

コーポレート・ボンド・ インカム(為替ヘッジ型)

【愛称:泰平航路】

【運用報告書(全体版)】

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|------------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券 |
| 信託期間 | 2009年5月29日から2029年5月7日まで |
| 運用方針 | マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建投資適格社債等に投資することにより、信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド 米ドル建投資適格社債等 |
| 当ファンドの運用方法 | ■高格付社債（米ドル建て、投資適格社債）へ投資します。 ■投資対象とする債券の格付けは、A格相当以上を中心とし、業種配分等にも配慮します。 ■対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減します。 |
| 組入制限 | 当ファンド ■株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド ■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 分配方針 | ■毎月5日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 |

第29作成期（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

第169期 / 第170期 / 第171期
決算日2023年6月5日 決算日2023年7月5日 決算日2023年8月7日

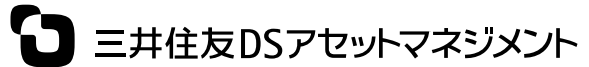
第172期 / 第173期 / 第174期
決算日2023年9月5日 決算日2023年10月5日 決算日2023年11月6日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建投資適格社債等に投資することにより、信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 (分配落) | 準 価 額 | | | 公 社 債 率 組 入 比 | 債 券 先 物 率 比 (買建-売建) | 純 資 産 額 |
|-------------------|------------|-------|---------|-----------|------------------|------------------------|---------------|
| | | 税 分 配 | 込 金 | 期 騰 落 中 率 | | | |
| 145期 (2021年6月7日) | 円 8,180 | | 円 15 | % 0.5 | % 97.9 | % - | 百万円 11,473 |
| 146期 (2021年7月5日) | 8,211 | | 15 | 0.6 | 93.7 | - | 11,371 |
| 147期 (2021年8月5日) | 8,281 | | 15 | 1.0 | 96.8 | - | 11,214 |
| 148期 (2021年9月6日) | 8,207 | | 15 | △0.7 | 95.0 | - | 11,016 |
| 149期 (2021年10月5日) | 8,136 | | 15 | △0.7 | 96.0 | - | 10,798 |
| 150期 (2021年11月5日) | 8,082 | | 15 | △0.5 | 96.1 | - | 10,405 |
| 151期 (2021年12月6日) | 8,054 | | 15 | △0.2 | 95.6 | - | 10,115 |
| 152期 (2022年1月5日) | 7,940 | | 15 | △1.2 | 99.2 | - | 9,729 |
| 153期 (2022年2月7日) | 7,716 | | 15 | △2.6 | 94.0 | - | 9,368 |
| 154期 (2022年3月7日) | 7,704 | | 15 | 0.0 | 92.9 | - | 9,248 |
| 155期 (2022年4月5日) | 7,423 | | 15 | △3.5 | 99.0 | - | 8,868 |
| 156期 (2022年5月6日) | 7,063 | | 10 | △4.7 | 96.9 | - | 8,379 |
| 157期 (2022年6月6日) | 7,138 | | 10 | 1.2 | 94.5 | - | 8,328 |
| 158期 (2022年7月5日) | 7,080 | | 10 | △0.7 | 96.2 | - | 8,237 |
| 159期 (2022年8月5日) | 7,203 | | 10 | 1.9 | 93.0 | - | 8,356 |
| 160期 (2022年9月5日) | 6,969 | | 10 | △3.1 | 95.5 | - | 8,073 |
| 161期 (2022年10月5日) | 6,725 | | 10 | △3.4 | 94.7 | - | 7,762 |
| 162期 (2022年11月7日) | 6,544 | | 10 | △2.5 | 92.8 | - | 7,516 |
| 163期 (2022年12月5日) | 6,786 | | 10 | 3.9 | 86.9 | - | 7,739 |
| 164期 (2023年1月5日) | 6,689 | | 10 | △1.3 | 83.5 | - | 7,660 |
| 165期 (2023年2月6日) | 6,757 | | 10 | 1.2 | 93.8 | - | 7,825 |
| 166期 (2023年3月6日) | 6,524 | | 10 | △3.3 | 97.4 | - | 7,604 |
| 167期 (2023年4月5日) | 6,747 | | 10 | 3.6 | 92.4 | - | 7,922 |
| 168期 (2023年5月8日) | 6,697 | | 10 | △0.6 | 97.2 | - | 7,877 |
| 169期 (2023年6月5日) | 6,573 | | 10 | △1.7 | 99.7 | △1.1 | 7,742 |
| 170期 (2023年7月5日) | 6,518 | | 10 | △0.7 | 100.7 | - | 7,683 |
| 171期 (2023年8月7日) | 6,453 | | 10 | △0.8 | 97.1 | △1.1 | 7,589 |
| 172期 (2023年9月5日) | 6,392 | | 10 | △0.8 | 101.4 | △5.5 | 7,458 |
| 173期 (2023年10月5日) | 6,193 | | 10 | △3.0 | 98.2 | △3.1 | 7,166 |
| 174期 (2023年11月6日) | 6,251 | | 10 | 1.1 | 100.1 | - | 6,941 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 公 社 債 率 | 債 券 先 物 率 (買 建 - 売 建) |
|-------|------------------------|------------|--------|-----------|---------|--------------------------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| 第169期 | (期 首) 2023年 5 月 8 日 | 円 6,697 | % — | % 97.2 | % — | |
| | 5 月末 | 6,590 | △1.6 | 99.7 | △1.9 | |
| | (期 末) 2023年 6 月 5 日 | 6,583 | △1.7 | 99.7 | △1.1 | |
| 第170期 | (期 首) 2023年 6 月 5 日 | 6,573 | — | 99.7 | △1.1 | |
| | 6 月末 | 6,525 | △0.7 | 101.3 | — | |
| | (期 末) 2023年 7 月 5 日 | 6,528 | △0.7 | 100.7 | — | |
| 第171期 | (期 首) 2023年 7 月 5 日 | 6,518 | — | 100.7 | — | |
| | 7 月末 | 6,492 | △0.4 | 96.4 | △0.7 | |
| | (期 末) 2023年 8 月 7 日 | 6,463 | △0.8 | 97.1 | △1.1 | |
| 第172期 | (期 首) 2023年 8 月 7 日 | 6,453 | — | 97.1 | △1.1 | |
| | 8 月末 | 6,423 | △0.5 | 101.0 | △5.4 | |
| | (期 末) 2023年 9 月 5 日 | 6,402 | △0.8 | 101.4 | △5.5 | |
| 第173期 | (期 首) 2023年 9 月 5 日 | 6,392 | — | 101.4 | △5.5 | |
| | 9 月末 | 6,266 | △2.0 | 98.5 | △3.2 | |
| | (期 末) 2023年10月 5 日 | 6,203 | △3.0 | 98.2 | △3.1 | |
| 第174期 | (期 首) 2023年10月 5 日 | 6,193 | — | 98.2 | △3.1 | |
| | 10 月末 | 6,140 | △0.9 | 100.1 | △4.5 | |
| | (期 末) 2023年11月 6 日 | 6,261 | 1.1 | 100.1 | — | |

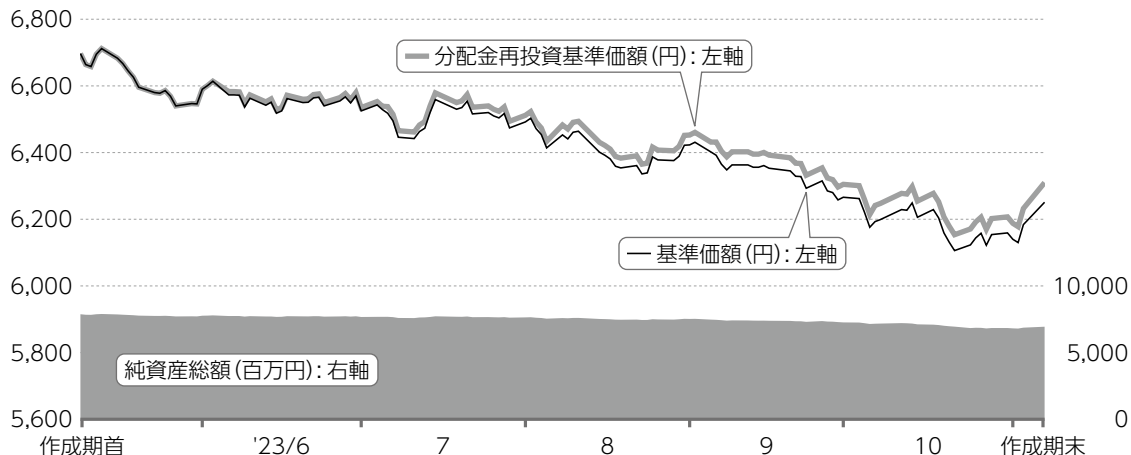
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

| | |
|------|-------------------------------|
| 作成期首 | 6,697円 |
| 作成期末 | 6,251円 (当作成期既払分配金60円(税引前)) |
| 騰落率 | -5.8% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

基準価額の主な変動要因(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建て投資適格社債等に投資しました。実質外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

上昇要因

- 社債の金利収入

下落要因

- 社債利回りの上昇(社債価格は下落)
- 為替のヘッジコスト

投資環境について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

社債スプレッド(国債に対する上乗せ金利)は縮小しましたが、米国10年国債利回りが上昇したことで、社債利回りは上昇しました。

米国債利回りは、米国経済が堅調に推移し、F R B(米連邦準備制度理事会)が利上げを行い、引き締めの金融政策が長期化するとの思惑から上昇しました。

社債スプレッド(国債に対する上乗せ金

利)は、金利変動が大きくなったことで拡大する局面もありましたが、期を通して縮小傾向で推移しました。その結果、社債利回りは上昇しました。

ポートフォリオについて（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

当ファンド

期を通じて「コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド」を高位に組み入れました。なお、実質外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

●債券組入比率

高水準の米ドル建て社債の組入れを維持して、安定的に利息収入を得ることができました。

●業種配分

業種別には、安定業種(消費・公益・通信)への配分を一貫して50%以上に維持しました。安定業種以外では、テクノロジー、資本財といった相対的に格付けが高めである業種に配分しました。

●格付け別配分

格付け別には、全体の平均格付けはA格を維持しました。B B B格の債券は、20%未満に抑制しています。

●デュレーション(投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度)

デュレーションは6年程度としました。

ベンチマークとの差異について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第169期 | 第170期 | 第171期 | 第172期 | 第173期 | 第174期 |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| (対基準価額比率) | (0.15%) | (0.15%) | (0.15%) | (0.16%) | (0.16%) | (0.16%) |
| 当期の収益 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 当期の収益以外 | － | － | － | － | － | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 110 | 114 | 118 | 124 | 128 | 139 |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、「コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。また、実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

米国では、利上げは最終局面とみられますが、堅調な景気や根強いインフレ圧力を背景に、FRBのインフレ抑制姿勢の継続が予想される中、国債発行増などの需給懸念も意識されることから、当面金利は高水準での推移が続く見通しです。ただし、来年の半ばから累積した利上げの効果による

インフレ鈍化と景気減速が徐々に進むと想定されることから、金利は緩やかに低下する展開を予想します。

社債市場については、金融引き締めの影響に対する市場の織り込みが進展すると想定されます。また、米国の景気も底堅く、社債スプレッドは安定的に推移するものと予想します。

以上の投資環境見通しをベースに、社債発行企業の信用力評価や個別証券の投資価値に着目して、銘柄選択を行っていきます。ポートフォリオ全体の業種配分は安定業種を多めとし、格付け配分についてはA格以上を中心とします。金融政策正常化の過程で社債利回りは当面落ち着きどころを探す展開になると見込まれるため、引き続き慎重に買い場を探す姿勢で臨みます。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|------------|---------------|--|
| (a) 信託報酬 | 35円 | 0.540% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は6,422円です。 |
| （投信会社） | (15) | (0.240) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (18) | (0.273) | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (2) | (0.027) | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 |
| （株式） | (-) | (-) | 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （先物・オプション） | (0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | (-) | (-) | |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 |
| （株式） | (-) | (-) | 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （公社債） | (-) | (-) | |
| （投資信託証券） | (-) | (-) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.010 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (1) | (0.008) | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.002) | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 35 | 0.551 | |

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

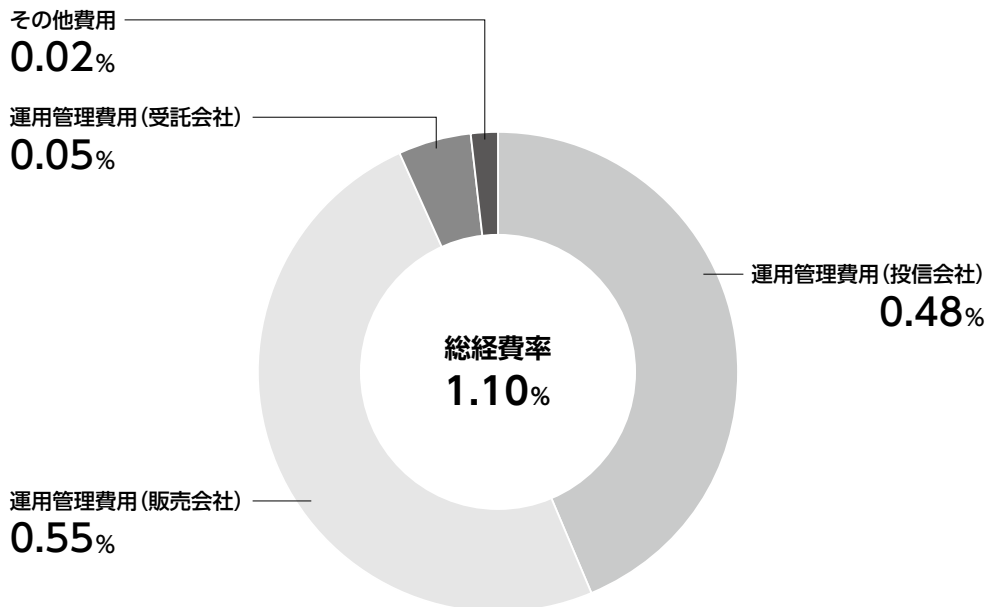
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は1.10%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 当 作 成 期 | | | |
|------------------------|---------|---------|---------------|-----------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド | 千口 — | 千円 — | 千口 510,385 | 千円 1,237,475 |

■ 利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 （2023年5月9日から2023年11月6日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細（2023年11月6日現在）

親投資信託残高

| 種 類 | 作 成 期 首 | | 作 成 期 末 | |
|------------------------|-----------------|---------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 評 価 額 |
| コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド | 千口 3,353,830 | 千円 — | 千口 2,843,444 | 千円 7,108,043 |

※コーポレート・ボンド・インカムマザーファンドの作成期末の受益権総口数は19,726,856,752口です。

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月6日現在)

| 項 目 | 作 成 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド | 千円 7,108,043 | % 98.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 82,508 | 1.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 7,190,551 | 100.0 |

※コーポレート・ボンド・インカムマザーファンドにおいて、作成期末における外貨建資産（49,142,896千円）の投資信託財産総額（49,611,691千円）に対する比率は99.1%です。

※外貨建資産は、作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月5日) (2023年7月5日) (2023年8月7日) (2023年9月5日) (2023年10月5日) (2023年11月6日)

| 項 目 | 第169期末 | 第170期末 | 第171期末 | 第172期末 | 第173期末 | 第174期末 |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| (A) 資 産 | 15,203,663,298円 | 15,415,016,825円 | 14,964,260,800円 | 14,950,482,211円 | 14,144,392,107円 | 13,686,292,036円 |
| コール・ローン等 | 96,615,967 | 85,603,023 | 96,524,453 | 41,726,491 | 81,071,856 | 82,508,708 |
| コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド(評価額) | 7,911,127,599 | 8,133,494,070 | 7,658,166,633 | 7,838,380,207 | 7,263,228,111 | 7,108,043,138 |
| 未 収 入 金 | 7,195,919,732 | 7,195,919,732 | 7,209,569,714 | 7,070,375,513 | 6,800,092,140 | 6,495,740,190 |
| (B) 負 債 | 7,461,393,080 | 7,731,579,210 | 7,374,892,148 | 7,491,936,161 | 6,977,949,226 | 6,744,732,282 |
| 未 払 金 | 7,441,078,005 | 7,709,780,605 | 7,349,506,126 | 7,444,778,342 | 6,952,430,211 | 6,720,648,045 |
| 未払収益分配金 | 11,778,542 | 11,787,910 | 11,760,345 | 11,669,185 | 11,571,776 | 11,105,484 |
| 未払解約金 | 2,009,693 | 3,092,863 | 6,082,543 | 28,968,873 | 7,356,666 | 6,290,440 |
| 未払信託報酬 | 6,493,739 | 6,882,794 | 7,504,699 | 6,486,479 | 6,557,225 | 6,654,583 |
| その他未払費用 | 33,101 | 35,038 | 38,435 | 33,282 | 33,348 | 33,730 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,742,270,218 | 7,683,437,615 | 7,589,368,652 | 7,458,546,050 | 7,166,442,881 | 6,941,559,754 |
| 元 本 | 11,778,542,618 | 11,787,910,286 | 11,760,345,733 | 11,669,185,878 | 11,571,776,166 | 11,105,484,759 |
| 次期繰越損益金 | △ 4,036,272,400 | △ 4,104,472,671 | △ 4,170,977,081 | △ 4,210,639,828 | △ 4,405,333,285 | △ 4,163,925,005 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 11,778,542,618口 | 11,787,910,286口 | 11,760,345,733口 | 11,669,185,878口 | 11,571,776,166口 | 11,105,484,759口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 6,573円 | 6,518円 | 6,453円 | 6,392円 | 6,193円 | 6,251円 |

※当作成期における作成期首元本額11,762,613,324円、作成期中追加設定元本額478,513,303円、作成期中一部解約元本額1,135,641,868円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

〔自2023年5月9日〕〔自2023年6月6日〕〔自2023年7月6日〕〔自2023年8月8日〕〔自2023年9月6日〕〔自2023年10月6日〕
〔至2023年6月5日〕〔至2023年7月5日〕〔至2023年8月7日〕〔至2023年9月5日〕〔至2023年10月5日〕〔至2023年11月6日〕

| 項 目 | 第 169 期 | 第 170 期 | 第 171 期 | 第 172 期 | 第 173 期 | 第 174 期 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 4,908円 | △ 5,016円 | △ 6,813円 | △ 4,250円 | △ 3,367円 | △ 877円 |
| 受 取 利 息 | 10 | 286 | 133 | 200 | 88 | 21 |
| 支 払 利 息 | △ 4,918 | △ 5,302 | △ 6,946 | △ 4,450 | △ 3,455 | △ 898 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 127,015,753 | △ 45,977,487 | △ 56,519,063 | △ 53,471,073 | △ 211,152,757 | △ 81,456,259 |
| 売 買 益 | 203,274,092 | 222,462,100 | 508,290,971 | 233,957,295 | 414,822,447 | 160,289,218 |
| 売 買 損 | △ 330,289,845 | △ 268,439,587 | △ 564,810,034 | △ 287,428,368 | △ 625,975,204 | △ 78,832,959 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 6,526,760 | △ 6,917,797 | △ 7,543,031 | △ 6,519,576 | △ 6,590,519 | △ 6,688,267 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 133,547,421 | △ 52,900,300 | △ 64,068,907 | △ 59,994,899 | △ 217,746,643 | △ 74,767,115 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 2,043,940,080 | △ 2,166,882,355 | △ 2,206,395,895 | △ 2,253,337,389 | △ 2,288,455,261 | △ 2,408,535,050 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 1,847,006,357 | △ 1,872,902,106 | △ 1,888,751,934 | △ 1,885,638,355 | △ 1,887,559,605 | △ 1,819,051,586 |
| (配当等相当額) | (70,934,959) | (71,727,022) | (72,252,768) | (72,188,049) | (72,211,191) | (69,657,785) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,917,941,316) | (△ 1,944,629,128) | (△ 1,961,004,702) | (△ 1,957,826,404) | (△ 1,959,770,796) | (△ 1,888,709,371) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | △ 4,024,493,858 | △ 4,092,684,761 | △ 4,159,216,736 | △ 4,198,970,643 | △ 4,393,761,509 | △ 4,152,819,521 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 11,778,542 | △ 11,787,910 | △ 11,760,345 | △ 11,669,185 | △ 11,571,776 | △ 11,105,484 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | △ 4,036,272,400 | △ 4,104,472,671 | △ 4,170,977,081 | △ 4,210,639,828 | △ 4,405,333,285 | △ 4,163,925,005 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 1,847,006,357 | △ 1,872,902,106 | △ 1,888,751,934 | △ 1,885,638,355 | △ 1,887,559,605 | △ 1,819,051,586 |
| (配当等相当額) | (71,024,589) | (71,860,175) | (72,420,638) | (72,284,669) | (72,346,773) | (69,693,794) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,918,030,946) | (△ 1,944,762,281) | (△ 1,961,172,572) | (△ 1,957,923,024) | (△ 1,959,906,378) | (△ 1,888,745,380) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 58,710,400 | 62,811,710 | 67,273,258 | 72,419,353 | 76,439,151 | 84,687,637 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 2,247,976,443 | △ 2,294,382,275 | △ 2,349,498,405 | △ 2,397,420,826 | △ 2,594,212,831 | △ 2,429,561,056 |

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 第 169 期 | 第 170 期 | 第 171 期 | 第 172 期 | 第 173 期 | 第 174 期 |
|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 14,582,111円 | 16,435,086円 | 16,886,082円 | 17,618,816円 | 16,585,942円 | 22,309,467円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 71,024,589 | 71,860,175 | 72,420,638 | 72,284,669 | 72,346,773 | 69,693,794 |
| (d) 分配準備積立金 | 55,906,831 | 58,164,534 | 62,147,521 | 66,469,722 | 71,424,985 | 73,483,654 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 141,513,531 | 146,459,795 | 151,454,241 | 156,373,207 | 160,357,700 | 165,486,915 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 120.15 | 124.25 | 128.78 | 134.01 | 138.58 | 149.01 |
| (f) 分配金 | 11,778,542 | 11,787,910 | 11,760,345 | 11,669,185 | 11,571,776 | 11,105,484 |
| 1万口当たり分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 第169期 | 第170期 | 第171期 | 第172期 | 第173期 | 第174期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金（特別分配金）」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

第29作成期（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2009年5月29日） |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">・主として、米ドル建投資適格社債[※]等に投資することにより、信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指します。ただし、米ドル建て投資適格社債を対象としたETF（上場投資信託）、国債および政府機関債等へ投資を行うことがあります。※投資適格社債とは、主要格付機関による格付けが、BBB格相当以上の社債とします。・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 | 価 額 | | 公 社 債 率 | 債 券 先 物 率 (買 建 - 売 建) | 純 資 産 額 |
|-------------------|--------|-------|------|---------|--------------------------|---------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| 145期 (2021年6月7日) | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| | 20,684 | | 0.8 | 97.9 | — | 52,197 |
| 146期 (2021年7月5日) | 21,123 | | 2.1 | 93.4 | — | 53,255 |
| 147期 (2021年8月5日) | 21,085 | | △0.2 | 97.8 | — | 52,362 |
| 148期 (2021年9月6日) | 20,990 | | △0.5 | 95.3 | — | 51,866 |
| 149期 (2021年10月5日) | 21,072 | | 0.4 | 96.3 | — | 51,430 |
| 150期 (2021年11月5日) | 21,533 | | 2.2 | 96.1 | — | 51,339 |
| 151期 (2021年12月6日) | 21,394 | | △0.6 | 95.6 | — | 50,147 |
| 152期 (2022年1月5日) | 21,746 | | 1.6 | 97.9 | — | 50,178 |
| 153期 (2022年2月7日) | 21,026 | | △3.3 | 93.7 | — | 48,216 |
| 154期 (2022年3月7日) | 21,014 | | △0.1 | 93.7 | — | 47,737 |
| 155期 (2022年4月5日) | 21,635 | | 3.0 | 96.5 | — | 48,056 |
| 156期 (2022年5月6日) | 22,014 | | 1.8 | 96.1 | — | 46,919 |
| 157期 (2022年6月6日) | 22,359 | | 1.6 | 93.2 | — | 46,696 |
| 158期 (2022年7月5日) | 23,114 | | 3.4 | 91.1 | — | 47,257 |
| 159期 (2022年8月5日) | 23,112 | | △0.0 | 96.6 | — | 44,999 |
| 160期 (2022年9月5日) | 23,655 | | 2.3 | 94.0 | — | 45,703 |
| 161期 (2022年10月5日) | 23,535 | | △0.5 | 90.5 | — | 44,807 |
| 162期 (2022年11月7日) | 23,526 | | △0.0 | 92.0 | — | 43,359 |
| 163期 (2022年12月5日) | 22,655 | | △3.7 | 92.8 | — | 41,569 |
| 164期 (2023年1月5日) | 22,063 | | △2.6 | 90.7 | — | 40,247 |
| 165期 (2023年2月6日) | 22,520 | | 2.1 | 91.9 | — | 42,616 |
| 166期 (2023年3月6日) | 22,452 | | △0.3 | 93.1 | — | 43,084 |
| 167期 (2023年4月5日) | 22,701 | | 1.1 | 96.1 | — | 43,393 |
| 168期 (2023年5月8日) | 23,265 | | 2.5 | 98.1 | — | 44,879 |
| 169期 (2023年6月5日) | 23,801 | | 2.3 | 97.6 | △1.1 | 46,143 |
| 170期 (2023年7月5日) | 24,470 | | 2.8 | 95.1 | — | 48,236 |
| 171期 (2023年8月7日) | 23,958 | | △2.1 | 96.2 | △1.0 | 47,351 |
| 172期 (2023年9月5日) | 24,679 | | 3.0 | 96.5 | △5.2 | 49,254 |
| 173期 (2023年10月5日) | 24,462 | | △0.9 | 96.9 | △3.1 | 48,397 |
| 174期 (2023年11月6日) | 24,998 | | 2.2 | 97.8 | — | 49,312 |

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

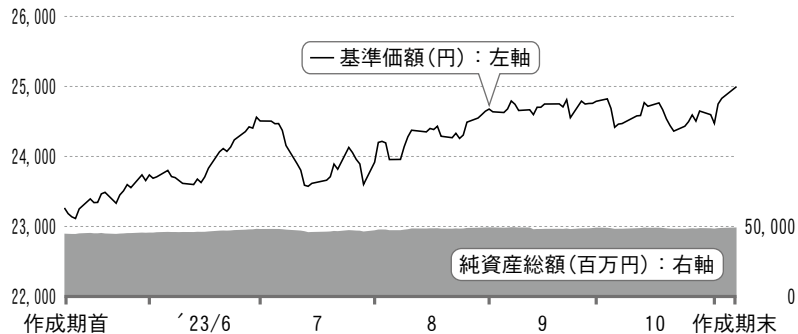
| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 円 | 騰 落 率 % | 公 組 入 社 比 % | 債 券 先 物 率 比 (買 建 - 売 建) % |
|-------|---------------------|--------------|------------|----------------|---------------------------------|
| | | | | | |
| 第169期 | (期 首) 2023年5月8日 | 23,265 | — | 98.1 | — |
| | 5月末 | 23,736 | 2.0 | 98.2 | △1.8 |
| | (期 末) 2023年6月5日 | 23,801 | 2.3 | 97.6 | △1.1 |
| 第170期 | (期 首) 2023年6月5日 | 23,801 | — | 97.6 | △1.1 |
| | 6月末 | 24,507 | 3.0 | 95.4 | — |
| | (期 末) 2023年7月5日 | 24,470 | 2.8 | 95.1 | — |
| 第171期 | (期 首) 2023年7月5日 | 24,470 | — | 95.1 | — |
| | 7月末 | 23,918 | △2.3 | 96.3 | △0.7 |
| | (期 末) 2023年8月7日 | 23,958 | △2.1 | 96.2 | △1.0 |
| 第172期 | (期 首) 2023年8月7日 | 23,958 | — | 96.2 | △1.0 |
| | 8月末 | 24,677 | 3.0 | 96.3 | △5.2 |
| | (期 末) 2023年9月5日 | 24,679 | 3.0 | 96.5 | △5.2 |
| 第173期 | (期 首) 2023年9月5日 | 24,679 | — | 96.5 | △5.2 |
| | 9月末 | 24,788 | 0.4 | 96.5 | △3.1 |
| | (期 末) 2023年10月5日 | 24,462 | △0.9 | 96.9 | △3.1 |
| 第174期 | (期 首) 2023年10月5日 | 24,462 | — | 96.9 | △3.1 |
| | 10月末 | 24,473 | 0.0 | 97.4 | △4.4 |
| | (期 末) 2023年11月6日 | 24,998 | 2.2 | 97.8 | — |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

基準価額等の推移



| | |
|------|---------|
| 作成期首 | 23,265円 |
| 作成期末 | 24,998円 |
| 騰落率 | +7.4% |

▶ 基準価額の主な変動要因（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

当ファンドは、主として米ドル建て投資適格社債等に投資しました。外貨建資産については、為替ヘッジを行っていません。

上昇要因

- ・社債の金利収入
- ・為替が米ドル高・円安で推移したこと

下落要因

- ・社債利回りの上昇（社債価格は下落）

▶ 投資環境について (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

社債スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小しましたが、米国10年国債利回りが上昇したことで、社債利回りは上昇しました。為替市場では米ドルが対円で上昇しました。

債券市場

米国債利回りは、米国経済が堅調に推移しFRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを行い、引き締め的な金融政策が長期化するとの思惑から上昇しました。社債スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、金利変動が大きくなったことで拡大する局面もありましたが、期を通して縮小傾向で推移しました。その結果、社債利回りは上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は、米政策金利の引上げが行われ、引き締め的な金融政策が長期化するとの観測が高まったため、米ドル高・円安となりました。

▶ ポートフォリオについて (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

債券組入比率

高水準の米ドル建て社債の組入れを維持して、安定的に利息収入を得ることができました。

業種配分

業種別には、安定業種（消費・公益・通信）への配分を一貫して50%以上に維持しました。安定業種以外では、テクノロジー、資本財といった相対的に格付けが高めである業種に配分しました。

格付け別配分

格付け別には、全体の平均格付けはA格を維持しました。BBB格の債券は、20%未満に抑制しています。

デュレーション（投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度）

デュレーションは6年程度としました。

▶ ベンチマークとの差異について（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

2 今後の運用方針

米国では、利上げは最終局面とみられますが、堅調な景気や根強いインフレ圧力を背景に、FRBのインフレ抑制姿勢の継続が予想される中、国債発行増などの需給懸念も意識されることから、当面金利は高水準での推移が続く見通しです。ただし、来年の半ばから累積した利上げの効果によるインフレ鈍化と景気減速が徐々に進むと想定されることから、金利は緩やかに低下する展開を予想します。

社債市場については、金融引き締めの影響に対する市場の織り込みが進展すると想定されます。また、米国の景気も底堅く、社債スプレッドは安定的に推移するものと予想します。

米ドル/円は、FRBの引き締め姿勢の継続が米ドルの上昇要因となる一方、日銀の更なる政策修正観測や政府・日銀による介入警戒感が円の下落幅を抑制し、当面は高値圏でのみみ合いを予想します。来年の半ばからは、米金利が低下し、緩やかに米ドル安・円高に向かう展開を予想します。

以上の投資環境見通しをベースに、社債発行企業の信用力評価や個別証券の投資価値に着目して、銘柄選択を行っていきます。ポートフォリオ全体の業種配分は安定業種を多めとし、格付け配分についてはA格以上を中心とします。金融政策正常化の過程で社債利回りは当面落ち着きどころを探す展開になると見込まれるため、引き続き慎重に買い場を探す姿勢で臨みます。

■ 1万口当たりの費用明細 (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|------------------------------|-----------------|-----------------------------|--|
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 (0) | 0.002% (0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) その他費用 (保管費用) (その他) | 2 (2) (0) | 0.007 (0.007) (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 2 | 0.009 | |

期中の平均基準価額は24,200円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

(1) 公社債

| | | | 当 作 成 期 | |
|----|------|-----|--------------------|-----------------------------|
| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
| 外国 | アメリカ | 社債券 | 千アメリカ・ドル 54,109 | 千アメリカ・ドル 40,223 (767) |

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | 当 作 成 期 | | | |
|--------------|----------|----------|---------------|---------------|
| | 買 建 | | 売 建 | |
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 債券先物取引 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 16,735 | 百万円 16,731 |

※金額は受渡し代金。

※外国の取引金額は、各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年5月9日から2023年11月6日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2023年5月9日から2023年11月6日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2023年11月6日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分 | 作 成 期 末 | | | | | | | |
|---------|---------------------|---------------------|------------------|-----------|--------------------------|-------------------|-----------|----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | う ち B B 格 以 下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 355,898 | 千アメリカ・ドル 322,205 | 千円 48,224,489 | % 97.8 | % — | % 62.3 | % 34.3 | % 1.2 |
| 合 計 | — | — | 48,224,489 | 97.8 | — | 62.3 | 34.3 | 1.2 |

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 作 成 期 末 | | | | |
|---------|-------------------------|-------|---------|----------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| ア メ リ カ | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | PUBLIC SERVICE ELECTRIC | 社 債 券 | 3.1000 | 500 | 420 | 62,886 | 2032/03/15 |
| | PUBLIC SERVICE ELECTRIC | 社 債 券 | 4.9000 | 500 | 477 | 71,400 | 2032/12/15 |
| | PUBLIC SERVICE ELECTRIC | 社 債 券 | 5.4500 | 1,000 | 944 | 141,363 | 2053/08/01 |
| | PUBLIC SERVICE | 社 債 券 | 3.0000 | 8,000 | 7,440 | 1,113,628 | 2027/05/15 |
| | PUBLIC SERVICE | 社 債 券 | 2.4500 | 2,000 | 1,679 | 251,319 | 2030/01/15 |
| | DUKE ENERGY CAROLINAS | 社 債 券 | 2.5500 | 1,500 | 1,228 | 183,883 | 2031/04/15 |
| | DUKE ENERGY FLORIDA LLC | 社 債 券 | 2.4000 | 2,000 | 1,580 | 236,550 | 2031/12/15 |
| | DUKE ENERGY PROG | 社 債 券 | 3.4500 | 2,000 | 1,826 | 273,396 | 2029/03/15 |
| | DUKE ENERGY CAR | 社 債 券 | 2.4500 | 2,000 | 1,676 | 250,930 | 2030/02/01 |
| | DUKE ENERGY PROG | 社 債 券 | 2.0000 | 2,000 | 1,545 | 231,279 | 2031/08/15 |
| | ALABAMA POWER CO | 社 債 券 | 3.7500 | 1,000 | 950 | 142,307 | 2027/09/01 |
| | NISOURCE INC | 社 債 券 | 5.4000 | 3,000 | 2,871 | 429,801 | 2033/06/30 |
| | IBM CORP | 社 債 券 | 4.4000 | 1,000 | 923 | 138,151 | 2032/07/27 |
| | IBM CORP | 社 債 券 | 4.5000 | 1,000 | 970 | 145,284 | 2028/02/06 |
| | IBM CORP | 社 債 券 | 4.7500 | 2,000 | 1,890 | 282,909 | 2033/02/06 |
| | SHELL INTL FIN | 社 債 券 | 2.5000 | 2,000 | 1,867 | 279,538 | 2026/09/12 |
| | SHELL INTL FIN | 社 債 券 | 3.8750 | 2,000 | 1,895 | 283,630 | 2028/11/13 |
| | NESTLE HOLDINGS INC | 社 債 券 | 1.5000 | 1,000 | 850 | 127,237 | 2028/09/14 |
| | NESTLE HOLDINGS INC | 社 債 券 | 1.8750 | 3,000 | 2,378 | 356,020 | 2031/09/14 |
| | NESTLE HOLDINGS INC | 社 債 券 | 4.3000 | 1,000 | 944 | 141,405 | 2032/10/01 |
| | NESTLE HOLDINGS | 社 債 券 | 3.6250 | 3,000 | 2,835 | 424,354 | 2028/09/24 |
| | MCDONALD'S CORP | 社 債 券 | 4.8000 | 600 | 588 | 88,034 | 2028/08/14 |
| | MCDONALD'S CORP | 社 債 券 | 5.4500 | 1,000 | 926 | 138,664 | 2053/08/14 |
| | CARGILL INC | 社 債 券 | 5.1250 | 500 | 484 | 72,513 | 2032/10/11 |
| | CARGILL INC | 社 債 券 | 4.7500 | 600 | 567 | 84,907 | 2033/04/24 |
| | EATON CORP | 社 債 券 | 4.1500 | 500 | 453 | 67,807 | 2033/03/15 |

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 作 成 期 末 | | | | |
|-----|--------------------------|-------|---------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | UNION PAC CORP | 社 債 券 | 3.7000 | 2,000 | 1,866 | 279,326 | 2029/03/01 |
| | UNION PAC CORP | 社 債 券 | 2.3750 | 1,000 | 810 | 121,285 | 2031/05/20 |
| | COX COMMUNICATIONS INC | 社 債 券 | 5.4500 | 700 | 694 | 103,877 | 2028/09/15 |
| | COX COMMUNICATIONS INC | 社 債 券 | 5.7000 | 1,600 | 1,549 | 231,890 | 2033/06/15 |
| | JOHN DEERE CAPITAL CORP | 社 債 券 | 1.5000 | 2,000 | 1,716 | 256,959 | 2028/03/06 |
| | JOHN DEERE CAP | 社 債 券 | 2.4500 | 3,500 | 2,977 | 445,703 | 2030/01/09 |
| | METROPOLITAN EDISON CO | 社 債 券 | 5.2000 | 1,000 | 979 | 146,636 | 2028/04/01 |
| | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 社 債 券 | 2.9500 | 2,000 | 1,668 | 249,775 | 2032/03/15 |
| | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 社 債 券 | 5.7500 | 1,000 | 1,015 | 151,953 | 2031/02/01 |
| | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 社 債 券 | 5.9000 | 1,000 | 1,020 | 152,688 | 2033/11/15 |
| | BRISTOL-MYERS | 社 債 券 | 3.2000 | 1,641 | 1,565 | 234,374 | 2026/06/15 |
| | BRISTOL-MYERS | 社 債 券 | 3.4500 | 5,000 | 4,705 | 704,197 | 2027/11/15 |
| | BRISTOL-MYERS | 社 債 券 | 3.4000 | 619 | 566 | 84,750 | 2029/07/26 |
| | PFIZER INC | 社 債 券 | 3.4500 | 1,000 | 924 | 138,296 | 2029/03/15 |
| | PFIZER INC | 社 債 券 | 2.6250 | 2,500 | 2,137 | 319,844 | 2030/04/01 |
| | PFIZER INC | 社 債 券 | 1.7000 | 2,000 | 1,613 | 241,426 | 2030/05/28 |
| | PFIZER INC | 社 債 券 | 1.7500 | 1,500 | 1,163 | 174,117 | 2031/08/18 |
| | CONSTELLATION EN GEN LLC | 社 債 券 | 5.8000 | 1,000 | 973 | 145,735 | 2033/03/01 |
| | CONSTELLATION EN GEN LLC | 社 債 券 | 6.1250 | 1,000 | 994 | 148,914 | 2034/01/15 |
| | HOME DEPOT INC | 社 債 券 | 1.5000 | 2,000 | 1,694 | 253,585 | 2028/09/15 |
| | HOME DEPOT INC | 社 債 券 | 3.2500 | 2,000 | 1,717 | 257,094 | 2032/04/15 |
| | HOME DEPOT INC | 社 債 券 | 2.8000 | 2,000 | 1,843 | 275,880 | 2027/09/14 |
| | HOME DEPOT INC | 社 債 券 | 0.9000 | 1,000 | 843 | 126,204 | 2028/03/15 |
| | HOME DEPOT INC | 社 債 券 | 2.9500 | 1,000 | 895 | 133,972 | 2029/06/15 |
| | CISCO SYSTEMS INC | 社 債 券 | 2.5000 | 2,000 | 1,872 | 280,292 | 2026/09/20 |
| | ORACLE CORP | 社 債 券 | 4.9000 | 600 | 557 | 83,371 | 2033/02/06 |
| | ORACLE CORP | 社 債 券 | 5.5500 | 2,100 | 1,838 | 275,103 | 2053/02/06 |
| | AMERICAN TOWER CORP | 社 債 券 | 5.8000 | 1,000 | 992 | 148,560 | 2028/11/15 |
| | AMERICAN TOWER CORP | 社 債 券 | 5.9000 | 700 | 683 | 102,233 | 2033/11/15 |
| | BALTIMORE GAS & ELECTRIC | 社 債 券 | 2.2500 | 3,500 | 2,788 | 417,352 | 2031/06/15 |
| | COMMONWEALTH EDISON CO | 社 債 券 | 3.1500 | 1,000 | 842 | 126,061 | 2032/03/15 |
| | EXELON CORP | 社 債 券 | 5.3000 | 1,000 | 954 | 142,819 | 2033/03/15 |
| | COMMONWEALTH EDI | 社 債 券 | 2.9500 | 5,000 | 4,594 | 687,673 | 2027/08/15 |
| | ATLANTIC CITY EL | 社 債 券 | 4.0000 | 1,000 | 941 | 140,893 | 2028/10/15 |
| | SAN DIEGO G & E | 社 債 券 | 2.5000 | 3,500 | 3,261 | 488,124 | 2026/05/15 |
| | PENSKE TRUCK LEASING/PTL | 社 債 券 | 5.5500 | 1,000 | 977 | 146,284 | 2028/05/01 |
| | CATERPILLAR INC | 社 債 券 | 2.6000 | 1,000 | 879 | 131,616 | 2029/09/19 |
| | CATERPILLAR INC | 社 債 券 | 2.6000 | 1,000 | 859 | 128,713 | 2030/04/09 |
| | RALPH LAUREN | 社 債 券 | 2.9500 | 3,500 | 2,997 | 448,641 | 2030/06/15 |
| | GILEAD SCIENCES INC | 社 債 券 | 5.2500 | 3,000 | 2,924 | 437,762 | 2033/10/15 |
| | GILEAD SCIENCES | 社 債 券 | 2.9500 | 3,000 | 2,782 | 416,465 | 2027/03/01 |
| | GILEAD SCIENCES | 社 債 券 | 1.6500 | 4,500 | 3,523 | 527,315 | 2030/10/01 |
| | COMCAST CORP | 社 債 券 | 4.1500 | 3,000 | 2,853 | 427,057 | 2028/10/15 |
| | COMCAST CORP | 社 債 券 | 4.6500 | 1,000 | 932 | 139,589 | 2033/02/15 |

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 作 成 期 末 | | | | |
|-----|--------------------------|-------|---------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | COMCAST CORP | 社 債 券 | 2.6500 | 2,000 | 1,700 | 254,489 | 2030/02/01 |
| | ANHEUSER-BUSCH | 社 債 券 | 4.7500 | 3,000 | 2,946 | 441,049 | 2029/01/23 |
| | BMW US CAPITAL LLC | 社 債 券 | 5.1500 | 2,000 | 1,900 | 284,492 | 2033/08/11 |
| | TOTAL CAP INTL | 社 債 券 | 3.4550 | 3,000 | 2,765 | 413,897 | 2029/02/19 |
| | TOTAL CAP INTL | 社 債 券 | 2.8290 | 1,500 | 1,306 | 195,501 | 2030/01/10 |
| | SANOFI | 社 債 券 | 3.6250 | 3,000 | 2,848 | 426,397 | 2028/06/19 |
| | UNILEVER CAPITAL | 社 債 券 | 3.5000 | 4,000 | 3,752 | 561,705 | 2028/03/22 |
| | UNILEVER CAPITAL | 社 債 券 | 1.7500 | 2,000 | 1,550 | 232,111 | 2031/08/12 |
| | BP CAP MKTS AMER | 社 債 券 | 3.9370 | 3,000 | 2,829 | 423,416 | 2028/09/21 |
| | BP CAP MKTS AMER | 社 債 券 | 4.2340 | 1,000 | 955 | 143,011 | 2028/11/06 |
| | GLAXOSMITHKLINE | 社 債 券 | 3.8750 | 2,000 | 1,901 | 284,627 | 2028/05/15 |
| | GLAXOSMITHKLINE | 社 債 券 | 3.3750 | 2,000 | 1,835 | 274,734 | 2029/06/01 |
| | ASTRAZENECA FINANCE LLC | 社 債 券 | 1.7500 | 1,000 | 865 | 129,531 | 2028/05/28 |
| | ASTRAZENECA FINANCE LLC | 社 債 券 | 2.2500 | 1,500 | 1,212 | 181,501 | 2031/05/28 |
| | ASTRAZENECA FINANCE LLC | 社 債 券 | 4.8750 | 1,000 | 990 | 148,285 | 2028/03/03 |
| | ROCHE HOLDINGS INC | 社 債 券 | 1.9300 | 2,000 | 1,715 | 256,800 | 2028/12/13 |
| | AMERICAN HONDA FINANCE | 社 債 券 | 5.8000 | 1,000 | 1,007 | 150,803 | 2025/10/03 |
| | ABBOTT LABS | 社 債 券 | 3.7500 | 833 | 805 | 120,498 | 2026/11/30 |
| | ABBOTT LABS | 社 債 券 | 1.4000 | 1,000 | 795 | 119,128 | 2030/06/30 |
| | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 社 債 券 | 1.9000 | 1,000 | 848 | 127,044 | 2028/06/15 |
| | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 社 債 券 | 4.6250 | 500 | 482 | 72,277 | 2027/07/15 |
| | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 社 債 券 | 5.0000 | 1,000 | 937 | 140,251 | 2032/07/15 |
| | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 社 債 券 | 5.0500 | 1,000 | 935 | 139,980 | 2033/02/28 |
| | NEXTERA ENERGY CAPITAL | 社 債 券 | 5.2500 | 1,000 | 855 | 128,099 | 2053/02/28 |
| | TRANSCANADA PIPELINES | 社 債 券 | 2.5000 | 3,000 | 2,331 | 348,880 | 2031/10/12 |
| | DOMINION ENERGY INC | 社 債 券 | 4.3500 | 2,000 | 1,780 | 266,508 | 2032/08/15 |
| | VERIZON COMMUNICATIONS | 社 債 券 | 4.3290 | 5,554 | 5,277 | 789,953 | 2028/09/21 |
| | VERIZON COMMUNICATIONS | 社 債 券 | 2.5500 | 2,014 | 1,622 | 242,824 | 2031/03/21 |
| | VERIZON COMMUNICATIONS | 社 債 券 | 5.0500 | 400 | 379 | 56,755 | 2033/05/09 |
| | THERMO FISHER SCIENTIFIC | 社 債 券 | 5.4040 | 2,000 | 1,888 | 282,723 | 2043/08/10 |
| | THERMO FISHER | 社 債 券 | 1.7500 | 1,000 | 851 | 127,396 | 2028/10/15 |
| | THERMO FISHER | 社 債 券 | 2.0000 | 2,000 | 1,559 | 233,425 | 2031/10/15 |
| | ENEL FINANCE INTL NV | 社 債 券 | 7.5000 | 1,000 | 1,063 | 159,200 | 2032/10/14 |
| | SIEMENS FINANCIERINGSMAT | 社 債 券 | 1.7000 | 4,000 | 3,464 | 518,570 | 2028/03/11 |
| | GENERAL MOTORS FINL CO | 社 債 券 | 5.8000 | 2,000 | 1,967 | 294,463 | 2028/06/23 |
| | COCA-COLA CO/THE | 社 債 券 | 2.9000 | 7,000 | 6,534 | 977,955 | 2027/05/25 |
| | COLGATE-PALMOLIVE CO | 社 債 券 | 3.2500 | 1,100 | 954 | 142,840 | 2032/08/15 |
| | COLGATE-PALMOLIVE CO | 社 債 券 | 4.6000 | 2,000 | 1,930 | 288,931 | 2033/03/01 |
| | ELI LILLY & CO | 社 債 券 | 5.0000 | 3,000 | 2,997 | 448,560 | 2026/02/27 |
| | ELI LILLY & CO | 社 債 券 | 3.3750 | 2,437 | 2,260 | 338,294 | 2029/03/15 |
| | MERCK & CO INC | 社 債 券 | 2.1500 | 1,500 | 1,188 | 177,879 | 2031/12/10 |
| | MERCK & CO INC | 社 債 券 | 4.5000 | 300 | 281 | 42,075 | 2033/05/17 |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 2.3750 | 3,000 | 2,804 | 419,765 | 2026/10/06 |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 1.9500 | 500 | 395 | 59,221 | 2031/10/21 |

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 作 成 期 末 | | | | |
|-----|--------------------------|-------|---------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 3.9000 | 2,000 | 1,822 | 272,749 | 2032/07/18 |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 4.4500 | 400 | 383 | 57,454 | 2033/02/15 |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 4.6500 | 3,500 | 3,087 | 462,094 | 2053/02/15 |
| | PEPSICO INC | 社 債 券 | 2.7500 | 2,000 | 1,743 | 260,910 | 2030/03/19 |
| | MONDELEZ INTERNATIONAL | 社 債 券 | 3.0000 | 1,500 | 1,236 | 185,001 | 2032/03/17 |
| | CVS HEALTH CORP | 社 債 券 | 5.2500 | 600 | 569 | 85,268 | 2033/02/21 |
| | CVS HEALTH CORP | 社 債 券 | 5.3000 | 3,000 | 2,850 | 426,707 | 2033/06/01 |
| | NOVARTIS CAPITAL | 社 債 券 | 2.0000 | 3,000 | 2,729 | 408,563 | 2027/02/14 |
| | APPLE INC | 社 債 券 | 3.3500 | 1,000 | 885 | 132,501 | 2032/08/08 |
| | APPLE INC | 社 債 券 | 1.4000 | 500 | 428 | 64,125 | 2028/08/05 |
| | APPLE INC | 社 債 券 | 1.7000 | 500 | 395 | 59,127 | 2031/08/05 |
| | SOUTHERN CO | 社 債 券 | 5.2000 | 2,000 | 1,893 | 283,343 | 2033/06/15 |
| | GEORGIA POWER | 社 債 券 | 2.6500 | 1,000 | 857 | 128,286 | 2029/09/15 |
| | WALT DISNEY COMPANY/THE | 社 債 券 | 2.9500 | 5,000 | 4,673 | 699,422 | 2027/06/15 |
| | WALT DISNEY CO | 社 債 券 | 2.0000 | 2,000 | 1,676 | 250,897 | 2029/09/01 |
| | PHILIP MORRIS INTL INC | 社 債 券 | 5.3750 | 2,000 | 1,905 | 285,220 | 2033/02/15 |
| | AMGEN INC | 社 債 券 | 5.2500 | 200 | 192 | 28,745 | 2033/03/02 |
| | AMGEN INC | 社 債 券 | 5.6000 | 1,000 | 930 | 139,300 | 2043/03/02 |
| | INTEL CORP | 社 債 券 | 3.1500 | 3,000 | 2,799 | 419,070 | 2027/05/11 |
| | INTEL CORP | 社 債 券 | 4.1500 | 1,000 | 911 | 136,494 | 2032/08/05 |
| | INTEL CORP | 社 債 券 | 5.2000 | 500 | 486 | 72,753 | 2033/02/10 |
| | INTEL CORP | 社 債 券 | 2.0000 | 2,000 | 1,581 | 236,670 | 2031/08/12 |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 社 債 券 | 4.9000 | 300 | 290 | 43,522 | 2033/03/14 |
| | CONOCOPHILLIPS COMPANY | 社 債 券 | 5.3000 | 500 | 453 | 67,804 | 2053/05/15 |
| | CONOCOPHILLIPS COMPANY | 社 債 券 | 5.0500 | 1,300 | 1,247 | 186,758 | 2033/09/15 |
| | EXXON MOBIL CORP | 社 債 券 | 2.4400 | 3,000 | 2,605 | 389,960 | 2029/08/16 |
| | EXXON MOBIL CORP | 社 債 券 | 3.4820 | 1,500 | 1,362 | 203,913 | 2030/03/19 |
| | PUBLIC SERV COLO | 社 債 券 | 3.7000 | 2,000 | 1,860 | 278,404 | 2028/06/15 |
| | MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS | 社 債 券 | 4.2500 | 500 | 483 | 72,304 | 2028/03/30 |
| | MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS | 社 債 券 | 4.5000 | 1,500 | 1,402 | 209,849 | 2033/03/30 |
| | VIRGINIA ELEC & POWER CO | 社 債 券 | 2.3000 | 3,000 | 2,344 | 350,928 | 2031/11/15 |
| | VIRGINIA ELEC & POWER CO | 社 債 券 | 2.4000 | 1,500 | 1,169 | 175,024 | 2032/03/30 |
| | AMAZON.COM INC | 社 債 券 | 3.4500 | 2,000 | 1,860 | 278,440 | 2029/04/13 |
| | AMAZON.COM INC | 社 債 券 | 3.6000 | 500 | 447 | 66,903 | 2032/04/13 |
| | AMAZON.COM INC | 社 債 券 | 4.7000 | 2,000 | 1,932 | 289,168 | 2032/12/01 |
| | KINDER MORGAN INC | 社 債 券 | 5.2000 | 500 | 464 | 69,464 | 2033/06/01 |
| | T-MOBILE US INC | 社 債 券 | 5.7500 | 1,100 | 1,075 | 161,018 | 2034/01/15 |
| | STARBUCKS CORP | 社 債 券 | 4.8000 | 2,500 | 2,355 | 352,487 | 2033/02/15 |
| | ESTEE LAUDER CO INC | 社 債 券 | 1.9500 | 3,500 | 2,747 | 411,244 | 2031/03/15 |
| | ESTEE LAUDER CO INC | 社 債 券 | 4.6500 | 1,000 | 932 | 139,522 | 2033/05/15 |
| | SALESFORCE.COM INC | 社 債 券 | 1.9500 | 3,000 | 2,382 | 356,527 | 2031/07/15 |
| | MERCEDES-BENZ FIN NA | 社 債 券 | 4.9500 | 2,000 | 1,988 | 297,606 | 2025/03/30 |
| | DAIMLER TRUCK FINAN NA | 社 債 券 | 5.1250 | 1,200 | 1,176 | 176,085 | 2028/01/19 |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 社 債 | 3.9240 | 2,000 | 1,801 | 269,696 | 2032/06/01 |

コーポレート・ボンド・インカムザーフンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 作 成 期 末 | | | | |
|-----|--------------------------|-------|---------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | DTE ENERGY CO | 社 債 券 | 4.8750 | 1,000 | 965 | 144,486 | 2028/06/01 |
| | EQUIFAX INC | 社 債 券 | 5.1000 | 1,000 | 971 | 145,332 | 2028/06/01 |
| | ALCON FINANCE CORP | 社 債 券 | 5.3750 | 3,000 | 2,886 | 432,019 | 2032/12/06 |
| | AUTOZONE INC | 社 債 券 | 4.7500 | 1,500 | 1,362 | 203,974 | 2033/02/01 |
| | AUTOZONE INC | 社 債 券 | 5.2000 | 2,000 | 1,866 | 279,415 | 2033/08/01 |
| | RYDER SYSTEM INC | 社 債 券 | 5.6500 | 1,000 | 991 | 148,462 | 2028/03/01 |
| | RYDER SYSTEM INC | 社 債 券 | 5.2500 | 1,000 | 976 | 146,169 | 2028/06/01 |
| | RYDER SYSTEM INC | 社 債 券 | 6.3000 | 1,000 | 1,011 | 151,386 | 2028/12/01 |
| | KENVUE INC | 社 債 券 | 5.1000 | 3,000 | 2,761 | 413,273 | 2043/03/22 |
| | KENVUE INC | 社 債 券 | 5.5000 | 1,000 | 1,001 | 149,930 | 2025/03/22 |
| | ARCHER-DANIELS-MIDLAND C | 社 債 券 | 4.5000 | 1,500 | 1,389 | 208,006 | 2033/08/15 |
| | EIDP INC | 社 債 券 | 4.8000 | 1,200 | 1,125 | 168,394 | 2033/05/15 |
| | COLUMBIA PIPELINES OPCO | 社 債 券 | 6.4970 | 1,500 | 1,452 | 217,433 | 2043/08/15 |
| | ONEOK INC | 社 債 券 | 5.5500 | 700 | 696 | 104,312 | 2026/11/01 |
| | ONEOK INC | 社 債 券 | 6.6250 | 1,300 | 1,278 | 191,405 | 2053/09/01 |
| | INTUIT INC | 社 債 券 | 5.2000 | 2,500 | 2,453 | 367,151 | 2033/09/15 |
| | SOUTHWESTN EL PR | 社 債 券 | 2.7500 | 2,000 | 1,847 | 276,551 | 2026/10/01 |
| | BECTON DICKINSON AND CO | 社 債 券 | 4.6930 | 1,000 | 971 | 145,358 | 2028/02/13 |
| | NEVADA POWER CO | 社 債 券 | 3.7000 | 3,000 | 2,735 | 409,461 | 2029/05/01 |
| | NEVADA POWER CO | 社 債 券 | 2.4000 | 3,000 | 2,467 | 369,315 | 2030/05/01 |
| | CSX CORP | 社 債 券 | 4.1000 | 2,000 | 1,800 | 269,492 | 2032/11/15 |
| | CSX CORP | 社 債 券 | 5.2000 | 1,500 | 1,450 | 217,049 | 2033/11/15 |
| | DIAGEO CAPITAL PLC | 社 債 券 | 5.3000 | 200 | 201 | 30,127 | 2027/10/24 |
| | SOUTHERN CAL EDISON | 社 債 券 | 5.6500 | 1,000 | 1,005 | 150,529 | 2028/10/01 |
| | ESTEE LAUDER CO | 社 債 券 | 3.1500 | 4,500 | 4,226 | 632,639 | 2027/03/15 |
| | FOX CORP | 社 債 券 | 6.5000 | 1,000 | 1,007 | 150,785 | 2033/10/13 |
| | GENERAL MILLS INC | 社 債 券 | 2.2500 | 500 | 388 | 58,156 | 2031/10/14 |
| | HONEYWELL INTL | 社 債 券 | 1.9500 | 1,500 | 1,221 | 182,814 | 2030/06/01 |
| | HERSHEY COMPANY | 社 債 券 | 1.7000 | 2,500 | 2,004 | 300,043 | 2030/06/01 |
| | KELLOGG CO | 社 債 券 | 5.2500 | 700 | 661 | 98,954 | 2033/03/01 |
| | MARS INC | 社 債 券 | 4.7500 | 2,400 | 2,264 | 338,995 | 2033/04/20 |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 社 債 券 | 3.0000 | 1,000 | 826 | 123,684 | 2032/03/15 |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 社 債 券 | 4.4500 | 2,500 | 2,283 | 341,767 | 2033/03/01 |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 社 債 券 | 5.3500 | 2,000 | 1,794 | 268,654 | 2054/08/01 |
| | TARGET CORP | 社 債 券 | 4.4000 | 500 | 464 | 69,483 | 2033/01/15 |
| | TARGET CORP | 社 債 券 | 4.8000 | 1,000 | 857 | 128,353 | 2053/01/15 |
| | TARGET CORP | 社 債 券 | 3.3750 | 3,000 | 2,759 | 412,963 | 2029/04/15 |
| | TARGET CORP | 社 債 券 | 2.3500 | 1,500 | 1,261 | 188,840 | 2030/02/15 |
| | WASTE MANAGEMENT INC | 社 債 券 | 4.6250 | 1,500 | 1,441 | 215,726 | 2030/02/15 |
| | WASTE MANAGEMENT INC | 社 債 券 | 4.8750 | 2,000 | 1,888 | 282,621 | 2034/02/15 |
| | ZOETIS INC | 社 債 券 | 5.6000 | 500 | 498 | 74,548 | 2032/11/16 |
| | PUB SVC OKLAHOMA | 社 債 券 | 2.2000 | 1,000 | 772 | 115,573 | 2031/08/15 |
| | 小 計 | | — | 355,898 | 322,205 | 48,224,489 | — |
| | 合 計 | | — | — | — | 48,224,489 | — |

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

コーポレート・ボンド・インカムマザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月6日現在)

| 項 目 | 作 成 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 48,224,489 | 97.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,387,201 | 2.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 49,611,691 | 100.0 |

※作成期末における外貨建資産（49,142,896千円）の投資信託財産総額（49,611,691千円）に対する比率は99.1%です。
 ※外貨建資産は、作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月5日) (2023年7月5日) (2023年8月7日) (2023年9月5日) (2023年10月5日) (2023年11月6日)

| 項 目 | 第169期末 | 第170期末 | 第171期末 | 第172期末 | 第173期末 | 第174期末 |
|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 46,988,236,753円 | 48,236,560,174円 | 47,707,901,078円 | 49,445,231,662円 | 48,457,429,802円 | 49,611,691,082円 |
| コール・ローン等 | 1,548,599,429 | 1,832,780,288 | 1,514,932,665 | 1,306,527,417 | 870,411,708 | 606,237,326 |
| 公社債(評価額) | 45,017,772,655 | 45,887,572,139 | 45,575,347,164 | 47,527,256,256 | 46,908,736,931 | 48,224,489,369 |
| 未 収 入 金 | — | — | — | — | 84,506,964 | — |
| 未 収 利 息 | 349,930,064 | 424,090,634 | 488,775,634 | 449,976,270 | 395,173,138 | 469,408,610 |
| 前 払 費 用 | 5,794,963 | 7,542,297 | 13,274,809 | 1,554,839 | 431,062 | 285,038 |
| 差入委託証拠金 | 66,139,642 | 84,574,816 | 115,570,806 | 159,916,880 | 198,169,999 | 311,270,739 |
| (B) 負 債 | 844,948,473 | 2,275 | 356,807,756 | 190,455,731 | 59,556,687 | 298,695,030 |
| 未 払 金 | 844,947,581 | — | 356,804,851 | 15,251,400 | 59,555,146 | 298,693,426 |
| 未 払 解 約 金 | — | — | — | 175,202,000 | — | — |
| その他未払費用 | 892 | 2,275 | 2,905 | 2,331 | 1,541 | 1,604 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 46,143,288,280 | 48,236,557,899 | 47,351,093,322 | 49,254,775,931 | 48,397,873,115 | 49,312,996,052 |
| 元 本 | 19,387,136,272 | 19,712,588,178 | 19,764,133,777 | 19,958,256,402 | 19,785,189,657 | 19,726,856,752 |
| 次期繰越損益金 | 26,756,152,008 | 28,523,969,721 | 27,586,959,545 | 29,296,519,529 | 28,612,683,458 | 29,586,139,300 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 19,387,136,272口 | 19,712,588,178口 | 19,764,133,777口 | 19,958,256,402口 | 19,785,189,657口 | 19,726,856,752口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,801円 | 24,470円 | 23,958円 | 24,679円 | 24,462円 | 24,998円 |

※当作成期における作成期首元本額19,290,750,596円、作成期中追加設定元本額1,904,310,576円、作成期中一部解約元本額1,468,204,420円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※作成期末における元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|--|----------------|
| コーポレート・ボンド・インカム（為替ヘッジ型） | 2,843,444,731円 |
| コーポレート・ボンド・インカム（為替ノーヘッジ型） | 9,346,953,142円 |
| コーポレート・ボンド・インカム（為替ヘッジ型／1年決算型） | 1,806,547,278円 |
| コーポレート・ボンド・インカム（為替ノーヘッジ型／1年決算型） | 2,194,271,203円 |
| SMAM・コーポレート・ボンド・インカム（為替ヘッジ型）＜適格機関投資家限定＞ | 1,928,896,339円 |
| SMAM・年金コーポレート・ボンド・インカム（為替ヘッジあり）＜適格機関投資家限定＞ | 78,116,612円 |
| SMDAM・コーポレート・ボンド・インカム（為替ヘッジ60）2020-01＜適格機関投資家限定＞ | 1,528,627,447円 |

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

〔自2023年5月9日〕〔自2023年6月6日〕〔自2023年7月6日〕〔自2023年8月8日〕〔自2023年9月6日〕〔自2023年10月6日〕
 〔自2023年6月5日〕〔自2023年7月5日〕〔自2023年8月7日〕〔自2023年9月5日〕〔自2023年10月5日〕〔自2023年11月6日〕

| 項 目 | 第 169 期 | 第 170 期 | 第 171 期 | 第 172 期 | 第 173 期 | 第 174 期 |
|-------------------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 122,670,924円 | 137,944,463円 | 151,740,854円 | 151,824,371円 | 153,403,436円 | 168,403,048円 |
| 受 取 利 息 | 122,682,703 | 137,812,562 | 150,655,920 | 144,618,640 | 152,045,822 | 167,191,790 |
| そ の 他 収 益 金 | — | 169,197 | 1,113,007 | 7,225,408 | 1,380,023 | 1,219,020 |
| 支 払 利 息 | △ 11,779 | △ 37,296 | △ 28,073 | △ 19,677 | △ 22,409 | △ 7,762 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 919,920,497 | 1,157,548,384 | △ 1,124,454,801 | 1,281,270,241 | △ 707,715,650 | 862,889,591 |
| 売 買 益 | 1,669,871,521 | 1,469,987,138 | 74,315,149 | 1,629,206,757 | 756,351,059 | 863,061,712 |
| 売 買 損 | △ 749,951,024 | △ 312,438,754 | △ 1,198,769,950 | △ 347,936,516 | △ 1,464,066,709 | △ 172,121 |
| (C) 先 物 取 引 等 損 益 | △ 8,269,401 | 13,240,424 | △ 43,130,589 | 215,649 | 119,464,319 | 25,855,702 |
| 取 引 益 | 762,775 | 13,786,485 | 1,576,781 | 22,633,686 | 119,464,319 | 28,605,948 |
| 取 引 損 | △ 9,032,176 | △ 546,061 | △ 44,707,370 | △ 22,418,037 | — | △ 2,750,246 |
| (D) そ の 他 費 用 等 | △ 564,357 | △ 588,652 | △ 605,041 | △ 592,652 | △ 608,921 | △ 635,404 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D) | 1,033,757,663 | 1,308,144,619 | △ 1,016,449,577 | 1,432,717,609 | △ 435,456,816 | 1,056,512,937 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 25,588,840,021 | 26,756,152,008 | 28,523,969,721 | 27,586,959,545 | 29,296,519,529 | 28,612,683,458 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 378,398,545 | △ 95,579,076 | △ 415,771,350 | △ 103,984,569 | △ 798,740,811 | △ 279,113,229 |
| (H) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 511,952,869 | 555,252,170 | 495,210,751 | 380,826,944 | 550,361,556 | 196,056,134 |
| (I) 合 計 (E + F + G + H) | 26,756,152,008 | 28,523,969,721 | 27,586,959,545 | 29,296,519,529 | 28,612,683,458 | 29,586,139,300 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 26,756,152,008 | 28,523,969,721 | 27,586,959,545 | 29,296,519,529 | 28,612,683,458 | 29,586,139,300 |

※有価証券売買損益および先物取引等損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。