.5% 25/02/14	100,000	95,732.66
ENBRIDGE INC 3.7% 27/07/15	50,000	47,934.80
ENEL CHILE SA 4.875% 28/06/12	100,000	95,423.00
ENERGY TRANSFER OPERATNG 4.5% 24/04/15	100,000	99,824.45
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.25% 29/04/15	200,000	196,779.81
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.875% 24/01/15	250,000	253,910.03
ENSTAR GROUP LTD 4.95% 29/06/01	100,000	95,269.72
ENERGY CORP 1.9% 28/06/15	85,000	72,771.09
ENERGY LOUISIANA LLC 2.4% 26/10/01	300,000	279,352.61

ENTERPRISE PRODUCTS OPER 2.8% 30/01/31	160,000	139,939.04
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 5.375% 28/02/15	100,000	78,217.39
EOG RESOURCES INC 3.15% 25/04/01	200,000	196,830.42
EQT CORP 7.5% 30/02/01	100,000	105,352.00
EQUINIX INC 1% 25/09/15	100,000	89,590.84
EQUINIX INC 2% 28/05/15	100,000	85,086.51
EQUINIX INC 2.15% 30/07/15	100,000	80,635.34
EQUINIX INC 3.2% 29/11/18	45,000	39,829.42
EQUINIX INC 3.9% 32/04/15	100,000	90,397.99
ERP OPERATING LP 2.5% 30/02/15	100,000	86,755.31
ERP OPERATING LP 3.25% 27/08/01	35,000	33,109.07
ERP OPERATING LP 4.15% 28/12/01	50,000	48,828.93
ESSENTIAL UTILITIES INC 2.704% 30/04/15	60,000	52,068.38
ESSEX PORTFOLIO LP 1.7% 28/03/01	85,000	72,749.23
ESSEX PORTFOLIO LP 3.5% 25/04/01	100,000	98,009.42
ESSEX PORTFOLIO LP 3.875% 24/05/01	50,000	49,830.76
ESTEE LAUDER CO INC 1.95% 31/03/15	45,000	37,816.21
ESTEE LAUDER CO INC 3.15% 27/03/15	100,000	97,025.46
EVERGY INC 2.9% 29/09/15	100,000	87,727.49
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 24/10/01	50,000	48,777.53
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 27/03/01	100,000	94,233.56
EVERSOURCE ENERGY 3.375% 32/03/01	100,000	89,491.03
EXELON 3.4% 26/04/15	100,000	96,907.57
EXPEDIA GROUP INC 3.25% 30/02/15	200,000	165,579.35
EXPEDIA GROUP INC 4.625% 27/08/01	75,000	71,847.16
EXXON MOBIL CORPORATION 2.44% 29/08/16	100,000	89,611.74
EXXON MOBIL CORPORATION 2.992% 25/03/19	300,000	294,929.97
EXXON MOBIL CORPORATION 3.294% 27/03/19	150,000	147,157.68
FAIRFAX FINL HLDGS LTD 4.625% 30/04/29	100,000	95,243.37
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.2% 29/06/15	50,000	44,878.36
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.25% 27/07/15	50,000	46,889.98
FEDEX CORP 3.1% 29/08/05	200,000	181,698.91
FIBRIA OVERSEAS FINANCE 5.5% 27/01/17	50,000	49,634.93
FIDELITY NATL FINANCIAL 4.5% 28/08/15	100,000	96,065.58
FIDELITY NATL INFO SERV 0.6% 24/03/01	15,000	14,167.49
FIDELITY NATL INFO SERV 1.65% 28/03/01	20,000	16,905.01
FIDELITY NATL INFO SERV 2.25% 31/03/01	100,000	80,481.93
FIFTH THIRD BANCORP 1.707% 27/11/01	65,000	57,110.05
FIFTH THIRD BANCORP 2.55% 27/05/05	60,000	54,813.84
FIFTH THIRD BANCORP 3.65% 24/01/25	100,000	99,479.37
FIFTH THIRD BANK 2.25% 27/02/01	150,000	137,788.42
FIRST AMERICAN FINANCIAL 2.4% 31/08/15	65,000	49,966.68
FISERV INC 3.2% 26/07/01	250,000	237,432.58
FISERV INC 3.8% 23/10/01	250,000	249,846.36
FLEX LTD 4.875% 30/05/12	85,000	80,427.57
FLEXTRONICS INTERNATIONA 4.75% 25/06/15	125,000	125,147.26
FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.85% 25/04/01	100,000	98,448.18
FLOWERS FOODS INC 3.5% 26/10/01	35,000	33,322.76
FLOWERVE CORP 2.8% 32/01/15	100,000	76,859.29
FORTUNE BRANDS HOME & SE 4% 23/09/21	100,000	100,097.70
FOX CORP 3.5% 30/04/08	25,000	22,560.63
FOX CORP 4.03% 24/01/25	150,000	149,990.56
FOX CORP 4.709% 29/01/25	100,000	97,978.76
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.125% 28/03/01	200,000	185,214.29
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.625% 30/08/01	100,000	92,400.00
FS KKR CAPITAL CORP 3.125% 28/10/12	100,000	79,587.57
FS KKR CAPITAL CORP 4.125% 25/02/01	100,000	94,147.16
GATX CORP 1.9% 31/06/01	100,000	77,353.75
GENERAL DYNAMICS CORP 2.125% 26/08/15	100,000	94,059.42

GENERAL DYNAMICS CORP 3.25% 25/04/01	100,000	98,938.78
GENERAL DYNAMICS CORP 3.75% 28/05/15	80,000	78,570.67
GENERAL ELECTRIC CO 6.75% 32/03/15	200,000	223,032.09
GENERAL MILLS INC 2.25% 31/10/14	50,000	40,970.00
GENERAL MILLS INC 4.2% 28/04/17	100,000	99,203.48
GENERAL MOTORS CO 5% 28/10/01	200,000	193,843.56
GENERAL MOTORS CO 5.4% 23/10/02	100,000	101,274.93
GENERAL MOTORS FINL CO 1.05% 24/03/08	50,000	47,441.28
GENERAL MOTORS FINL CO 1.5% 26/06/10	150,000	130,788.63
GENERAL MOTORS FINL CO 2.4% 28/04/10	100,000	84,111.03
GENERAL MOTORS FINL CO 2.4% 28/10/15	100,000	82,392.74
GENERAL MOTORS FINL CO 3.1% 32/01/12	100,000	80,628.29
GENERAL MOTORS FINL CO 3.85% 28/01/05	100,000	91,589.21
GENERAL MOTORS FINL CO 3.95% 24/04/13	100,000	99,417.69
GENERAL MOTORS FINL CO 4% 25/01/15	200,000	197,067.41
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35% 27/01/17	100,000	95,815.85
GENERAL MOTORS FINL CO 5.1% 24/01/17	200,000	202,403.36
GENERAL MOTORS FINL CO 5.65% 29/01/17	100,000	99,213.89
GENUINE PARTS CO 1.75% 25/02/01	25,000	23,555.23
GEORGIA POWER CO 2.65% 29/09/15	70,000	61,368.15
GEORGIA POWER CO 3.25% 26/04/01	50,000	48,447.60
GEORGIA POWER CO 4.7% 32/05/15	100,000	99,521.62
GILEAD SCIENCES INC 1.65% 30/10/01	60,000	49,426.52
GILEAD SCIENCES INC 3.65% 26/03/01	200,000	196,825.13
GILEAD SCIENCES INC 3.7% 24/04/01	250,000	250,571.64
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.625% 25/05/15	55,000	54,896.79
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.875% 28/05/15	100,000	99,314.61
GLOBAL PAYMENTS INC 2.65% 25/02/15	100,000	95,043.98
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9% 31/11/15	200,000	162,622.91
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 23/11/01	145,000	143,357.15
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 26/04/15	85,000	83,715.94
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75% 28/06/01	45,000	43,903.89
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.657% 24/09/10	200,000	191,382.56
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.542% 27/09/10	100,000	87,837.37
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.757% 25/01/24	300,000	288,225.65
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383% 32/07/21	715,000	578,197.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615% 32/04/22	105,000	87,037.16
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5% 25/04/01	500,000	492,300.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.691% 28/06/05	200,000	189,594.55
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75% 25/05/22	100,000	98,936.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 24/07/08	300,000	299,882.47
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 27/01/26	300,000	291,634.13
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223% 29/05/01	500,000	481,362.45
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.387% 27/06/15	200,000	196,911.99
GOLUB CAPITAL BDC 2.5% 26/08/24	60,000	50,132.45
GRUPO TELEVISA SAB 6.625% 25/03/18	100,000	104,630.00
GSK CONSUMER HEALTHCARE 3.375% 29/03/24	250,000	233,917.91
GULF POEWR CO 3.3% 27/05/30	100,000	96,033.23
GXO LOGISTICS INC 1.65% 26/07/15	100,000	86,914.14
HANOVER INSURANCE GROUP 4.5% 26/04/15	50,000	49,780.76
HARRIS CORPORATION 4.4% 28/06/15	150,000	147,051.93
HASBRO INC 3.5% 27/09/15	30,000	28,338.30
HASBRO INC 3.55% 26/11/19	125,000	119,544.37
HCA INC 3.625% 32/03/15	500,000	424,067.87
HCA INC 4.125% 29/06/15	100,000	91,131.48
HCA INC 4.5% 27/02/15	105,000	100,835.72
HCA INC 5% 24/03/15	200,000	200,545.27
HCA INC 5.875% 26/02/15	200,000	201,441.00
HEALTHPEAK PROPERTIES 3% 30/01/15	100,000	88,113.60

HERSHEY COMPANY 1.7% 30/06/01	80,000	67,064.95
HERSHEY COMPANY 2.05% 24/11/15	100,000	96,597.14
HESS CORP 4.3% 27/04/01	100,000	97,120.10
HF SINCLAIR CORP 5.875% 26/04/01	100,000	100,824.66
HIGHWOODS REALTY LP 3.05% 30/02/15	100,000	86,274.99
HOME DEPOT INC 0.9% 28/03/15	30,000	25,513.34
HOME DEPOT INC 1.875% 31/09/15	40,000	33,251.34
HOME DEPOT INC 2.5% 27/04/15	100,000	94,779.10
HOME DEPOT INC 2.7% 30/04/15	55,000	49,879.53
HOME DEPOT INC 2.8% 27/09/14	100,000	95,323.94
HOME DEPOT INC 2.875% 27/04/15	50,000	48,418.23
HOME DEPOT INC 3.9% 28/12/06	300,000	298,913.13
HONDA MOTOR CO LTD 2.271% 25/03/10	200,000	191,882.36
HONEYWELL INTERNATIONAL 1.75% 31/09/01	160,000	132,153.51
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.7% 29/08/15	120,000	109,824.16
HORMEL FOODS CORP 1.7% 28/06/03	170,000	150,418.36
HOST HOTELS & RESORTS LP 3.875% 24/04/01	50,000	49,306.78
HOST HOTELS & RESORTS LP 4.5% 26/02/01	150,000	147,064.54
HP ENTERPRISE CO 1.45% 24/04/01	100,000	96,265.96
HP ENTERPRISE CO 4.9% 25/10/15	200,000	203,915.99
HP INC 2.65% 31/06/17	100,000	79,402.02
HP INC 3.4% 30/06/17	150,000	130,726.72
HP INC 4% 29/04/15	100,000	93,127.50
HSBC HOLDINGS PLC 0.732% 24/08/17	200,000	191,568.86
HSBC HOLDINGS PLC 0.976% 25/05/24	200,000	186,171.48
HSBC HOLDINGS PLC 1.589% 27/05/24	200,000	175,417.46
HSBC HOLDINGS PLC 2.099% 26/06/04	530,000	488,949.37
HSBC HOLDINGS PLC 2.804% 32/05/24	100,000	81,451.18
HSBC HOLDINGS PLC 2.848% 31/06/04	200,000	167,492.84
HSBC HOLDINGS PLC 2.871% 32/11/22	1,000,000	813,050.49
HSBC HOLDINGS PLC 3.973% 30/05/22	200,000	183,141.52
HSBC HOLDINGS PLC 4.583% 29/06/19	200,000	192,671.19
HUBBELL INC 3.35% 26/03/01	100,000	97,091.30
HUDSON PACIFIC PROPRTIE 3.25% 30/01/15	100,000	86,695.67
HUMANA INC 1.35% 27/02/03	55,000	47,982.35
HUMANA INC 3.85% 24/10/01	150,000	150,229.06
HUNTINGTON BANCSHARES 2.487% 36/08/15	100,000	74,654.30
HUNTINGTON BANCSHARES 2.55% 30/02/04	100,000	85,124.72
HUNTINGTON INGALLS INDUS 0.67% 23/08/16	100,000	96,224.57
HUNTSMAN INTERNATIONAL L 4.5% 29/05/01	100,000	93,515.60
HYATT HOTELS CORP 4.375% 28/09/15	50,000	46,885.03
HYATT HOTELS CORP 4.85% 26/03/15	50,000	49,749.70
IBM CORP 1.7% 27/05/15	470,000	424,136.32
IBM CORP 3.375% 23/08/01	250,000	249,972.96
IBM CORP 3.5% 29/05/15	100,000	94,695.39
IDEX CORP 3% 30/05/01	50,000	43,387.36
ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65% 26/11/15	100,000	95,889.18
ING GROEP NV 1.726% 27/04/01	200,000	177,951.83
ING GROEP NV 4.1% 23/10/02	200,000	200,526.60
INGREDION INC 2.9% 30/06/01	100,000	86,574.99
INTEL CORP 1.6% 28/08/12	55,000	48,135.81
INTEL CORP 2% 31/08/12	100,000	84,322.97
INTEL CORP 2.875% 24/05/11	100,000	99,781.49
INTEL CORP 3.7% 25/07/29	145,000	145,796.43
INTEL CORP 3.9% 30/03/25	250,000	246,608.73
INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.1% 27/09/15	100,000	94,316.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.65% 25/05/23	300,000	298,596.00
INTERPUBLIC GROUP COS 4.65% 28/10/01	25,000	24,517.33
INTERPUBLIC GROUP COS 4.75% 30/03/30	100,000	98,121.54

INTERSTATE POWER & LIGHT 3.25% 24/12/01	100,000	98,879.09
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.6% 29/04/01	50,000	47,363.92
INTL FLAVOR & FRAGRANCES 4.45% 28/09/26	45,000	43,875.64
INTUIT INC 0.65% 23/07/15	100,000	97,328.67
INVESCO FINANCE PLC 3.75% 26/01/15	150,000	147,142.90
INVITATION HOMES OP 2.3% 28/11/15	50,000	41,940.15
IPALCO ENTERPRISES INC 3.7% 24/09/01	100,000	98,205.93
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25% 30/05/01	100,000	92,743.87
ITC HOLDINGS CORP 3.25% 26/06/30	60,000	57,573.53
ITC HOLDINGS CORP 3.65% 24/06/15	25,000	24,720.74
JABIL INC 3.6% 30/01/15	150,000	132,099.67
JACKSON FINANCIAL INC 5.67% 32/06/08	100,000	95,942.97
JD.COM INC 3.375% 30/01/14	100,000	90,451.19
JEFFERIES GROUP 4.85% 27/01/15	90,000	89,662.08
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.45% 24/06/07	65,000	61,502.50
JOHN DEERE CAPITAL CORP 0.7% 23/07/05	100,000	97,708.58
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.05% 26/06/17	100,000	90,220.06
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.7% 27/01/11	100,000	91,398.51
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.125% 25/03/07	25,000	24,120.86
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.45% 30/01/09	200,000	178,685.16
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.65% 24/06/24	50,000	49,381.74
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8% 29/07/18	50,000	46,062.62
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.05% 28/01/06	50,000	47,755.92
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.35% 29/04/18	100,000	95,540.19
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.9% 32/06/07	100,000	98,364.10
JOHNSON & JOHNSON 0.55% 25/09/01	50,000	45,860.14
JOHNSON & JOHNSON 0.95% 27/09/01	65,000	57,075.59
JOHNSON & JOHNSON 1.3% 30/09/01	100,000	84,528.08
JOHNSON & JOHNSON 2.45% 26/03/01	100,000	96,999.03
JOHNSON & JOHNSON 2.95% 27/03/03	100,000	97,533.00
JOHNSON CONTROLS/TYCO FI 2% 31/09/16	100,000	79,464.91
JPMORGAN CHASE & 0.969% 25/06/23	400,000	374,259.54
JPMORGAN CHASE & CO 0.563% 25/02/16	90,000	84,747.99
JPMORGAN CHASE & CO 0.653% 24/09/16	135,000	129,084.62
JPMORGAN CHASE & CO 0.824% 25/06/01	65,000	60,790.76
JPMORGAN CHASE & CO 1.47% 27/09/22	75,000	65,920.52
JPMORGAN CHASE & CO 1.578% 27/04/22	65,000	58,195.52
JPMORGAN CHASE & CO 2.005% 26/03/13	600,000	562,038.77
JPMORGAN CHASE & CO 2.182% 28/06/01	400,000	356,446.70
JPMORGAN CHASE & CO 2.545% 32/11/08	125,000	103,709.18
JPMORGAN CHASE & CO 2.58% 32/04/22	275,000	231,315.88
JPMORGAN CHASE & CO 2.739% 30/10/15	100,000	87,246.01
JPMORGAN CHASE & CO 2.956% 31/05/13	150,000	130,009.40
JPMORGAN CHASE & CO 2.963% 33/01/25	500,000	429,911.58
JPMORGAN CHASE & CO 3.22% 25/03/01	200,000	196,377.60
JPMORGAN CHASE & CO 3.509% 29/01/23	250,000	233,870.82
JPMORGAN CHASE & CO 3.797% 24/07/23	200,000	199,244.61
JPMORGAN CHASE & CO 3.96% 27/01/29	200,000	195,323.46
JPMORGAN CHASE & CO 4.005% 29/04/23	100,000	95,729.11
JPMORGAN CHASE & CO 4.203% 29/07/23	700,000	674,377.58
JPMORGAN CHASE & CO 4.25% 27/10/01	100,000	99,443.52
JPMORGAN CHASE & CO 4.323% 28/04/26	250,000	245,854.18
JPMORGAN CHASE & CO 7.75% 25/07/15	200,000	218,786.56
JUNIPER NETWORKS INC 2% 30/12/10	100,000	78,467.16
KAISER FOUNDATION HOSPIT 3.15% 27/05/01	50,000	48,576.69
KANSAS CITY SOUTHERN 2.875% 29/11/15	65,000	58,158.20
KELLOGG CO 4.3% 28/05/15	100,000	99,076.56
KEMPER CORP 2.4% 30/09/30	100,000	80,636.91
KEMPER CORP 4.35% 25/02/15	35,000	34,714.06

KEURIG DR PEPPER INC 3.13% 23/12/15	100,000	99,322.72
KEURIG DR PEPPER INC 4.597% 28/05/25	250,000	249,544.41
KEY BANK NA 3.4% 26/05/20	200,000	191,102.24
KEYCORP 2.25% 27/04/06	100,000	89,547.77
KEYSIGHT TECHNOLOGIES 4.6% 27/04/06	60,000	60,041.26
KILROY REALTY LP 4.375% 25/10/01	100,000	98,727.19
KIMBERLY-CLARK CORP 1.05% 27/09/15	100,000	87,327.01
KIMBERLY-CLARK CORP 2% 31/11/02	100,000	83,821.05
KIMCO REALTY CORP 1.9% 28/03/01	50,000	43,082.56
KIMCO REALTY CORP 2.7% 24/03/01	50,000	48,893.18
KIMCO REALTY CORP 3.3% 25/02/01	80,000	78,133.27
KINDER MORGAN ENER PART 4.3% 24/05/01	200,000	199,781.61
KINDER MORGAN INC 1.75% 26/11/15	65,000	57,696.97
KITE REALTY GROUP LP 4% 26/10/01	50,000	47,411.91
KLA-TENCOR CORP 4.1% 29/03/15	100,000	99,017.37
KRAFT HEINZ FOODS CO 4.25% 31/03/01	200,000	189,462.13
KROGER CO 3.5% 26/02/01	150,000	147,754.79
KROGER CO 4% 24/02/01	100,000	100,359.62
KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15% 31/10/15	100,000	73,310.59
LABORATORY CORP OF AMER 1.55% 26/06/01	70,000	62,943.12
LABORATORY CORP OF AMER 3.6% 27/09/01	150,000	144,866.97
LABORATORY CORP OF AMERI 4% 23/11/01	50,000	50,142.44
LAM RESEARCH CORP 4% 29/03/15	55,000	53,994.74
LAZARD GROUP LLC 3.625% 27/03/01	100,000	94,050.20
LAZARD GROUP LLC 4.5% 28/09/19	50,000	47,795.46
LEAR CORP 4.25% 29/05/15	100,000	91,668.72
LEGGETT & PLATT INC 3.5% 27/11/15	50,000	46,935.28
LENNAR CORP 4.875% 23/12/15	200,000	201,550.83
LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35% 25/08/01	25,000	22,821.96
LIFE STORAGE LP 4% 29/06/15	100,000	91,659.83
LINCOLN NATIONAL CORP 3.35% 25/03/09	150,000	146,050.45
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.87% 25/07/09	200,000	197,035.31
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% 25/05/08	200,000	199,603.56
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.55% 28/08/16	200,000	194,368.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65% 26/03/24	200,000	195,381.08
LOCKHEED MARTIN CORP 1.85% 30/06/15	100,000	85,224.80
LOWE'S COS INC 1.3% 28/04/15	145,000	122,259.15
LOWE'S COS INC 1.7% 28/09/15	125,000	106,516.16
LOWE'S COS INC 2.625% 31/04/01	150,000	129,197.61
LOWE'S COS INC 3.1% 27/05/03	100,000	94,879.20
LOWE'S COS INC 4% 25/04/15	100,000	100,402.78
LYB INT FINANCE III 1.25% 25/10/01	20,000	18,032.32
LYB INT FINANCE III 2.25% 30/10/01	125,000	102,529.99
MAGALLANES INC 3.428% 24/03/15	100,000	97,956.49
MAGALLANES INC 3.638% 25/03/15	100,000	96,861.83
MAGALLANES INC 4.054% 29/03/15	200,000	182,553.14
MAGALLANES INC 4.279% 32/03/15	200,000	179,005.85
MAGELLAN MISDTREAM PARTN 5% 26/03/01	50,000	50,808.23
MAGNA INTERNATIONAL INC 2.45% 30/06/15	100,000	84,766.94
MAIN STREET CAPITAL CORP 3% 26/07/14	85,000	73,586.35
MANULIFE FINANCIAL CORP 2.484% 27/05/19	35,000	32,060.80
MANULIFE FINANCIAL CORP 3.703% 32/03/16	100,000	90,999.81
MARATHON PETROLEUM CORP 3.8% 28/04/01	30,000	28,206.55
MARATHON PETROLEUM CORP 4.7% 25/05/01	200,000	202,132.13
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.6% 24/04/15	50,000	49,636.54
MARRIOTT INTERNATIONAL 4.625% 30/06/15	110,000	104,336.94
MARRIOTT INTERNATIONAL 5.75% 25/05/01	50,000	51,789.98
MARSH & MCLENNAN COS INC 3.875% 24/03/15	100,000	99,978.13
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.375% 29/03/15	95,000	94,082.28

MARTIN MARIETTA 2.4% 31/07/15	50,000	40,626.75
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.45% 27/06/01	21,000	19,944.20
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.5% 27/12/15	50,000	46,883.57
MARTIN MARIETTA MATERIAL 4.25% 24/07/02	30,000	30,074.58
MARVELL TECHNOLOGY INC 4.875% 28/06/22	100,000	97,108.16
MASCO CORP 1.5% 28/02/15	50,000	41,817.00
MASCO CORP 2% 30/10/01	15,000	11,839.55
MASTERCARD INC 2.95% 29/06/01	100,000	93,455.99
MASTERCARD INC 3.35% 30/03/26	100,000	95,029.81
MASTERCARD INC 3.5% 28/02/26	30,000	29,476.78
MAXIM INTEGRATED PRODUCT 3.45% 27/06/15	100,000	94,639.17
MCCORMICK & CO 2.5% 30/04/15	100,000	85,277.26
MCDONALD'S CORP 3.5% 27/07/01	100,000	97,459.00
MCDONALD'S CORP 3.6% 30/07/01	100,000	95,199.15
MCKESSON CORP 1.3% 26/08/15	125,000	111,140.37
MEAD JOHNSON NUTRITION C 4.125% 25/11/15	60,000	60,079.53
MERCK & CO INC 2.15% 31/12/10	100,000	86,060.72
MERCK & CO INC 3.4% 29/03/07	300,000	289,307.37
MERCY HEALTHCARE SYSTEM 4.302% 28/07/01	15,000	14,900.00
METLIFE INC 4.368% 23/09/15	100,000	101,044.28
MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.25% 25/09/01	200,000	194,449.55
MICRON TECHNOLOGY INC 4.663% 30/02/15	200,000	190,688.24
MICRON TECHNOLOGY INC 5.327% 29/02/06	50,000	49,938.50
MICROSOFT CORP 2.4% 26/08/08	250,000	241,234.48
MICROSOFT CORP 2.7% 25/02/12	100,000	99,192.18
MICROSOFT CORP 3.3% 27/02/06	300,000	299,727.14
MICROSOFT CORP 3.625% 23/12/15	150,000	151,206.17
MID-AMERICA APARTMENTS 1.1% 26/09/15	100,000	87,642.88
MID-AMERICA APARTMENTS 3.95% 29/03/15	100,000	95,257.84
mitsubishi UFJ FIN GRP 0.848% 24/09/15	200,000	192,230.55
mitsubishi UFJ FIN GRP 1.538% 27/07/20	200,000	176,291.13
mitsubishi UFJ FIN GRP 1.64% 27/10/13	200,000	175,396.76
mitsubishi UFJ FIN GRP 3.195% 29/07/18	200,000	179,543.78
mitsubishi UFJ FIN GRP 3.407% 24/03/07	200,000	198,254.97
mitsubishi UFJ FIN GRP 4.05% 28/09/11	200,000	192,101.48
mitsubishi UFJ FIN GRP 4.315% 33/04/19	200,000	190,450.97
mitsubishi UFJ FINANCIAL 2.757% 26/09/13	200,000	186,414.16
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.849% 24/09/08	200,000	192,202.55
MIZUHO FINANCIAL GROUP 1.554% 27/07/09	200,000	175,466.98
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.869% 30/09/13	200,000	172,508.84
MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018% 28/03/05	200,000	190,437.83
MONDELEZ INTERNATIONAL 2.625% 27/03/17	100,000	93,456.02
MORGAN STANLEY 0.79% 25/05/30	200,000	186,422.25
MORGAN STANLEY 0.791% 25/01/22	150,000	141,777.88
MORGAN STANLEY 1.164% 25/10/21	75,000	69,651.58
MORGAN STANLEY 1.512% 27/07/20	150,000	132,316.66
MORGAN STANLEY 2.188% 26/04/28	350,000	328,830.91
MORGAN STANLEY 2.475% 28/01/21	170,000	154,959.03
MORGAN STANLEY 2.484% 36/09/16	200,000	154,395.28
MORGAN STANLEY 2.511% 32/10/20	75,000	61,739.58
MORGAN STANLEY 2.699% 31/01/22	300,000	259,606.41
MORGAN STANLEY 2.943% 33/01/21	135,000	115,804.33
MORGAN STANLEY 3.125% 26/07/27	450,000	427,727.92
MORGAN STANLEY 3.591% 28/07/22	200,000	189,342.69
MORGAN STANLEY 3.62% 25/04/17	200,000	197,351.89
MORGAN STANLEY 3.622% 31/04/01	200,000	184,365.01
MORGAN STANLEY 3.772% 29/01/24	200,000	190,388.19
MORGAN STANLEY 3.875% 26/01/27	300,000	295,940.85
MORGAN STANLEY 3.95% 27/04/23	100,000	96,841.73

MORGAN STANLEY 5.297% 37/04/20	200,000	193,400.19
MOTOROLA SOLUTIONS INC 2.75% 31/05/24	50,000	40,355.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4% 24/09/01	10,000	9,923.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6% 29/05/23	100,000	95,407.87
MPLX LP 2.65% 30/08/15	45,000	37,401.94
MPLX LP 4.8% 29/02/15	100,000	97,915.90
MPLX LP 4.875% 25/06/01	250,000	250,749.90
MYLAN 3.95% 26/06/15	100,000	94,132.38
NASDAQ 3.85% 26/06/30	30,000	29,789.05
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.5% 26/07/12	100,000	94,049.63
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.5% 25/06/09	250,000	247,240.70
NATIONAL BANK OF CANADA 3.75% 25/06/09	250,000	247,517.66
NATIONAL FUEL GAS CO 3.95% 27/09/15	50,000	46,163.26
NATIONAL FUEL GAS CO 4.75% 28/09/01	50,000	48,792.95
NATIONAL FUEL GAS CO 5.5% 26/01/15	15,000	15,061.57
NATIONAL HEALTH INVESTOR 3% 31/02/01	25,000	19,000.59
NATIONAL RETAIL PROP INC 4.3% 28/10/15	65,000	62,898.96
NATIONAL RETAIL PROPERTI 4% 25/11/15	65,000	64,342.05
NATIONAL RURAL UTIL COOP 1.875% 25/02/07	100,000	95,420.08
NATIONAL RURAL UTIL COOP 3.4% 23/11/15	100,000	100,174.82
NATIONAL RURAL UTILITIES 5.25% 26/04/20	150,000	136,070.39
NATWEST GROUP PLC 4.892% 29/05/18	400,000	385,063.32
NATWEST GROUP PLC 6% 23/12/19	200,000	203,259.45
NETAPP INC 2.375% 27/06/22	100,000	90,640.62
NEVADA POWER CO 3.7% 29/05/01	300,000	287,163.15
NEXTERA ENERGY CAPITAL 1.9% 28/06/15	65,000	56,414.26
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.44% 32/01/15	200,000	166,277.40
NEXTERA ENERGY CAPITAL 3.8% 27/03/15	100,000	79,630.80
NEXTERA ENERGY CAPITAL 4.45% 25/06/20	100,000	101,008.19
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65% 29/05/01	150,000	132,959.06
NIKE INC 2.375% 26/11/01	100,000	95,060.83
NIKE INC 2.85% 30/03/27	50,000	46,025.43
NISOURCE FINANCE CORP 3.49% 27/05/15	100,000	95,417.63
NOMURA HOLDINGS INC 1.653% 26/07/14	100,000	87,754.22
NOMURA HOLDINGS INC 2.172% 28/07/14	200,000	167,649.14
NOMURA HOLDINGS INC 2.999% 32/01/22	200,000	160,996.04
NORFOLK SOUTHERN 2.9% 26/06/15	65,000	62,491.06
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.15% 27/06/01	75,000	71,390.79
NORTHERN TRUST CORP 3.375% 32/05/08	62,000	57,900.56
NORTHERN TRUST CORP 3.65% 28/08/03	50,000	48,729.02
NORTHERN TRUST CORP 3.95% 25/10/30	100,000	100,085.48
NORTHROP GRUMMAN CORP 3.25% 28/01/15	200,000	190,665.03
NOVARTIS CAPITAL CORP 1.75% 25/02/14	100,000	96,393.50
NOVARTIS CAPITAL CORP 2% 27/02/14	200,000	186,516.22
NSTAR ELECTRIC CO 3.2% 27/05/15	50,000	48,092.37
NSTAR ELECTRIC CO 3.25% 29/05/15	100,000	93,992.67
NUCOR CORP 3.95% 25/05/23	200,000	198,433.96
NUTRIEN LTD 3% 25/04/01	100,000	97,278.44
NVIDIA CORP 0.584% 24/06/14	75,000	71,213.67
NVIDIA CORP 2% 31/06/15	100,000	85,177.70
NVIDIA CORP 2.85% 30/04/01	100,000	91,893.90
NVR INC 3% 30/05/15	65,000	55,721.02
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.4% 30/05/01	45,000	39,777.49
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875% 26/06/18	100,000	96,902.29
NXP BV/NXP FUNDING LLC 4.875% 24/03/01	100,000	101,261.52
NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.55% 28/12/01	100,000	101,129.14
OAKTREE SPECIALTY LEND 2.7% 27/01/15	50,000	42,844.06
OCHSNER LSU HEALTH SYST 2.51% 31/05/15	100,000	79,643.86
OFFICE PPTY INCOME TRST 4.5% 25/02/01	100,000	94,827.74

OKLAHOMA G&E CO 3.25% 30/04/01	55,000	50,410.81
OLD REPUBLIC INTERNATION 3.875% 26/08/26	100,000	96,923.16
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 25/01/15	50,000	49,258.47
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 27/04/01	100,000	94,661.98
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.95% 24/04/01	100,000	100,184.20
OMNICOM GROUP INC 2.45% 30/04/30	100,000	84,111.28
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 3.7% 28/11/15	100,000	97,123.53
ONE GAS INC 1.1% 24/03/11	100,000	94,880.46
ONE GAS INC 2% 30/05/15	100,000	82,846.21
ONEOK INC 4% 27/07/13	85,000	81,515.93
ONEOK INC 4.55% 28/07/15	150,000	144,172.55
ONEOK INC 5.85% 26/01/15	65,000	67,024.35
ORACLE CORP 2.3% 28/03/25	105,000	91,074.79
ORACLE CORP 2.8% 27/04/01	700,000	642,591.90
ORACLE CORP 2.875% 31/03/25	95,000	78,499.00
ORACLE CORP 3.25% 27/11/15	150,000	137,937.68
ORACLE CORP 3.25% 30/05/15	100,000	86,507.47
ORACLE CORP 3.625% 23/07/15	150,000	150,199.84
ORANGE SA 9% 31/03/01	100,000	128,701.39
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35% 28/06/01	150,000	148,532.04
ORIX CORP 3.25% 24/12/04	100,000	97,929.10
ORIX CORP 3.7% 27/07/18	50,000	48,048.75
OTIS WORLDWIDE CORP 2.056% 25/04/05	100,000	94,456.20
OTIS WORLDWIDE CORP 2.293% 27/04/05	35,000	31,543.19
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565% 30/02/15	40,000	34,415.97
OWENS CORNING 3.95% 29/08/15	180,000	166,039.31
OWL ROCK CAPITAL CORP 2.875% 28/06/11	100,000	78,998.03
OWL ROCK CAPITAL CORP 4% 25/03/30	100,000	94,443.42
PACCAR FINANCIAL CORP 2.85% 25/04/07	150,000	146,578.49
PACCAR FINANCIAL CORP 3.4% 23/08/09	50,000	49,941.29
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.25% 31/06/01	40,000	31,970.01
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.45% 25/07/01	300,000	281,760.67
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.75% 28/07/01	100,000	87,525.60
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.55% 30/07/01	300,000	264,954.33
PACIFIC GAS & ELECTRIC 5.45% 27/06/15	100,000	96,564.31
PACIFIC GAS & ELECTRIC 5.9% 32/06/15	100,000	95,626.43
PACKAGING CORP OF AMERIC 3.4% 27/12/15	35,000	33,299.73
PARKER-HANNIFIN CORP 3.3% 24/11/21	150,000	147,898.84
PARKER-HANNIFIN CORP 4.5% 29/09/15	100,000	99,152.89
PAYPAL HOLDINGS INC 2.4% 24/10/01	105,000	102,310.24
PAYPAL HOLDINGS INC 2.85% 29/10/01	200,000	181,826.50
PEPSICO INC 1.95% 31/10/21	150,000	127,614.15
PEPSICO INC 2.25% 25/03/19	100,000	97,521.77
PEPSICO INC 2.75% 30/03/19	200,000	184,117.96
PEPSICO INC 2.85% 26/02/24	100,000	97,927.52
PERKINELMER INC 0.85% 24/09/15	60,000	55,634.83
PERKINELMER INC 2.25% 31/09/15	70,000	55,008.88
PFIZER INC 1.75% 31/08/18	65,000	54,474.90
PFIZER INC 2.625% 30/04/01	200,000	182,234.44
PFIZER INC 3.45% 29/03/15	100,000	97,603.33
PHILIP MORRIS INTL INC 1.5% 25/05/01	200,000	187,493.63
PHILIP MORRIS INTL INC 2.75% 26/02/25	150,000	143,123.50
PHILIP MORRIS INTL INC 3.125% 27/08/17	100,000	93,267.13
PHILLIPS 66 0.9% 24/02/15	100,000	95,207.36
PHILLIPS 66 3.15% 29/12/15	100,000	89,131.63
PHILLIPS 66 CO 3.55% 26/10/01	75,000	72,354.50
PHYSICIANS REALTY LP 2.625% 31/11/01	100,000	80,522.78
PIEDMONT NATURAL GAS CO 2.5% 31/03/15	155,000	130,228.10
PIEDMONT OPERATING PARTN 3.15% 30/08/15	100,000	82,288.37

PLAINS ALL AMER PIPELINE 3.6% 24/11/01	100,000	97,592.55
PLAINS ALL AMER PIPELINE 4.65% 25/10/15	200,000	197,650.30
PNC BANK NA 2.7% 29/10/22	100,000	86,668.12
PNC BANK NA 3.25% 25/06/01	150,000	147,189.75
PNC BANK NA 4.05% 28/07/26	250,000	240,193.58
PNC FINANCIAL SERVICES 1.15% 26/08/13	100,000	88,855.04
PPG INDUSTRIES INC 2.55% 30/06/15	100,000	87,450.30
PRAXAIR INC 1.1% 30/08/10	100,000	79,768.77
PRAXAIR INC 3.2% 26/01/30	50,000	49,477.16
PRICELINE GROUP 3.6% 26/06/01	100,000	99,179.66
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 2.125% 30/06/15	100,000	82,294.84
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 3.7% 29/05/15	50,000	46,785.59
PROCTER & GAMBLE 2.45% 26/11/03	100,000	95,893.33
PROCTER & GAMBLE CO/THE 1% 26/04/23	45,000	41,312.92
PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.8% 27/03/25	200,000	193,006.24
PROCTER & GAMBLE CO/THE 3% 30/03/25	100,000	93,943.17
PROGRESSIVE CORP 3.2% 30/03/26	100,000	92,723.03
PROLOGIS LP 2.125% 27/04/15	50,000	45,816.32
PROSPECT CAPITAL CORP 3.364% 26/11/15	55,000	46,320.11
PROV ST JOSEPH HLTH OBL 2.532% 29/10/01	100,000	88,426.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4.5% 27/09/15	100,000	90,280.94
PRUDENTIAL PLC 3.125% 30/04/14	100,000	91,474.13
PUBLIC SERVICE COLORADO 3.7% 28/06/15	50,000	48,730.44
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 2.45% 30/01/15	35,000	31,012.03
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 25/05/15	150,000	146,449.78
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 27/05/15	100,000	95,885.18
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3.25% 23/09/01	50,000	49,856.08
PUBLIC SERVICE OKLAHOMA 2.2% 31/08/15	100,000	82,922.97
PUBLIC STORAGE 3.094% 27/09/15	125,000	117,530.10
PUGET ENERGY INC 2.379% 28/06/15	100,000	87,345.31
QORVO INC 1.75% 24/12/15	30,000	28,024.58
QUALCOMM INC 2.9% 24/05/20	100,000	99,077.14
QUALCOMM INC 3.25% 27/05/20	100,000	97,754.50
QUALCOMM INC 4.25% 32/05/20	150,000	152,011.80
QUANTA SERVICES INC 0.95% 24/10/01	100,000	92,301.42
QUEST DIAGNOSTICS INC 3.5% 25/03/30	100,000	98,366.54
RALPH LAUREN CORP 3.75% 25/09/15	50,000	49,621.34
RAYTHEON TECH CORP 2.25% 30/07/01	200,000	172,047.01
RAYTHEON TECH CORP 2.375% 32/03/15	200,000	169,138.02
RAYTHEON TECH CORP 4.125% 28/11/16	200,000	197,307.68
REALTY INCOME CORP 0.75% 26/03/15	80,000	70,164.06
REALTY INCOME CORP 3.65% 28/01/15	200,000	191,305.97
REALTY INCOME CORP 3.95% 27/08/15	40,000	38,957.60
REALTY INCOME CORP 4.6% 24/02/06	40,000	40,339.52
REALTY INCOME CORP 4.875% 26/06/01	50,000	50,891.52
REGENCY CENTERS LP 3.6% 27/02/01	30,000	28,729.60
REGENCY CENTERS LP 4.125% 28/03/15	50,000	47,854.73
REGENERON PHARMACEUTICAL 1.75% 30/09/15	135,000	108,086.94
REGIONS FINANCIAL CORP 1.8% 28/08/12	100,000	85,579.60
REINSURANCE GRP OF AMER 3.15% 30/06/15	35,000	30,846.10
REINSURANCE GRP OF AMER 3.9% 29/05/15	75,000	70,304.61
RELX CAPITAL INC 3% 30/05/22	85,000	75,922.09
RENAISSANCERE FINANCE 3.45% 27/07/01	65,000	61,309.31
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6% 29/04/15	25,000	23,278.20
REPUBLIC SERVICES INC 2.5% 24/08/15	45,000	43,751.38
REPUBLIC SERVICES INC 3.375% 27/11/15	60,000	57,132.64
REPUBLIC SERVICES INC 3.95% 28/05/15	100,000	98,056.45
REYNOLDS AMERICAN INC 4.45% 25/06/12	250,000	248,053.57
RIO TINTO FIN USA LTD 7.125% 28/07/15	100,000	113,985.72

ROCKWELL AUTOMATION 1.75% 31/08/15	100,000	81,717.39
ROGERS COMMUNICATIONS IN 2.9% 26/11/15	200,000	189,559.77
ROGERS COMMUNICATIONS IN 3.2% 27/03/15	65,000	61,589.21
ROGERS COMMUNICATIONS IN 3.8% 32/03/15	65,000	59,839.47
ROPER TECHNOLOGIES INC 2% 30/06/30	100,000	81,074.41
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.8% 26/12/15	155,000	151,644.01
ROYAL BANK OF CANADA 0.65% 24/07/29	100,000	93,697.53
ROYAL BANK OF CANADA 1.6% 25/01/21	200,000	188,871.40
ROYAL BANK OF CANADA 2.25% 24/11/01	150,000	144,329.12
ROYAL BANK OF CANADA 2.3% 31/11/03	100,000	83,152.18
ROYAL BANK OF CANADA 3.7% 23/10/05	100,000	100,475.87
ROYAL BANK OF CANADA 4.65% 26/01/27	150,000	150,991.60
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 4.445% 30/05/08	200,000	187,893.98
ROYALTY PHARMA PLC 0.75% 23/09/02	105,000	101,026.08
ROYALTY PHARMA PLC 2.2% 30/09/02	65,000	52,564.99
RPM INTERNATIONAL INC 4.55% 29/03/01	50,000	47,904.22
RYDER SYSTEM INC 1.75% 26/09/01	65,000	58,844.51
RYDER SYSTEM INC 3.65% 24/03/18	100,000	99,138.48
S&P GLOBAL INC 2.9% 32/03/01	100,000	89,130.63
S&P GLOBAL INC 4.75% 28/08/01	200,000	202,681.64
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.2% 28/03/15	400,000	381,828.31
SABINE PASS LIQUEFACTION 5.75% 24/05/15	100,000	101,865.96
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 3.9% 29/10/15	50,000	43,951.80
SALESFORCE.COM INC 0.625% 24/07/15	55,000	51,999.67
SALESFORCE.COM INC 1.95% 31/07/15	80,000	67,864.62
SALESFORCE.COM INC 3.7% 28/04/11	100,000	99,438.31
SANOFI 3.625% 28/06/19	100,000	98,027.25
SANTANDER HOLDINGS USA 2.49% 28/01/06	35,000	30,743.91
SANTANDER HOLDINGS USA 3.45% 25/06/02	100,000	96,227.38
SANTANDER HOLDINGS USA 3.5% 24/06/07	70,000	68,685.83
SANTANDER HOLDINGS USA 4.4% 27/07/13	120,000	114,877.86
SANTANDER ISSUANCES 5.179% 25/11/19	200,000	199,838.12
SANTANDER UK GROUP HLDGS 1.673% 27/06/14	200,000	174,415.09
SANTANDER UK GROUP HLDGS 4.796% 24/11/15	200,000	200,020.86
SCHLUMBERGER INVESTMENT 3.65% 23/12/01	200,000	201,040.71
SEMPRA ENERGY 3.3% 25/04/01	100,000	97,644.83
SEMPRA ENERGY 3.4% 28/02/01	100,000	94,809.07
SHELL INTERNATIONAL 2.875% 26/05/10	300,000	290,221.66
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.375% 29/11/07	100,000	87,919.12
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875% 28/11/13	150,000	147,047.39
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.125% 24/06/01	50,000	49,521.79
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45% 27/06/01	100,000	95,711.35
SHIRE ACQ INV IRELAND DA 2.875% 23/09/23	60,000	59,306.61
SIGNATURE BANK NEW YORK 4% 30/10/15	100,000	96,124.58
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.25% 32/01/15	100,000	79,251.53
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.65% 30/07/15	100,000	84,356.57
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.25% 26/11/30	100,000	95,309.67
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 24/10/01	100,000	98,795.39
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 27/12/01	100,000	93,713.79
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.5% 25/09/01	65,000	63,497.65
SIXTH STREET SPECIALTY 2.5% 26/08/01	65,000	56,267.94
SMITH & NEPHEW PLC 2.032% 30/10/14	50,000	39,756.17
SONOCO PRODUCTS CO 2.25% 27/02/01	100,000	90,025.57
SOUTHERN CAL EDISON 2.25% 30/06/01	35,000	29,171.88
SOUTHERN CAL EDISON 2.5% 31/06/01	50,000	41,780.44
SOUTHERN CAL EDISON 3.5% 23/10/01	100,000	99,823.80
SOUTHERN CALIF GAS CO 3.15% 24/09/15	100,000	99,242.76
SOUTHERN CO 3.7% 30/04/30	250,000	232,154.38
SOUTHERN CO 4% 25/10/15	100,000	90,082.00

SOUTHERN CO 4.475% 24/08/01	85,000	85,128.70
SOUTHERN CO GAS CAPITAL 2.45% 23/10/01	50,000	49,206.52
SOUTHWEST AIRLINES CO 3% 26/11/15	100,000	93,232.32
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.125% 27/06/15	170,000	170,969.94
SOUTHWESTERN ELEC POWER 1.65% 26/03/15	100,000	90,824.79
SOUTHWESTERN ELEC POWER 4.1% 28/09/15	100,000	96,426.95
SPECTRA ENERGY PARTNERS 4.75% 24/03/15	150,000	150,978.52
SPIRIT REALTY LP 3.2% 27/01/15	100,000	91,503.88
SPIRIT REALTY LP 3.4% 30/01/15	100,000	85,872.98
STANLEY BLACK & DECKER I 3.4% 26/03/01	70,000	68,911.13
STANLEY BLACK & DECKER I 4% 25/03/15	30,000	26,155.22
STARBUCKS CORP 2% 27/03/12	200,000	182,031.23
STARBUCKS CORP 3.5% 28/03/01	50,000	47,821.85
STARBUCKS CORP 3.8% 25/08/15	100,000	99,847.72
STEEL DYNAMICS INC 2.8% 24/12/15	150,000	145,043.17
STIFEL FIANCIAL 4.25% 24/07/18	100,000	99,783.94
STORE CAPITAL CORP 4.625% 29/03/15	50,000	48,539.94
STRYKER CORP 1.95% 30/06/15	100,000	83,023.64
STRYKER CORP 3.5% 26/03/15	25,000	24,551.02
SUMITOMO MITSUI FINANCIA 3.784% 26/03/09	150,000	146,629.71
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.948% 26/01/12	200,000	177,763.82
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 1.902% 28/09/17	200,000	168,986.82
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.222% 31/09/17	200,000	160,196.89
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.348% 25/01/15	300,000	286,222.99
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.448% 24/09/27	200,000	192,672.51
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.364% 27/07/12	200,000	189,163.21
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.544% 28/01/17	100,000	94,770.19
SUN COMMUNITIES OPER LP 4.2% 32/04/15	100,000	89,919.08
SUNOCO LOGISTICS PARTNER 4.25% 24/04/01	60,000	59,686.68
SUNTRUST BANK 3.3% 26/05/15	200,000	192,677.94
SUNTRUST BANKS INC 4% 25/05/01	150,000	149,829.79
SUTTER HEALTH 2.294% 30/08/15	100,000	85,261.50
SUZANO AUSTRIA GMBH 6% 29/01/15	200,000	197,007.94
SVB FINANCIAL GROUP 3.5% 25/01/29	150,000	146,462.36
SYNCHRONY FINANCIAL 2.875% 31/10/28	50,000	37,732.01
SYNCHRONY FINANCIAL 3.7% 26/08/04	150,000	139,353.52
SYNCHRONY FINANCIAL 4.875% 25/06/13	100,000	98,620.55
SYSCO CORPORATION 2.45% 31/12/14	100,000	82,786.56
SYSCO CORPORATION 5.95% 30/04/01	120,000	127,439.31
TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.05% 30/03/31	200,000	167,115.63
TAKEDA PHARMACEUTICAL 4.4% 23/11/26	200,000	201,536.71
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF 3.55% 25/04/14	100,000	98,401.17
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF 4% 32/04/14	100,000	93,520.94
TARGA RESOURCES PARTNERS 6.875% 29/01/15	200,000	202,500.00
TARGET CORP 2.25% 25/04/15	100,000	96,264.77
TARGET CORP 2.65% 30/09/15	100,000	89,922.77
TC PIPELINES LP 3.9% 27/05/25	40,000	39,044.35
SYNNEX CORP 2.65% 31/08/09	100,000	79,757.39
TECK RESOURCES LIMITED 3.9% 30/07/15	100,000	90,378.21
TELEFONICA EMISIONES SAU 4.103% 27/03/08	150,000	146,591.09
TELUS CORP 2.8% 27/02/16	50,000	47,140.89
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.375% 25/03/12	130,000	122,834.74
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.25% 29/09/04	65,000	57,768.58
TEXTRON INC 3% 30/06/01	100,000	86,640.03
TEXTRON INC 4% 26/03/15	25,000	24,606.28
TEXTRON INC 4.3% 24/03/01	115,000	115,509.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC 0.797% 23/10/18	80,000	77,552.63
THERMO FISHER SCIENTIFIC 1.215% 24/10/18	75,000	71,510.12
THERMO FISHER SCIENTIFIC 1.75% 28/10/15	35,000	30,597.78

TIMKEN CO/THE 3.875% 24/09/01	70,000	69,097.26
T-MOBILE USA INC 3.75% 27/04/15	650,000	626,760.38
T-MOBILE USA INC 3.875% 30/04/15	200,000	187,312.77
TORONTO-DOMINION BANK 0.55% 24/03/04	250,000	237,822.07
TORONTO-DOMINION BANK 0.7% 24/09/10	200,000	186,962.65
TORONTO-DOMINION BANK 1.25% 24/12/13	65,000	61,208.34
TORONTO-DOMINION BANK 2.35% 24/03/08	100,000	97,802.50
TORONTO-DOMINION BANK 2.8% 27/03/10	100,000	93,681.52
TORONTO-DOMINION BANK 3.5% 23/07/19	200,000	200,249.32
TORONTO-DOMINION BANK 3.625% 31/09/15	200,000	191,762.46
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.829% 30/01/10	100,000	90,325.93
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.7% 24/01/15	100,000	100,108.88
TOTAL CAPITAL INTL SA 3.75% 24/04/10	150,000	150,360.29
TOYOTA MOTOR CORP 0.681% 24/03/25	400,000	381,252.26
TOYOTA MOTOR CORP 3.419% 23/07/20	100,000	100,059.62
TOYOTA MOTOR CORP 3.669% 28/07/20	70,000	68,061.22
TOYOTA MOTOR CREDIT 2.25% 23/10/18	200,000	197,207.99
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8% 25/02/13	200,000	190,311.58
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.9% 28/04/06	100,000	88,506.00
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.9% 31/09/12	100,000	81,882.89
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15% 30/02/13	100,000	86,335.23
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.2% 27/01/11	100,000	96,582.03
TRANSCANADA PIPELINES 1% 24/10/12	60,000	55,971.82
TRANSCANADA PIPELINES 4.1% 30/04/15	100,000	95,095.45
TRANSCANADA PIPELINES 4.25% 28/05/15	150,000	146,378.35
TRANSCONT GAS PIPE LINE 3.25% 30/05/15	150,000	134,019.18
TRIMBLE INC 4.9% 28/06/15	100,000	96,245.00
TRUIST BANK 1.5% 25/03/10	250,000	235,747.66
TRUIST FINANCIAL CORP 1.267% 27/03/02	60,000	53,804.27
TRUIST FINANCIAL CORP 1.887% 29/06/07	225,000	192,438.14
TRUIST FINANCIAL CORP 1.95% 30/06/05	65,000	53,876.98
TSMC ARIZONA CORP 2.5% 31/10/25	200,000	169,256.02
TUCSON ELECTRIC POWER CO 3.25% 32/05/15	100,000	89,635.38
TYCO ELECTRONICS GROUP 3.7% 26/02/15	100,000	99,186.88
TYSON FOODS INC 3.9% 23/09/28	40,000	40,117.10
TYSON FOODS INC 3.95% 24/08/15	100,000	99,975.38
TYSON FOODS INC 4.35% 29/03/01	100,000	98,907.65
UDR INC 3% 31/08/15	50,000	42,566.83
UNILEVER CAPITAL CORP 1.75% 31/08/12	100,000	81,967.47
UNILEVER CAPITAL CORP 3.1% 25/07/30	100,000	98,264.10
UNILEVER CAPITAL CORP 3.25% 24/03/07	100,000	100,036.43
UNILEVER CAPITAL CORP 3.5% 28/03/22	100,000	98,103.99
UNION ELECTRIC CO 2.95% 27/06/15	50,000	47,581.18
UNION PACIFIC CORP 2.75% 26/03/01	100,000	96,036.21
UNION PACIFIC CORP 3.7% 29/03/01	200,000	194,231.33
UNITED AIR 2020-1 A PTT 5.875% 27/10/15	211,710	209,420.52
UNITED AIR 2020-1 B PTT 4.875% 26/01/15	83,000	78,626.36
UNITED PARCEL SERVICE 2.2% 24/09/01	20,000	19,489.92
UNITED PARCEL SERVICE 3.05% 27/11/15	150,000	145,537.89
UNITED PARCEL SERVICE 3.9% 25/04/01	100,000	100,749.08
UNITEDHEALTH GROUP INC 0.55% 24/05/15	65,000	61,884.31
UNITEDHEALTH GROUP INC 1.15% 26/05/15	100,000	90,913.78
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.375% 24/08/15	70,000	68,631.09
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.875% 29/08/15	75,000	69,308.43
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.45% 27/01/15	100,000	98,182.67
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.5% 24/02/15	20,000	20,031.45
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7% 25/12/15	20,000	19,914.87
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.875% 28/12/15	25,000	24,762.12
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.2% 32/05/15	100,000	100,657.53

UNIVERSAL HEALTH SVCS 1.65% 26/09/01	65,000	55,508.47
UNUM GROUP 4% 24/03/15	100,000	99,747.51
URD INC 2.95% 26/09/01	25,000	23,502.65
US BANCORP 2.375% 26/07/22	150,000	141,112.44
US BANCORP 2.4% 24/07/30	100,000	97,670.12
US BANCORP 3.15% 27/04/27	100,000	95,539.17
US BANK NA CINCINNATI 2.05% 25/01/21	250,000	239,243.67
US BANK NA CINCINNATI 3.4% 23/07/24	150,000	149,771.70
VALE OVERSEAS LIMITED 3.75% 30/07/08	100,000	87,651.00
VALERO ENERGY CORP 4.35% 28/06/01	70,000	67,755.88
VENTAS REALTY LP 3.5% 25/02/01	100,000	97,305.40
VENTAS REALTY LP 4.4% 29/01/15	100,000	95,687.03
VERISIGN INC 2.7% 31/06/15	100,000	81,133.88
VERISK ANALYTICS INC 4% 25/06/15	100,000	98,822.55
VERIZON COMMUNICATIONS 0.75% 24/03/22	250,000	238,904.33
VERIZON COMMUNICATIONS 1.68% 30/10/30	197,000	159,093.81
VERIZON COMMUNICATIONS 2.355% 32/03/15	200,000	166,369.82
VERIZON COMMUNICATIONS 3.376% 25/02/15	300,000	298,159.50
VERIZON COMMUNICATIONS 4.016% 29/12/03	200,000	194,815.78
VERIZON COMMUNICATIONS 4.125% 27/03/16	200,000	199,805.30
VERIZON COMMUNICATIONS 4.329% 28/09/21	200,000	199,414.53
VF CORP 2.95% 30/04/23	65,000	56,740.36
VIACOMCBS INC 3.7% 28/06/01	200,000	185,597.35
VIATRIS INC 2.3% 27/06/22	100,000	85,806.04
VIATRIS INC 2.7% 30/06/22	100,000	79,889.55
VICI PROPERTIES LP 4.95% 30/02/15	100,000	94,362.00
VIRGINIA ELEC & POWER CO 3.1% 25/05/15	100,000	97,941.26
VIRGINIA ELECTRIC & POWE 3.15% 26/01/15	200,000	194,516.76
VISA INC 1.9% 27/04/15	350,000	323,159.43
VISA INC 2.75% 27/09/15	50,000	47,880.44
VMWARE INC 1% 24/08/15	65,000	60,671.09
VMWARE INC 1.4% 26/08/15	140,000	123,507.81
VMWARE INC 3.9% 27/08/21	100,000	96,204.76
VODAFONE GROUP PLC 4.375% 28/05/30	300,000	297,805.50
VORNADO REALTY LP 3.5% 25/01/15	100,000	96,619.72
VOYA FINANCIAL 3.65% 26/06/15	100,000	96,783.04
VULCAN MATERIALS CO 4.5% 25/04/01	100,000	101,411.93
WABTEC 4.95% 28/09/15	150,000	143,875.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.2% 30/04/15	75,000	65,856.26
WALMART INC 1.05% 26/09/17	65,000	59,186.98
WALMART INC 1.5% 28/09/22	400,000	349,222.56
WALMART INC 2.375% 29/09/24	11,000	9,988.97
WALMART INC 3.55% 25/06/26	100,000	100,431.88
WALT DISNEY COMPANY/THE 2% 29/09/01	265,000	228,197.10
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.2% 28/01/13	270,000	244,270.55
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.95% 27/06/15	100,000	95,199.45
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.7% 24/09/15	100,000	100,141.55
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.8% 30/03/22	100,000	96,442.47
WASTE CONNECTIONS INC 3.5% 29/05/01	100,000	93,712.70
WASTE MANAGEMENT INC 2% 29/06/01	100,000	86,510.13
WASTE MANAGEMENT INC 4.15% 32/04/15	100,000	97,749.36
WEC ENERGY GROUP INC 0.55% 23/09/15	100,000	96,490.00
WEIBO CORP 3.375% 30/07/08	200,000	161,892.84
WELLS FARGO & CO 3.55% 25/09/29	200,000	196,329.19
WELLS FARGO & COMPANY 0.805% 25/05/19	85,000	79,539.91
WELLS FARGO & COMPANY 2.164% 26/02/11	325,000	305,895.13
WELLS FARGO & COMPANY 2.188% 26/04/30	95,000	88,916.85
WELLS FARGO & COMPANY 3% 25/02/19	200,000	195,283.47
WELLS FARGO & COMPANY 3.196% 27/06/17	200,000	189,968.57

WELLS FARGO & COMPANY 3.35% 33/03/02	355,000	315,698.73
WELLS FARGO & COMPANY 3.584% 28/05/22	465,000	442,090.27
WELLS FARGO & COMPANY 3.75% 24/01/24	250,000	250,634.81
WELLS FARGO & COMPANY 3.908% 26/04/25	145,000	142,669.83
WELLS FARGO & COMPANY 4.1% 26/06/03	100,000	98,807.89
WELLS FARGO & COMPANY 4.125% 23/08/15	100,000	100,477.37
WELLS FARGO & COMPANY 4.15% 29/01/24	250,000	242,324.19
WELLTOWER INC 2.05% 29/01/15	60,000	50,399.79
WELLTOWER INC 2.7% 27/02/15	100,000	92,304.60
WELLTOWER INC 3.625% 24/03/15	130,000	128,959.58
WELLTOWER INC 4.25% 28/04/15	50,000	48,377.43
WESTERN DIGITAL CORP 2.85% 29/02/01	200,000	161,121.07
WESTLAKE CHEMICAL CORP 0.875% 24/08/15	100,000	95,293.92
WESTPAC BANKING CORP 1.019% 24/11/18	100,000	93,973.57
WESTPAC BANKING CORP 2.15% 31/06/03	100,000	83,303.79
WESTPAC BANKING CORP 2.668% 35/11/15	85,000	67,417.66
WESTPAC BANKING CORP 2.894% 30/02/04	100,000	94,297.39
WESTPAC BANKING CORP 3.02% 36/11/18	100,000	79,442.35
WESTPAC BANKING CORP 3.35% 27/03/08	100,000	96,335.29
WESTPAC BANKING CORP 3.735% 25/08/26	100,000	99,220.16
WESTPAC BANKING CORP 4.11% 34/07/24	150,000	135,933.96
WESTPAC BANKING CORP 4.322% 31/11/23	100,000	95,832.77
WHIRLPOOL CORP 3.7% 25/05/01	100,000	98,433.08
WILLIAMS COMPANIES INC 4.55% 24/06/24	140,000	140,917.37
WILLIAMS PARTNERS LP 4.3% 24/03/04	200,000	200,311.70
WILLIS NORTH AMERICA INC 3.6% 24/05/15	50,000	49,065.66
WILLIS NORTH AMERICA INC 4.5% 28/09/15	100,000	96,201.77
WISCONSIN ELECTRIC POWER 1.7% 28/06/15	65,000	56,511.21
WORKDAY INC 3.8% 32/04/01	100,000	91,324.65
WRKCO INC 4% 28/03/15	50,000	48,497.88
WRKCO INC 4.9% 29/03/15	200,000	200,879.83
WW GRAINGER INC 1.85% 25/02/15	50,000	47,470.38
WYETH 6.45% 24/02/01	100,000	104,403.25
XCEL ENERGY INC 0.5% 23/10/15	100,000	96,194.71
XCEL ENERGY INC 1.75% 27/03/15	85,000	75,791.87
XCEL ENERGY INC 4% 28/06/15	50,000	48,626.09
XYLEM INC 3.25% 26/11/01	55,000	53,049.27
ZIMMER BIOMET HOLDINGS 3.05% 26/01/15	100,000	96,130.06
ZOETIS INC 2% 30/05/15	100,000	83,651.92
ZOETIS INC 3.9% 28/08/20	25,000	24,088.87
アメリカ・ドル 小計	166,198,117	155,948,427.89 (21,282,281,954)
社債券 小計		21,282,281,954 (21,282,281,954)
合計		21,282,281,954 (21,282,281,954)

(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 1,279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】

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>

【純資産額計算書】

(2022年7月29日現在)

資産総額	269,854,941円
負債総額	133,178,059円
純資産総額(-)	136,676,882円
発行済口数	163,294,591口
1口当たり純資産額(/)	0.8370円

<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）

(2022年7月29日現在)

資産総額	22,251,714,287円
負債総額	346,709,069円
純資産総額(-)	21,905,005,218円
発行済口数	9,259,354,968口
1口当たり純資産額(/)	2.3657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年間にお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。

2022年7月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、123本であり、その純資産総額は2,828,745百万円です（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（2021年4月1日から2022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 (2021年3月31日現在)		当事業年度 (2022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	3,455,294		4,391,110	
有価証券	22,281		23,294	
前払金	59,450		119,649	
前払費用	20,090		29,290	
未収入金	795,709		688,466	
未収還付法人税等	592		-	
未収委託者報酬	651,298		685,229	
未収収益	41,992		42,751	
流動資産計	5,046,710	70.1	5,979,793	75.8
固定資産				
有形固定資産	4,695		375	
建物附属設備	1	-	0	
器具備品	1	4,695	375	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,149,769		1,904,306	
長期差入保証金	55,283		71,694	
繰延税金資産	2,088,211		1,826,336	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,154,465	29.9	1,904,682	24.2
資産合計	7,201,176	100.0	7,884,475	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2021年3月31日現在)		当事業年度 (2022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	141,855		172,682	
未払金	300,612		344,370	
未払手数料	163,883		177,539	
その他未払金	136,728		166,831	
未払費用	11,026		11,699	
未払法人税等	-		296,332	
未払消費税等	79,008		30,068	
賞与引当金	76,891		74,876	
流動負債計	609,394	8.5	930,030	11.8
固定負債				
退職給付引当金	81,500		84,840	
固定負債計	81,500	1.1	84,840	1.1
負債合計	690,894	9.6	1,014,871	12.9
(純資産の部)		%		%

株主資本		6,510,281	90.4		6,869,604	87.1
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	6,091,161			6,450,484		
純資産合計		6,510,281	90.4		6,869,604	87.1
負債・純資産合計		7,201,176	100.0		7,884,475	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日		当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
		%		%
営業収益				
委託者報酬	2,468,063		2,655,508	
投資顧問収入	2,871,928		3,030,659	
その他営業収益	78,227		85,660	
営業収益計	5,418,219	100.0	5,771,828	100.0
営業費用				
支払手数料	631,100		711,649	
広告宣伝費	28,458		53,735	
公告費	1,140		1,140	
調査費	527,766		712,486	
調査費	268,033		407,466	
委託調査費	259,021		304,641	
図書費	711		378	
委託計算費	242,239		485,872	
営業雑経費	38,381		29,696	
通信費	4,038		3,997	
印刷費	11,238		7,276	
協会費	18,183		12,853	
諸会費	5		55	
その他	4,915		5,512	
営業費用計	1,469,086	27.1	1,994,579	34.6
一般管理費				
給料	1,307,873		1,568,661	
役員報酬	235,947		425,268	
給料・手当	800,039		787,766	
賞与	210,310		285,950	
賞与引当金繰入額	61,576		69,676	
交際費	728		1,607	
旅費交通費	801		676	
租税公課	6,244		32,240	
不動産賃借料	91,686		60,478	
退職給付費用	71,604		74,675	
固定資産減価償却費	20,149		2,571	
福利厚生費	126,174		130,238	

諸経費		202,081			186,753	
一般管理費計		1,827,345	33.7		2,057,903	35.7
営業利益		2,121,787	39.2		1,719,345	29.8
営業外収益						
為替差益		123			18	
有価証券運用益		1,026			1,013	
雑収入		36			881	
営業外収益計		1,186	0.0		1,913	0.0
営業外費用						
移転価格調整金		1,306,329			363,220	
為替差損		656			214	
有価証券運用損		-			1	
雑損失		193			329	
営業外費用計		1,307,179	24.1		363,766	6.3
経常利益		815,794	15.1		1,357,491	23.5
特別利益						
事業再構築費用戻入		102			7,084	
特別利益計		102	0.0		7,084	0.1
特別損失						
事務処理損失		8,806			146	
固定資産除却損		45,130			2,326	
特別損失計		53,937	1.0		2,472	0.0
税引前当期純利益		761,960	14.1		1,362,102	23.6
法人税,住民税及び事業税		530	0.0		261,905	4.5
法人税等調整額		281,513	5.2		261,874	4.5
当期純利益		479,916	8.9		838,322	14.5

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

(単位：千円)

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本合計	
		利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計		
			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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本合計	
		利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計		
			別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(479,000)	(479,000)	(479,000)	(479,000)
当期純利益	-	-	-	838,322	838,322	838,322	838,322
当期変動額合計	-	-	-	359,322	359,322	359,322	359,322
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604

[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	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。 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 of 翌事業年度に一括損益処理しております。
5. 収益の計上方法	(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。 (2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。
6. 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。

会計方針の変更

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。この変更による当財務諸表への影響はありません。

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 令和元年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 令和元年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。この変更による当財務諸表への影響はありません。

表示方法の変更

従来、損益計算書の「一般管理費」の「事務手数料」に含めていたステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払う「移転価格調整金」は、グループ内の精算の目的等をより適切に反映させるため、当事業年度より「営業外費用」の「移転価格調整金」として表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の損益計算書において「一般管理費」の「事務手数料」として表示していた1,306,329千円を「営業外費用」の「移転価格調整金」として組替えて表示しています。

この変更により、従来の方と比べて、当事業年度の営業利益は363,220千円、前事業年度の営業利益は1,306,329千円、それぞれ増加しています。経常利益以下に影響はありません。

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 1,826,336千円

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。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2021年3月31日現在)	当事業年度 (2022年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品 52,734千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品 30,399千円
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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金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85,395千円は、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363,220千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金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 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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	利益剰余金	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28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。

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。

2022年3月31日現在

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在、前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

(有価証券関係)

前事業年度 (2021年3月31日現在)	当事業年度 (2022年3月31日現在)
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	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 23,294千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,011千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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 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	51,930	
退職給付債務の期末残高	450,505	

(単位：千円)

	当事業年度	
	自 2021年4月 1日	至 2022年3月31日
退職給付債務の期首残高	450,505	
勤務費用	58,354	
利息費用	-	
数理計算上の差異の発生額	10,018	
退職給付の支払額	18,668	
退職給付債務の期末残高	480,173	

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 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	

(単位：千円)

	当事業年度	
	自 2021年4月 1日	至 2022年3月31日
年金資産の期首残高	368,935	
期待運用収益	2,728	

数理計算上の差異の発生額	2,919
事業主からの拠出額	52,354
退職給付の支払額	18,668
年金資産の期末残高	402,431

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 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
	<u>81,570</u>
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
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	<u>81,500</u>

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
積立型制度の退職給付債務	480,173
年金資産	402,431
	<u>77,742</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	77,742
未認識数理計算上の差異	7,098
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	<u>84,840</u>

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 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	<u>55,966</u>
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	55,694
(1)勤務費用	58,354
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,728
(4)過去勤務費用の費用処理額	0
(5)数理計算上の差異の費用処理額	69
(6)その他	-

6．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2022年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.1%
その他	1.9%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (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

	当事業年度 (2022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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日		当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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	
賞与引当金繰入超過額	21,034	賞与引当金繰入超過額	19,674
退職給付引当金	26,660	退職給付引当金	27,681
(注) 繰越欠損金	1,987,863	(注) 繰越欠損金	1,727,082
その他	52,654	その他	51,898
繰延税金資産 合計	2,088,211	繰延税金資産 合計	1,826,336
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	2,088,211	繰延税金資産の純額	1,826,336

（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（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)	-	-	-	-	848,990	1,138,872	1,987,863
繰延税金資産	-	-	-	-	848,990	1,138,872	1,987,863

(*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。

当事業年度（2022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)	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082
繰延税金資産	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082

(*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1,727,082千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,727,082千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（2021年3月31日現在）	当事業年度（2022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	6.8%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%
その他	0.4%	その他	0.2%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	37.0%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%
	=====		=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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14,661千円であります。当事業年度において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、20,679千円減少しました。

（収益認識関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社は、「（セグメント情報）」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社は、「（セグメント情報）」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

（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 2020年4月1日 至 2021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	前事業年度 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)	
						関連当事者との関係 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		19,408
								人件費等及び事務手数料の受取	77,977			
							移転価格調整金の支払	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	投資信託計理業務委託	38,231	前払金	59,280	
							兼職社員の人件費支払等	人件費等の支払	133,561			
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク・イングランド	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	17,282	-	-	
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シカゴ	シカゴ	136万シカゴドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	249 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

1. 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。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当事業年度 自 2021年4月1日 至 2022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 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
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	351,919	前払金	598
								投資顧問料の支払	221,949		
								ソフトウェアの使用契約	396,782	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	85,395		
							移転価格調整金の支払	363,220			
	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	38,999	前払金	119,051	
							兼職社員の人件費支払等	127,476			
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・コングラーム	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	19,193	-	-	
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	264	-	-	
							投資顧問料の支払	24,400			

(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

1. 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。
2. 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。
3. 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。

4. 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。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
1株当たり純資産 1,050,045円38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、記載していません。	1株当たり純資産 1,108,000円68銭 1株当たり当期純利益 135,213円36銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

(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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
当期純利益 (千円)	479,916	838,322
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)	479,916	838,322
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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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。)。

通常の見積り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（2022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（2022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 (2022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。
楽天証券株式会社	17,495百万円 (2022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 (2022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。
マネックス証券株式会社	12,200百万円 (2022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：1,098百万ドル（2021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

2022年9月16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2022年1月12日から2022年7月11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2022年7月11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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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. 上記の監査報告書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

2022年6月22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2021年4月1日から2022年3月31日までの第25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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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す。