

【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】	2023年10月10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】	久保 政喜
【電話番号】	03-4530-7297
【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】	1兆5,000億円を上限とします。
【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、2023年4月10日付をもって提出した有価証券届出書（2023年7月5日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。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】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

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）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、米国の投資適格社債を主要投資対象とした「米国社債インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）に投資を行い、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、ブルームバーグ米国社債（1 - 10年）インデックス（円ヘッジベース）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加できるものとします。

また委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

<略>

ファンドの特色

<略>

## 投資対象とするマザーファンドの概要

### 米国社債インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円換算ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	米国社債の投資適格銘柄
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。</li> <li>・厳密な層化抽出法に従って米国クレジット債券市場のエクスポージャーを幅広く確保しつつ、発行体レベルの保守的なリスク管理により発行体の分散最大化に配慮します。</li> <li>・米国社債の投資割合は原則として高位を維持します。</li> <li>・外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。</li> </ul>

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

## ■ ベンチマーク(オリジナル指数)

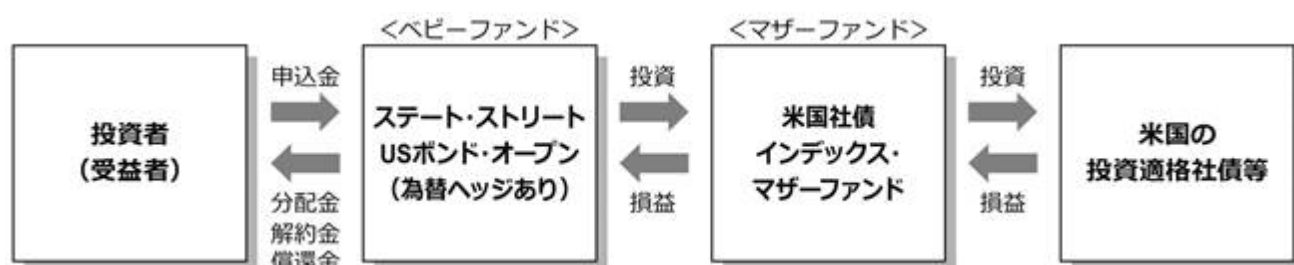
### ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス

「Bloomberg®」およびブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、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、当社)による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグは当社とは提携しておらず、また、ステート・ストリートUSボンド・オープン(為替ヘッジあり)(以下、当ファンド)を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、当ファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

(2) 【ファンドの沿革】 <略>

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



~ <略>

## 2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

<訂正前>

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として米国社債の投資適格銘柄に実質的に投資を行い、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(Bloomberg US Intermediate Corporate Index、円ヘッジベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。

ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(Bloomberg US Intermediate Corporate Index、円ヘッジベース)をベンチマークとします。

~ <略>

(2) ~ (4) <略>

(5) 【投資制限】

~ <略>

(参考) 「米国社債インデックス・マザーファンド」の概要

<略>

(1) 投資方針

この投資信託は、米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とし、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(Bloomberg US Intermediate Corporate Index、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とします。

ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(Bloomberg US Intermediate Corporate Index、円ベース)をベンチマークとします。

~ <略>

(2)~(3) <略>

<訂正後>

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として米国社債の投資適格銘柄に実質的に投資を行い、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。

ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円ヘッジベース)をベンチマークとします。

~ <略>

(2)~(4) <略>

(5)【投資制限】

~ <略>

(参考)「米国社債インデックス・マザーファンド」の概要

<略>

(1) 投資方針

この投資信託は、米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とし、ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

米国社債の投資適格銘柄を主要投資対象とします。

ブルームバーグ米国社債(1-10年)インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。

~ <略>

(2)~(3) <略>

### 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>

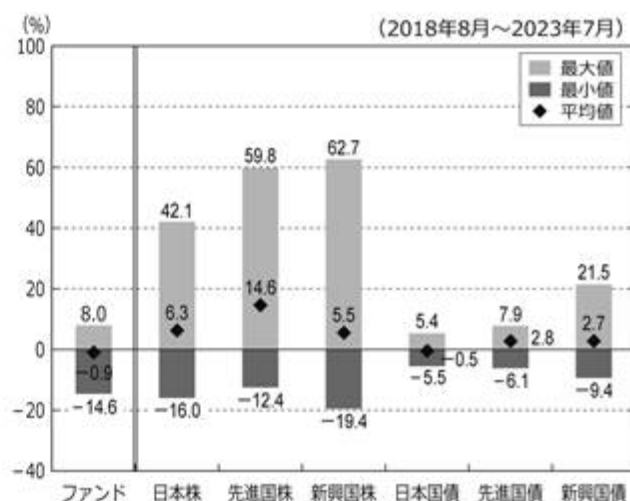
## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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：TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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>

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<略>

<略>

少額投資非課税制度（NISA）、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資者に対する課税

<略>

<略>

上記は、2023年1月末現在のもので、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>

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<略>

<略>

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資者に対する課税

<略>

<略>

上記は、2023年7月末現在のもので、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】

(2023年7月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	167,838,789	98.25
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,991,248	1.75
純資産総額		170,830,037	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)

(2023年7月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	日本	1,129,714,322	3.08
	アメリカ	29,875,664,892	81.45
	イギリス	1,668,863,979	4.55
	カナダ	1,388,680,766	3.79
	オランダ	365,044,971	0.99
	オーストラリア	361,201,012	0.98
	スペイン	210,991,445	0.58
	アイルランド	193,373,621	0.53
	ケイマン諸島	192,832,785	0.53
	ドイツ	184,836,230	0.50
	シンガポール	162,106,410	0.44
	スイス	155,283,389	0.42
	ルクセンブルク	109,973,089	0.30
	フランス	87,595,592	0.24
	バミューダ	65,181,462	0.18
	オーストリア	62,032,796	0.17
	メキシコ	45,700,220	0.12
ジャージー	26,771,353	0.07	
チリ	13,548,570	0.04	
	小計	36,299,396,904	98.96
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		380,460,005	1.04
純資産総額		36,679,856,909	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】

(2023年7月31日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	米国社債インデックス・マザーファンド		67,586,997	2.4829	167,817,232	2.4833	167,838,789	98.25

(注1)投資有価証券は1銘柄です。

(注2)投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
親投資信託受益証券	-	98.25
合計		98.25

（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。

## &lt; 参考情報 &gt;

## 親投資信託受益証券（米国社債インデックス・マザーファンド）

## 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2023年7月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.500	2025/04/01	1,300,000	13,583.00	176,579,098	13,575.42	176,480,542	0.48
2	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.223	2029/05/01	1,100,000	13,159.54	144,755,044	13,347.13	146,818,501	0.40
3	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	5.015	2033/07/22	1,000,000	13,606.92	136,069,257	13,719.98	137,199,890	0.37
4	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	3.700	2026/01/12	1,000,000	13,501.41	135,014,183	13,543.93	135,439,356	0.37
5	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.565	2030/06/14	1,000,000	13,385.08	133,850,856	13,509.22	135,092,211	0.37
6	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	0.981	2025/09/25	1,000,000	13,123.95	131,239,580	13,278.28	132,782,800	0.36
7	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	2.083	2026/04/22	1,000,000	13,089.12	130,891,219	13,250.66	132,506,608	0.36
8	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	4.412	2031/03/31	1,000,000	13,098.99	130,989,925	13,224.80	132,248,044	0.36
9	イギリス	社債券	BARCLAYS PLC	4.836	2028/05/09	1,000,000	13,172.02	131,720,283	13,084.85	130,848,567	0.36
10	アメリカ	社債券	APPLE INC	1.200	2028/02/08	1,000,000	11,961.77	119,617,776	12,194.58	121,945,845	0.33
11	イギリス	社債券	NATWEST GROUP PLC	4.892	2029/05/18	900,000	13,384.67	120,462,087	13,447.71	121,029,459	0.33
12	アメリカ	社債券	AT&T INC	1.650	2028/02/01	1,000,000	11,972.31	119,723,129	12,016.16	120,161,627	0.33
13	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	2.875	2031/02/15	1,000,000	11,705.31	117,053,184	11,926.35	119,263,580	0.33
14	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	2.871	2032/11/22	1,000,000	11,155.98	111,559,874	11,363.63	113,636,300	0.31
15	イギリス	社債券	HSBC HOLDINGS PLC	5.210	2028/08/11	800,000	13,748.80	109,990,433	13,787.29	110,298,321	0.30
16	アメリカ	社債券	JOHN DEERE CAPITAL CORP	4.050	2025/09/08	800,000	13,790.13	110,321,070	13,774.65	110,197,246	0.30
17	アメリカ	社債券	ABBVIE INC	3.600	2025/05/14	800,000	13,552.35	108,418,872	13,645.97	109,167,784	0.30
18	アメリカ	社債券	BOEING CO	2.196	2026/02/04	800,000	12,717.51	101,740,127	12,993.40	103,947,265	0.28



19	アイ ルラ ンド	社債券	AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	3.300	2032/01/30	900,000	11,378.44	102,405,976	11,528.29	103,754,642	0.28
20	アメ リカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	4.080	2026/04/26	750,000	13,727.79	102,958,497	13,736.53	103,024,045	0.28
21	アメ リカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	2.383	2032/07/21	915,000	11,196.34	102,446,555	11,233.41	102,785,732	0.28
22	アメ リカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	3.419	2028/12/20	783,000	12,805.55	100,267,494	12,939.12	101,313,366	0.28
23	アメ リカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	4.150	2029/01/24	750,000	13,259.55	99,446,656	13,340.39	100,052,981	0.27
24	ドイ ツ	社債券	DEUTSCHE BANK NY	6.119	2026/07/14	700,000	14,034.85	98,243,978	14,009.92	98,069,477	0.27
25	アメ リカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	4.827	2026/07/22	700,000	13,866.03	97,062,211	13,873.95	97,117,656	0.26
26	アメ リカ	社債券	AMERICAN EXPRESS CO	3.950	2025/08/01	700,000	13,682.33	95,776,342	13,673.41	95,713,919	0.26
27	カナ ダ	社債券	BANK OF MONTREAL	3.700	2025/06/07	700,000	13,613.01	95,291,123	13,628.43	95,399,052	0.26
28	アメ リカ	社債券	WELLS FARGO & COMPANY	3.000	2025/02/19	700,000	13,495.91	94,471,394	13,560.95	94,926,710	0.26
29	アメ リカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	2.456	2025/10/22	700,000	13,379.59	93,657,189	13,527.79	94,694,587	0.26
30	アメ リカ	社債券	US BANCORP	4.548	2028/07/22	700,000	13,703.28	95,923,014	13,490.17	94,431,231	0.26

（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）2023年7月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（%）
社債券	-	98.96
合計		98.96

（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）2023年7月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

#### （3）【運用実績】

##### 【純資産の推移】

2023年7月31日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間・月末	純資産総額（円）		1口当たりの 純資産額（円）	
第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
第24特定期間	自2022年 7月12日 至2023年 1月10日	分配付： 155,626,154 分配落： 155,334,320	分配付： 0.7999 分配落： 0.7984
第25特定期間	自2023年 1月11日 至2023年 7月10日	分配付： 167,749,818 分配落： 167,422,406	分配付： 0.7685 分配落： 0.7670
	2022年 7月末日	136,676,882	0.8370
	8月末日	137,101,632	0.8203
	9月末日	134,218,383	0.7852
	10月末日	135,850,267	0.7778
	11月末日	147,175,716	0.7918
	12月末日	151,677,703	0.7907
	2023年 1月末日	163,313,045	0.8020
	2月末日	161,050,024	0.7831
	3月末日	163,292,359	0.7892
	4月末日	168,853,240	0.7904
	5月末日	171,744,933	0.7802
	6月末日	167,828,509	0.7729
	7月末日	170,830,037	0.7727

## 【分配の推移】

特定期間	計算期間	一口当たりの分配金
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
第24特定期間	自2022年 7月12日 至2023年 1月10日	0.0090円
第25特定期間	自2023年 1月11日 至2023年 7月10日	0.0090円

## 【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率
第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%
第24特定期間	自2022年 7月12日 至2023年 1月10日	1.6%
第25特定期間	自2023年 1月11日 至2023年 7月10日	2.8%

（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
第24特定期間	自2022年 7月12日 至2023年 1月10日	38,996,175	6,330,284	194,556,552
第25特定期間	自2023年 1月11日 至2023年 7月10日	46,760,431	23,041,695	218,275,288

（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

（2023年7月31日現在）

## 基準価額・純資産の推移



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

## ＜基準価額・純資産総額＞

基準価額	7,727円
純資産総額	171百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第143期（2023年2月10日）	15円
第144期（2023年3月10日）	15円
第145期（2023年4月10日）	15円
第146期（2023年5月10日）	15円
第147期（2023年6月12日）	15円
第148期（2023年7月10日）	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	3,150円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

（マザーファンドのデータを表示しています。）

上位10銘柄<sup>※</sup>

銘柄名	利率	償還日	投資比率
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3.500%	2025/04/01	0.48%
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.223%	2029/05/01	0.40%
BANK OF AMERICA CORP	5.015%	2033/07/22	0.37%
CITIGROUP INC	3.700%	2026/01/12	0.37%
JPMORGAN CHASE & CO	4.565%	2030/06/14	0.37%
BANK OF AMERICA CORP	0.981%	2025/09/25	0.36%
JPMORGAN CHASE & CO	2.083%	2026/04/22	0.36%
CITIGROUP INC	4.412%	2031/03/31	0.36%
BARCLAYS PLC	4.836%	2028/05/09	0.36%
APPLE INC	1.200%	2028/02/08	0.33%

※比率はマザーファンド純資産総額対比です。

## 特性値

	ファンド
修正デュレーション(年)	4.09
最終利回り	5.50%
オプション調整後スプレッド	1.04%

格付別構成比<sup>※</sup>

格付	比率
AAA格	0.50%
AA格	5.86%
A格	45.31%
BBB格	48.31%
BB格以下	0.00%

残存年数別構成比<sup>※</sup>

残存年数	比率
1年未満	0.00%
1～3年	35.43%
3～7年	43.16%
7～10年	21.39%
10年以上	0.00%

※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）



※2023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（2023年1月11日から2023年7月10日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ステート・ストリートUSボンド・オープン(為替ヘッジあり)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 (2023年1月10日現在)	当期 (2023年7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	5,701	453
コール・ローン	497,194	240,900
親投資信託受益証券	153,815,788	165,651,364
派生商品評価勘定	1,800,571	1,875,481
未収入金	-	326,000
流動資産合計	156,119,254	168,094,198
<b>資産合計</b>		
	156,119,254	168,094,198
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	31,582	153,652
未払収益分配金	291,834	327,412
未払解約金	375,595	98,981
未払受託者報酬	5,290	5,646
未払委託者報酬	79,320	84,697
未払利息	1	-
その他未払費用	1,312	1,404
流動負債合計	784,934	671,792
<b>負債合計</b>		
	784,934	671,792
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	194,556,552	218,275,288
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	39,222,232	50,852,882
(分配準備積立金)	5,303,310	5,554,451
元本等合計	155,334,320	167,422,406
<b>純資産合計</b>		
	155,334,320	167,422,406
<b>負債純資産合計</b>		
	156,119,254	168,094,198



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期	当期
	自 2022年7月12日 至 2023年1月10日	自 2023年1月11日 至 2023年7月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,664,553	13,797,682
為替差損益	2,229,254	18,119,519
その他収益	5	-
営業収益合計	1,435,294	4,321,837
営業費用		
支払利息	15	22
受託者報酬	30,799	36,129
委託者報酬	461,940	541,834
その他費用	13,583	8,971
営業費用合計	506,337	586,956
営業利益又は営業損失（ ）	1,941,631	4,908,793
経常利益又は経常損失（ ）	1,941,631	4,908,793
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,941,631	4,908,793
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（ ）	14,046	1,621
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	29,079,165	39,222,232
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,242,436	4,955,355
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,242,436	4,955,355
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,866,538	9,765,636
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	7,866,538	9,765,636
分配金	1,591,380	1,913,197
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,222,232	50,852,882

## (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。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

前期 (2023年1月10日現在)	当期 (2023年7月10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 (2023年1月10日現在)	当期 (2023年7月10日現在)
1 期首元本額	161,890,661円	194,556,552円
期中追加設定元本額	38,996,175円	46,760,431円
期中一部解約元本額	6,330,284円	23,041,695円
2 受益権の総数	194,556,552口	218,275,288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39,222,232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50,852,882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 2022年7月12日 至 2023年1月10日	当期 自 2023年1月11日 至 2023年7月10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>(2022年7月12日から2022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（369,407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（14,328,223円）及び分配準備積立金（4,905,380円）より分配対象収益は19,603,010円（1万口当たり1,194円）であり、うち246,186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8月11日から2022年9月12日までの計算期間)          計算期間末における費用控除後の配当等収益（345,642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（14,747,084円）及び分配準備積立金（4,997,141円）より分配対象収益は20,089,867円（1万口当たり1,200円）であり、うち250,940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9月13日から2022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（335,861円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（15,318,549円）及び分配準備積立金（5,075,323円）より分配対象収益は20,729,733円（1万口当たり1,206円）であり、うち257,792円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>(2023年1月11日から2023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（431,830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（19,589,273円）及び分配準備積立金（5,146,599円）より分配対象収益は25,167,702円（1万口当たり1,231円）であり、うち306,653円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>(2023年2月11日から2023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（398,302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（19,970,272円）及び分配準備積立金（5,235,740円）より分配対象収益は25,604,314円（1万口当たり1,235円）であり、うち310,743円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>(2023年3月11日から2023年4月10日までの計算期間)          計算期間末における費用控除後の配当等収益（496,872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（20,054,655円）及び分配準備積立金（5,259,605円）より分配対象収益は25,811,132円（1万口当たり1,245円）であり、うち310,837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10月12日から2022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(287,306円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(15,856,352円)及び分配準備積立金(5,136,857円)より分配対象収益は21,280,515円(1万口当たり1,208円)であり、うち264,226円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年4月11日から2023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(397,748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(21,395,330円)及び分配準備積立金(5,399,971円)より分配対象収益は27,193,049円(1万口当たり1,249円)であり、うち326,341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11月11日から2022年12月12日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(414,410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(17,182,024円)及び分配準備積立金(5,147,256円)より分配対象収益は22,743,690円(1万口当たり1,216円)であり、うち280,402円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年5月11日から2023年6月12日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(519,600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(21,873,608円)及び分配準備積立金(5,419,526円)より分配対象収益は27,812,734円(1万口当たり1,259円)であり、うち331,211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12月13日から2023年1月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(376,137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(18,182,786円)及び分配準備積立金(5,219,007円)より分配対象収益は23,777,930円(1万口当たり1,222円)であり、うち291,834円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年6月13日から2023年7月10日までの計算期間)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(463,958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(21,782,319円)及び分配準備積立金(5,417,905円)より分配対象収益は27,664,182円(1万口当たり1,267円)であり、うち327,412円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 (2023年1月10日現在)	当期 (2023年7月10日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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 (2023年1月10日現在)	当 期 (2023年7月10日現在)
	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,088,716	2,718,169
合 計	4,088,716	2,718,169

## (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 (2023年1月10日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
		うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	262,851	262,863	12
	売建 アメリカ・ドル	152,541,452	150,772,475	1,768,977
	合 計	152,804,303	151,035,338	1,768,989

(単位：円)

区 分	種 類	当 期 (2023年7月10日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
		うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	13,218,901	13,065,249	153,652
	売建 アメリカ・ドル	180,266,267	178,390,786	1,875,481
	合 計	193,485,168	191,456,035	1,721,829

## (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 (2023年1月10日現在)	当期 (2023年7月10日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7984円 (7,984円)	0.7670円 (7,670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	66,708,829	165,651,364	
合計		66,708,829	165,651,364	

（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	(2023年1月10日現在)	(2023年7月10日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		84,368,618	79,207,537
金銭信託		143,797	20,343
コール・ローン		12,539,695	10,822,800
社債券		35,573,344,542	36,197,402,338
派生商品評価勘定		37,202	186,369
未収入金		39,096,821	
未収利息		312,372,056	400,532,441
前払費用		62,145,662	6,971,249
流動資産合計		36,084,048,393	36,695,143,077
資産合計		36,084,048,393	36,695,143,077
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,810	
未払金		80,942,214	28,508,000
未払解約金		4,412,364	15,410,030
未払利息		33	29
その他未払費用			3
流動負債合計		85,358,421	43,918,062
負債合計		85,358,421	43,918,062
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,716,848,037	14,759,568,245
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		20,281,841,935	21,891,656,770
元本等合計		35,998,689,972	36,651,225,015
純資産合計		35,998,689,972	36,651,225,015
負債純資産合計		36,084,048,393	36,695,143,077

(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）

（2023年1月10日現在）	（2023年7月10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	（2023年1月10日現在）	（2023年7月10日現在）
1 期首元本額	9,197,839,446円	15,716,848,037円
期中追加設定元本額	7,139,299,318円	477,318,286円
期中一部解約元本額	620,290,727円	1,434,598,078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＞	11,729,048,752円	11,715,440,536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）	67,153,804円	66,708,829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＞	469,080,824円	414,602,898円
ステート・ストリート米国社債インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,503,333,373円	528,725,302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	240,695,250円	498,477,955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＞	1,707,536,034円	1,535,612,725円
計	15,716,848,037円	14,759,568,245円
2 受益権の総数	15,716,848,037口	14,759,568,245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	（2023年1月10日現在）	（2023年7月10日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ ん。	同左

2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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	(2023年1月10日現在)	(2023年7月10日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
社債券	1,158,349,736	41,803,149
合計	1,158,349,736	41,803,149

(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	(2023年1月10日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
		うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	6,150,000	6,116,608	33,392
	合 計	6,150,000	6,116,608	33,392

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年7月10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 売建 アメリカ・ドル	15,360,000	15,173,631	186,369
	合 計	15,360,000	15,173,631	186,369

## (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)

	(2023年1月10日現在)	(2023年7月10日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2905円 (22,905円)	2.4832円 (24,832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	142,550.82	
		3M COMPANY 2% 25/02/14	100,000	94,375.03	
		3M COMPANY 3.05% 30/04/15	100,000	89,191.21	
		ABBOTT LABORATORIES 3.75% 26/11/30	100,000	97,055.68	

ABBVIE INC 2.6% 24/11/21	100,000	96,084.94	
ABBVIE INC 2.95% 26/11/21	145,000	134,924.81	
ABBVIE INC 3.6% 25/05/14	800,000	773,569.21	
ABBVIE INC 3.8% 25/03/15	300,000	291,846.19	
ABBVIE INC 4.25% 28/11/14	200,000	192,425.74	
ADOBE INC 2.3% 30/02/01	100,000	86,406.46	
ADVANCE AUTO PARTS 3.5% 32/03/15	40,000	31,760.54	
ADVANCED MICRO DEVICES 3.924% 32/06/01	100,000	92,921.02	
ADVENTIST HEALTH SYS/W 5.43% 32/03/01	100,000	97,568.74	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.65% 24/10/29	150,000	141,017.09	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75% 24/10/29	150,000	140,977.92	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 2.45% 26/10/29	150,000	133,625.36	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.3% 32/01/30	900,000	724,971.68	
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 3.65% 27/07/21	150,000	137,057.43	
AFFILIATED MANAGERS GROU 3.3% 30/06/15	70,000	58,168.17	
AFLAC INC 1.125% 26/03/15	40,000	35,680.37	
AFLAC INC 3.6% 30/04/01	100,000	90,487.85	
AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.1% 30/06/04	60,000	48,570.82	
AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.3% 31/03/12	100,000	80,683.41	
AGREE LP 2% 28/06/15	65,000	53,654.47	
AIR LEASE CORP 2.3% 25/02/01	150,000	141,378.06	
AIR LEASE CORP 2.875% 32/01/15	300,000	237,302.80	
AIR LEASE CORP 3.125% 30/12/01	100,000	82,015.34	
AIR LEASE CORP 3.625% 27/12/01	150,000	135,830.75	
AIR LEASE CORP 4.625% 28/10/01	300,000	279,488.91	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 2.05% 30/05/15	35,000	29,358.62	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS 4.8% 33/03/03	200,000	198,187.16	
AIRCASTLE LTD 4.25% 26/06/15	65,000	61,024.74	
ALBEMARLE CORP 5.05% 32/06/01	100,000	95,435.16	
ALEXANDRIA REAL ESTATE E 4.7% 30/07/01	400,000	375,112.28	
ALIBABA GROUP HOLDING 3.4% 27/12/06	200,000	184,490.29	
ALIBABA GROUP HOLDING 3.6% 24/11/28	100,000	96,904.48	
ALLEGION US HOLDING CO 3.2% 24/10/01	50,000	48,264.89	
ALLEGION US HOLDING CO 3.55% 27/10/01	50,000	45,763.51	
ALLIED WORLD ASSURANCE 4.35% 25/10/29	50,000	47,751.18	
ALLY FINANCIAL INC 4.75% 27/06/09	300,000	276,229.69	
ALLY FINANCIAL INC 8% 31/11/01	200,000	203,597.38	
ALPHABET INC 0.8% 27/08/15	150,000	128,998.76	
ALPHABET INC 1.1% 30/08/15	130,000	103,864.56	
ALTRIA GROUP INC 2.45% 32/02/04	200,000	154,320.46	
ALTRIA GROUP INC 3.4% 30/05/06	25,000	21,766.49	
ALTRIA GROUP INC 4.4% 26/02/14	156,000	152,128.49	
ALTRIA GROUP INC 4.8% 29/02/14	150,000	145,126.95	
AMAZON COM INC 5.2% 25/12/03	50,000	50,251.04	
AMAZON.COM INC 1% 26/05/12	100,000	89,604.24	
AMAZON.COM INC 1.2% 27/06/03	200,000	174,578.67	
AMAZON.COM INC 1.65% 28/05/12	500,000	433,123.08	
AMAZON.COM INC 3.15% 27/08/22	100,000	93,348.92	
AMAZON.COM INC 3.45% 29/04/13	600,000	561,016.27	
AMAZON.COM INC 3.6% 32/04/13	200,000	183,393.62	
AMAZON.COM INC 4.6% 25/12/01	400,000	396,964.50	
AMAZON.COM INC 4.7% 32/12/01	200,000	198,288.30	
AMCOR FINANCE USA INC 5.625% 33/05/26	65,000	63,313.06	
AMCOR FLEXIBLES NORTH AM 2.69% 31/05/25	65,000	52,404.38	
AMER AIRLINE 16-1 AA PTT 3.575% 28/01/15	345,317.45	318,024.80	
AMEREN CORP 3.5% 31/01/15	200,000	176,287.65	
AMEREN CORP 3.65% 26/02/15	100,000	95,042.08	

AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.7% 32/07/21	200,000	189,811.80	
AMERICAN EXPRESS CO 3% 24/10/30	100,000	96,729.56	
AMERICAN EXPRESS CO 3.625% 24/12/05	200,000	194,276.58	
AMERICAN EXPRESS CO 3.95% 25/08/01	700,000	679,276.12	
AMERICAN EXPRESS CO 4.9% 26/02/13	45,000	44,446.55	
AMERICAN EXPRESS CO 4.989% 33/05/26	100,000	94,350.91	
AMERICAN EXPRESS CO 4.99% 26/05/01	250,000	247,152.68	
AMERICAN HOMES 4 RENT 2.375% 31/07/15	100,000	78,346.68	
AMERICAN HONDA FINANCE 1.2% 25/07/08	500,000	461,019.48	
AMERICAN HONDA FINANCE 4.6% 30/04/17	200,000	192,907.76	
AMERICAN INTERNATIONAL 5.125% 33/03/27	100,000	96,065.54	
AMERICAN INTL GROUP 2.5% 25/06/30	67,000	63,124.43	
AMERICAN INTL GROUP 3.9% 26/04/01	100,000	95,791.85	
AMERICAN TOWER CORP 2.9% 30/01/15	50,000	42,544.87	
AMERICAN TOWER CORP 2.95% 25/01/15	200,000	191,213.24	
AMERICAN TOWER CORP 3.65% 27/03/15	500,000	466,086.84	
AMERICAN TOWER CORP 3.95% 29/03/15	300,000	274,443.45	
AMERICAN TOWER CORP 5.5% 28/03/15	100,000	98,766.41	
AMERICAN TOWER CORP 5.65% 33/03/15	100,000	99,983.92	
AMERICAN WATER CAPITAL 3.4% 25/03/01	100,000	96,707.30	
AMERICAN WATER CAPITAL 3.75% 28/09/01	100,000	93,564.47	
AMERICAN WATER CAPITAL C 2.8% 30/05/01	200,000	172,633.94	
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 30/05/15	100,000	85,658.11	
AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45% 27/12/15	100,000	93,021.75	
AMGEN INC 1.65% 28/08/15	600,000	507,595.14	
AMGEN INC 1.9% 25/02/21	65,000	61,275.82	
AMGEN INC 2.2% 27/02/21	170,000	153,451.83	
AMGEN INC 3.35% 32/02/22	90,000	78,039.31	
AMGEN INC 4.2% 33/03/01	100,000	91,777.20	
AMGEN INC 5.15% 28/03/02	150,000	148,705.18	
AMGEN INC 5.25% 25/03/02	35,000	34,877.16	
AMGEN INC 5.25% 30/03/02	100,000	99,084.04	
AMGEN INC 5.25% 33/03/02	600,000	590,247.71	
AMPHENOL CORP 2.05% 25/03/01	100,000	94,297.62	
AMPHENOL CORP 2.2% 31/09/15	60,000	48,258.94	
ANALOG DEVICES INC 1.7% 28/10/01	45,000	38,224.41	
ANALOG DEVICES INC 2.1% 31/10/01	60,000	48,799.64	
ANALOG DEVICES INC 3.45% 27/06/15	100,000	94,102.75	
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV 3.65% 26/02/01	400,000	385,990.64	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 4.75% 29/01/23	400,000	394,540.99	
ANTHEM INC 3.65% 27/12/01	100,000	93,786.80	
ANTHEM INC 4.1% 32/05/15	100,000	91,432.92	
AON CORP 4.5% 28/12/15	200,000	191,267.83	
AON CORP/AON GLOBAL HOLD 2.05% 31/08/23	100,000	78,780.99	
APPALACHIAN POWER CO 3.3% 27/06/01	100,000	92,477.63	
APPLE INC 1.2% 28/02/08	1,000,000	858,966.01	
APPLE INC 1.4% 28/08/05	100,000	85,472.64	
APPLE INC 1.65% 30/05/11	200,000	165,614.84	
APPLE INC 1.7% 31/08/05	200,000	161,837.18	
APPLE INC 1.8% 24/09/11	100,000	96,245.13	
APPLE INC 2.2% 29/09/11	100,000	86,998.92	
APPLE INC 2.5% 25/02/09	400,000	383,533.23	
APPLE INC 2.9% 27/09/12	250,000	232,888.64	
APPLE INC 3.25% 26/02/23	200,000	192,083.09	
APPLE INC 3.35% 27/02/09	350,000	333,373.98	
APPLE INC 3.35% 32/08/08	100,000	91,708.64	
APPLIED MATERIALS INC 1.75% 30/06/01	330,000	271,526.31	

APTIV PLC / APTIV CORP 2.396% 25/02/18	200,000	189,794.67	
ARCELORMITTAL SA 6.55% 27/11/29	100,000	101,970.30	
ARCELORMITTAL SA 6.8% 32/11/29	100,000	100,935.23	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND C 3.25% 30/03/27	300,000	271,606.66	
ARES CAPITAL CORP 2.875% 27/06/15	100,000	86,451.96	
ARES CAPITAL CORP 2.875% 28/06/15	200,000	164,987.82	
ARES CAPITAL CORP 3.875% 26/01/15	300,000	277,828.71	
ARIZONA PUBLIC SERVICE 2.95% 27/09/15	100,000	90,054.55	
ARROW ELECTRONICS INC 3.875% 28/01/12	200,000	184,219.71	
ASSURANT INC 4.9% 28/03/27	100,000	94,556.73	
ASSURED GUARANTY US HLDG 5% 24/07/01	100,000	98,767.99	
ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.875% 28/03/03	200,000	198,580.40	
ASTRAZENECA PLC 3.375% 25/11/16	550,000	528,384.36	
ASTRAZENECA PLC 4% 29/01/17	100,000	95,652.24	
AT&T INC 1.65% 28/02/01	1,000,000	853,124.34	
AT&T INC 1.7% 26/03/25	200,000	181,816.43	
AT&T INC 2.25% 32/02/01	200,000	155,907.66	
AT&T INC 4.3% 30/02/15	200,000	187,492.01	
ATHENE HOLDING LTD 4.125% 28/01/12	150,000	136,378.97	
ATMOS ENERGY CORP 3% 27/06/15	65,000	60,361.59	
AUST & NZ BANKING GRP NY 5.088% 25/12/08	250,000	248,680.94	
AUTODESK INC 4.375% 25/06/15	100,000	97,620.76	
AUTOMATIC DATA PROCESSNG 1.7% 28/05/15	260,000	226,213.84	
AUTONATION INC 1.95% 28/08/01	30,000	24,311.30	
AUTONATION INC 3.5% 24/11/15	100,000	96,334.26	
AUTONATION INC 3.85% 32/03/01	100,000	83,966.15	
AUTONATION INC 4.5% 25/10/01	20,000	19,287.19	
AUTOZONE INC 3.25% 25/04/15	110,000	105,393.86	
AUTOZONE INC 4% 30/04/15	100,000	91,670.61	
AUTOZONE INC 4.5% 28/02/01	100,000	96,678.60	
AVALONBAY COMMUNITIES 3.3% 29/06/01	65,000	57,886.25	
AVALONBAY COMMUNITIES 3.35% 27/05/15	300,000	278,257.16	
AVALONBAY COMMUNITIES IN 2.9% 26/10/15	50,000	46,054.46	
AVANGRID INC 3.2% 25/04/15	100,000	95,024.66	
AVANGRID INC 3.8% 29/06/01	75,000	67,891.24	
AVERY DENNISON CORP 0.85% 24/08/15	40,000	37,731.81	
AVERY DENNISON CORP 4.875% 28/12/06	100,000	97,273.03	
AVNET INC 3% 31/05/15	100,000	78,828.56	
AXA EQUITABLE HOLDINGS I 4.35% 28/04/20	100,000	93,017.44	
AXIS SPECIALTY FINAN PLC 4% 27/12/06	100,000	93,214.52	
BAIDU INC 1.625% 27/02/23	200,000	174,825.22	
BAIDU INC 2.375% 30/10/09	300,000	243,936.19	
BAKER HUGHES LLC/CO-OBL 3.337% 27/12/15	150,000	137,560.15	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 1.125% 25/09/18	100,000	90,226.29	
BANCO SANTANDER SA 2.746% 25/05/28	200,000	188,101.92	
BANCO SANTANDER SA 2.749% 30/12/03	800,000	618,726.65	
BANCO SANTANDER SA 2.958% 31/03/25	200,000	162,817.56	
BANCO SANTANDER SA 3.8% 28/02/23	100,000	91,161.22	
BANCO SANTANDER SA 4.175% 28/03/24	200,000	185,793.68	
BANK OF AMERICA CORP 0.981% 25/09/25	1,000,000	940,467.40	
BANK OF AMERICA CORP 2.087% 29/06/14	200,000	168,870.90	
BANK OF AMERICA CORP 2.299% 32/07/21	200,000	156,713.49	
BANK OF AMERICA CORP 2.456% 25/10/22	700,000	668,577.60	
BANK OF AMERICA CORP 2.482% 36/09/21	100,000	74,880.95	
BANK OF AMERICA CORP 2.572% 32/10/20	100,000	79,856.98	
BANK OF AMERICA CORP 2.592% 31/04/29	595,000	489,938.47	
BANK OF AMERICA CORP 2.651% 32/03/11	100,000	81,208.03	

BANK OF AMERICA CORP 2.687% 32/04/22	200,000	162,784.75	
BANK OF AMERICA CORP 3.194% 30/07/23	150,000	130,444.81	
BANK OF AMERICA CORP 3.384% 26/04/02	300,000	287,739.00	
BANK OF AMERICA CORP 3.419% 28/12/20	783,000	713,564.30	
BANK OF AMERICA CORP 3.559% 27/04/23	500,000	471,480.02	
BANK OF AMERICA CORP 3.593% 28/07/21	650,000	600,306.51	
BANK OF AMERICA CORP 3.974% 30/02/07	250,000	228,672.71	
BANK OF AMERICA CORP 4.183% 27/11/25	200,000	188,406.66	
BANK OF AMERICA CORP 4.271% 29/07/23	400,000	375,270.41	
BANK OF AMERICA CORP 4.376% 28/04/27	150,000	142,955.58	
BANK OF AMERICA CORP 4.571% 33/04/27	500,000	460,087.80	
BANK OF AMERICA CORP 4.827% 26/07/22	700,000	687,147.09	
BANK OF AMERICA CORP 5.015% 33/07/22	1,000,000	957,470.98	
BANK OF AMERICA CORP 5.202% 29/04/25	200,000	195,490.89	
BANK OF AMERICA CORP 5.288% 34/04/25	200,000	194,570.13	
BANK OF MONTREAL 0.625% 24/07/09	70,000	66,416.37	
BANK OF MONTREAL 1.5% 25/01/10	200,000	188,090.27	
BANK OF MONTREAL 3.7% 25/06/07	700,000	677,362.06	
BANK OF MONTREAL 5.2% 24/12/12	75,000	74,367.72	
BANK OF MONTREAL 5.203% 28/02/01	100,000	98,932.57	
BANK OF NEW YORK MELLON 3.25% 24/09/11	100,000	97,129.03	
BANK OF NOVA SCO 1.35% 26/06/24	200,000	177,648.40	
BANK OF NOVA SCOTIA 1.3% 26/09/15	100,000	87,625.52	
BANK OF NOVA SCOTIA 1.95% 27/02/02	140,000	124,226.97	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.2% 25/02/03	300,000	283,925.47	
BANK OF NOVA SCOTIA 3.45% 25/04/11	100,000	96,362.49	
BANK OF NOVA SCOTIA 4.5% 25/12/16	500,000	482,599.66	
BANK OF NY MELLON CORP 2.8% 26/05/04	100,000	93,254.08	
BANK OF NY MELLON CORP 3.4% 28/01/29	100,000	92,648.46	
BANK OF NY MELLON CORP 3.442% 28/02/07	400,000	373,888.16	
BANK OF NY MELLON CORP 3.95% 25/11/18	500,000	482,197.95	
BANK OF NY MELLON CORP 4.289% 33/06/13	100,000	92,556.21	
BANK OF NY MELLON CORP 4.967% 34/04/26	200,000	191,998.71	
BANK OF NY MELLON CORP 5.802% 28/10/25	145,000	146,474.90	
BANKUINTEED INC 5.125% 30/06/11	100,000	75,458.66	
BARCLAYS PLC 3.564% 35/09/23	200,000	155,609.63	
BARCLAYS PLC 4.836% 28/05/09	1,000,000	914,528.15	
BARCLAYS PLC 5.088% 30/06/20	300,000	270,189.77	
BARCLAYS PLC 5.304% 26/08/09	200,000	195,429.59	
BARCLAYS PLC 7.437% 33/11/02	400,000	424,508.92	
BAT CAPITAL CORP 2.259% 28/03/25	150,000	127,479.62	
BAT CAPITAL CORP 3.557% 27/08/15	100,000	91,277.42	
BAT CAPITAL CORP 4.742% 32/03/16	100,000	89,884.60	
BAT CAPITAL CORP 4.906% 30/04/02	100,000	93,343.25	
BAT INTL FINANCE PLC 4.448% 28/03/16	400,000	375,931.91	
BAXALTA INC 4% 25/06/23	330,000	319,962.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC 2.539% 32/02/01	200,000	159,297.22	
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.95% 30/04/01	100,000	91,187.11	
BECTON DICKINSON AND CO 4.298% 32/08/22	100,000	93,248.03	
BECTON DICKINSON AND CO 4.693% 28/02/13	190,000	185,867.18	
BEMIS COMPANY INC 2.63% 30/06/19	100,000	82,002.19	
BERKSHIRE HATHAWAY FIN 1.45% 30/10/15	80,000	63,850.75	
BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.125% 26/03/15	200,000	192,132.76	
BERRY GLOBAL INC 1.57% 26/01/15	100,000	89,936.53	
BERRY GLOBAL INC 5.5% 28/04/15	200,000	196,389.76	
BEST BUY CO INC 4.45% 28/10/01	100,000	95,844.28	
BIOGEN INC 2.25% 30/05/01	35,000	28,799.74	



BIOGEN INC 4.05% 25/09/15	200,000	193,539.41	
BIO-RAD LABS 3.3% 27/03/15	100,000	92,651.89	
BLACK HILLS CORP 3.05% 29/10/15	50,000	42,324.66	
BLACK HILLS CORP 3.95% 26/01/15	50,000	47,688.28	
BLACK HILLS CORP 5.95% 28/03/15	100,000	100,493.86	
BLACKROCK INC 2.4% 30/04/30	200,000	170,731.75	
BLACKROCK INC 3.2% 27/03/15	100,000	93,906.11	
BLACKROCK INC 4.75% 33/05/25	65,000	62,771.26	
BLACKSTONE PRIVATE CRE 1.75% 24/09/15	100,000	93,804.54	
BLACKSTONE PRIVATE CRE 2.7% 25/01/15	75,000	69,939.22	
BLACKSTONE PRIVATE CRE 7.05% 25/09/29	300,000	299,935.96	
BLACKSTONE SECURED LEND 2.125% 27/02/15	150,000	125,721.97	
BLACKSTONE SECURED LEND 3.625% 26/01/15	100,000	91,729.05	
BLOCK FINANCIAL 2.5% 28/07/15	45,000	37,735.46	
BOARDWALK PIPELINES LP 3.6% 32/09/01	200,000	167,631.80	
BOARDWALK PIPELINES LP 4.45% 27/07/15	100,000	94,562.05	
BOARDWALK PIPELINES LP 4.8% 29/05/03	20,000	18,980.53	
BOEING CO 2.196% 26/02/04	800,000	733,512.23	
BOEING CO 3.25% 28/02/01	250,000	227,083.31	
BOEING CO 3.625% 31/02/01	200,000	177,537.94	
BOEING CO 4.875% 25/05/01	345,000	339,011.45	
BOEING CO 5.15% 30/05/01	100,000	97,529.84	
BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 30/04/13	200,000	192,533.86	
BORGWARNER INC 2.65% 27/07/01	150,000	135,302.04	
BOSTON PROPERTIES INC 3.4% 29/06/21	100,000	83,546.07	
BOSTON PROPERTIES LP 2.55% 32/04/01	400,000	296,778.63	
BOSTON PROPERTIES LP 3.2% 25/01/15	50,000	47,477.40	
BOSTON PROPERTIES LP 3.65% 26/02/01	150,000	139,059.33	
BOSTON SCIENTIFIC CORP 1.9% 25/06/01	200,000	187,444.81	
BP CAP MARKETS AMERICA 1.749% 30/08/10	200,000	160,861.77	
BP CAP MARKETS AMERICA 3.937% 28/09/21	300,000	284,121.35	
BP CAP MARKETS AMERICA 4.234% 28/11/06	650,000	627,077.85	
BRANDYWINE OPER PARTNERS 7.55% 28/03/15	100,000	90,008.93	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 3.7% 27/06/22	150,000	136,998.22	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 0.75% 25/11/13	500,000	454,167.81	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.9% 24/07/26	64,000	62,259.30	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.95% 32/03/15	200,000	173,158.23	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9% 28/02/20	150,000	144,210.68	
BRITISH TELECOMMUNICATIO 5.125% 28/12/04	200,000	194,433.65	
BRITISH TELECOMMUNICATIO 9.625% 30/12/15	100,000	121,889.40	
BRIXMOR OPERATING PART 4.05% 30/07/01	100,000	89,030.28	
BROADCOM INC 1.95% 28/02/15	80,000	68,605.97	
BROADCOM INC 4.11% 28/09/15	169,000	158,825.19	
BROADCOM INC 4.15% 30/11/15	400,000	363,636.95	
BROADCOM INC 4.15% 32/04/15	40,000	35,675.02	
BROADCOM INC 4.3% 32/11/15	200,000	180,118.25	
BROADCOM INC 4.75% 29/04/15	350,000	335,846.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLU 3.4% 26/06/27	100,000	93,876.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOL 2.9% 29/12/01	100,000	84,553.11	
BROADSTONE NET LEASE LLC 2.6% 31/09/15	100,000	70,732.55	
BROOKFIELD ASSET MAN INC 4% 25/01/15	100,000	97,048.45	
BROOKFIELD FINANCE INC 4.35% 30/04/15	200,000	182,409.16	
BROWN & BROWN INC 4.2% 24/09/15	100,000	98,073.93	
BRUNSWICK CORP 4.4% 32/09/15	200,000	171,386.77	
BUNGE LTD FINANCE CORP 1.63% 25/08/17	100,000	91,950.47	
BUNGE LTD FINANCE CORP 2.75% 31/05/14	100,000	82,732.00	
BURLINGTN NORTH SANTA FE 3.25% 27/06/15	100,000	94,339.12	

CABOT CORP 5% 32/06/30	100,000	94,168.40	
CAMDEN PROPERTY TRUST 3.15% 29/07/01	100,000	88,082.06	
CAMDEN PROPERTY TRUST 4.1% 28/10/15	45,000	42,145.28	
CAMPBELL SOUP CO 3.95% 25/03/15	100,000	97,127.20	
CANADIAN IMPERIAL BANK 0.95% 25/10/23	300,000	272,315.40	
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.3% 25/04/07	200,000	192,124.68	
CANADIAN IMPERIAL BANK 3.45% 27/04/07	90,000	83,891.19	
CANADIAN IMPERIAL BANK 5.001% 28/04/28	100,000	97,863.09	
CANADIAN NATIONAL RAILWA 2.75% 26/03/01	50,000	46,950.44	
CANADIAN NATL RAILWAY 3.85% 32/08/05	100,000	91,640.66	
CANADIAN NATL RESOURCES 7.2% 32/01/15	100,000	107,082.19	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.05% 30/03/05	155,000	128,186.71	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.875% 29/11/15	65,000	56,914.27	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.9% 25/02/01	200,000	191,770.23	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 1.878% 27/11/02	150,000	128,492.34	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 2.359% 32/07/29	100,000	69,576.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.2% 25/02/05	150,000	142,855.71	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.273% 30/03/01	400,000	338,030.73	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 3.75% 27/03/09	200,000	185,068.78	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.985% 26/07/24	300,000	290,420.84	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 5.268% 33/05/10	300,000	275,478.57	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.377% 34/06/08	135,000	131,363.36	
CARLISLE COS INC 2.75% 30/03/01	100,000	84,115.08	
CARLISLE COS INC 3.5% 24/12/01	65,000	62,695.66	
CARRIER GLOBAL CORP 2.242% 25/02/15	50,000	47,324.76	
CARRIER GLOBAL CORP 2.722% 30/02/15	200,000	169,854.81	
CATERPILLAR FINANCIAL SE 2.4% 26/08/09	50,000	46,239.35	
CATERPILLAR FINL SERVICE 1.15% 26/09/14	100,000	88,599.81	
CATERPILLAR FINL SERVICE 3.4% 25/05/13	600,000	581,722.08	
CATERPILLAR FINL SERVICE 3.65% 25/08/12	100,000	97,024.91	
CATERPILLAR INC 2.6% 29/09/19	100,000	88,852.04	
CBOE HOLDINGS 3.65% 27/01/12	50,000	47,324.87	
CDW LLC/CDW FINANCE 2.67% 26/12/01	200,000	178,819.90	
CDW LLC/CDW FINANCE 3.569% 31/12/01	100,000	82,874.65	
CDW LLC/CDW FINANCE 4.25% 28/04/01	100,000	91,768.00	
CELANESE US HOLDINGS LLC 1.4% 26/08/05	50,000	43,156.20	
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05% 25/03/15	400,000	397,997.80	
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.379% 32/07/15	200,000	197,610.24	
CENTENE CORP 2.5% 31/03/01	200,000	157,478.00	
CENTENE CORP 3.375% 30/02/15	500,000	424,320.00	
CENTENE CORP 4.625% 29/12/15	400,000	365,732.47	
CENTERPOINT ENER HOUSTON 4.95% 33/04/01	200,000	195,866.12	
CENTERPOINT ENERGY RES 4.4% 32/07/01	200,000	187,275.04	
CGI INC 2.3% 31/09/14	100,000	76,939.34	
CHARLES SCHWAB CORP 1.15% 26/05/13	50,000	44,108.59	
CHARLES SCHWAB CORP 2.45% 27/03/03	40,000	35,649.37	
CHARLES SCHWAB CORP 3.2% 28/01/25	100,000	90,493.25	
CHARLES SCHWAB CORP 4% 29/02/01	100,000	92,879.62	
CHARLES SCHWAB CORP 4.625% 30/03/22	500,000	481,575.70	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 2.8% 31/04/01	100,000	79,283.54	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.75% 28/02/15	100,000	90,809.73	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.2% 28/03/15	250,000	231,972.44	
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.908% 25/07/23	400,000	392,372.58	
CHENIERE CORP CHRISTI HD 5.875% 25/03/31	100,000	99,562.05	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25% 32/01/31	300,000	244,735.98	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 5.95% 33/06/30	50,000	49,472.00	
CHEVRON 2.954% 26/05/16	100,000	94,821.94	

CHEVRON CORP 1.554% 25/05/11	500,000	468,529.91	
CHEVRON USA INC 3.9% 24/11/15	200,000	196,407.37	
CHUBB INA HOLDINGS INC 1.375% 30/09/15	150,000	117,424.16	
CHURCH & DWIGHT CO INC 2.3% 31/12/15	100,000	81,000.70	
CI FINANCIAL CORP 3.2% 30/12/17	100,000	73,966.65	
CIGNA CORP 2.375% 31/03/15	290,000	238,385.29	
CIGNA CORP 3.25% 25/04/15	100,000	95,856.42	
CIGNA CORP 4.5% 26/02/25	500,000	489,184.11	
CIGNA GROUP/THE 5.4% 33/03/15	200,000	199,875.82	
CINTAS CORP NO 2 3.7% 27/04/01	100,000	95,575.22	
CITIGROUP INC 2.52% 32/11/03	145,000	114,521.67	
CITIGROUP INC 2.561% 32/05/01	55,000	44,091.74	
CITIGROUP INC 3.057% 33/01/25	135,000	111,010.32	
CITIGROUP INC 3.106% 26/04/08	700,000	667,969.38	
CITIGROUP INC 3.7% 26/01/12	1,000,000	955,596.33	
CITIGROUP INC 3.785% 33/03/17	200,000	173,780.91	
CITIGROUP INC 3.887% 28/01/10	350,000	328,941.04	
CITIGROUP INC 4.075% 29/04/23	250,000	233,421.95	
CITIGROUP INC 4.412% 31/03/31	1,000,000	924,707.84	
CITIGROUP INC 4.45% 27/09/29	500,000	473,588.08	
CITIGROUP INC 4.6% 26/03/09	100,000	96,578.22	
CITIGROUP INC 4.91% 33/05/24	200,000	189,602.67	
CITIGROUP INC 5.61% 26/09/29	200,000	199,418.22	
CITIGROUP INC 6.27% 33/11/17	400,000	416,007.53	
CITIZENS BANK NA/RI 2.25% 25/04/28	100,000	90,783.67	
CITIZENS FINANCIAL GROUP 3.25% 30/04/30	330,000	267,757.05	
CLOROX COMPANY 1.8% 30/05/15	130,000	104,844.79	
CLOROX COMPANY 4.4% 29/05/01	100,000	96,330.45	
CME GROUP INC 2.65% 32/03/15	200,000	166,867.68	
CMS ENERGY CORP 4.75% 30/03/01	100,000	86,053.37	
CNA FINANCIAL CORP 3.45% 27/08/15	50,000	45,949.74	
CNA FINANCIAL CORP 3.9% 29/05/01	40,000	36,252.30	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC 1.45% 26/07/15	100,000	88,287.00	
CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25% 25/05/30	100,000	98,122.67	
COCA-COLA CO/THE 2% 31/03/05	165,000	136,906.76	
COCA-COLA CO/THE 3.375% 27/03/25	250,000	239,462.75	
COCA-COLA CO/THE 3.45% 30/03/25	500,000	464,607.26	
COCA-COLA FEMSA SAB CV 2.75% 30/01/22	150,000	130,297.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO 3.1% 25/08/15	100,000	96,333.58	
COMCAST CORP 3.4% 30/04/01	200,000	181,660.63	
COMCAST CORP 4.15% 28/10/15	390,000	374,235.51	
COMCAST CORP 4.25% 30/10/15	400,000	379,875.21	
COMCAST CORP 4.65% 33/02/15	200,000	194,500.47	
COMCAST CORP 5.5% 32/11/15	100,000	102,187.25	
COMERICA INC 4% 29/02/01	100,000	83,214.48	
COMMONSPIRIT HEALTH 2.782% 30/10/01	15,000	12,433.27	
COMMONSPIRIT HEALTH 3.347% 29/10/01	100,000	87,208.38	
COMMONWEALTH BK AUSTR NY 5.316% 26/03/13	250,000	249,576.39	
COMMONWEALTH EDISON CO 2.2% 30/03/01	300,000	250,473.15	
CON EDISON CO OF NY INC 3.35% 30/04/01	120,000	107,655.60	
CONAGRA BRANDS INC 1.375% 27/11/01	100,000	83,970.64	
CONAGRA BRANDS INC 4.6% 25/11/01	100,000	97,627.17	
CONAGRA BRANDS INC 4.85% 28/11/01	100,000	96,689.97	
CONOCOPHILLIPS COMPANY 2.4% 25/03/07	44,000	41,852.94	
CONOCOPHILLIPS COMPANY 6.95% 29/04/15	100,000	108,691.51	
CONSOLIDATED EDISON CO 3.125% 27/11/15	100,000	92,075.66	
CONSTELLATION BRANDS INC 3.7% 26/12/06	50,000	47,521.32	

CONSTELLATION BRANDS INC 4.4% 25/11/15	365,000	357,681.20	
CONSTELLATION BRANDS INC 4.75% 32/05/09	100,000	95,501.81	
CONSUMERS ENERGY CO 3.6% 32/08/15	100,000	88,655.41	
CONTINENTAL RESOURCES 4.375% 28/01/15	200,000	186,300.25	
COOPERAT RABOBANK UA/NY 5% 25/01/13	250,000	247,950.92	
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% 25/08/04	300,000	289,554.80	
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.5% 25/04/04	300,000	286,027.68	
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.9% 32/04/05	100,000	85,502.25	
COSTCO WHOLESALE CORP 1.6% 30/04/20	300,000	246,388.64	
COTERRA ENERGY INC 4.375% 29/03/15	75,000	69,210.76	
CREDIT SUISSE NEW YORK 2.95% 25/04/09	500,000	470,091.13	
CREDIT SUISSE NEW YORK 3.625% 24/09/09	250,000	241,372.37	
CREDIT SUISSE NEW YORK 5% 27/07/09	250,000	238,291.23	
CROWN CASTLE INC 1.35% 25/07/15	300,000	274,866.80	
CROWN CASTLE INC 5% 28/01/11	35,000	34,156.21	
CROWN CASTLE INTL CORP 2.9% 27/03/15	110,000	100,056.45	
CROWN CASTLE INTL CORP 3.3% 30/07/01	100,000	87,078.87	
CROWN CASTLE INTL CORP 3.8% 28/02/15	200,000	184,943.99	
CROWN CASTLE INTL CORP 4% 27/03/01	100,000	94,632.37	
CSX CORP 4.25% 29/03/15	400,000	382,818.68	
CUMMINS INC 1.5% 30/09/01	100,000	79,688.37	
CVS HEALTH CORP 1.75% 30/08/21	100,000	78,729.05	
CVS HEALTH CORP 2.125% 31/09/15	200,000	158,256.07	
CVS HEALTH CORP 3.25% 29/08/15	200,000	177,402.03	
CVS HEALTH CORP 3.375% 24/08/12	100,000	97,601.35	
CVS HEALTH CORP 3.75% 30/04/01	145,000	130,830.94	
CVS HEALTH CORP 3.875% 25/07/20	600,000	582,874.30	
CVS HEALTH CORP 4.3% 28/03/25	272,000	260,838.10	
CVS HEALTH CORP 5% 26/02/20	70,000	69,479.93	
CVS HEALTH CORP 5% 29/01/30	90,000	88,243.47	
CVS HEALTH CORP 5.25% 33/02/21	100,000	98,015.01	
D.R. HORTON INC 1.3% 26/10/15	150,000	131,040.06	
DANAHER CORP 3.35% 25/09/15	105,000	101,183.80	
DCP MIDSTREAM OPERATING 8.125% 30/08/16	200,000	223,101.20	
DELL INT LLC / EMC CORP 5.85% 25/07/15	400,000	401,377.14	
DELL INT LLC / EMC CORP 6.02% 26/06/15	300,000	303,171.13	
DELL INT LLC / EMC CORP 6.1% 27/07/15	150,000	153,479.66	
DENTSPLY SIRONA INC 3.25% 30/06/01	100,000	85,530.01	
DEUTSCHE BANK NY 1.686% 26/03/19	50,000	44,884.69	
DEUTSCHE BANK NY 3.742% 33/01/07	300,000	216,105.48	
DEUTSCHE BANK NY 4.162% 25/05/13	200,000	193,417.08	
DEUTSCHE BANK NY 5.371% 27/09/09	150,000	145,873.88	
DEUTSCHE BANK NY 6.119% 26/07/14	700,000	692,314.98	
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75% 30/06/15	300,000	355,812.35	
DEVON ENERGY CORPORATION 4.5% 30/01/15	163,000	152,138.34	
DEVON ENERGY CORPORATION 5.85% 25/12/15	100,000	100,573.77	
DIAGEO CAPITAL PLC 2% 30/04/29	200,000	165,684.12	
DIAGEO CAPITAL PLC 2.125% 32/04/29	200,000	160,036.80	
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5% 29/12/01	100,000	89,196.64	
DIGITAL REALTY TRUST LP 4.45% 28/07/15	100,000	92,979.89	
DIGITAL REALTY TRUST LP 5.55% 28/01/15	100,000	98,078.69	
DISCOVER BANK 3.45% 26/07/27	150,000	137,652.81	
DISCOVER FINANCIAL SVS 4.5% 26/01/30	300,000	286,390.44	
DISCOVERY COMMUNICATIONS 3.95% 28/03/20	300,000	277,314.92	
DISCOVERY COMMUNICATIONS 4.125% 29/05/15	45,000	40,887.10	
DOLLAR GENERAL CORP 4.15% 25/11/01	50,000	48,531.11	
DOLLAR GENERAL CORP 4.625% 27/11/01	100,000	97,073.94	

DOLLAR GENERAL CORP 5.2% 28/07/05	140,000	137,748.82	
DOLLAR TREE INC 2.65% 31/12/01	100,000	80,437.92	
DOLLAR TREE INC 4.2% 28/05/15	100,000	94,364.85	
DOMINION ENERGY INC 3.375% 30/04/01	560,000	494,091.45	
DOMINION RESOURCES INC 5.75% 54/10/01	100,000	95,505.32	
DOW CHEMICAL CO/THE 7.375% 29/11/01	92,000	101,528.77	
DOWDUPONT INC 4.493% 25/11/15	100,000	97,950.07	
DTE ELECTRIC CO 1.9% 28/04/01	15,000	13,009.14	
DTE ELECTRIC CO 2.25% 30/03/01	200,000	168,314.82	
DTE ENERGY 2.85% 26/10/01	100,000	91,591.83	
DTE ENERGY CO 1.05% 25/06/01	70,000	64,148.63	
DTE ENERGY CO 2.529% 24/10/01	75,000	71,835.96	
DTE ENERGY CO 2.95% 30/03/01	50,000	42,754.21	
DUKE ENERGY CAROLINAS 2.45% 29/08/15	25,000	21,349.32	
DUKE ENERGY CAROLINAS 3.95% 28/11/15	250,000	235,704.35	
DUKE ENERGY CORP 4.5% 32/08/15	100,000	92,723.05	
DUKE ENERGY CORP 5% 25/12/08	200,000	198,656.24	
DUKE ENERGY FLORIDA LLC 1.75% 30/06/15	105,000	84,299.18	
DUKE ENERGY PROGRESS LLC 2% 31/08/15	100,000	79,286.77	
DXC TECHNOLOGY CO 1.8% 26/09/15	100,000	86,936.78	
E*TRADE FINANCIAL CORP 3.8% 27/08/24	15,000	13,973.83	
E*TRADE FINANCIAL CORP 4.5% 28/06/20	50,000	47,716.23	
EAGLE MATERIALS 2.5% 31/07/01	100,000	80,443.04	
EASTERN GAS TRAN 3% 29/11/15	200,000	172,868.50	
EASTMAN CHEMICAL CO 4.5% 28/12/01	100,000	94,421.92	
EATON CORP 4.15% 33/03/15	200,000	186,647.58	
EATON VANCE CORP 3.5% 27/04/06	50,000	46,286.50	
EBAY INC 1.4% 26/05/10	100,000	90,072.85	
EBAY INC 1.9% 25/03/11	100,000	94,054.50	
EBAY INC 3.6% 27/06/05	100,000	93,913.43	
EBAY INC 6.3% 32/11/22	100,000	103,547.19	
ECOLAB INC 1.65% 27/02/01	100,000	89,246.78	
ECOLAB INC 4.8% 30/03/24	45,000	44,681.72	
ECOLAB INC 5.25% 28/01/15	100,000	100,832.41	
EDISON INTERNATIONAL 4.7% 25/08/15	400,000	390,499.94	
EDISON INTERNATIONAL 4.95% 25/04/15	40,000	39,203.93	
EDISON INTERNATIONAL 5.75% 27/06/15	160,000	159,682.51	
EDWARDS LIFESCIENCES COR 4.3% 28/06/15	100,000	95,811.99	
ELECTRONIC ARTS INC 1.85% 31/02/15	60,000	47,835.22	
ELEVANCE HEALTH INC 2.375% 25/01/15	400,000	380,490.49	
ELEVANCE HEALTH INC 4.75% 33/02/15	200,000	191,279.38	
ELI LILLY & CO 3.375% 29/03/15	80,000	74,468.55	
EMERSON ELECTRIC CO 1.95% 30/10/15	200,000	163,052.46	
EMERSON ELECTRIC CO 3.15% 25/06/01	100,000	95,926.49	
ENBRIDGE ENERGY PARTNERS 5.875% 25/10/15	100,000	100,496.60	
ENBRIDGE INC 2.5% 25/01/15	200,000	190,423.49	
ENBRIDGE INC 3.7% 27/07/15	50,000	46,829.26	
ENBRIDGE INC 5.7% 33/03/08	250,000	249,150.25	
ENEL CHILE SA 4.875% 28/06/12	100,000	95,106.30	
ENERGY TRANSFER LP 4.75% 26/01/15	400,000	389,715.52	
ENERGY TRANSFER LP 5.75% 33/02/15	200,000	198,029.46	
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.25% 29/04/15	200,000	193,443.15	
ENSTAR GROUP LTD 4.95% 29/06/01	100,000	92,578.72	
ENTERGY CORP 1.9% 28/06/15	85,000	71,853.13	
ENTERGY LOUISIANA LLC 2.4% 26/10/01	300,000	273,515.85	
ENTERGY TEXAS INC 4% 29/03/30	400,000	372,563.89	
ENTERPRISE PRODUCTS OPER 3.75% 25/02/15	400,000	388,944.25	

ENTERPRISE PRODUCTS OPER 5.375% 78/02/15	100,000	83,156.53	
EOG RESOURCES INC 3.15% 25/04/01	100,000	96,393.42	
EPR PROPERTIES 3.6% 31/11/15	300,000	230,913.43	
EQT CORP 6.125% 25/02/01	100,000	99,414.88	
EQT CORP 7% 30/02/01	100,000	103,235.37	
EQUIFAX INC 2.6% 25/12/15	200,000	185,826.90	
EQUIFAX INC 5.1% 27/12/15	100,000	98,117.06	
EQUINIX INC 1% 25/09/15	400,000	361,344.91	
EQUINIX INC 2% 28/05/15	100,000	84,465.16	
EQUINIX INC 2.15% 30/07/15	100,000	79,908.71	
EQUINIX INC 3.2% 29/11/18	45,000	39,082.28	
EQUINIX INC 3.9% 32/04/15	100,000	88,263.51	
EQUITABLE HOLDINGS INC 5.594% 33/01/11	100,000	96,729.84	
ERP OPERATING LP 2.5% 30/02/15	100,000	83,918.71	
ERP OPERATING LP 3.25% 27/08/01	35,000	32,017.28	
ERP OPERATING LP 4.15% 28/12/01	50,000	47,079.06	
ESSENTIAL UTILITIES INC 2.704% 30/04/15	60,000	50,104.98	
ESSEX PORTFOLIO LP 1.7% 28/03/01	85,000	70,992.66	
ESSEX PORTFOLIO LP 3.5% 25/04/01	100,000	95,789.07	
ESTEE LAUDER CO INC 1.95% 31/03/15	45,000	36,413.07	
ESTEE LAUDER CO INC 3.15% 27/03/15	100,000	94,402.69	
EVERGY INC 2.9% 29/09/15	100,000	86,183.88	
EVERGY METRO 2.25% 30/06/01	200,000	163,951.15	
EVERSOURCE ENERGY 0.8% 25/08/15	400,000	360,276.92	
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 24/10/01	50,000	48,109.96	
EVERSOURCE ENERGY 2.9% 27/03/01	100,000	91,321.05	
EVERSOURCE ENERGY 3.375% 32/03/01	100,000	85,792.84	
EXELON 3.4% 26/04/15	100,000	94,801.05	
EXELON CORP 5.15% 28/03/15	50,000	49,472.27	
EXELON CORP 5.3% 33/03/15	100,000	98,213.55	
EXPEDIA GROUP INC 3.25% 30/02/15	200,000	171,747.38	
EXPEDIA GROUP INC 5% 26/02/15	200,000	196,440.54	
EXTRA SPACE STORAGE LP 5.7% 28/04/01	200,000	198,180.62	
EXXON MOBIL CORPORATION 2.44% 29/08/16	100,000	87,944.45	
EXXON MOBIL CORPORATION 2.61% 30/10/15	200,000	173,025.93	
EXXON MOBIL CORPORATION 2.992% 25/03/19	300,000	288,757.39	
EXXON MOBIL CORPORATION 3.482% 30/03/19	400,000	369,220.99	
FAIRFAX FINL HLDGS LTD 3.375% 31/03/03	200,000	165,974.74	
FAIRFAX FINL HLDGS LTD 4.625% 30/04/29	100,000	92,368.78	
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.2% 29/06/15	50,000	42,899.97	
FEDERAL REALTY INVESTMEN 3.25% 27/07/15	50,000	45,003.71	
FEDEX CORP 3.1% 29/08/05	200,000	178,061.73	
FEDEX CORP 4.25% 30/05/15	200,000	188,582.76	
FIBRIA OVERSEAS FINANCE 5.5% 27/01/17	50,000	49,625.00	
FIDELITY NATL FINANCIAL 4.5% 28/08/15	100,000	94,024.00	
FIDELITY NATL INFO SERV 2.25% 31/03/01	100,000	79,345.11	
FIDELITY NATL INFO SERV 4.5% 25/07/15	400,000	391,085.52	
FIFTH THIRD BANCORP 1.707% 27/11/01	65,000	55,264.40	
FIFTH THIRD BANCORP 2.55% 27/05/05	60,000	52,569.74	
FIFTH THIRD BANCORP 4.772% 30/07/28	300,000	275,891.50	
FIFTH THIRD BANK 2.25% 27/02/01	150,000	130,811.47	
FIRST AMERICAN FINANCIAL 2.4% 31/08/15	65,000	48,708.12	
FIRST-CITIZENS BANK/TRST 6.125% 28/03/09	100,000	98,644.94	
FISERV INC 2.65% 30/06/01	500,000	419,521.93	
FISERV INC 3.2% 26/07/01	250,000	234,358.07	
FISERV INC 5.6% 33/03/02	100,000	100,207.80	
FLEX LTD 4.875% 30/05/12	85,000	80,814.15	

FLEXTRONICS INTERNATIONA 4.75% 25/06/15	125,000	121,932.46	
FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.85% 25/04/01	600,000	577,230.78	
FLOWERS FOODS INC 3.5% 26/10/01	35,000	32,700.85	
FLOWSERVE CORPORATION 2.8% 32/01/15	100,000	78,459.70	
FORTUNE BRANDS HOME & SE 3.25% 29/09/15	200,000	173,247.10	
FOX CORP 3.05% 25/04/07	200,000	191,386.72	
FOX CORP 3.5% 30/04/08	25,000	22,226.18	
FRANKLIN RESOURCES INC 2.85% 25/03/30	100,000	95,056.37	
FREEPOR-T-MCMORAN INC 4.125% 28/03/01	200,000	187,048.00	
FREEPOR-T-MCMORAN INC 4.625% 30/08/01	100,000	93,420.78	
FS KKR CAPITAL CORP 3.125% 28/10/12	100,000	80,567.44	
FS KKR CAPITAL CORP 3.4% 26/01/15	100,000	90,766.68	
FS KKR CAPITAL CORP 4.125% 25/02/01	100,000	95,167.05	
GATX CORP 1.9% 31/06/01	100,000	75,572.03	
GE HEALTHCARE TECH INC 5.6% 25/11/15	200,000	200,200.51	
GE HEALTHCARE TECH INC 5.905% 32/11/22	300,000	308,317.83	
GENERAL DYNAMICS CORP 3.25% 25/04/01	100,000	96,724.21	
GENERAL DYNAMICS CORP 3.75% 28/05/15	280,000	265,737.41	
GENERAL ELECTRIC CO 6.75% 32/03/15	200,000	222,162.05	
GENERAL MILLS INC 2.25% 31/10/14	50,000	40,330.42	
GENERAL MILLS INC 4.2% 28/04/17	100,000	96,322.95	
GENERAL MILLS INC 4.95% 33/03/29	200,000	195,114.48	
GENERAL MOTORS CO 5% 28/10/01	200,000	193,183.74	
GENERAL MOTORS CO 5.6% 32/10/15	500,000	477,265.40	
GENERAL MOTORS CO 6.125% 25/10/01	200,000	201,221.42	
GENERAL MOTORS FINL CO 1.5% 26/06/10	150,000	132,396.31	
GENERAL MOTORS FINL CO 2.4% 28/04/10	100,000	85,733.81	
GENERAL MOTORS FINL CO 3.1% 32/01/12	100,000	79,466.03	
GENERAL MOTORS FINL CO 3.85% 28/01/05	100,000	91,797.19	
GENERAL MOTORS FINL CO 4% 25/01/15	200,000	193,979.30	
GENERAL MOTORS FINL CO 4.35% 27/01/17	100,000	95,406.34	
GENERAL MOTORS FINL CO 5.4% 26/04/06	200,000	197,073.15	
GENERAL MOTORS FINL CO 5.65% 29/01/17	100,000	97,740.54	
GENERAL MOTORS FINL CO 6% 28/01/09	100,000	99,989.95	
GENERAL MOTORS FINL CO 6.05% 25/10/10	400,000	401,223.52	
GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.375% 24/12/01	100,000	96,283.02	
GENUINE PARTS CO 1.75% 25/02/01	25,000	23,397.67	
GEORGIA POWER CO 2.65% 29/09/15	70,000	59,878.84	
GEORGIA POWER CO 3.25% 26/04/01	50,000	47,278.86	
GEORGIA-PACIFIC LLC 7.75% 29/11/15	100,000	111,674.79	
GILEAD SCIENCES INC 3.65% 26/03/01	200,000	191,977.64	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.625% 25/05/15	55,000	53,495.92	
GLAXOSMITHKLINE CAP INC 3.875% 28/05/15	300,000	286,475.82	
GLOBAL PAYMENTS INC 2.65% 25/02/15	400,000	379,291.70	
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9% 31/11/15	100,000	80,244.24	
GLOBAL PAYMENTS INC 5.4% 32/08/15	100,000	96,091.60	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.375% 26/04/15	285,000	278,076.12	
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75% 28/06/01	45,000	43,733.02	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.542% 27/09/10	100,000	87,633.30	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383% 32/07/21	915,000	719,501.79	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615% 32/04/22	105,000	84,555.30	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272% 25/09/29	500,000	483,305.78	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5% 25/04/01	1,300,000	1,248,987.62	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.691% 28/06/05	200,000	186,539.01	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75% 25/05/22	100,000	96,570.09	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.85% 27/01/26	300,000	283,410.84	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223% 29/05/01	1,300,000	1,214,566.50	

GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.387% 27/06/15	200,000	193,440.78	
GOLUB CAPITAL BDC 2.5% 26/08/24	60,000	51,969.96	
GSK CONSUMER HEALTHCARE 3.125% 25/03/24	300,000	286,727.82	
GSK CONSUMER HEALTHCARE 3.375% 29/03/24	250,000	224,883.78	
GULF POEWR CO 3.3% 27/05/30	100,000	93,623.92	
GXO LOGISTICS INC 1.65% 26/07/15	100,000	87,063.66	
HANOVER INSURANCE GROUP 4.5% 26/04/15	50,000	48,220.07	
HARRIS CORPORATION 4.4% 28/06/15	150,000	143,152.23	
HASBRO INC 3.55% 26/11/19	125,000	116,089.92	
HASBRO INC 3.9% 29/11/19	100,000	89,981.94	
HCA INC 3.625% 32/03/15	300,000	256,022.36	
HCA INC 4.125% 29/06/15	100,000	91,832.97	
HCA INC 4.5% 27/02/15	105,000	100,820.66	
HCA INC 5.375% 25/02/01	300,000	297,043.29	
HCA INC 5.875% 26/02/15	600,000	599,222.95	
HEALTHPEAK PROPERTIES 3% 30/01/15	100,000	85,650.61	
HEALTHPEAK PROPERTIES 3.5% 29/07/15	200,000	177,371.45	
HEALTHPEAK PROPERTIES 5.25% 32/12/15	15,000	14,362.75	
HERSHEY COMPANY 1.7% 30/06/01	80,000	65,394.19	
HERSHEY COMPANY 2.05% 24/11/15	100,000	95,922.24	
HESS CORP 4.3% 27/04/01	100,000	95,640.76	
HESS CORP 7.3% 31/08/15	100,000	108,090.08	
HF SINCLAIR CORP 5.875% 26/04/01	100,000	99,978.66	
HIGHWOODS REALTY LP 3.05% 30/02/15	100,000	76,820.97	
HOME DEPOT INC 0.9% 28/03/15	30,000	25,091.59	
HOME DEPOT INC 1.875% 31/09/15	40,000	31,899.84	
HOME DEPOT INC 2.7% 30/04/15	755,000	660,796.07	
HOME DEPOT INC 3.9% 28/12/06	300,000	287,107.93	
HOME DEPOT INC 4.5% 32/09/15	60,000	58,393.07	
HONDA MOTOR CO LTD 2.271% 25/03/10	200,000	190,233.66	
HONEYWELL INTERNATIONAL 1.35% 25/06/01	300,000	279,923.81	
HONEYWELL INTERNATIONAL 1.75% 31/09/01	160,000	126,199.48	
HONEYWELL INTERNATIONAL 2.7% 29/08/15	120,000	105,686.84	
HORMEL FOODS CORP 1.7% 28/06/03	170,000	146,340.16	
HOST HOTELS & RESORTS LP 2.9% 31/12/15	100,000	77,578.31	
HOST HOTELS & RESORTS LP 4.5% 26/02/01	150,000	144,835.84	
HP ENTERPRISE CO 4.9% 25/10/15	200,000	197,336.20	
HP ENTERPRISE CO 5.9% 24/10/01	250,000	249,807.94	
HP INC 2.2% 25/06/17	200,000	188,320.70	
HP INC 3.4% 30/06/17	150,000	129,957.10	
HP INC 4.2% 32/04/15	300,000	264,902.42	
HSBC HOLDINGS PLC 1.589% 27/05/24	200,000	175,983.19	
HSBC HOLDINGS PLC 2.099% 26/06/04	530,000	490,299.09	
HSBC HOLDINGS PLC 2.633% 25/11/07	600,000	571,695.48	
HSBC HOLDINGS PLC 2.804% 32/05/24	100,000	79,774.04	
HSBC HOLDINGS PLC 2.848% 31/06/04	200,000	163,712.98	
HSBC HOLDINGS PLC 2.871% 32/11/22	1,000,000	791,019.86	
HSBC HOLDINGS PLC 3.973% 30/05/22	200,000	177,840.25	
HSBC HOLDINGS PLC 4.583% 29/06/19	200,000	186,139.64	
HSBC HOLDINGS PLC 5.21% 28/08/11	800,000	775,166.24	
HSBC HOLDINGS PLC 6.254% 34/03/09	200,000	201,425.65	
HSBC HOLDINGS PLC 6.547% 34/06/20	350,000	341,779.14	
HSBC HOLDINGS PLC 7.336% 26/11/03	200,000	205,845.80	
HUBBELL INC 3.35% 26/03/01	100,000	94,758.54	
HUDSON PACIFIC PROPERTIE 3.25% 30/01/15	100,000	63,291.22	
HUMANA INC 3.85% 24/10/01	150,000	146,485.19	
HUMANA INC 5.75% 28/03/01	100,000	100,992.91	



HUMANA INC 5.875% 33/03/01	100,000	102,379.16	
HUNTINGTON BANCSHARES 2.487% 36/08/15	100,000	70,247.31	
HUNTINGTON BANCSHARES 2.55% 30/02/04	100,000	78,726.29	
HUNTINGTON INGALLS INDUS 2.043% 28/08/16	200,000	166,672.13	
HUNTSMAN INTERNATIONAL L 4.5% 29/05/01	100,000	91,125.71	
HYATT HOTELS CORP 4.375% 28/09/15	50,000	46,996.87	
HYATT HOTELS CORP 4.85% 26/03/15	50,000	48,953.41	
IBM CORP 1.7% 27/05/15	470,000	413,878.97	
IBM CORP 3.5% 29/05/15	100,000	91,647.84	
IBM CORP 4% 25/07/27	300,000	293,108.14	
IBM CORP 4.4% 32/07/27	100,000	94,472.95	
IBM CORP 4.5% 28/02/06	250,000	243,488.10	
IDEX CORP 3% 30/05/01	50,000	43,338.15	
ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65% 26/11/15	100,000	93,233.85	
ILLUMINA INC 5.8% 25/12/12	200,000	199,939.35	
ING GROEP NV 1.726% 27/04/01	200,000	177,723.29	
ING GROEP NV 4.55% 28/10/02	300,000	284,184.00	
INGREDION INC 2.9% 30/06/01	100,000	85,518.05	
INTEL CORP 1.6% 28/08/12	55,000	46,855.49	
INTEL CORP 3.7% 25/07/29	145,000	140,856.12	
INTEL CORP 3.9% 30/03/25	650,000	604,632.11	
INTEL CORP 4% 29/08/05	100,000	94,340.40	
INTEL CORP 4.15% 32/08/05	100,000	93,342.26	
INTEL CORP 4.875% 26/02/10	300,000	298,240.36	
INTEL CORP 5.2% 33/02/10	200,000	198,276.86	
INTERCONTINENTALEXCHANGE 1.85% 32/09/15	200,000	150,962.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.1% 27/09/15	100,000	92,830.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.65% 25/05/23	300,000	293,439.00	
INTERPUBLIC GROUP COS 4.65% 28/10/01	25,000	23,863.24	
INTERPUBLIC GROUP COS 4.75% 30/03/30	100,000	95,680.45	
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.25% 24/12/01	100,000	96,450.53	
INTERSTATE POWER & LIGHT 3.6% 29/04/01	50,000	45,236.85	
INTL FLAVOR & FRAGRANCES 4.45% 28/09/26	45,000	42,016.99	
INTUIT INC 0.95% 25/07/15	200,000	183,214.00	
INVESCO FINANCE PLC 3.75% 26/01/15	150,000	143,596.80	
INVITATION HOMES OP 2.3% 28/11/15	50,000	42,178.14	
INVITATION HOMES OP 4.15% 32/04/15	100,000	88,399.65	
IPALCO ENTERPRISES INC 3.7% 24/09/01	100,000	96,869.58	
IPALCO ENTERPRISES INC 4.25% 30/05/01	100,000	89,116.80	
ITC HOLDINGS CORP 3.25% 26/06/30	60,000	56,515.20	
JABIL INC 3.6% 30/01/15	250,000	220,959.98	
JACKSON FINANCIAL INC 5.67% 32/06/08	100,000	94,250.88	
JBS USA/FOOD/FINANCE 3% 32/05/15	200,000	151,801.24	
JBS USA/FOOD/FINANCE 5.125% 28/02/01	400,000	379,922.60	
JD.COM INC 3.375% 30/01/14	100,000	87,971.96	
JEFFERIES GROUP 4.85% 27/01/15	90,000	87,369.45	
JEFFERIES GRP LLC / CAP 2.625% 31/10/15	200,000	151,756.19	
JM SMUCKER CO 3.5% 25/03/15	200,000	193,263.20	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.05% 26/06/17	100,000	89,564.73	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.7% 27/01/11	100,000	89,318.53	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.125% 25/03/07	25,000	23,766.68	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.45% 30/01/09	200,000	173,108.77	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.8% 29/07/18	50,000	44,340.05	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.35% 29/04/18	100,000	91,767.01	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.9% 32/06/07	100,000	92,868.40	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.05% 25/09/08	800,000	783,035.49	
JOHNSON & JOHNSON 0.55% 25/09/01	50,000	45,699.90	

JOHNSON & JOHNSON 0.95% 27/09/01	65,000	56,384.23	
JOHNSON & JOHNSON 1.3% 30/09/01	100,000	80,749.97	
JOHNSON & JOHNSON 2.45% 26/03/01	100,000	94,201.49	
JOHNSON & JOHNSON 2.95% 27/03/03	200,000	188,922.31	
JOHNSON CONTROLS/TYCO FI 2% 31/09/16	100,000	78,540.98	
JPMORGAN CHASE & CO 1.47% 27/09/22	75,000	65,607.55	
JPMORGAN CHASE & CO 1.578% 27/04/22	65,000	57,872.04	
JPMORGAN CHASE & CO 2.005% 26/03/13	600,000	563,627.46	
JPMORGAN CHASE & CO 2.083% 26/04/22	1,000,000	936,793.99	
JPMORGAN CHASE & CO 2.182% 28/06/01	400,000	352,681.60	
JPMORGAN CHASE & CO 2.545% 32/11/08	125,000	100,291.46	
JPMORGAN CHASE & CO 2.58% 32/04/22	275,000	224,263.60	
JPMORGAN CHASE & CO 2.595% 26/02/24	300,000	284,673.61	
JPMORGAN CHASE & CO 2.739% 30/10/15	100,000	84,873.29	
JPMORGAN CHASE & CO 2.956% 31/05/13	150,000	126,306.02	
JPMORGAN CHASE & CO 2.963% 33/01/25	500,000	412,960.87	
JPMORGAN CHASE & CO 3.509% 29/01/23	250,000	228,775.50	
JPMORGAN CHASE & CO 3.96% 27/01/29	200,000	191,339.49	
JPMORGAN CHASE & CO 4.005% 29/04/23	100,000	93,206.63	
JPMORGAN CHASE & CO 4.08% 26/04/26	750,000	729,177.79	
JPMORGAN CHASE & CO 4.203% 29/07/23	700,000	656,554.39	
JPMORGAN CHASE & CO 4.565% 30/06/14	1,000,000	948,511.05	
JPMORGAN CHASE & CO 4.586% 33/04/26	200,000	187,465.62	
JPMORGAN CHASE & CO 4.912% 33/07/25	100,000	95,762.35	
JPMORGAN CHASE & CO 5.717% 33/09/14	400,000	398,749.61	
JPMORGAN CHASE & CO 7.75% 25/07/15	200,000	208,059.37	
JUNIPER NETWORKS INC 2% 30/12/10	100,000	76,372.36	
KAISER FOUNDATION HOSPIT 3.15% 27/05/01	50,000	46,631.65	
KELLOGG CO 4.3% 28/05/15	100,000	95,974.71	
KELLOGG CO 5.25% 33/03/01	200,000	197,914.69	
KEMPER CORP 2.4% 30/09/30	100,000	76,789.85	
KEMPER CORP 4.35% 25/02/15	35,000	33,673.09	
KENNAMETAL INC 2.8% 31/03/01	100,000	79,069.67	
KENVUE INC 4.9% 33/03/22	200,000	198,891.29	
KENVUE INC 5% 30/03/22	100,000	99,706.62	
KENVUE INC 5.35% 26/03/22	100,000	100,403.84	
KEURIG DR PEPPER INC 3.4% 25/11/15	200,000	190,983.89	
KEURIG DR PEPPER INC 4.597% 28/05/25	250,000	242,606.91	
KEY BANK NA 3.4% 26/05/20	200,000	172,627.38	
KEY BANK NA 5% 33/01/26	250,000	210,585.54	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES 4.6% 27/04/06	60,000	58,832.59	
KILROY REALTY LP 2.5% 32/11/15	200,000	136,948.70	
KILROY REALTY LP 4.375% 25/10/01	100,000	93,779.38	
KIMBERLY-CLARK CORP 1.05% 27/09/15	100,000	85,711.95	
KIMBERLY-CLARK CORP 2% 31/11/02	100,000	81,185.43	
KIMBERLY-CLARK CORP 3.05% 25/08/15	100,000	96,051.07	
KIMCO REALTY CORP 1.9% 28/03/01	50,000	41,753.02	
KIMCO REALTY CORP 3.3% 25/02/01	180,000	172,035.92	
KINDER MORGAN INC 5.2% 33/06/01	200,000	190,675.52	
KINDER MORGAN INC 7.75% 32/01/15	300,000	333,372.61	
KITE REALTY GROUP LP 4% 26/10/01	50,000	44,648.14	
KLA-TENCOR CORP 4.1% 29/03/15	100,000	95,496.27	
KRAFT HEINZ FOODS CO 4.25% 31/03/01	200,000	187,283.92	
KROGER CO 3.5% 26/02/01	150,000	143,370.69	
KYNDRYL HOLDINGS INC 2.7% 28/10/15	90,000	72,478.03	
KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15% 31/10/15	100,000	74,046.90	
L3HARRIS TECH INC 4.4% 28/06/15	200,000	190,869.65	

LABORATORY CORP OF AMER 1.55% 26/06/01	70,000	62,281.54	
LABORATORY CORP OF AMER 2.3% 24/12/01	200,000	190,261.83	
LAM RESEARCH CORP 4% 29/03/15	255,000	243,181.23	
LAZARD GROUP LLC 3.625% 27/03/01	100,000	92,101.21	
LAZARD GROUP LLC 4.5% 28/09/19	50,000	46,707.72	
LEAR CORP 4.25% 29/05/15	100,000	92,745.21	
LEGGETT & PLATT INC 3.5% 27/11/15	50,000	45,700.78	
LEIDOS INC 4.375% 30/05/15	200,000	181,186.29	
LENNAR CORP 5% 27/06/15	100,000	97,280.08	
LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35% 25/08/01	125,000	113,869.14	
LIFE STORAGE LP 2.4% 31/10/15	100,000	77,941.83	
LIFE STORAGE LP 4% 29/06/15	100,000	89,801.71	
LINCOLN NATIONAL CORP 3.35% 25/03/09	150,000	143,373.86	
LINDE INC/CT 4.7% 25/12/05	100,000	99,414.80	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.87% 25/07/09	200,000	194,915.11	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% 25/05/08	200,000	193,867.52	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.55% 28/08/16	200,000	187,840.93	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.582% 25/12/10	600,000	575,700.27	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65% 26/03/24	200,000	190,523.35	
LOCKHEED MARTIN CORP 1.85% 30/06/15	200,000	164,043.11	
LOCKHEED MARTIN CORP 4.45% 28/05/15	35,000	34,241.49	
LOCKHEED MARTIN CORP 4.95% 25/10/15	100,000	99,751.73	
LOEWS CORP 3.75% 26/04/01	200,000	193,255.12	
LOWE'S COS INC 1.3% 28/04/15	145,000	121,465.77	
LOWE'S COS INC 1.7% 28/09/15	125,000	105,323.70	
LOWE'S COS INC 2.625% 31/04/01	150,000	124,723.56	
LOWE'S COS INC 3.1% 27/05/03	100,000	92,643.63	
LOWE'S COS INC 4% 25/04/15	100,000	97,313.82	
LOWE'S COS INC 4.4% 25/09/08	400,000	391,865.36	
LOWE'S COS INC 5% 33/04/15	85,000	82,665.19	
LXP INDUSTRIAL TRUST 2.7% 30/09/15	100,000	78,666.59	
LYB INT FINANCE III 1.25% 25/10/01	20,000	18,112.89	
LYB INT FINANCE III 2.25% 30/10/01	125,000	101,443.58	
M&T BANK CORPORATION 4.553% 28/08/16	100,000	92,827.96	
M&T BANK CORPORATION 5.053% 34/01/27	100,000	88,894.24	
MAGELLAN MISTREAM PARTN 5% 26/03/01	50,000	49,275.67	
MAGNA INTERNATIONAL INC 2.45% 30/06/15	100,000	83,468.11	
MAGNA INTERNATIONAL INC 5.5% 33/03/21	100,000	100,336.63	
MAIN STREET CAPITAL CORP 3% 26/07/14	85,000	74,330.94	
MANUF & TRADERS TRUST CO 4.7% 28/01/27	250,000	231,136.38	
MANULIFE FINANCIAL CORP 2.484% 27/05/19	35,000	31,870.28	
MANULIFE FINANCIAL CORP 4.15% 26/03/04	200,000	193,559.51	
MARATHON OIL CORP 6.8% 32/03/15	200,000	203,880.12	
MARATHON PETROLEUM CORP 3.8% 28/04/01	30,000	27,715.84	
MARATHON PETROLEUM CORP 4.7% 25/05/01	200,000	196,051.22	
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.5% 32/10/15	300,000	254,302.11	
MARRIOTT INTERNATIONAL 4.9% 29/04/15	100,000	96,278.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL 5% 27/10/15	100,000	98,564.57	
MARRIOTT INTERNATIONAL 5.75% 25/05/01	50,000	50,058.83	
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.375% 29/03/15	95,000	91,397.32	
MARTIN MARIETTA 2.4% 31/07/15	50,000	40,162.21	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.45% 27/06/01	21,000	19,507.58	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 3.5% 27/12/15	50,000	46,282.54	
MARTIN MARIETTA MATERIAL 4.25% 24/07/02	30,000	29,577.62	
MARVELL TECHNOLOGY INC 4.875% 28/06/22	100,000	96,141.41	
MASCO CORP 1.5% 28/02/15	150,000	126,494.70	
MASCO CORP 2% 30/10/01	15,000	11,705.92	

MASTERCARD INC 2.95% 29/06/01	100,000	89,975.82	
MASTERCARD INC 3.35% 30/03/26	500,000	460,104.98	
MASTERCARD INC 4.875% 28/03/09	70,000	70,100.11	
MCCORMICK & CO 2.5% 30/04/15	100,000	83,567.52	
MCCORMICK & CO 4.95% 33/04/15	200,000	193,416.31	
MCDONALD'S CORP 3.7% 26/01/30	600,000	578,075.56	
MCKESSON CORP 1.3% 26/08/15	125,000	110,936.01	
MCKESSON CORP 5.25% 26/02/15	65,000	64,657.18	
MEAD JOHNSON NUTRITION C 4.125% 25/11/15	60,000	58,581.01	
MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS 4.5% 33/03/30	100,000	96,300.50	
MERCEDES-BENZ FIN NA 8.5% 31/01/18	200,000	245,646.48	
MERCK & CO INC 1.9% 28/12/10	200,000	173,065.48	
MERCK & CO INC 2.15% 31/12/10	100,000	81,315.92	
MERCK & CO INC 3.4% 29/03/07	300,000	278,405.95	
MERCY HEALTHCARE SYSTEM 4.302% 28/07/01	15,000	14,177.30	
META PLATFORMS INC 3.5% 27/08/15	300,000	282,987.40	
META PLATFORMS INC 3.85% 32/08/15	100,000	91,259.60	
META PLATFORMS INC 4.6% 28/05/15	200,000	196,188.18	
METLIFE INC 3.6% 25/11/13	200,000	192,475.82	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.25% 25/09/01	200,000	193,916.17	
MICRON TECHNOLOGY INC 4.663% 30/02/15	200,000	186,107.53	
MICRON TECHNOLOGY INC 5.327% 29/02/06	50,000	48,804.06	
MICRON TECHNOLOGY INC 5.375% 28/04/15	200,000	196,657.08	
MICROSOFT CORP 2.4% 26/08/08	250,000	233,297.47	
MICROSOFT CORP 2.7% 25/02/12	100,000	96,487.46	
MICROSOFT CORP 3.125% 25/11/03	500,000	481,914.73	
MID-AMERICA APARTMENTS 1.1% 26/09/15	100,000	86,934.54	
MID-AMERICA APARTMENTS 3.95% 29/03/15	100,000	93,198.27	
MIDAMERICAN ENERGY CO 6.75% 31/12/30	200,000	219,150.94	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 1.412% 25/07/17	500,000	458,634.27	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 1.538% 27/07/20	200,000	175,860.02	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 1.64% 27/10/13	200,000	175,177.34	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3.195% 29/07/18	200,000	175,289.97	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 4.05% 28/09/11	100,000	93,195.58	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 4.315% 33/04/19	200,000	182,294.10	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 5.063% 25/09/12	400,000	395,087.63	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 5.242% 29/04/19	200,000	194,759.49	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 5.354% 28/09/13	600,000	590,483.29	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP 5.441% 34/02/22	200,000	196,295.20	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL 2.757% 26/09/13	200,000	182,436.40	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 1.554% 27/07/09	200,000	175,659.65	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 2.869% 30/09/13	200,000	167,877.92	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.018% 28/03/05	200,000	186,709.94	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 4.254% 29/09/11	400,000	370,327.98	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 5.669% 33/09/13	200,000	197,949.71	
MIZUHO FINANCIAL GROUP 5.778% 29/07/06	200,000	198,759.82	
MONDELEZ INTERNATIONAL 1.5% 25/05/04	100,000	93,271.56	
MONDELEZ INTERNATIONAL 2.625% 27/03/17	100,000	91,559.69	
MOODY'S CORPORATION 4.25% 32/08/08	100,000	93,469.12	
MORGAN STANLEY 1.164% 25/10/21	75,000	70,115.64	
MORGAN STANLEY 1.512% 27/07/20	150,000	132,393.87	
MORGAN STANLEY 2.188% 26/04/28	100,000	93,805.87	
MORGAN STANLEY 2.475% 28/01/21	170,000	152,236.13	
MORGAN STANLEY 2.484% 36/09/16	200,000	148,885.58	
MORGAN STANLEY 2.511% 32/10/20	75,000	59,320.82	
MORGAN STANLEY 2.699% 31/01/22	300,000	251,145.51	
MORGAN STANLEY 2.72% 25/07/22	1,000,000	964,798.34	

MORGAN STANLEY 2.943% 33/01/21	635,000	518,216.88	
MORGAN STANLEY 3.125% 26/07/27	200,000	186,991.69	
MORGAN STANLEY 3.591% 28/07/22	200,000	182,893.84	
MORGAN STANLEY 3.622% 31/04/01	200,000	177,098.46	
MORGAN STANLEY 3.772% 29/01/24	700,000	645,462.06	
MORGAN STANLEY 3.95% 27/04/23	100,000	94,017.21	
MORGAN STANLEY 4.679% 26/07/17	500,000	490,820.52	
MORGAN STANLEY 4.889% 33/07/20	300,000	283,443.72	
MORGAN STANLEY 5.05% 27/01/28	580,000	572,899.59	
MORGAN STANLEY 5.123% 29/02/01	135,000	131,623.55	
MORGAN STANLEY 5.164% 29/04/20	155,000	151,342.27	
MORGAN STANLEY 5.25% 34/04/21	180,000	174,069.43	
MORGAN STANLEY 5.297% 37/04/20	200,000	184,948.96	
MORGAN STANLEY 5.948% 38/01/19	200,000	192,943.95	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 2.75% 31/05/24	50,000	40,373.25	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4% 24/09/01	10,000	9,764.14	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6% 29/05/23	100,000	95,767.43	
MPLX LP 2.65% 30/08/15	45,000	37,181.47	
MPLX LP 4.8% 29/02/15	100,000	95,727.04	
MPLX LP 4.875% 25/06/01	650,000	638,010.26	
MYLAN 3.95% 26/06/15	100,000	94,559.13	
NASDAQ 3.85% 26/06/30	30,000	28,752.77	
NATIONAL AUSTRALIA BK 2.5% 26/07/12	100,000	92,196.17	
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.5% 25/06/09	250,000	241,698.76	
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 4.9% 28/06/13	250,000	244,957.67	
NATIONAL BANK OF CANADA 5.25% 25/01/17	250,000	247,406.04	
NATIONAL FUEL GAS CO 3.95% 27/09/15	50,000	45,768.14	
NATIONAL FUEL GAS CO 4.75% 28/09/01	50,000	46,948.21	
NATIONAL FUEL GAS CO 5.5% 26/01/15	15,000	14,726.29	
NATIONAL HEALTH INVESTOR 3% 31/02/01	25,000	19,025.53	
NATIONAL RETAIL PROP INC 4.3% 28/10/15	65,000	60,364.40	
NATIONAL RETAIL PROPRTI 4% 25/11/15	65,000	61,846.48	
NATIONAL RURAL UTIL COOP 1.875% 25/02/07	100,000	94,434.55	
NATIONAL RURAL UTIL COOP 2.4% 30/03/15	300,000	250,003.56	
NATIONAL RURAL UTIL COOP 4.8% 28/03/15	200,000	196,176.30	
NATIONAL RURAL UTILITIES 5.25% 46/04/20	150,000	139,387.50	
NATWEST GROUP PLC 4.892% 29/05/18	900,000	846,969.15	
NETAPP INC 2.375% 27/06/22	100,000	90,152.03	
NETFLIX INC 5.875% 28/11/15	400,000	408,844.40	
NEVADA POWER CO 3.7% 29/05/01	300,000	274,952.48	
NEWMONT CORP 2.25% 30/10/01	300,000	242,686.76	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 1.9% 28/06/15	65,000	55,198.06	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 2.44% 32/01/15	200,000	159,561.10	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 3.8% 82/03/15	100,000	83,750.60	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 4.255% 24/09/01	100,000	98,250.39	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 4.45% 25/06/20	100,000	98,073.87	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.05% 33/02/28	200,000	193,399.49	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65% 79/05/01	150,000	138,072.96	
NIKE INC 2.375% 26/11/01	100,000	92,708.74	
NIKE INC 2.85% 30/03/27	250,000	222,193.45	
NISOURCE FINANCE CORP 3.49% 27/05/15	100,000	93,480.80	
NISOURCE INC 0.95% 25/08/15	300,000	273,264.50	
NOMURA HOLDINGS INC 1.653% 26/07/14	100,000	87,584.63	
NOMURA HOLDINGS INC 2.172% 28/07/14	200,000	166,223.70	
NOMURA HOLDINGS INC 2.999% 32/01/22	200,000	158,600.03	
NOMURA HOLDINGS INC 5.099% 25/07/03	400,000	392,103.75	
NOMURA HOLDINGS INC 6.07% 28/07/12	200,000	198,898.99	

NORFOLK SOUTHERN 2.9% 26/06/15	65,000	60,990.74	
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.15% 27/06/01	75,000	69,711.41	
NORTHERN TRUST CORP 1.95% 30/05/01	200,000	162,508.62	
NORTHERN TRUST CORP 3.375% 32/05/08	62,000	54,593.84	
NORTHERN TRUST CORP 3.95% 25/10/30	100,000	96,388.18	
NORTHROP GRUMMAN CORP 3.25% 28/01/15	200,000	185,214.85	
NOVARTIS CAPITAL CORP 1.75% 25/02/14	100,000	94,814.74	
NOVARTIS CAPITAL CORP 3% 25/11/20	400,000	382,798.03	
NSTAR ELECTRIC CO 3.25% 29/05/15	100,000	90,592.15	
NUCOR CORP 3.95% 25/05/23	200,000	194,146.50	
NUTRIEN LTD 3% 25/04/01	100,000	95,185.06	
NUTRIEN LTD 4.9% 28/03/27	100,000	97,769.41	
NUTRIEN LTD 5.9% 24/11/07	100,000	100,105.20	
NVENT FINANCE SARL 4.55% 28/04/15	100,000	93,040.54	
NVIDIA CORP 2% 31/06/15	100,000	82,314.59	
NVIDIA CORP 2.85% 30/04/01	300,000	268,178.37	
NVR INC 3% 30/05/15	65,000	55,388.13	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 2.5% 31/05/11	100,000	80,537.41	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.4% 30/05/01	45,000	39,281.85	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA 3.875% 26/06/18	100,000	95,630.24	
NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.35% 26/03/01	200,000	198,342.48	
NXP BV/NXP FUNDING LLC 5.55% 28/12/01	100,000	99,927.66	
OAKTREE SPECIALTY LEND 2.7% 27/01/15	50,000	43,012.10	
OCHSNER LSU HEALTH SYST 2.51% 31/05/15	100,000	72,968.41	
OHIO POWER COMPANY 2.6% 30/04/01	400,000	338,306.61	
OKLAHOMA G&E CO 3.25% 30/04/01	55,000	48,433.20	
OLD REPUBLIC INTERNATION 3.875% 26/08/26	100,000	93,837.66	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 25/01/15	50,000	47,999.77	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS 4.5% 27/04/01	100,000	92,259.25	
OMNICOM GROUP INC 2.45% 30/04/30	100,000	82,723.16	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 3.7% 28/11/15	100,000	93,590.60	
ONCOR ELECTRIC DELIVERY 4.55% 32/09/15	200,000	190,818.08	
ONE GAS INC 2% 30/05/15	100,000	81,577.47	
ONEOK INC 4% 27/07/13	85,000	78,846.24	
ONEOK INC 4.55% 28/07/15	150,000	141,176.16	
ONEOK INC 5.85% 26/01/15	65,000	65,040.91	
ONEOK INC 6.35% 31/01/15	200,000	203,410.83	
ORACLE CORP 2.8% 27/04/01	700,000	639,022.86	
ORACLE CORP 2.875% 31/03/25	95,000	79,671.37	
ORACLE CORP 2.95% 24/11/15	100,000	96,559.27	
ORACLE CORP 2.95% 25/05/15	600,000	573,158.83	
ORACLE CORP 2.95% 30/04/01	200,000	172,270.08	
ORACLE CORP 3.25% 27/11/15	150,000	138,026.96	
ORACLE CORP 3.25% 30/05/15	100,000	87,856.38	
ORACLE CORP 4.5% 28/05/06	85,000	82,113.18	
ORACLE CORP 4.9% 33/02/06	90,000	85,722.30	
ORACLE CORP 6.25% 32/11/09	250,000	260,570.84	
ORANGE SA 9% 31/03/01	200,000	243,294.07	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35% 28/06/01	150,000	144,281.79	
ORIX CORP 3.7% 27/07/18	50,000	46,716.50	
ORIX CORP 5.2% 32/09/13	200,000	199,185.39	
OSHKOSH CORP 3.1% 30/03/01	100,000	86,289.29	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.056% 25/04/05	200,000	188,426.95	
OTIS WORLDWIDE CORP 2.565% 30/02/15	40,000	34,030.65	
OVINTIV INC 8.125% 30/09/15	200,000	219,806.34	
OWENS CORNING 3.95% 29/08/15	180,000	166,009.93	
OWL ROCK CAPITAL CORP 4% 25/03/30	100,000	94,238.27	

OWL ROCK CAPITAL CORP 4.25% 26/01/15	200,000	184,457.80	
OWL ROCK CORE INCOME COR 7.75% 27/09/16	100,000	99,316.65	
PACCAR FINANCIAL CORP 2.85% 25/04/07	150,000	143,554.54	
PACCAR FINANCIAL CORP 4.95% 25/10/03	200,000	198,383.81	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.45% 25/07/01	300,000	283,000.58	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 3.75% 28/07/01	100,000	88,816.50	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.2% 29/03/01	500,000	444,204.21	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.55% 30/07/01	300,000	268,000.20	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 5.45% 27/06/15	100,000	96,508.57	
PACKAGING CORP OF AMERIC 3.4% 27/12/15	35,000	32,292.98	
PARAMOUNT GLOBAL 4.2% 32/05/19	100,000	82,515.87	
PARAMOUNT GLOBAL 7.875% 30/07/30	200,000	208,732.14	
PARKER-HANNIFIN CORP 3.3% 24/11/21	150,000	144,796.94	
PARKER-HANNIFIN CORP 4.25% 27/09/15	200,000	192,469.68	
PARTNERRE FINANCE B LLC 3.7% 29/07/02	100,000	90,558.86	
PAYPAL HOLDINGS INC 2.3% 30/06/01	300,000	251,013.58	
PAYPAL HOLDINGS INC 2.4% 24/10/01	105,000	100,985.18	
PAYPAL HOLDINGS INC 2.85% 29/10/01	200,000	175,689.98	
PECO ENERGY CO 4.9% 33/06/15	105,000	103,098.30	
PEPSICO INC 1.95% 31/10/21	150,000	121,969.33	
PEPSICO INC 2.75% 30/03/19	400,000	355,256.17	
PEPSICO INC 2.85% 26/02/24	100,000	95,003.28	
PEPSICO INC 3.6% 28/02/18	500,000	478,477.59	
PERKINELMER INC 0.85% 24/09/15	60,000	56,444.54	
PERKINELMER INC 1.9% 28/09/15	200,000	168,325.42	
PERKINELMER INC 2.25% 31/09/15	70,000	55,137.08	
PFIZER INC 1.7% 30/05/28	500,000	410,035.24	
PFIZER INC 2.625% 30/04/01	200,000	175,673.68	
PFIZER INC 3.45% 29/03/15	100,000	93,251.76	
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.45% 26/05/19	195,000	191,809.30	
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.45% 28/05/19	500,000	486,526.55	
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.75% 33/05/19	265,000	260,004.68	
PHILIP MORRIS INTL INC 1.5% 25/05/01	200,000	187,113.62	
PHILIP MORRIS INTL INC 2.1% 30/05/01	200,000	163,300.49	
PHILIP MORRIS INTL INC 2.75% 26/02/25	150,000	140,734.45	
PHILIP MORRIS INTL INC 3.125% 27/08/17	100,000	92,971.31	
PHILIP MORRIS INTL INC 4.875% 26/02/13	100,000	98,884.21	
PHILIP MORRIS INTL INC 4.875% 28/02/15	100,000	97,862.12	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.125% 30/02/15	100,000	97,663.47	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.375% 33/02/15	100,000	98,259.90	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.625% 29/11/17	100,000	101,003.69	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.75% 32/11/17	200,000	202,183.34	
PHILLIPS 66 3.15% 29/12/15	300,000	258,943.40	
PHILLIPS 66 CO 3.55% 26/10/01	75,000	70,148.64	
PHYSICIANS REALTY LP 2.625% 31/11/01	100,000	76,565.57	
PIEDMONT NATURAL GAS CO 2.5% 31/03/15	155,000	124,391.25	
PIEDMONT OPERATING PARTN 3.15% 30/08/15	100,000	72,565.93	
PILGRIM'S PRIDE CORP 4.25% 31/04/15	200,000	169,166.32	
PIONEER NATURAL RESOURCE 1.9% 30/08/15	300,000	239,912.80	
PLAINS ALL AMER PIPELINE 3.8% 30/09/15	200,000	175,508.56	
PLAINS ALL AMER PIPELINE 4.65% 25/10/15	200,000	194,755.21	
PNC BANK NA 2.7% 29/10/22	100,000	82,914.56	
PNC BANK NA 3.25% 25/06/01	150,000	143,430.22	
PNC BANK NA 4.05% 28/07/26	250,000	228,058.86	
PNC FINANCIAL SERVICES 2.2% 24/11/01	300,000	285,399.92	
PNC FINANCIAL SERVICES 4.758% 27/01/26	100,000	97,395.74	
PNC FINANCIAL SERVICES 5.068% 34/01/24	200,000	188,220.71	

PNC FINANCIAL SERVICES 5.354% 28/12/02	100,000	98,056.37	
PNC FINANCIAL SERVICES 6.037% 33/10/28	250,000	251,572.96	
PPG INDUSTRIES INC 2.55% 30/06/15	100,000	84,050.98	
PRAXAIR INC 1.1% 30/08/10	100,000	78,521.39	
PRAXAIR INC 3.2% 26/01/30	50,000	48,098.52	
PRICELINE GROUP 3.6% 26/06/01	100,000	96,082.42	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 2.125% 30/06/15	100,000	80,107.82	
PRINCIPAL FINANCIAL GRP 3.7% 29/05/15	50,000	45,368.80	
PROCTER & GAMBLE 2.45% 26/11/03	100,000	93,241.23	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 1% 26/04/23	45,000	40,586.71	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.8% 27/03/25	200,000	187,114.69	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.05% 33/01/26	200,000	194,675.60	
PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.1% 26/01/26	100,000	98,471.41	
PROGRESS ENERGY INC 7% 31/10/30	500,000	539,123.28	
PROGRESSIVE CORP 3.2% 30/03/26	100,000	88,427.08	
PROGRESSIVE CORP 6.625% 29/03/01	100,000	107,278.16	
PROLOGIS LP 2.125% 27/04/15	50,000	44,688.12	
PROLOGIS LP 2.25% 30/04/15	400,000	334,200.40	
PROLOGIS LP 4% 28/09/15	50,000	47,442.10	
PROLOGIS LP 4.875% 28/06/15	100,000	98,328.58	
PROSPECT CAPITAL CORP 3.364% 26/11/15	55,000	46,072.64	
PROV ST JOSEPH HLTH OBL 2.532% 29/10/01	100,000	83,098.98	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 1.5% 26/03/10	250,000	227,772.82	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4.5% 47/09/15	100,000	91,314.52	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 6% 52/09/01	200,000	189,344.40	
PRUDENTIAL FUNDING ASIA 3.125% 30/04/14	100,000	87,506.19	
PUBLIC SERVICE COLORADO 3.7% 28/06/15	50,000	46,889.87	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 2.45% 30/01/15	35,000	29,804.26	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 25/05/15	150,000	143,806.55	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 3% 27/05/15	100,000	92,764.66	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC 4.65% 33/03/15	100,000	96,494.36	
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS 5.85% 27/11/15	100,000	101,375.03	
PUBLIC SERVICE OKLAHOMA 2.2% 31/08/15	100,000	79,583.86	
PUBLIC STORAGE 3.094% 27/09/15	125,000	115,423.66	
PUGET ENERGY INC 2.379% 28/06/15	100,000	85,390.24	
PULTEGROUP INC 5.5% 26/03/01	200,000	198,220.61	
QORVO INC 1.75% 24/12/15	130,000	121,007.61	
QUALCOMM INC 3.25% 27/05/20	100,000	94,098.21	
QUALCOMM INC 3.45% 25/05/20	200,000	194,130.45	
QUALCOMM INC 4.25% 32/05/20	150,000	143,663.55	
QUANTA SERVICES INC 0.95% 24/10/01	100,000	94,051.61	
QUEST DIAGNOSTICS INC 3.5% 25/03/30	300,000	289,285.74	
RADIAN GROUP INC 6.625% 25/03/15	200,000	199,675.88	
RALPH LAUREN CORP 3.75% 25/09/15	50,000	48,214.90	
RAYTHEON TECH CORP 2.25% 30/07/01	200,000	165,984.50	
RAYTHEON TECH CORP 2.375% 32/03/15	200,000	161,286.66	
RAYTHEON TECH CORP 4.125% 28/11/16	500,000	477,026.20	
REALTY INCOME CORP 0.75% 26/03/15	80,000	70,178.56	
REALTY INCOME CORP 3.25% 31/01/15	400,000	343,329.00	
REALTY INCOME CORP 3.65% 28/01/15	200,000	184,886.48	
REALTY INCOME CORP 3.95% 27/08/15	40,000	37,617.86	
REALTY INCOME CORP 4.85% 30/03/15	65,000	62,039.18	
REGAL REXNORD CORP 6.3% 30/02/15	200,000	197,292.72	
REGENCY CENTERS LP 4.125% 28/03/15	150,000	138,853.13	
REGENERON PHARMACEUTICAL 1.75% 30/09/15	135,000	106,284.30	
REGIONS FINANCIAL CORP 1.8% 28/08/12	100,000	80,651.86	
REINSURANCE GRP OF AMER 3.15% 30/06/15	35,000	29,674.49	



REINSURANCE GRP OF AMER 3.9% 29/05/15	75,000	67,684.54	
RELX CAPITAL INC 3% 30/05/22	185,000	163,231.75	
RENAISSANCERE FINANCE 3.45% 27/07/01	65,000	59,995.23	
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6% 29/04/15	25,000	22,087.12	
RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75% 33/06/05	100,000	96,592.53	
REPUBLIC SERVICES INC 2.375% 33/03/15	200,000	159,586.94	
REPUBLIC SERVICES INC 2.5% 24/08/15	45,000	43,422.65	
REPUBLIC SERVICES INC 3.375% 27/11/15	60,000	55,985.42	
REPUBLIC SERVICES INC 3.95% 28/05/15	100,000	95,041.48	
REYNOLDS AMERICAN INC 4.45% 25/06/12	450,000	437,424.68	
RIO TINTO FIN USA LTD 7.125% 28/07/15	100,000	109,183.84	
ROCKWELL AUTOMATION 1.75% 31/08/15	100,000	79,054.96	
ROGERS COMMUNICATIONS IN 2.9% 26/11/15	100,000	91,436.75	
ROGERS COMMUNICATIONS IN 3.2% 27/03/15	65,000	59,973.66	
ROGERS COMMUNICATIONS IN 3.625% 25/12/15	200,000	189,294.49	
ROPER TECHNOLOGIES INC 2% 30/06/30	300,000	241,141.89	
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.8% 26/12/15	155,000	147,793.49	
ROYAL BANK OF CANADA 0.65% 24/07/29	100,000	94,812.32	
ROYAL BANK OF CANADA 1.6% 25/01/21	200,000	188,170.14	
ROYAL BANK OF CANADA 2.3% 31/11/03	100,000	79,717.74	
ROYAL BANK OF CANADA 3.375% 25/04/14	200,000	192,676.34	
ROYAL BANK OF CANADA 4.65% 26/01/27	650,000	631,040.25	
ROYAL BANK OF CANADA 4.9% 28/01/12	150,000	146,800.31	
ROYAL BANK OF CANADA 4.95% 25/04/25	180,000	177,788.20	
ROYAL BANK OF CANADA 5% 33/05/02	200,000	191,628.07	
ROYAL BANK OF CANADA 5.66% 24/10/25	100,000	100,014.07	
ROYAL BANK OF CANADA 6% 27/11/01	100,000	101,948.57	
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC 4.445% 30/05/08	200,000	182,460.20	
ROYALTY PHARMA PLC 1.2% 25/09/02	200,000	180,679.36	
ROYALTY PHARMA PLC 2.2% 30/09/02	65,000	51,469.18	
RPM INTERNATIONAL INC 4.55% 29/03/01	50,000	46,519.85	
RYDER SYSTEM INC 1.75% 26/09/01	65,000	57,983.26	
RYDER SYSTEM INC 4.3% 27/06/15	200,000	190,643.53	
S&P GLOBAL INC 2.9% 32/03/01	100,000	85,393.87	
S&P GLOBAL INC 4.25% 29/05/01	200,000	193,015.86	
S&P GLOBAL INC 4.75% 28/08/01	200,000	197,171.23	
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.2% 28/03/15	300,000	281,983.30	
SABINE PASS LIQUEFACTION 5.625% 25/03/01	200,000	199,474.89	
SABRA HEALTH CARE LP 3.2% 31/12/01	200,000	146,841.43	
SABRA HEALTH/CAPTL CORP 3.9% 29/10/15	50,000	40,278.33	
SALESFORCE.COM INC 0.625% 24/07/15	55,000	52,319.19	
SALESFORCE.COM INC 1.95% 31/07/15	80,000	64,852.68	
SALESFORCE.COM INC 3.7% 28/04/11	100,000	95,353.01	
SANOFI 3.625% 28/06/19	100,000	95,422.12	
SANTANDER HOLDINGS USA 2.49% 28/01/06	35,000	30,026.96	
SANTANDER HOLDINGS USA 3.45% 25/06/02	300,000	283,589.91	
SANTANDER HOLDINGS USA 4.4% 27/07/13	120,000	112,285.78	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 1.673% 27/06/14	200,000	172,525.49	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 3.823% 28/11/03	200,000	178,263.22	
SANTANDER UK GROUP HLDGS 6.833% 26/11/21	200,000	200,884.00	
SEMPRA ENERGY 3.3% 25/04/01	400,000	383,838.21	
SEMPRA ENERGY 3.4% 28/02/01	100,000	91,300.17	
SHELL INTERNATIONAL 2.875% 26/05/10	200,000	189,889.96	
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.375% 29/11/07	100,000	86,704.16	
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.25% 25/05/11	200,000	193,347.20	
SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875% 28/11/13	150,000	143,943.92	
SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45% 27/06/01	100,000	93,469.93	

SHERWIN-WILLIAMS CO 4.25% 25/08/08	200,000	195,679.25	
SIMON PROPERTY GROUP LP 1.75% 28/02/01	500,000	423,981.84	
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.25% 32/01/15	100,000	76,821.46	
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.65% 30/07/15	100,000	83,759.61	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.25% 26/11/30	100,000	93,243.88	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.5% 25/09/01	65,000	62,220.79	
SIXTH STREET SPECIALTY 2.5% 26/08/01	65,000	56,739.83	
SMITH & NEPHEW PLC 2.032% 30/10/14	50,000	39,845.91	
SONOCO PRODUCTS CO 2.25% 27/02/01	100,000	88,647.43	
SOUTHERN CAL EDISON 2.25% 30/06/01	35,000	28,848.37	
SOUTHERN CAL EDISON 2.5% 31/06/01	50,000	40,956.57	
SOUTHERN CO 3.7% 30/04/30	250,000	226,126.66	
SOUTHERN CO 4% 51/01/15	600,000	555,241.50	
SOUTHERN CO 5.2% 33/06/15	200,000	194,445.97	
SOUTHWEST AIRLINES CO 3% 26/11/15	100,000	92,128.75	
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.125% 27/06/15	170,000	167,824.91	
SOUTHWEST GAS CORP 4.05% 32/03/15	200,000	177,822.41	
SOUTHWESTERN ELEC POWER 1.65% 26/03/15	100,000	90,172.84	
SOUTHWESTERN ELEC POWER 4.1% 28/09/15	100,000	94,035.39	
SOUTHWESTERN ELEC POWER 5.3% 33/04/01	200,000	193,705.09	
SPIRIT REALTY LP 3.2% 27/01/15	100,000	89,501.03	
SPIRIT REALTY LP 3.4% 30/01/15	100,000	84,177.21	
SSM HEALTH CARE 4.894% 28/06/01	100,000	97,283.70	
STANLEY BLACK & DECKER I 2.3% 30/03/15	200,000	162,768.27	
STANLEY BLACK & DECKER I 3.4% 26/03/01	70,000	66,173.42	
STANLEY BLACK & DECKER I 4% 25/03/15	30,000	22,765.74	
STARBUCKS CORP 2% 27/03/12	200,000	178,449.91	
STARBUCKS CORP 2.55% 30/11/15	200,000	167,935.84	
STARBUCKS CORP 3.5% 28/03/01	50,000	46,577.46	
STARBUCKS CORP 3.8% 25/08/15	100,000	97,014.31	
STARBUCKS CORP 4.8% 33/02/15	145,000	141,230.81	
STEEL DYNAMICS INC 2.8% 24/12/15	150,000	143,480.65	
STEWART INFORMATION SERV 3.6% 31/11/15	100,000	75,578.81	
STIFEL FIANCIAL 4.25% 24/07/18	100,000	97,892.17	
STORE CAPITAL CORP 2.7% 31/12/01	200,000	136,092.87	
STORE CAPITAL CORP 4.625% 29/03/15	50,000	41,583.79	
STRYKER CORP 1.95% 30/06/15	100,000	82,504.16	
STRYKER CORP 3.375% 25/11/01	300,000	287,164.94	
STRYKER CORP 3.5% 26/03/15	25,000	23,889.83	
SUMITOMO MITSUI FINANCIA 3.784% 26/03/09	150,000	142,890.61	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.948% 26/01/12	200,000	177,745.38	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 1.402% 26/09/17	200,000	175,039.35	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.13% 30/07/08	500,000	399,838.63	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.222% 31/09/17	200,000	156,345.26	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.348% 25/01/15	300,000	284,887.83	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.448% 24/09/27	200,000	191,792.76	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 2.75% 30/01/15	400,000	339,572.66	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.364% 27/07/12	200,000	185,221.41	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.544% 28/01/17	100,000	91,533.06	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 5.71% 30/01/13	200,000	199,799.75	
SUN COMMUNITIES OPER LP 4.2% 32/04/15	100,000	85,677.60	
SUNTRUST BANK 3.3% 26/05/15	200,000	182,853.68	
SUNTRUST BANKS INC 4% 25/05/01	150,000	145,103.64	
SUTTER HEALTH 2.294% 30/08/15	100,000	81,478.43	
SUZANO AUSTRIA GMBH 3.125% 32/01/15	300,000	236,590.83	
SUZANO AUSTRIA GMBH 6% 29/01/15	200,000	198,954.00	
SYNCHRONY FINANCIAL 2.875% 31/10/28	450,000	323,662.54	

SYNCHRONY FINANCIAL 3.7% 26/08/04	150,000	134,607.19	
SYNCHRONY FINANCIAL 4.875% 25/06/13	100,000	95,141.97	
SYSCO CORPORATION 2.45% 31/12/14	100,000	80,365.13	
SYSCO CORPORATION 3.75% 25/10/01	100,000	96,785.48	
SYSCO CORPORATION 5.95% 30/04/01	120,000	123,924.43	
TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.05% 30/03/31	200,000	163,913.94	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF 3.55% 25/04/14	100,000	96,393.69	
TANGER PROPERTIES LP 2.75% 31/09/01	200,000	142,828.45	
TARGA RESOURCES CORP 4.2% 33/02/01	200,000	174,269.41	
TARGA RESOURCES PARTNERS 6.5% 27/07/15	200,000	198,835.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS 6.875% 29/01/15	200,000	201,826.00	
TARGET CORP 2.25% 25/04/15	100,000	95,361.73	
TARGET CORP 2.65% 30/09/15	400,000	343,704.07	
TARGET CORP 4.4% 33/01/15	35,000	33,464.21	
TARGET CORP 4.5% 32/09/15	100,000	96,039.48	
TC PIPELINES LP 3.9% 27/05/25	40,000	37,769.91	
TCI COMMUNICATIONS INC 7.875% 26/02/15	500,000	529,738.90	
TD SYNEX CORP 2.375% 28/08/09	100,000	81,454.66	
TD SYNEX CORP 2.65% 31/08/09	100,000	75,258.09	
TECK RESOURCES LIMITED 3.9% 30/07/15	100,000	89,700.11	
TELEFONICA EMISIONES SAU 4.103% 27/03/08	150,000	142,774.35	
TELUS CORP 2.8% 27/02/16	50,000	45,924.48	
TENCENT MUSIC ENT GRP 2% 30/09/03	200,000	155,152.47	
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.75% 30/05/04	200,000	165,414.23	
TEXAS INSTRUMENTS INC 2.25% 29/09/04	65,000	56,146.46	
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.9% 33/03/14	200,000	201,212.03	
TEXTRON INC 4% 26/03/15	25,000	24,040.71	
THERMO FISHER SCIENTIFIC 1.215% 24/10/18	275,000	260,241.15	
THERMO FISHER SCIENTIFIC 1.75% 28/10/15	35,000	29,872.11	
THERMO FISHER SCIENTIFIC 4.95% 32/11/21	100,000	99,944.62	
TIMKEN CO/THE 3.875% 24/09/01	70,000	68,122.09	
TJX COS INC 3.875% 30/04/15	200,000	188,315.48	
T-MOBILE USA INC 2.25% 26/02/15	300,000	275,542.17	
T-MOBILE USA INC 2.875% 31/02/15	1,000,000	832,066.30	
T-MOBILE USA INC 3.5% 25/04/15	300,000	288,942.09	
T-MOBILE USA INC 3.75% 27/04/15	400,000	375,809.41	
T-MOBILE USA INC 3.875% 30/04/15	200,000	181,668.77	
TORONTO-DOMINION BANK 0.7% 24/09/10	200,000	188,595.69	
TORONTO-DOMINION BANK 0.75% 25/09/11	600,000	543,243.66	
TORONTO-DOMINION BANK 1.15% 25/06/12	300,000	276,668.43	
TORONTO-DOMINION BANK 1.25% 24/12/13	65,000	61,261.71	
TORONTO-DOMINION BANK 2.45% 32/01/12	150,000	120,867.65	
TORONTO-DOMINION BANK 2.8% 27/03/10	100,000	91,226.08	
TORONTO-DOMINION BANK 3.625% 31/09/15	200,000	183,676.60	
TOTAL CAPITAL INTL SA 2.829% 30/01/10	100,000	88,314.27	
TOTALENERGIES CAP INTL 2.434% 25/01/10	200,000	191,742.89	
TOYOTA MOTOR CORP 3.669% 28/07/20	70,000	66,185.69	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.8% 25/10/16	600,000	543,704.67	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.8% 25/02/13	200,000	189,185.15	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.9% 28/04/06	100,000	87,003.46	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.9% 31/09/12	100,000	79,298.83	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.2% 27/01/11	100,000	93,770.09	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.65% 25/08/18	400,000	386,992.48	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.45% 26/05/18	300,000	294,475.74	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.625% 28/01/12	125,000	123,248.79	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.4% 25/11/10	100,000	100,591.95	
TRACTOR SUPPLY CO 5.25% 33/05/15	30,000	29,301.06	

TRANE TECHNOLOGIES LUX 3.8% 29/03/21	200,000	186,708.59	
TRANSCANADA PIPELINES 1% 24/10/12	60,000	56,410.94	
TRANSCANADA PIPELINES 4.1% 30/04/15	100,000	91,433.07	
TRANSCANADA PIPELINES 4.875% 26/01/15	100,000	98,451.61	
TRANSCANADA PIPELINES 6.203% 26/03/09	100,000	99,857.12	
TRIMBLE INC 4.9% 28/06/15	100,000	96,844.83	
TRUIST BANK 1.5% 25/03/10	250,000	231,057.10	
TRUIST BANK 4.05% 25/11/03	600,000	571,182.65	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.267% 27/03/02	60,000	52,803.55	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.887% 29/06/07	225,000	185,599.04	
TRUIST FINANCIAL CORP 1.95% 30/06/05	65,000	50,616.98	
TRUIST FINANCIAL CORP 5.122% 34/01/26	200,000	185,328.85	
TSMC ARIZONA CORP 1.75% 26/10/25	200,000	178,626.96	
TSMC ARIZONA CORP 2.5% 31/10/25	200,000	165,036.82	
TUCSON ELECTRIC POWER CO 3.25% 32/05/15	100,000	85,183.00	
TYCO ELECTRONICS GROUP 3.7% 26/02/15	100,000	96,080.42	
TYSON FOODS INC 3.95% 24/08/15	100,000	97,997.08	
TYSON FOODS INC 4.35% 29/03/01	100,000	94,345.16	
UBS GROUP AG 4.55% 26/04/17	150,000	143,857.71	
UDR INC 3% 31/08/15	50,000	41,640.90	
UDR INC 3.5% 27/07/01	200,000	184,985.80	
UNILEVER CAPITAL CORP 1.75% 31/08/12	100,000	79,489.82	
UNILEVER CAPITAL CORP 2.125% 29/09/06	300,000	256,935.55	
UNILEVER CAPITAL CORP 3.1% 25/07/30	100,000	96,015.24	
UNILEVER CAPITAL CORP 3.5% 28/03/22	100,000	94,853.49	
UNION ELECTRIC CO 2.95% 27/06/15	50,000	46,162.36	
UNION PACIFIC CORP 2.75% 26/03/01	100,000	94,244.02	
UNION PACIFIC CORP 4.75% 26/02/21	565,000	559,389.12	
UNITED AIR 2020-1 A PTT 5.875% 27/10/15	323,407.48	320,988.77	
UNITED AIR 2020-1 B PTT 4.875% 26/01/15	68,500	65,600.31	
UNITED PARCEL SERVICE 2.2% 24/09/01	20,000	19,277.00	
UNITED PARCEL SERVICE 3.05% 27/11/15	150,000	139,874.98	
UNITED PARCEL SERVICE 3.9% 25/04/01	100,000	97,857.18	
UNITED PARCEL SERVICE 4.875% 33/03/03	100,000	99,276.95	
UNITEDHEALTH GROUP INC 1.15% 26/05/15	100,000	89,946.59	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2% 30/05/15	500,000	414,219.95	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.375% 24/08/15	70,000	67,641.85	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.875% 29/08/15	75,000	66,779.37	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.45% 27/01/15	100,000	95,357.37	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7% 25/12/15	20,000	19,291.29	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.875% 28/12/15	25,000	23,736.54	
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.2% 32/05/15	100,000	93,720.12	
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.25% 29/01/15	200,000	192,709.44	
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.5% 33/04/15	200,000	191,547.68	
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.15% 25/10/15	45,000	45,111.72	
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.25% 28/02/15	100,000	101,195.79	
UNIVERSAL HEALTH SVCS 1.65% 26/09/01	65,000	56,710.84	
US BANCORP 2.677% 33/01/27	150,000	118,170.19	
US BANCORP 4.548% 28/07/22	700,000	663,981.36	
US BANCORP 4.653% 29/02/01	200,000	189,396.60	
US BANCORP 4.967% 33/07/22	100,000	88,707.64	
US BANCORP 5.727% 26/10/21	100,000	99,980.38	
US BANCORP 5.775% 29/06/12	200,000	197,857.76	
US BANCORP 5.836% 34/06/12	200,000	197,197.70	
US BANCORP 5.85% 33/10/21	100,000	98,479.87	
US BANK NA CINCINNATI 2.05% 25/01/21	250,000	235,727.54	
VALE OVERSEAS LIMITED 3.75% 30/07/08	100,000	86,983.75	

VALE OVERSEAS LIMITED 6.125% 33/06/12	115,000	113,936.25	
VALERO ENERGY CORP 2.8% 31/12/01	100,000	81,229.97	
VALERO ENERGY CORP 4.35% 28/06/01	48,000	45,517.90	
VENTAS REALTY LP 3.5% 25/02/01	400,000	382,919.07	
VENTAS REALTY LP 4.4% 29/01/15	100,000	92,329.40	
VERISK ANALYTICS INC 4% 25/06/15	100,000	96,973.57	
VERIZON COMMUNICATIONS 0.85% 25/11/20	600,000	540,747.82	
VERIZON COMMUNICATIONS 1.68% 30/10/30	197,000	153,755.62	
VERIZON COMMUNICATIONS 2.355% 32/03/15	400,000	316,482.34	
VERIZON COMMUNICATIONS 3.376% 25/02/15	300,000	289,754.22	
VERIZON COMMUNICATIONS 4.016% 29/12/03	200,000	185,230.14	
VERIZON COMMUNICATIONS 4.125% 27/03/16	200,000	193,457.35	
VERIZON COMMUNICATIONS 7.75% 30/12/01	500,000	570,569.04	
VF CORP 2.4% 25/04/23	100,000	93,794.63	
VF CORP 2.95% 30/04/23	65,000	52,973.90	
VIACOMCBS INC 3.7% 28/06/01	200,000	176,745.67	
VIATRIS INC 2.3% 27/06/22	300,000	260,621.21	
VIATRIS INC 2.7% 30/06/22	100,000	79,816.73	
VICI PROPERTIES LP 4.375% 25/05/15	100,000	96,694.32	
VICI PROPERTIES LP 4.95% 30/02/15	100,000	91,780.98	
VICI PROPERTIES LP 5.125% 32/05/15	100,000	92,133.73	
VIRGINIA ELEC & POWER CO 3.1% 25/05/15	100,000	95,467.56	
VIRGINIA ELECTRIC & POWE 3.15% 26/01/15	200,000	189,841.75	
VISA INC 1.9% 27/04/15	350,000	316,231.46	
VISA INC 3.15% 25/12/14	300,000	287,546.91	
VMWARE INC 1% 24/08/15	65,000	61,585.67	
VMWARE INC 1.4% 26/08/15	140,000	123,218.46	
VMWARE INC 3.9% 27/08/21	100,000	94,011.21	
VMWARE INC 4.7% 30/05/15	200,000	188,033.02	
VODAFONE GROUP PLC 7.875% 30/02/15	200,000	226,622.78	
VONTIER CORP 2.4% 28/04/01	100,000	82,830.00	
VORNADO REALTY LP 3.5% 25/01/15	100,000	93,851.66	
VOYA FINANCIAL 3.65% 26/06/15	100,000	93,689.32	
VULCAN MATERIALS CO 4.5% 25/04/01	100,000	98,073.69	
WABTEC 4.95% 28/09/15	150,000	143,450.03	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 3.2% 30/04/15	75,000	62,784.55	
WALMART INC 1.05% 26/09/17	65,000	57,808.74	
WALMART INC 1.5% 28/09/22	400,000	343,870.94	
WALMART INC 2.375% 29/09/24	11,000	9,605.53	
WALMART INC 3.55% 25/06/26	100,000	97,305.70	
WALMART INC 3.9% 25/09/09	200,000	195,691.64	
WALMART INC 3.95% 27/09/09	100,000	97,441.60	
WALMART INC 4.15% 32/09/09	200,000	193,641.35	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2% 29/09/01	265,000	222,939.32	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.2% 28/01/13	100,000	89,618.21	
WALT DISNEY COMPANY/THE 2.95% 27/06/15	100,000	93,288.60	
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.7% 24/09/15	100,000	97,805.11	
WALT DISNEY COMPANY/THE 3.8% 30/03/22	600,000	559,060.02	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 3.638% 25/03/15	100,000	96,310.65	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.054% 29/03/15	200,000	181,227.15	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.279% 32/03/15	400,000	347,826.30	
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.412% 26/03/15	200,000	200,179.89	
WASTE CONNECTIONS INC 3.5% 29/05/01	200,000	182,705.37	
WASTE MANAGEMENT INC 2% 29/06/01	100,000	84,321.35	
WASTE MANAGEMENT INC 4.15% 32/04/15	100,000	93,902.07	
WEC ENERGY GROUP INC 4.75% 28/01/15	100,000	96,917.60	
WEIBO CORP 3.375% 30/07/08	200,000	155,934.83	

WELLS FARGO & CO 3.55% 25/09/29	200,000	191,794.91	
WELLS FARGO & COMPANY 2.164% 26/02/11	325,000	306,230.51	
WELLS FARGO & COMPANY 2.188% 26/04/30	95,000	89,111.71	
WELLS FARGO & COMPANY 2.406% 25/10/30	200,000	190,769.36	
WELLS FARGO & COMPANY 3% 25/02/19	700,000	672,126.56	
WELLS FARGO & COMPANY 3.35% 33/03/02	355,000	298,519.00	
WELLS FARGO & COMPANY 3.584% 28/05/22	665,000	614,162.84	
WELLS FARGO & COMPANY 3.908% 26/04/25	345,000	333,109.51	
WELLS FARGO & COMPANY 4.1% 26/06/03	100,000	95,483.71	
WELLS FARGO & COMPANY 4.15% 29/01/24	750,000	702,352.20	
WELLS FARGO & COMPANY 4.54% 26/08/15	100,000	97,671.08	
WELLS FARGO & COMPANY 4.897% 33/07/25	500,000	470,430.28	
WELLS FARGO & COMPANY 5.389% 34/04/24	300,000	292,073.14	
WELLTOWER INC 2.05% 29/01/15	60,000	49,476.46	
WELLTOWER INC 2.7% 27/02/15	100,000	90,056.06	
WELLTOWER INC 4% 25/06/01	100,000	96,456.37	
WELLTOWER INC 4.25% 28/04/15	50,000	46,591.44	
WESTERN DIGITAL CORP 2.85% 29/02/01	400,000	316,318.00	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 4.3% 30/02/01	200,000	178,748.95	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 6.15% 33/04/01	200,000	197,278.06	
WESTLAKE CHEMICAL CORP 0.875% 24/08/15	100,000	94,446.14	
WESTPAC BANKING CORP 1.953% 28/11/20	100,000	85,015.15	
WESTPAC BANKING CORP 2.15% 31/06/03	100,000	82,497.21	
WESTPAC BANKING CORP 2.65% 30/01/16	500,000	436,282.26	
WESTPAC BANKING CORP 2.668% 35/11/15	85,000	64,333.51	
WESTPAC BANKING CORP 2.894% 30/02/04	100,000	93,424.49	
WESTPAC BANKING CORP 3.02% 36/11/18	100,000	75,435.21	
WESTPAC BANKING CORP 3.735% 25/08/26	100,000	96,926.73	
WESTPAC BANKING CORP 4.11% 34/07/24	150,000	129,637.39	
WESTPAC BANKING CORP 4.322% 31/11/23	100,000	92,149.45	
WESTPAC BANKING CORP 5.457% 27/11/18	200,000	201,861.60	
WHIRLPOOL CORP 3.7% 25/05/01	100,000	96,602.83	
WILLIAMS COMPANIES INC 5.65% 33/03/15	200,000	199,448.72	
WILLIAMS COMPANIES INC 8.75% 32/03/15	400,000	468,794.92	
WILLIS NORTH AMERICA INC 4.5% 28/09/15	200,000	188,408.62	
WISCONSIN ELECTRIC POWER 1.7% 28/06/15	65,000	55,439.33	
WISCONSIN POWER & LIGHT 4.95% 33/04/01	200,000	194,180.01	
WISCONSIN PUBLIC SERVICE 5.35% 25/11/10	175,000	175,236.02	
WORKDAY INC 3.8% 32/04/01	100,000	88,341.32	
WRKCO INC 4% 28/03/15	50,000	46,186.32	
WRKCO INC 4.9% 29/03/15	200,000	191,806.32	
WW GRAINGER INC 1.85% 25/02/15	50,000	47,377.66	
XCEL ENERGY INC 1.75% 27/03/15	85,000	74,598.09	
XCEL ENERGY INC 2.6% 29/12/01	300,000	254,498.88	
XCEL ENERGY INC 4% 28/06/15	50,000	47,198.40	
XYLEM INC 3.25% 26/11/01	55,000	51,491.89	
YAMANA GOLD INC 2.63% 31/08/15	100,000	76,282.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS 1.45% 24/11/22	200,000	188,516.90	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS 3.05% 26/01/15	100,000	94,251.66	
ZOETIS INC 2% 30/05/15	100,000	82,197.09	
ZOETIS INC 3.9% 28/08/20	25,000	23,728.54	
ZOETIS INC 4.5% 25/11/13	100,000	98,479.10	
ZOETIS INC 5.6% 32/11/16	100,000	102,730.46	
アメリカ・ドル 小計	275,101,224	253,945,575.55 (36,197,402,338)	
社債券 小計		36,197,402,338 (36,197,402,338)	

合計		36,197,402,338 (36,197,402,338)	
----	--	------------------------------------	--

- (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 1,482銘柄	100.0%	100.0%

(注) 組入株式時価比率及び組入投資証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】

(2023年7月31日現在)

資産総額	358,033,272円
負債総額	187,203,235円
純資産総額( - )	170,830,037円
発行済口数	221,079,990口
1口当たり純資産額( / )	0.7727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）

(2023年7月31日現在)

資産総額	36,994,884,205円
負債総額	315,027,296円
純資産総額( - )	36,679,856,909円
発行済口数	14,770,842,766口
1口当たり純資産額( / )	2.4833円



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間にける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

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

###### 2) 運用実施計画の作成

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

###### 3) 運用の実行

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年7月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、125本であり、その純資産総額は3,304,624百万円です（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（2022年4月1日から2023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 (2022年3月31日現在)		当事業年度 (2023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	4,391,110		4,944,755	
有価証券	23,294		24,319	
前払金	119,649		232,900	
前払費用	29,290		34,419	
未収入金	688,466		615,211	
未収委託者報酬	685,229		665,966	
未収収益	42,751		36,568	
流動資産計	5,979,793	75.8	6,554,141	80.5
固定資産				
有形固定資産	375		112	
建物附属設備	1 0		0	
器具備品	1 375		112	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	1,904,306		1,586,165	
長期差入保証金	71,694		42,548	
繰延税金資産	1,826,336		1,537,341	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	1,904,682	24.2	1,586,278	19.5
資産合計	7,884,475	100.0	8,140,419	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)		当事業年度 (2023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	172,682		211,213	
未払金	344,370		341,855	
未払手数料	177,539		180,016	
その他未払金	166,831		161,839	
未払費用	11,699		12,884	
未払法人税等	296,332		176,932	
未払消費税等	30,068		25,106	
賞与引当金	74,876		92,579	
流動負債計	930,030	11.8	860,572	10.6
固定負債				
退職給付引当金	84,840		76,260	
固定負債計	84,840	1.1	76,260	0.9
負債合計	1,014,871	12.9	936,833	11.5
(純資産の部)		%		%
株主資本	6,869,604	87.1	7,203,586	88.5

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	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

科 目	期 別	前事業年度		当事業年度	
		自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	金 額	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	金 額
			構成比		構成比
			%		%
営業収益					
委託者報酬		2,655,508		2,681,106	
投資顧問収入		3,030,659		2,805,885	
その他営業収益	1	85,660		12,640	
営業収益計		5,771,828	100.0	5,499,631	100.0
営業費用					
支払手数料		711,649		753,876	
広告宣伝費		53,735		51,264	
公告費		1,140		1,140	
調査費		712,486		654,933	
調査費		407,466		337,268	
委託調査費		304,641		317,181	
図書費		378		483	
委託計算費		485,872		387,357	
営業雑経費		29,696		44,076	
通信費		3,997		6,765	
印刷費		7,276		14,575	
協会費		12,853		17,758	
諸会費		55		7	
その他		5,512		4,968	
営業費用計		1,994,579	34.6	1,892,648	34.4
一般管理費					
給料		1,568,661		1,475,040	
役員報酬		425,268		251,291	
給料・手当		787,766		816,610	
賞与		285,950		330,579	
賞与引当金繰入額		69,676		76,559	
交際費		1,607		3,676	
旅費交通費		676		10,847	
租税公課		32,240		3,770	
不動産賃借料		60,478		64,855	
退職給付費用		74,675		61,481	
固定資産減価償却費		2,571		765	
福利厚生費		130,238		139,590	
諸経費		186,753		192,029	
一般管理費計		2,057,903	35.7	1,952,057	35.5
営業利益		1,719,345	29.8	1,654,925	30.1
営業外収益					
移転価格調整金	1、 2			131,841	
為替差益		18		1,707	
有価証券運用益		1,013		2,727	

雑収入		881		106	
営業外収益計		1,913	0.0	136,383	2.5
営業外費用					
移転価格調整金	1	363,220		-	
為替差損		214		1,046	
有価証券運用損		1		-	
雑損失		329		73	
営業外費用計		363,766	6.3	1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5	1,790,188	32.6
特別利益					
事業再構築費用戻入		7,084		-	
特別利益計		7,084	0.1	-	0.0
特別損失					
事務処理損失		146		4,303	
固定資産除却損		2,326		-	
特別損失計		2,472	0.0	4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6	1,785,884	32.5
法人税,住民税及び事業税		261,905	4.5	324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5	288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5	1,171,982	21.3

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(838,000)	(838,000)	(838,000)	
当期純利益	-	-	-	1,171,982	1,171,982	1,171,982	
当期変動額合計	-	-	-	333,982	333,982	333,982	
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	

## [ 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 発生の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、投資顧問契約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

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準適用指針の適用にともなう当事業年度における貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書への影響は有りません。

## 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 1,537,341千円

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 (2022年3月31日現在)	当事業年度 (2023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 30,399千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品 30,661千円
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
1. 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。	1. 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事務手数料調整額12,389千円は、損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額131,841千円は、損益計算書の営業外収益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。	2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外収益 131,841千円

##### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28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
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,171,000千円	利益剰余金	188,870.96円	2023年3月31日	2023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、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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。

2023年3月31日現在

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
有価証券	24,319	24,319	-
資産計	24,319	24,319	-

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。

2023年3月31日現在

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	24,319	-	24,319
資産計	-	24,319	-	24,319

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

（有価証券関係）

前事業年度 （2022年3月31日現在）	当事業年度 （2023年3月31日現在）
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 1,013千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 24,319千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,025千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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	至
	2021年4月 1日	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

(単位：千円)

	当事業年度	
	自	至
	2022年4月 1日	2023年3月31日
退職給付債務の期首残高		480,173
勤務費用		53,150
利息費用		-
数理計算上の差異の発生額		12,549
退職給付の支払額		37,376
退職給付債務の期末残高		483,396

## 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	至
	2021年4月 1日	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

(単位：千円)

	当事業年度	
	自	至
	2022年4月 1日	2023年3月31日
年金資産の期首残高		402,431
期待運用収益		2,979
数理計算上の差異の発生額		3,493
事業主からの拠出額		51,651
退職給付の支払額		37,376
年金資産の期末残高		416,191

## 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 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
	<u>84,840</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
積立型制度の退職給付債務	483,396
年金資産	416,191
	<u>67,205</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	67,205
未認識数理計算上の差異	9,055
	<u>76,260</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	76,260

## 5．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 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	<u>55,694</u>
(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	-

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>43,071</u>
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,979
(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	7,098
(6) その他	-

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2023年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.2%

その他 1.8%

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 (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

	当事業年度 (2023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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 2021年4月 1日	自 2022年4月 1日
至 2022年3月31日	至 2023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	19,674	賞与引当金繰入超過額	22,144
退職給付引当金	27,681	退職給付引当金	25,052
(注) 繰越欠損金	1,727,082	(注) 繰越欠損金	1,453,659
その他	51,898	その他	36,485
繰延税金資産 合計	1,826,336	繰延税金資産 合計	1,537,341
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	1,826,336	繰延税金資産の純額	1,537,341

(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（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	(*2) 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。

当事業年度（2023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)	-	-	319,359	158,439	-	975,860	1,453,659
繰延税金資産	-	-	319,359	158,439	-	975,860	(*2) 1,453,659

(\*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1,453,659千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,453,659千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（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023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	8.0%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	3.1%
その他	0.2%	その他	0.6%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%
	=====		=====

## （資産除去債務関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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15,059千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、397千円増加千円減少しました。

## （収益認識関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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、投資顧問収入については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

前事業年度 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		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)		
						役員の 兼任等	事業上の関係						
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・ス トリート・バ ンク・ア ン ト・トラス ト・カンパ ニー	米国 マサチューセツ 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	28,457
								人件費等及び 事務手数料の 支払	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	投資信託計理業 務委託	38,999	前払金	119,051		
							兼職社員の人 件費支払等	人件費等の支払	127,476				
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザー ズ・ユナイ テッド・キン グダム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ	投資顧問料の支 払	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 シンガポ ール 市	136万シ ンガポ ール	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	264 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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当事業年度 自 2022年4月1日 至 2023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	295,434	前払金	3,388		
								投資顧問料の支払	232,843				
								ソフトウェアの使用契約	175,762			未払金	24,509
								人件費等及び事務手数料の受取	12,389				
							移転価格調整金の受取	131,841					
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	39,303	前払金	229,512			
							兼職社員の人件費支払等	127,670					
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	19,754	-	-			
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	250	-	-			
							投資顧問料の支払	22,792					

(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。

## 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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
1株当たり純資産 1,108,000円68銭	1株当たり純資産 1,161,868円75銭
1株当たり当期純利益 135,213円36銭	1株当たり当期純利益 189,029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、記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
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）	838,322	1,171,982
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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（2023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（2023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 (2023年3月末)	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	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	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	

#### (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：914百万ドル（2022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

2023年9月15日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリートUSボンド・オープン（為替ヘッジあり）の2023年1月11日から2023年7月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリートUSボンド・オープン（為替ヘッジあり）の2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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

2023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 稲葉 宏和  
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2022年4月1日から2023年3月31日までの第26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2023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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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。