

りそな・ストラテジック・ インカムファンド 2016-09(為替ヘッジなし)

【愛称:ボンドマスター-2016-09(為替ヘッジなし)】

【運用報告書(全体版)】

第6作成期 (2019年3月13日から2019年9月12日まで)

第 **11** 期 / 第 **12** 期

第11期：決算日 2019年6月12日

第12期：決算日 2019年9月12日

受益者の皆さまへ

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、米ドル建ての債券等に投資し、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得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。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|------------|--|
| 商品分類 | 単位型投信／海外／債券 |
| 信託期間 | 2016年9月30日から2022年3月14日まで |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、米ドル建ての債券等に投資し、安定的なインカム収入の確保と値上り益の獲得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投資信託証券を主要投資対象とします。 ピムコ・バミューダ・インカムファンドEクラスB-J 1609 (USD) ピムコ・バミューダ・インカムファンド(M) (米ドル建ての債券等) マネー・オープン・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品 |
| 当ファンドの運用方法 | ■米ドル建ての世界の幅広い債券および債券関連派生商品等に投資します。 ■当ファンドの運用指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託します。 ■原則として対円での為替ヘッジを行わず、為替差益の獲得を目指します。 |
| 組入制限 | ■外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 配分方針 | ■年4回(原則として毎年3月、6月、9月、12月の12日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子、配当等収益のいずれか多い金額とします。 ■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。 |



三井住友DSアセットマネジメント

(旧:三井住友アセットマネジメント)

〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1

<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

フリーダイヤル 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

■ 設定以来の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 (分配落) | 基準価額 | | | 受益者 利回り | 債券組入 比率 | 投資信託 証券組入 比率 | 元本 残存率 |
|-----------|---------------------|---------------|-----------|-----------|-----------|------------|------------|--------------------|-----------|
| | | | 税込 分配金 | 期中 騰落額 | 期中 騰落率 | | | | |
| 第1 作成期 | (設定日) 2016年9月30日 | 円 10,000 | 円 - | 円 - | % - | % - | % - | % - | 100.0 |
| | 1期(2016年12月12日) | 11,323 | 67 | 1,390 | 13.9 | 68.6 | 0.0 | 98.8 | 78.0 |
| | 2期(2017年3月13日) | 11,425 | 61 | 163 | 1.4 | 34.4 | 0.0 | 98.5 | 60.2 |
| 第2 作成期 | 3期(2017年6月12日) | 11,165 | 67 | △ 193 | △ 1.7 | 19.4 | 0.0 | 98.4 | 53.9 |
| | 4期(2017年9月12日) | 11,057 | 67 | △ 41 | △ 0.4 | 13.8 | 0.0 | 98.2 | 49.3 |
| 第3 作成期 | 5期(2017年12月12日) | 11,467 | 69 | 479 | 4.3 | 14.9 | 0.0 | 98.3 | 48.2 |
| | 6期(2018年3月12日) | 10,672 | 69 | △ 726 | △ 6.3 | 7.4 | 0.0 | 98.0 | 46.5 |
| 第4 作成期 | 7期(2018年6月12日) | 10,814 | 70 | 212 | 2.0 | 7.5 | 0.0 | 98.3 | 44.8 |
| | 8期(2018年9月12日) | 10,885 | 70 | 141 | 1.3 | 7.3 | 0.0 | 98.2 | 44.0 |
| 第5 作成期 | 9期(2018年12月12日) | 11,004 | 71 | 190 | 1.7 | 7.3 | 0.0 | 98.3 | 43.5 |
| | 10期(2019年3月12日) | 11,051 | 71 | 118 | 1.1 | 7.1 | 0.0 | 98.2 | 42.5 |
| 第6 作成期 | 11期(2019年6月12日) | 10,989 | 70 | 8 | 0.1 | 6.4 | 0.0 | 98.1 | 41.3 |
| | 12期(2019年9月12日) | 10,894 | 71 | △ 24 | △ 0.2 | 5.8 | 0.0 | 98.1 | 41.2 |

※基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

※受益者利回りは、基準価額(累計分配金込み)の当初元本に対する騰落率を年率換算したものです。

※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。

※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を記載しておりません。

■ 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 | | 債券組入 比率 | 投資信託 証券組入 比率 |
|------|--------------------|-------------|--------|------------|--------------------|
| | | 騰落率 | 騰落率 | | |
| 第11期 | (期首) 2019年3月12日 | 円 11,051 | % - | % 0.0 | % 98.2 |
| | 3月末 | 11,063 | 0.1 | 0.0 | 98.2 |
| | 4月末 | 11,223 | 1.6 | 0.0 | 98.3 |
| | 5月末 | 11,120 | 0.6 | 0.0 | 98.5 |
| | (期末) 2019年6月12日 | 11,059 | 0.1 | 0.0 | 98.1 |
| 第12期 | (期首) 2019年6月12日 | 10,989 | - | 0.0 | 98.1 |
| | 6月末 | 10,993 | 0.0 | 0.0 | 98.2 |
| | 7月末 | 11,107 | 1.1 | 0.0 | 98.3 |
| | 8月末 | 10,813 | △1.6 | 0.0 | 98.4 |
| | (期末) 2019年9月12日 | 10,965 | △0.2 | 0.0 | 98.1 |

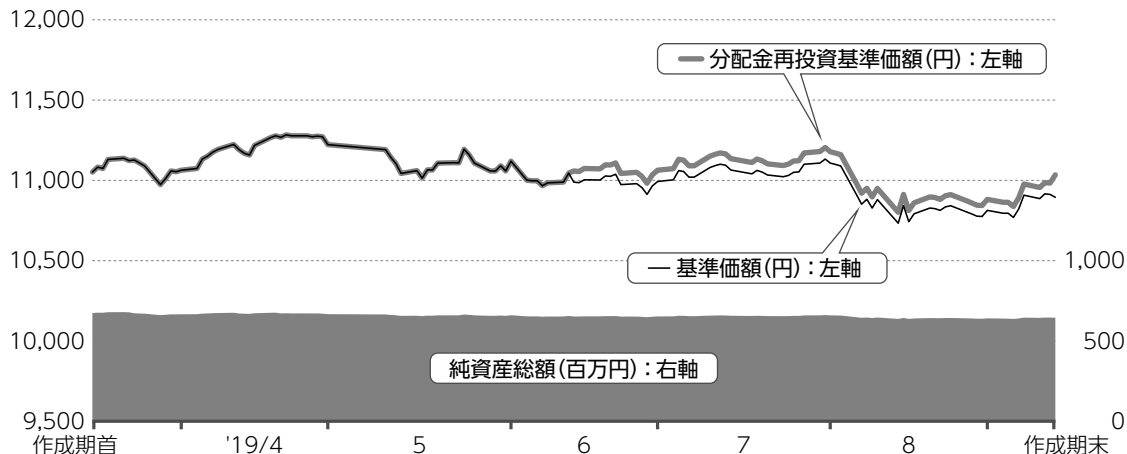
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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(2019年3月13日から2019年9月12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 | 11,051円 |
| 作成期末 | 11,035円 (当作成期分配金141円(税引前)込み) |
| 騰落率 | -0.1% (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。

※単位型投信の場合、実際には分配金は再投資されませんので留意ください。(以下、同じ)

基準価額の主な変動要因(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建ての債券および債券関連派生商品などに投資しました。米ドル売り・円買いの為替ヘッジは行っておりません。

なお、運用の指図に関する権限の一部をピムコジャパンリミテッドに委託しています。

上昇要因

- 米国公債、モーゲージ証券、ハイイールド社債の価格が上昇したこと

下落要因

- 売り建てていた英国国債や、日本国債の価格が上昇したこと
- 米ドルが円に対して下落したこと

組入れファンドの状況

| 組入れファンド | 投資資産 | 作成期末組入比率 |
|---|--------|----------|
| ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609(USD) | 外国債券 | 98.1% |
| マネー・オープン・マザーファンド | 短期金融資産 | 0.1% |

※比率は、純資産総額に対する割合です。

投資環境について(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

米国国債市場は上昇しました。ハイイールド債券市場や政府系モーゲージ証券市場も上昇しました。為替市場では、米ドル安・円高となりました。

債券市場

米国国債市場は、作成期初のFOMC(米連邦公開市場委員会)において年内の政策金利据え置きの見通しやバランスシート縮小の年内停止が示されたことに加え、5月以降の米中貿易摩擦の激化を背景に、堅調な推移となりました。また、7月末の約10年半ぶりのFRB(米連邦準備制度理事会)による利下げの実施や、香港での反政府デモの拡大や、アルゼンチンの大統領予備選での現職の劣位を受けた市場の混乱などを背景とした政治リスクの高まりをうけ、作成期末まで堅調な動きとなりました。

英国国債利回りも米国と同様の動きとなりました。英国のEU(欧州連合)離脱を巡る混乱も、利回りの低下要因となりました。

債券セクター別にみると、米国ハイイールド債券市場は米中貿易摩擦の激化や、上記政治リスクの高まりを背景にスプレッド(国債に対する上乗せ金利)が拡大し、一時軟調な動きとなる場面がありました。しかし、良好な米企業決算をプラス材料に作成期を通して

みればスプレッドが縮小し、堅調な動きとなりました。一方、政府系モーゲージ証券は期限前償還懸念の高まりからスプレッドが拡大したものの、国債金利低下の効果が勝り、プラスとなりました。

当作成期のブルームバーク・パークレイズ米国総合ボンド・インデックス(米ドルベース、ヘッジなし)は、作成期首に比べ6.5%上昇しました。

一方、英国10年国債利回りは作成期首1.18%から作成期末0.64%に低下しました。

為替市場

2019年に入ってから継続的な米国金利の低下や米中貿易摩擦激化への懸念に加えて、メイ首相の辞任表明に伴い英国の政局不透明感が高まったことなどを受けてリスク回避の動きが強まり、作成期を通じて、米ドル安・円高基調で推移しました。当作成期の米ドル・円は、作成期首111円47銭から作成期末108円09銭と3円38銭の米ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

当ファンド

「ピムコ・バミューダ・インカムファンド E クラスB-J 1609(USD)」および「マネー・オープン・マザーファンド」に投資し、「ピムコ・バミューダ・インカムファンド E クラスB-J 1609(USD)」の投資比率を高位に保ちました。

ピムコ・バミューダ・インカムファンド E クラスB-J 1609(USD)

●デュレーション(投資資金の平均回収期間)

金利戦略については、引き続き全体の金利リスク量は抑制しつつ、市場環境に応じて機動的に調整しています。デュレーションについては、作成期前半については1.4年から1.1年程度とし、作成期終盤の金利反発局面においては1.6年程度にまで調整しました。足もとでは、金融緩和に対する期待感の高まりや景気減速懸念を背景に大きく金利が低下している米国において、投資妙味が相対的に低下した中期年限の金利リスク量を一部削減しています。一方で、EU離脱に関する議論を受けて金利が大きく低下している英国や、相対的に投資妙味に欠けると判断している日本の国債は引き続き売り持ちとしています。

●債券セクター配分

セクター戦略については、米国政府関連債

や米国政府系住宅ローン担保証券といったリスク・オフ(リスク回避)時に底堅い値動きが期待できる債券を合わせて4割程度組み入れ、ポートフォリオの高い安定性を維持しています。一方、米国の景気拡大を捉える資産として、住宅市場の回復の恩恵を受けやすい非政府系住宅ローン担保証券や、企業の財務改善や収益の安定化を受けて、ハイイールド社債の組入れを継続しております。また、利回りが相対的に高く、ファンダメンタルズ(基礎的条件)の改善が期待できるメキシコやロシアなどの新興国債券への投資も継続していません。

●通貨別配分

通貨配分に関しては、概ね米ドルに投資していますが、一部、相対的に高い利回り水準を有する新興国通貨について分散を意識しながら、ロシアルーブル、メキシコペソ、ペルーソル、アルゼンチンペソなどに投資した一方で、日本円やオーストラリアドル、ニュージーランドドルへは消極的な投資としました。

マネー・オープン・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

ベンチマークとの差異について(2019年3月13日から2019年9月12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(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

(単位:円、1万口当たり、税引前)

| 項目 | 第11期 | 第12期 |
|-----------|----------|----------|
| 当期分配金 | 70 | 71 |
| (対基準価額比率) | (0.633%) | (0.648%) |

※「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。

当作成期の1万口当たりの分配金(税引前)は、分配可能額および基準価額水準等を勘案し、第11期は70円、第12期は71円といたしました。

なお、収益分配に充てなかった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。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609(USD)」および「マネー・オープン・マザーファンド」に投資を行い、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609(USD)」を高位に組み入れます。

ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609(USD)

主要国の経済活動には減速基調がみられるものの、堅調な米国の個人消費などが景気拡大サイクル終盤における世界経済の牽引役を担うと予想されます。ただし、米中貿易摩擦

に代表される通商政策を巡る不透明感や、イタリアの財政規律に対する懸念、英国のEU離脱に係る不透明感といった材料によって市場の値動きが短期的に増幅されうる点には注意が必要です。また、中長期的には主要国において低金利環境が継続する中、将来的な景気の転換点において経済活動を刺激する政策手段が限定的となる点にも留意する必要があり、投資の元本保全を意識しつつ、魅力的な水準のインカム収入を獲得していくことを目指していきます。

マネー・オープン・マザーファンド

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

合併について

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友DSアセットマネジメント株式会社に変更しました。

約款変更について

委託会社の合併に伴う商号変更および電子公告アドレスの変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(適用日：2019年4月1日)

■ 1万口当たりの費用明細(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 74円 | 0.668% | 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) |
| (投信会社) | (54) | (0.489) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| (販売会社) | (18) | (0.163) | 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) | (0.016) | 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 | 6 | 0.056 | 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 |
| (投資信託証券) | (6) | (0.056) | 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 |
| (c) その他費用 | 0 | 0.003 | その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数 |
| (監査費用) | (0) | (0.003) | 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 | 80 | 0.727 | |

期中の平均基準価額は11,053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、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。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。当該投資信託証券の費用は後掲の「損益計算書」をご覧ください。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

投資信託証券

| | | 当 作 成 期 | | | |
|----|--|---------|-------|-------|--------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国内 | ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609 (USD) | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | | — | — | 1,852 | 20,212 |
| | 合計 | — | — | 1,852 | 20,212 |

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 利害関係人との取引状況等(2019年3月13日から2019年9月12日まで)

利害関係人との取引状況

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし)

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。

マネー・オープン・マザーファンド

| 区 分 | 当 作 成 期 | | | | | |
|-------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公 社 債 | 百万円 28 | 百万円 14 | % 50.0 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

※平均保有割合 0.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 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
(2019年3月13日から2019年9月12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(2019年9月12日現在)

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファ ン ド 名 | 作成期首 | | 作 成 期 末 | |
|--------------------------------------|-------------|-------------|---------------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 組 入 比 率 |
| ビムコ・バミューダ・インカムファンドEクラスB-J 1609 (USD) | 口 60,077 | 口 58,225 | 千円 632,032 | % 98.1 |
| 合 計 | 60,077 | 58,225 | 632,032 | 98.1 |

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(2) 親投資信託残高

| 種 類 | 作成期首 | | 作 成 期 末 | |
|------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| マネー・オープン・マザーファンド | 千口 409 | 千口 409 | 千円 409 | 千円 409 |

※マネー・オープン・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は75,182千口です。

※単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2019年9月12日現在)

| 項 目 | 作 成 期 末 | |
|-----------------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 632,032 | % 97.1 |
| マ ネ ー ・ オ ー プ ン ・ マ ー ザ ー フ ァ ン ド | 409 | 0.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 18,136 | 2.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 650,577 | 100.0 |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年6月12日) (2019年9月12日)

| 項 目 | 第11期末 | 第12期末 |
|-----------------------|---------------------|---------------------|
| (A) 資 産 | 658,568,656円 | 650,577,348円 |
| コール・ローン等 | 18,113,003 | 18,135,233 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 640,045,832 | 632,032,375 |
| マネー・オープン・マザーファンド(評価額) | 409,821 | 409,740 |
| (B) 負 債 | 6,370,936 | 6,370,835 |
| 未払収益分配金 | 4,154,676 | 4,198,689 |
| 未払信託報酬 | 2,207,169 | 2,163,038 |
| 未払利息 | 52 | 14 |
| その他未払費用 | 9,039 | 9,094 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 652,197,720 | 644,206,513 |
| 元 本 | 593,525,283 | 591,364,719 |
| 次期繰越損益金 | 58,672,437 | 52,841,794 |
| (D) 受益権総口数 | 593,525,283口 | 591,364,719口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,989円 | 10,894円 |

- ※設 定 年 月 日 2016年9月30日
 設 定 元 本 額 1,434,728,640円
 作 成 期 首 元 本 額 609,879,929円
 作 成 期 末 元 本 残 存 率 41.2%
 ※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2019年3月13日) (自2019年6月13日)
 (自2019年6月12日) (自2019年9月12日)

| 項 目 | 第11期 | 第12期 |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 6,426,170円 | 6,402,656円 |
| 受 取 配 当 金 | 6,428,510 | 6,404,750 |
| 支 払 利 息 | △ 2,340 | △ 2,094 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,567,477 | 124,537 |
| 売 | 1,567,477 | 124,537 |
| 買 | | |
| (C) 有 価 証 券 評 価 差 損 益 | △ 5,402,441 | △ 5,853,538 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △ 2,231,511 | △ 2,179,074 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D) | 359,695 | △ 1,505,419 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 64,073,571 | 58,672,437 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 1,606,153 | △ 126,535 |
| (H) 計 (E+F+G) | 62,827,113 | 57,040,483 |
| (I) 収 益 分 配 金 | △ 4,154,676 | △ 4,198,689 |
| 次期繰越損益金(H+I) | 58,672,437 | 52,841,794 |

※信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

※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。

※当ファンドの運用の指図にかかる権限の一部委託に要する費用は2,147,372円(消費税等相当額を含む)です。(2019年3月13日～2019年9月12日、当社計算値)

※分配金の計算過程は以下の通りです。

第11期末における費用控除後の配当等収益が4,175,896円、純資産額の元本超過額62,827,113円のうち、多い金額である62,827,113円(1万口当たり1,058.54円)を分配可能額として、うち4,154,676円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

第12期末における費用控除後の配当等収益が4,212,224円、純資産額の元本超過額57,040,483円のうち、多い金額である57,040,483円(1万口当たり964.56円)を分配可能額として、うち4,198,689円(1万口当たり71円)を分配金額としております。

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金(税引前) | 第11期 | 第12期 |
|----------------|------|------|
| | 70円 | 71円 |

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。

■ 組入れ投資信託証券の内容

投資信託証券の概要

| | | |
|-------------|---|---------------|
| ファンド名 | ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609 (USD) | |
| 形態 | バミューダ籍外国投資信託 (円建て) | |
| 主要投資対象 | 「ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)」 受益証券 | |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 「ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)」 受益証券を主要投資対象として、投資適格未満の銘柄も含めた世界の幅広い銘柄の中から、米ドル建ての債券等を中心に投資を行うことで、長期的な信託財産の成長を目指すとともに、利子収入の最大化を目指す運用を行います。 ・ 原則として対円での為替ヘッジを行いません。 | |
| ベンチマーク | ありません。 | |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 米ドル建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・ テリパティブおよび外国為替予約取引の利用は、原則としてヘッジ目的および資産の効率的な運用に資することを目的とします。 | |
| 決算日 | 年1回決算 (原則として、毎年10月31日) | |
| 分配方針 | 年4回 (毎年3月、6月、9月、12月) 分配を行う方針。 | |
| 運用報酬 | ありません。 | |
| 管理およびその他の費用 | 販売管理報酬 2021年9月29日まで、年0.76% 2021年9月30日以降、ありません。 その他 ファンドの設立、取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 | |
| 申込手数料 | ありません。 | |
| 換金手数料 | 換金約定日に応じて、換金代金に以下の料率を乗じた額です。 | |
| | 換金約定日 | 換金手数料率 |
| | 2017年9月29日まで | 3.0% |
| | 2017年9月30日から2018年9月29日まで | 2.4% |
| | 2018年9月30日から2019年9月29日まで | 1.8% |
| | 2019年9月30日から2020年9月29日まで | 1.2% |
| | 2020年9月30日から2021年9月29日まで | 0.6% |
| | 2021年9月30日以降 | なし |
| 信託財産留保額 | ありません。 | |
| 投資顧問会社 | パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー | |
| 購入の可否 | 日本において一般投資者は購入できません。 | |

以下には、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE クラスB-J 1609 (USD)」をシェアクラスとして含む「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE」と、「ピムコ・バミューダ・インカムファンドE」が主要投資対象とする「ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)」の情報を、委託会社において抜粋・要約して翻訳したものを記載しています。

(1)ピムコ・バミューダ・インカムファンドE

■ 損益計算書(2017年11月1日から2018年10月31日まで)

(単位：千円)

| | |
|----------------------|-----------|
| 投資収益 | |
| 受取利息 (外国税控除後) | 25,656 |
| 総収益 | 25,656 |
| 費用 | |
| 販売手数料 | 185,267 |
| 支払利息 | 892 |
| 法務費用 B-Jクラス1612(円) | 1,297 |
| 法務費用 B-Jクラス1612(米ドル) | 548 |
| 総費用 | 188,004 |
| 投資純利益(損失) | (162,348) |
| 実現純利益(損失) | |
| 有価証券に対する投資 (外国税控除後) | 13,786 |
| 関連ファンドに対する投資 | 294,041 |
| OTC金融デリバティブ商品 | (509,882) |
| 外国為替 | 55,460 |
| 実現純利益(損失) | (146,595) |
| 未実現評価益(損)の純変動額 | |
| 有価証券に対する投資 (外国税控除後) | (24,710) |
| 関連ファンドに対する投資 | (372,254) |
| OTC金融デリバティブ商品 | 206,838 |
| 外貨建資産および負債 | (31,357) |
| 未実現評価益(損)の純変動額 | (221,483) |
| 純利益(損失) | (368,078) |
| 運用の結果による純資産の純増加(減少)額 | (530,426) |

■ 投資明細表(2018年10月31日現在)

| 種類 | 銘柄 | 通貨 | 額面金額 (単位：千) | 通貨 | 時価 (単位：千) | | | |
|--------------------------------------|---------------------------|---|----------------|----------------------|--------------|---------|------------|--------|
| 投資有価証券 8.7% | パフォーマンス・ リンク債 2.5% | Credit Suisse International, PIMCO Bermuda Income Fund (M) | | | | | | |
| | | 満期日 06/08/2021 | USD | 130 | JPY | 16,663 | | |
| | | 満期日 06/08/2021 | JPY | 50,000 | | 53,908 | | |
| | | 満期日 10/07/2021 | USD | 140 | | 17,344 | | |
| | | 満期日 10/07/2021 | JPY | 232,000 | | 243,076 | | |
| | | 満期日 01/11/2022 | USD | 200 | | 24,525 | | |
| | | 満期日 01/11/2022 | JPY | 207,000 | | 215,677 | | |
| | | パフォーマンス・リンク債合計 (原価：540,884円) | | | | | 571,193 | |
| | | 短期証券 6.2% | 定期性預金 6.2% | Bank of Nova Scotia | | | | |
| | | | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 371 | | 41,903 |
| Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | | | | | | | | |
| (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | | | 20 | | 20 | | |
| Brown Brothers Harriman & Co. | | | | | | | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | | | 2 | | 216 | | |
| Citibank N.A. | | | | | | | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | | | | 1,548 | | 174,676 | | |
| DBS Bank Ltd. | | | | | | | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | | | | 398 | | 44,989 | | |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | | | | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | | | | 3,292 | | 371,482 | | |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | | | | | |
| (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | | | 5 | | 5 | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | | | 3,788 | | 427,496 | | |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | | | | | |
| (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | 19 | | 19 | | | | |
| 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 2,943 | | 332,125 | | | | |
| | | | | | 1,392,931 | | | |
| 短期証券合計 (原価：1,392,931円) | | | | | 1,392,931 | | | |
| 投資有価証券合計 (原価：1,933,815円) | | | | | 1,964,124 | | | |
| 関連ファンド に対する投資 91.8% | ミューチュアル・ ファンド 91.8% | PIMCO Bermuda Income Fund (M) | | | | | | |
| | | (原価：18,254,727円) | | | | | | |
| | | 関連ファンドに対する投資合計 (原価：18,254,727円) | | | | | | |
| | | | | | | 14,369 | | |
| | | 投資合計 100.5% (原価：20,188,542円) | | | | JPY | 22,687,994 | |
| | | 金融デリバティブ商品 (0.1%) (原価またはプレミアム(純額) 0 円) | | | | | (15,475) | |
| | | その他の資産および負債 (純額) (0.4%) | | | | | (88,700) | |
| | | 純資産 100.0% | | | | JPY | 22,583,819 | |

(2)ピムコ・バミューダ・インカムファンド (M)

■ 損益計算書(2017年11月1日から2018年10月31日まで)

(単位：千米ドル)

| | |
|----------------------|-----------|
| 投資収益 | |
| 受取利息(外国税控除後) | 466,864 |
| 受取配当金(外国税控除後) | 1,292 |
| 雑収入 | 439 |
| 総収益 | 468,595 |
| 費用 | |
| 支払利息 | 8,886 |
| 雑費用 | 62 |
| 総費用 | 8,948 |
| 投資純利益(損失) | 459,647 |
| 実現純利益(損失) | |
| 有価証券に対する投資(外国税控除後) | (19,714) |
| 市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引 | 5,884 |
| OTC金融デリバティブ商品 | 63,963 |
| 外国為替 | (41,724) |
| 実現純利益(損失) | 8,409 |
| 未実現評価益(損)の純変動額 | |
| 有価証券に対する投資(外国税控除後) | (360,035) |
| 市場取引又は中央清算金融デリバティブ取引 | (123,597) |
| OTC金融デリバティブ商品 | 97,232 |
| 外貨建資産および負債 | (1,905) |
| 未実現評価益の純変動額 | (388,305) |
| 純利益(損失) | (379,896) |
| 運用の結果による純資産の純増加(減少)額 | 79,751 |
| * 外国源泉課税 | 303 |

■ 投資明細表(2018年10月31日現在)

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|--------|---------|--|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) |
| 投資有価証券 | 銀行ローン債権 | Accudyne Industries Borrower S.C.A. | | | | |
| 110.5% | 5.5% | 5.302% 期日 08/18/2024 | USD | 537 | USD | 536 |
| | | Air Medical Group Holdings, Inc. | | | | |
| | | 6.530% 期日 03/14/2025 | | 993 | | 977 |
| | | Alphabet Holding Co., Inc. | | | | |
| | | 5.802% 期日 09/26/2024 | | 495 | | 474 |
| | | Altica France S.A. | | | | |
| | | 6.280% 期日 08/14/2026 | | 5,400 | | 5,335 |
| | | Altran Technologies | | | | |
| | | 2.750% 期日 03/20/2025 | EUR | 2,789 | | 3,175 |
| | | American Builders & Contractors Supply Co., Inc. | | | | |
| | | 4.302% 期日 10/31/2023 | USD | 1,679 | | 1,666 |
| | | Ancestry.com Operations, Inc. | | | | |
| | | 5.550% 期日 10/19/2023 | | 1,177 | | 1,181 |
| | | Aramark Intermediate HoldCo Corp. | | | | |
| | | 4.052% 期日 03/11/2025 | | 933 | | 935 |
| | | Avantor, Inc. | | | | |
| | | 6.302% 期日 11/21/2024 | | 684 | | 689 |
| | | Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC | | | | |
| | | 4.280% 期日 01/15/2025 | | 42,148 | | 42,087 |
| | | AWAS Leasing 2011- I Ltd. | | | | |
| | | 4.870% 期日 10/02/2021 | | 633 | | 632 |
| | | Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV | | | | |
| | | 4.136% 期日 06/01/2024 | | 468 | | 467 |
| | | Bausch Health Co., Inc. | | | | |
| | | 5.274% 期日 06/01/2025 | | 461 | | 462 |
| | | Beacon Roofing Supply, Inc. | | | | |
| | | 4.527% 期日 01/02/2025 | | 1,104 | | 1,096 |
| | | BWay Holdings Co. | | | | |
| | | 5.658% 期日 04/03/2024 | | 385 | | 383 |
| | | Caesars Resort Collection LLC | | | | |
| | | 5.052% 期日 12/22/2024 | | 5,344 | | 5,352 |
| | | Camelot U.S. Acquisition 1 Co. | | | | |
| | | 5.552% 期日 10/03/2023 | | 192 | | 192 |
| | | Castlelake Aircraft Structured Trust | | | | |
| | | 3.967% 期日 07/12/2024 | | 3,359 | | 3,312 |
| | | Ceasers Entertainment Operating Co. LLC | | | | |
| | | 4.302% 期日 10/06/2024 | | 2,303 | | 2,294 |
| | | CenturyLink, Inc. | | | | |
| | | 5.052% 期日 01/31/2025 | | 2,006 | | 1,985 |
| | | CH Hold Corp. | | | | |
| | | 5.302% 期日 02/01/2024 | | 294 | | 295 |
| | | Charter Communications Operating LLC | | | | |
| | | 4.310% 期日 04/30/2025 | | 5,610 | | 5,617 |
| | | CityCenter Holdings LLC | | | | |
| | | 4.552% 期日 04/18/2024 | | 296 | | 296 |
| | | Community Health Systems, Inc. | | | | |
| | | 5.563% 期日 01/27/2021 | | 26,707 | | 26,217 |
| | | Concordia International Corp. | | | | |
| | | 7.781% 期日 09/06/2024 | | 3,400 | | 3,341 |
| | | Crown Holdings, Inc. | | | | |
| | | 4.283% 期日 04/03/2025 | | 763 | | 766 |
| | | CSC Holdings LLC | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--------------------------------------|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.780% 期日 01/25/2026 | | 2,886 | | 2,895 |
| | | DaVita, Inc. | | | | |
| | | 5.052% 期日 06/24/2021 | | 192 | | 192 |
| | | Dell International LLC | | | | |
| | | 4.310% 期日 09/07/2023 | | 2,814 | | 2,813 |
| | | Diamond Resorts International, Inc. | | | | |
| | | 6.052% 期日 09/02/2023 | | 3,942 | | 3,848 |
| | | Dubai World | | | | |
| | | 2.000% 期日 09/30/2022 | | 20,315 | | 19,045 |
| | | Energizer Holdings, Inc. | | | | |
| | | 7.353% 期日 05/18/2019 | | 2,700 | | 2,703 |
| | | Envision Healthcare Corp. | | | | |
| | | 6.052% 期日 10/10/2025 | | 9,100 | | 8,930 |
| | | FCA US LLC | | | | |
| | | 4.300% 期日 12/31/2018 | | 758 | | 759 |
| | | Financial & Risk U.S. Holdings, Inc. | | | | |
| | | 4.000% 期日 10/01/2025 | EUR | 15,000 | | 17,096 |
| | | 6.052% 期日 10/01/2025 | USD | 11,300 | | 11,215 |
| | | First Data Corp. | | | | |
| | | 4.287% 期日 07/08/2022 | | 2,629 | | 2,626 |
| | | Forest City Enterprises LP | | | | |
| | | 6.199% 期日 10/24/2025 | | 2,200 | | 2,212 |
| | | Frontier Communications Corp. | | | | |
| | | 6.060% 期日 06/15/2024 | | 7,425 | | 7,202 |
| | | Genworth Holdings, Inc. | | | | |
| | | 6.831% 期日 03/07/2023 | | 398 | | 407 |
| | | Golden Nugget, Inc. | | | | |
| | | 5.052% 期日 10/04/2023 | | 1 | | 1 |
| | | 5.186% 期日 10/04/2023 | | 13 | | 13 |
| | | 5.277% 期日 10/04/2023 | | 15 | | 16 |
| | | GreenSky Holdings LLC | | | | |
| | | 5.563% 期日 03/31/2025 | | 4,876 | | 4,900 |
| | | HCA, Inc. | | | | |
| | | 4.052% 期日 03/18/2023 | | 826 | | 831 |
| | | 4.302% 期日 03/13/2025 | | 2,976 | | 2,994 |
| | | HD Supply Waterworks Ltd. | | | | |
| | | 5.313% 期日 08/01/2024 | | 317 | | 317 |
| | | Hilton Worldwide Finance LLC | | | | |
| | | 4.031% 期日 10/25/2023 | | 10,682 | | 10,703 |
| | | iHeartCommunications, Inc. | | | | |
| | | 8.443% 期日 01/30/2019 | | 45,625 | | 33,183 |
| | | 9.802% 期日 07/30/2019 | | 6,200 | | 4,499 |
| | | Intelsat Jackson Holdings S. A. | | | | |
| | | 6.045% 期日 11/27/2023 | | 3,800 | | 3,805 |
| | | 6.625% 期日 01/02/2024 | | 10,100 | | 10,388 |
| | | Iqvia, Inc. | | | | |
| | | 4.386% 期日 01/17/2025 | | 10,098 | | 10,128 |
| | | IRB Holdings Corp. | | | | |
| | | 5.460% 期日 02/05/2025 | | 697 | | 697 |
| | | KFC Holding Co. | | | | |
| | | 4.037% 期日 04/03/2025 | | 1,078 | | 1,080 |
| | | Kinetic Concepts, Inc. | | | | |
| | | 5.636% 期日 02/02/2024 | | 9,381 | | 9,427 |
| | | Klockner Pentaplast of America, Inc. | | | | |
| | | 4.750% 期日 06/30/2022 | EUR | 300 | | 323 |
| | | Las Vegas Sands LLC | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.052% 期日 03/27/2025 | USD | 2,574 | | 2,568 |
| | | Marriott Ownership Resorts, Inc. | | | | |
| | | 4.552% 期日 08/29/2025 | | 1,300 | | 1,307 |
| | | McDermott International, Inc. | | | | |
| | | 7.302% 期日 05/10/2025 | | 2,832 | | 2,812 |
| | | Meredith Corp. | | | | |
| | | 5.052% 期日 01/31/2025 | | 975 | | 975 |
| | | Messer Industries LLC | | | | |
| | | 4.834% 期日 10/01/2025 | | 2,120 | | 2,123 |
| | | MGM Growth Properties Operating Partnership LP | | | | |
| | | 4.302% 期日 03/21/2025 | | 605 | | 603 |
| | | MH Sub I LLC | | | | |
| | | 6.030% 期日 09/13/2024 | | 1,000 | | 1,005 |
| | | Mission Broadcasting, Inc. | | | | |
| | | 4.544% 期日 01/17/2024 | | 63 | | 64 |
| | | Multi-Color Corp. | | | | |
| | | 4.302% 期日 10/31/2024 | | 174 | | 175 |
| | | Neiman Marcus Group Ltd. LLC | | | | |
| | | 5.531% 期日 10/25/2020 | | 11,822 | | 10,786 |
| | | Nexstar Broadcasting, Inc. | | | | |
| | | 4.544% 期日 01/17/2024 | | 396 | | 397 |
| | | Nielsen Finance LLC | | | | |
| | | 4.281% 期日 10/04/2023 | | 394 | | 392 |
| | | Ocean Rig UDW, Inc. | | | | |
| | | 8.000% 期日 09/20/2024 | | 6,693 | | 7,044 |
| | | Parexel International Corp. | | | | |
| | | 5.052% 期日 09/27/2024 | | 396 | | 391 |
| | | PetSmart, Inc. | | | | |
| | | 5.280% 期日 03/11/2022 | | 4,865 | | 4,138 |
| | | Pisces Midco, Inc. | | | | |
| | | 6.175% 期日 04/12/2025 | | 5,161 | | 5,149 |
| | | Post Holdings, Inc. | | | | |
| | | 4.290% 期日 05/24/2024 | | 876 | | 876 |
| | | Prestige Brands, Inc. | | | | |
| | | 4.302% 期日 01/26/2024 | | 60 | | 60 |
| | | Republic of Tanzania | | | | |
| | | 7.839% 期日 12/10/2019 | | 2,600 | | 2,551 |
| | | Reynolds Group Holdings, Inc. | | | | |
| | | 5.052% 期日 02/05/2023 | | 196 | | 196 |
| | | RPI Finance Trust | | | | |
| | | 4.386% 期日 03/27/2023 | | 7,018 | | 7,033 |
| | | SBA Senior Finance II LLC | | | | |
| | | 4.310% 期日 04/11/2025 | | 499 | | 498 |
| | | Sequa Mezzanine Holdings LLC | | | | |
| | | 7.389% 期日 11/28/2021 | | 31 | | 31 |
| | | 7.408% 期日 11/28/2021 | | 12,498 | | 12,333 |
| | | 11.520% 期日 04/28/2022 | | 650 | | 644 |
| | | Serta Simmons Bedding LLC | | | | |
| | | 5.774% 期日 11/08/2023 | | 197 | | 179 |
| | | Sigma Holdco BV | | | | |
| | | 3.500% 期日 07/02/2025 | EUR | 5,300 | | 6,013 |
| | | Sprint Communications, Inc. | | | | |
| | | 4.813% 期日 02/02/2024 | USD | 4,142 | | 4,140 |
| | | SS&C Technologies Holdings, Inc. | | | | |
| | | 4.552% 期日 04/16/2025 | | 8,567 | | 8,535 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|-------|---------|--|------|--------|----|-----------------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | Starfruit Finco BV | | | | |
| | | 3.750% 期日 10/01/2025 | EUR | 3,800 | | 4,347 |
| | | 5.506% 期日 10/01/2025 | USD | 4,900 | | 4,898 |
| | | State of Rio De Janeiro | | | | |
| | | 6.024% 期日 12/20/2020 | | 6,716 | | 6,531 |
| | | Syniverse Holdings, Inc. | | | | |
| | | 7.280% 期日 03/09/2023 | | 746 | | 750 |
| | | TerraForm Power Operating LLC | | | | |
| | | 4.302% 期日 11/08/2022 | | 199 | | 199 |
| | | Traverse Midstream Partners LLC | | | | |
| | | 6.600% 期日 09/27/2024 | | 234 | | 236 |
| | | Tronox Blocked Borrower LLC | | | | |
| | | 5.302% 期日 09/23/2024 | | 135 | | 135 |
| | | Tronox Finance LLC | | | | |
| | | 5.302% 期日 09/23/2024 | | 361 | | 361 |
| | | Unitymedia Finance LLC | | | | |
| | | 4.530% 期日 01/15/2026 | | 1,000 | | 1,000 |
| | | Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG | | | | |
| | | 2.750% 期日 01/15/2027 | EUR | 2,900 | | 3,306 |
| | | Univision Communications, Inc. | | | | |
| | | 5.052% 期日 03/15/2024 | USD | 26,641 | | 25,603 |
| | | Vertiv Group Corp. | | | | |
| | | 6.313% 期日 11/30/2023 | | 251 | | 248 |
| | | VICI Properties 1 LLC | | | | |
| | | 4.280% 期日 12/20/2024 | | 3,627 | | 3,623 |
| | | Vistra Operations Co. LLC | | | | |
| | | 4.302% 期日 08/04/2023 | | 425 | | 427 |
| | | 4.552% 期日 12/14/2023 | | 444 | | 445 |
| | | West Corp. | | | | |
| | | 6.302% 期日 10/10/2024 | | 1 | | 1 |
| | | 6.527% 期日 10/10/2024 | | 212 | | 212 |
| | | Westmoreland Coal Co. | | | | |
| | | 10.562% 期日 05/21/2019 | | 153 | | 156 |
| | | WHLN FIRST MTG CO LEND 2 ASSET HOTEL | | | | |
| | | 4.246% 期日 07/21/2025 | | 79,000 | | 79,077 |
| | | 4.850% 期日 02/09/2021 | | 45,000 | | 45,079 |
| | | WHOLE LOAN ST REGIS ASPEN | | | | |
| | | 3.200% 期日 07/09/2020 | | 99,000 | | 99,158 |
| | | Wyndham Hotels & Resorts, Inc. | | | | |
| | | 4.052% 期日 05/30/2025 | | 2,500 | | 2,502 |
| | | | | | | <u>646,322</u> |
| | | | | | | (原価：658,315米ドル) |
| | | | | | | 銀行貸付債権証券合計 |
| 社債券等 | 銀行および金融 | ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC | | | | |
| 33.0% | 20.4% | 2.626% 期日 04/28/2020 | EUR | 3,028 | | 3,432 |
| | | ABN AMRO Bank NV | | | | |
| | | 1.800% 期日 09/20/2019 | USD | 200 | | 198 |
| | | 2.450% 期日 06/04/2020 | | 5,900 | | 5,828 |
| | | ADLER Real Estate AG | | | | |
| | | 1.875% 期日 04/27/2023 | EUR | 2,900 | | 3,193 |
| | | 3.000% 期日 04/27/2026 | | 2,900 | | 3,188 |
| | | AerCap Ireland Capital DAC | | | | |
| | | 3.500% 期日 05/26/2022 | USD | 150 | | 146 |
| | | 3.750% 期日 05/15/2019 | | 1,850 | | 1,854 |
| | | 4.250% 期日 07/01/2020 | | 1,405 | | 1,414 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|------------------------------------|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.500% 期日 05/15/2021 | | 650 | | 657 |
| | | 4.625% 期日 10/30/2020 | | 4,000 | | 4,063 |
| | | 5.000% 期日 10/01/2021 | | 1,300 | | 1,335 |
| | | AGFC Capital Trust I | | | | |
| | | 4.186% 期日 01/15/2067 | | 2,200 | | 1,155 |
| | | Air Lease Corp. | | | | |
| | | 3.250% 期日 03/01/2025 | | 37,900 | | 35,227 |
| | | Akelius Residential Property AB | | | | |
| | | 1.500% 期日 01/23/2022 | EUR | 3,600 | | 4,162 |
| | | 3.375% 期日 09/23/2020 | | 2,900 | | 3,480 |
| | | Alliance Data Systems Corp. | | | | |
| | | 4.500% 期日 03/15/2022 | | 173 | | 199 |
| | | Ally Financial, Inc. | | | | |
| | | 3.250% 期日 11/05/2018 | USD | 1,400 | | 1,400 |
| | | 3.500% 期日 01/27/2019 | | 5,240 | | 5,240 |
| | | 3.750% 期日 11/18/2019 | | 1,060 | | 1,063 |
| | | 4.125% 期日 03/30/2020 | | 5,800 | | 5,822 |
| | | 4.250% 期日 04/15/2021 | | 4,660 | | 4,672 |
| | | 7.500% 期日 09/15/2020 | | 556 | | 591 |
| | | 8.000% 期日 12/31/2018 | | 400 | | 403 |
| | | 8.000% 期日 03/15/2020 | | 550 | | 580 |
| | | 8.000% 期日 11/01/2031 | | 8,949 | | 10,805 |
| | | Alpha Bank AE | | | | |
| | | 2.500% 期日 02/05/2023 | EUR | 3,900 | | 4,473 |
| | | Ambac LSNI LLC | | | | |
| | | 7.396% 期日 02/12/2023 | USD | 12,727 | | 12,918 |
| | | American International Group, Inc. | | | | |
| | | 5.750% 期日 04/01/2048 | | 2,516 | | 2,382 |
| | | American Tower Corp. | | | | |
| | | 3.000% 期日 06/15/2023 | | 1,864 | | 1,787 |
| | | Annington Funding PLC | | | | |
| | | 1.650% 期日 07/12/2024 | EUR | 1,600 | | 1,786 |
| | | 2.646% 期日 07/12/2025 | GBP | 2,200 | | 2,770 |
| | | 3.184% 期日 07/12/2029 | | 900 | | 1,136 |
| | | Ardonagh Midco 3 PLC | | | | |
| | | 8.375% 期日 07/15/2023 | | 3,560 | | 4,274 |
| | | Army Hawaii Family Housing Trust | | | | |
| | | Certificates | | | | |
| | | 2.680% 期日 06/15/2050 | USD | 8,200 | | 6,112 |
| | | Aroundtown S. A. | | | | |
| | | 1.000% 期日 01/07/2025 | EUR | 2,800 | | 2,977 |
| | | 1.625% 期日 01/31/2028 | | 2,100 | | 2,149 |
| | | 1.875% 期日 01/19/2026 | | 500 | | 548 |
| | | 2.000% 期日 11/02/2026 | | 2,500 | | 2,733 |
| | | 3.000% 期日 10/16/2029 | GBP | 7,400 | | 8,938 |
| | | Assurant, Inc. | | | | |
| | | 4.200% 期日 09/27/2023 | USD | 2,012 | | 2,003 |
| | | Athene Holding Ltd. | | | | |
| | | 4.125% 期日 01/12/2028 | | 894 | | 821 |
| | | Atrium European Real Estate Ltd. | | | | |
| | | 3.000% 期日 09/11/2025 | EUR | 3,100 | | 3,547 |
| | | 3.625% 期日 10/17/2022 | | 350 | | 426 |
| | | AXA Equitable Holdings, Inc. | | | | |
| | | 3.900% 期日 04/20/2023 | USD | 436 | | 431 |
| | | 4.350% 期日 04/20/2028 | | 2,610 | | 2,499 |
| | | 5.000% 期日 04/20/2048 | | 1,518 | | 1,358 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--------------------------------------|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | Axis Bank Ltd. | | | | |
| | | 3.250% 期日 05/21/2020 | | 2,200 | | 2,171 |
| | | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| | | 6.750% 期日 02/18/2020 | EUR | 7,600 | | 8,848 |
| | | 7.000% 期日 02/19/2019 | | 31,200 | | 35,738 |
| | | 8.875% 期日 04/14/2021 | | 8,600 | | 10,856 |
| | | Banco de Galicia y Buenos Aires S.A. | | | | |
| | | 25.980% 期日 04/26/2020 | ARS | 61,000 | | 1,262 |
| | | Banco do Brasil S.A. | | | | |
| | | 6.000% 期日 01/22/2020 | USD | 1,000 | | 1,026 |
| | | Banco do Nordeste do Brasil S.A. | | | | |
| | | 4.375% 期日 05/03/2019 | | 7,300 | | 7,318 |
| | | Banco Espirito Santo S.A. | | | | |
| | | 2.625% 期日 05/08/2049 | EUR | 3,100 | | 1,089 |
| | | Banco Santander S.A. | | | | |
| | | 3.545% 期日 04/12/2023 | USD | 800 | | 803 |
| | | 3.848% 期日 04/12/2023 | | 1,200 | | 1,162 |
| | | 4.379% 期日 04/12/2028 | | 800 | | 744 |
| | | 4.750% 期日 03/19/2025 | EUR | 10,200 | | 10,138 |
| | | 6.250% 期日 09/11/2021 | | 21,400 | | 24,926 |
| | | Bank of America Corp. | | | | |
| | | 3.106% 期日 03/05/2024 | USD | 4,136 | | 4,109 |
| | | 3.419% 期日 12/20/2028 | | 315 | | 291 |
| | | Bank of China Ltd. | | | | |
| | | 0.182% 期日 04/17/2021 | EUR | 3,020 | | 3,423 |
| | | Bank of Ireland | | | | |
| | | 7.375% 期日 06/18/2020 | | 500 | | 604 |
| | | Barclays Bank PLC | | | | |
| | | 7.625% 期日 11/21/2022 | USD | 7,540 | | 8,063 |
| | | 14.000% 期日 06/15/2019 | GBP | 9,970 | | 13,659 |
| | | Barclays PLC | | | | |
| | | 1.375% 期日 01/24/2026 | EUR | 4,300 | | 4,625 |
| | | 2.375% 期日 10/06/2023 | GBP | 7,350 | | 9,233 |
| | | 3.125% 期日 01/17/2024 | | 27,000 | | 34,633 |
| | | 3.250% 期日 02/12/2027 | | 17,530 | | 21,849 |
| | | 3.250% 期日 01/17/2033 | | 3,300 | | 3,790 |
| | | 3.684% 期日 01/10/2023 | USD | 500 | | 484 |
| | | 3.695% 期日 05/16/2024 | | 8,400 | | 8,335 |
| | | 4.039% 期日 01/10/2023 | | 1,000 | | 1,016 |
| | | 4.337% 期日 01/10/2028 | | 700 | | 652 |
| | | 4.338% 期日 05/16/2024 | | 5,400 | | 5,301 |
| | | 4.375% 期日 01/12/2026 | | 2,900 | | 2,786 |
| | | 4.972% 期日 05/16/2029 | | 2,600 | | 2,528 |
| | | 5.875% 期日 09/15/2024 | GBP | 5,800 | | 6,922 |
| | | 6.500% 期日 09/15/2019 | EUR | 21,200 | | 24,770 |
| | | 7.000% 期日 09/15/2019 | GBP | 7,540 | | 9,682 |
| | | 7.250% 期日 03/15/2023 | | 14,800 | | 19,444 |
| | | 7.750% 期日 09/15/2023 | USD | 11,100 | | 11,102 |
| | | 7.875% 期日 03/15/2022 | | 1,200 | | 1,239 |
| | | 7.875% 期日 09/15/2022 | GBP | 8,053 | | 10,761 |
| | | 8.000% 期日 12/15/2020 | EUR | 4,160 | | 5,166 |
| | | 8.250% 期日 12/15/2018 | USD | 5,030 | | 5,060 |
| | | Bevco Lux Sarl | | | | |
| | | 1.750% 期日 02/09/2023 | EUR | 5,100 | | 5,732 |
| | | BGC Partners, Inc. | | | | |
| | | 5.125% 期日 05/27/2021 | USD | 400 | | 409 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 5.375% 期日 12/09/2019 | | 1,450 | | 1,470 |
| | | Blackstone CQP Holdco LP | | | | |
| | | 6.000% 期日 08/18/2021 | | 1,300 | | 1,305 |
| | | 6.500% 期日 03/20/2021 | | 7,400 | | 7,454 |
| | | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl | | | | |
| | | 1.400% 期日 07/06/2022 | EUR | 4,100 | | 4,670 |
| | | 2.200% 期日 07/24/2025 | | 2,900 | | 3,220 |
| | | BNP Paribas S.A. | | | | |
| | | 3.375% 期日 01/09/2025 | USD | 54,443 | | 50,961 |
| | | 4.400% 期日 08/14/2028 | | 4,200 | | 4,041 |
| | | 7.000% 期日 08/16/2028 | | 1,400 | | 1,382 |
| | | 7.625% 期日 03/30/2021 | | 600 | | 625 |
| | | BOC Aviation Ltd. | | | | |
| | | 2.375% 期日 09/15/2021 | | 570 | | 544 |
| | | 3.499% 期日 09/26/2023 | | 3,500 | | 3,507 |
| | | 3.500% 期日 01/31/2023 | | 200 | | 195 |
| | | 3.609% 期日 05/02/2021 | | 3,380 | | 3,403 |
| | | Boston Properties LP | | | | |
| | | 3.200% 期日 01/15/2025 | | 991 | | 943 |
| | | BPCE S.A. | | | | |
| | | 12.500% 期日 09/30/2019 | | 700 | | 753 |
| | | Brighthouse Financial, Inc. | | | | |
| | | 3.700% 期日 06/22/2027 | | 2,400 | | 2,069 |
| | | Brixmor Operating Partnership LP | | | | |
| | | 3.250% 期日 09/15/2023 | | 300 | | 287 |
| | | Brookfield Finance, Inc. | | | | |
| | | 3.900% 期日 01/25/2028 | | 1,988 | | 1,860 |
| | | 4.700% 期日 09/20/2047 | | 4,240 | | 3,923 |
| | | Capital One Financial Corp. | | | | |
| | | 3.450% 期日 04/30/2021 | | 5,900 | | 5,878 |
| | | CBL & Associates LP | | | | |
| | | 5.950% 期日 12/15/2026 | | 1,384 | | 1,156 |
| | | China Construction Bank Corp. | | | | |
| | | 0.281% 期日 09/24/2021 | EUR | 2,000 | | 2,269 |
| | | CIT Group, Inc. | | | | |
| | | 4.125% 期日 03/09/2021 | USD | 1,216 | | 1,216 |
| | | 5.000% 期日 08/15/2022 | | 7,200 | | 7,245 |
| | | 5.000% 期日 08/01/2023 | | 4,136 | | 4,157 |
| | | 5.250% 期日 03/07/2025 | | 1,058 | | 1,067 |
| | | 5.375% 期日 05/15/2020 | | 1,330 | | 1,369 |
| | | Citigroup, Inc. | | | | |
| | | 3.142% 期日 01/24/2023 | | 2,500 | | 2,442 |
| | | Compass Bank | | | | |
| | | 2.750% 期日 09/29/2019 | | 700 | | 697 |
| | | Cooperatieve Rabobank UA | | | | |
| | | 2.938% 期日 04/26/2021 | | 1,750 | | 1,755 |
| | | 3.125% 期日 04/26/2021 | | 2,500 | | 2,478 |
| | | 4.625% 期日 12/29/2025 | EUR | 3,600 | | 4,050 |
| | | 5.500% 期日 06/29/2020 | | 17,610 | | 21,000 |
| | | 6.625% 期日 06/29/2021 | | 11,400 | | 14,218 |
| | | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd. | | | | |
| | | 6.875% 期日 07/08/2020 | GBP | 3,430 | | 4,650 |
| | | 7.500% 期日 07/08/2026 | | 600 | | 895 |
| | | Corestate Capital Holding S.A. | | | | |
| | | 3.500% 期日 04/15/2023 | EUR | 39,300 | | 43,747 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | CPI Property Group S.A. | | | | |
| | | 1.450% 期日 04/14/2022 | | 5,500 | | 6,219 |
| | | 2.125% 期日 10/04/2024 | | 4,800 | | 5,369 |
| | | Credit Agricole S.A. | | | | |
| | | 3.507% 期日 04/24/2023 | USD | 1,000 | | 998 |
| | | 3.750% 期日 04/24/2023 | | 1,750 | | 1,711 |
| | | 7.875% 期日 01/23/2024 | | 496 | | 514 |
| | | Credit Suisse AG | | | | |
| | | 4.375% 期日 08/05/2020 | | 750 | | 762 |
| | | 6.500% 期日 08/08/2023 | | 10,885 | | 11,526 |
| | | Credit Suisse Group AG | | | | |
| | | 2.997% 期日 12/14/2023 | | 3,600 | | 3,426 |
| | | 3.532% 期日 12/14/2023 | | 3,000 | | 3,025 |
| | | 3.574% 期日 06/12/2024 | | 2,750 | | 2,757 |
| | | 3.869% 期日 01/12/2029 | | 33,900 | | 31,519 |
| | | 4.207% 期日 06/12/2024 | | 3,500 | | 3,480 |
| | | 4.282% 期日 01/09/2028 | | 6,700 | | 6,428 |
| | | 7.250% 期日 09/12/2025 | | 1,800 | | 1,784 |
| | | 7.500% 期日 07/17/2023 | | 5,800 | | 5,916 |
| | | Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. | | | | |
| | | 2.750% 期日 08/08/2025 | GBP | 600 | | 757 |
| | | 3.750% 期日 03/26/2025 | USD | 1,800 | | 1,725 |
| | | Crown Castle International Corp. | | | | |
| | | 3.200% 期日 09/01/2024 | | 604 | | 571 |
| | | 3.650% 期日 09/01/2027 | | 2,678 | | 2,481 |
| | | 4.000% 期日 03/01/2027 | | 255 | | 244 |
| | | CTR Partnership LP | | | | |
| | | 5.250% 期日 06/01/2025 | | 504 | | 493 |
| | | Deutsche Bank AG | | | | |
| | | 0.375% 期日 01/18/2021 | EUR | 73,700 | | 82,269 |
| | | 2.700% 期日 07/13/2020 | USD | 4,272 | | 4,176 |
| | | 3.150% 期日 01/22/2021 | | 10,000 | | 9,756 |
| | | 3.284% 期日 01/22/2021 | | 12,700 | | 12,569 |
| | | 3.406% 期日 07/13/2020 | | 1,774 | | 1,763 |
| | | 3.766% 期日 02/04/2021 | | 5,310 | | 5,298 |
| | | 3.950% 期日 02/27/2023 | | 1,820 | | 1,753 |
| | | 4.250% 期日 10/14/2021 | | 15,940 | | 15,820 |
| | | 4.251% 期日 05/10/2019 | | 80 | | 80 |
| | | Digital Euro Finco LLC | | | | |
| | | 2.625% 期日 04/15/2024 | EUR | 1,400 | | 1,675 |
| | | Digital Realty Trust LP | | | | |
| | | 3.700% 期日 08/15/2027 | USD | 92 | | 86 |
| | | Digital Stout Holding LLC | | | | |
| | | 2.750% 期日 07/19/2024 | GBP | 400 | | 513 |
| | | 3.300% 期日 07/19/2029 | | 400 | | 508 |
| | | Discover Bank | | | | |
| | | 3.350% 期日 02/06/2023 | USD | 900 | | 870 |
| | | Emerald Bay S.A. | | | | |
| | | 0.000% 期日 10/08/2020 | EUR | 3,425 | | 3,682 |
| | | EPR Properties | | | | |
| | | 4.500% 期日 06/01/2027 | USD | 3,650 | | 3,469 |
| | | 4.750% 期日 12/15/2026 | | 372 | | 360 |
| | | 4.950% 期日 04/15/2028 | | 1,132 | | 1,096 |
| | | Equinix, Inc. | | | | |
| | | 2.875% 期日 03/15/2024 | EUR | 5,700 | | 6,551 |
| | | 2.875% 期日 10/01/2025 | | 500 | | 557 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 2.875% 期日 02/01/2026 | | 16,550 | | 18,346 |
| | | ERP Operating LP | | | | |
| | | 3.250% 期日 08/01/2027 | USD | 257 | | 242 |
| | | 3.500% 期日 03/01/2028 | | 792 | | 757 |
| | | Eurobank Ergasias S.A. | | | | |
| | | 2.750% 期日 11/02/2020 | EUR | 1,000 | | 1,157 |
| | | Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | | |
| | | 2.750% 期日 03/29/2028 | | 6,600 | | 7,524 |
| | | 4.850% 期日 04/17/2028 | USD | 3,411 | | 3,329 |
| | | Fastighets AB Balder | | | | |
| | | 1.125% 期日 03/14/2022 | EUR | 5,745 | | 6,550 |
| | | 1.875% 期日 03/14/2025 | | 1,100 | | 1,234 |
| | | 1.875% 期日 01/23/2026 | | 1,470 | | 1,622 |
| | | Franshion Brilliant Ltd. | | | | |
| | | 5.750% 期日 03/19/2019 | USD | 1,593 | | 1,605 |
| | | Freedom Mortgage Corp. | | | | |
| | | 8.250% 期日 04/15/2025 | | 1,259 | | 1,171 |
| | | Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | |
| | | 2.875% 期日 06/20/2022 | EUR | 1,400 | | 1,632 |
| | | 3.000% 期日 03/29/2025 | | 400 | | 454 |
| | | GLP Capital LP | | | | |
| | | 5.250% 期日 06/01/2025 | USD | 1,200 | | 1,209 |
| | | 5.300% 期日 01/15/2029 | | 3,424 | | 3,377 |
| | | Goldman Sachs Group, Inc. | | | | |
| | | 0.131% 期日 12/16/2020 | EUR | 1,200 | | 1,361 |
| | | 3.060% 期日 02/23/2023 | USD | 12,900 | | 12,895 |
| | | 3.200% 期日 02/23/2023 | | 12,900 | | 12,540 |
| | | 3.814% 期日 04/23/2029 | | 7,100 | | 6,677 |
| | | Goodman Australia Finance Pty Ltd. | | | | |
| | | 1.375% 期日 09/27/2025 | EUR | 400 | | 437 |
| | | Goodman U.S. Finance Three LLC | | | | |
| | | 3.700% 期日 03/15/2028 | USD | 2,324 | | 2,164 |
| | | Grainger PLC | | | | |
| | | 3.375% 期日 04/24/2028 | GBP | 2,000 | | 2,534 |
| | | Growthpoint Properties International Pty Ltd. | | | | |
| | | 5.872% 期日 05/02/2023 | USD | 1,600 | | 1,591 |
| | | High Street Funding Trust II | | | | |
| | | 4.682% 期日 02/15/2048 | | 300 | | 291 |
| | | Host Hotels & Resorts LP | | | | |
| | | 4.000% 期日 06/15/2025 | | 200 | | 193 |
| | | Howard Hughes Corp. | | | | |
| | | 5.375% 期日 03/15/2025 | | 3,600 | | 3,474 |
| | | HSBC Bank Argentina S.A. | | | | |
| | | 25.250% 期日 09/27/2019 | ARS | 53,530 | | 1,360 |
| | | HSBC Holdings PLC | | | | |
| | | 2.625% 期日 08/16/2028 | GBP | 360 | | 444 |
| | | 2.922% 期日 05/18/2021 | USD | 7,000 | | 7,009 |
| | | 3.033% 期日 11/22/2023 | | 4,900 | | 4,714 |
| | | 3.262% 期日 03/13/2023 | | 800 | | 782 |
| | | 3.322% 期日 05/18/2024 | | 3,000 | | 2,994 |
| | | 3.950% 期日 05/18/2024 | | 2,800 | | 2,773 |
| | | 4.041% 期日 03/13/2028 | | 700 | | 671 |
| | | 4.300% 期日 03/08/2026 | | 500 | | 493 |
| | | 4.750% 期日 07/04/2029 | EUR | 2,800 | | 2,991 |
| | | 5.250% 期日 09/16/2022 | | 7,500 | | 8,868 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 5.875% 期日 09/28/2026 | GBP | 4,500 | | 5,721 |
| | | 6.000% 期日 09/29/2023 | EUR | 7,210 | | 8,935 |
| | | 6.250% 期日 03/23/2023 | USD | 5,400 | | 5,252 |
| | | 6.500% 期日 03/23/2028 | | 9,470 | | 8,902 |
| | | Hudson Pacific Properties LP | | | | |
| | | 3.950% 期日 11/01/2027 | | 363 | | 336 |
| | | Hunt Cos., Inc. | | | | |
| | | 6.250% 期日 02/15/2026 | | 462 | | 427 |
| | | ICICI Bank Ltd. | | | | |
| | | 3.125% 期日 08/12/2020 | | 200 | | 197 |
| | | 3.441% 期日 12/04/2018 | | 25,600 | | 25,597 |
| | | InCaps Funding I Ltd. | | | | |
| | | 4.321% 期日 06/01/2033 | | 17,521 | | 17,521 |
| | | Industrial & Commercial Bank of China Ltd. | | | | |
| | | 2.625% 期日 05/26/2020 | | 1,600 | | 1,574 |
| | | 3.093% 期日 11/08/2020 | | 2,000 | | 2,001 |
| | | ING Bank NV | | | | |
| | | 2.450% 期日 03/16/2020 | | 3,200 | | 3,159 |
| | | 2.500% 期日 10/01/2019 | | 3,300 | | 3,282 |
| | | ING Groep NV | | | | |
| | | 1.000% 期日 09/20/2023 | EUR | 1,100 | | 1,239 |
| | | 3.398% 期日 10/02/2023 | USD | 4,100 | | 4,101 |
| | | 4.100% 期日 10/02/2023 | | 6,000 | | 5,966 |
| | | 4.550% 期日 10/02/2028 | | 4,300 | | 4,233 |
| | | Inmobiliaria Colonial Socimi S.A. | | | | |
| | | 1.625% 期日 11/28/2025 | EUR | 3,000 | | 3,282 |
| | | 2.000% 期日 04/17/2026 | | 2,900 | | 3,221 |
| | | International Lease Finance Corp. | | | | |
| | | 5.875% 期日 08/15/2022 | USD | 500 | | 527 |
| | | 8.250% 期日 12/15/2020 | | 7,970 | | 8,648 |
| | | 8.625% 期日 01/15/2022 | | 3,201 | | 3,629 |
| | | Intesa Sanpaolo SpA | | | | |
| | | 7.000% 期日 01/19/2021 | EUR | 26,850 | | 31,069 |
| | | 7.750% 期日 01/11/2027 | | 660 | | 768 |
| | | Intrepid Aviation Group Holdings LLC | | | | |
| | | 8.500% 期日 08/15/2021 | USD | 3,970 | | 4,000 |
| | | iStar, Inc. | | | | |
| | | 4.625% 期日 09/15/2020 | | 137 | | 136 |
| | | 5.250% 期日 09/15/2022 | | 515 | | 500 |
| | | Jefferies Finance LLC | | | | |
| | | 6.875% 期日 04/15/2022 | | 1,000 | | 1,008 |
| | | 7.250% 期日 08/15/2024 | | 600 | | 590 |
| | | 7.375% 期日 04/01/2020 | | 6,475 | | 6,572 |
| | | 7.500% 期日 04/15/2021 | | 1,380 | | 1,394 |
| | | JP Morgan Chase Bank N.A. | | | | |
| | | 2.848% 期日 04/26/2021 | | 12,400 | | 12,405 |
| | | 3.086% 期日 04/26/2021 | | 12,400 | | 12,355 |
| | | Kasikornbank PCL | | | | |
| | | 3.500% 期日 10/25/2019 | | 2,200 | | 2,200 |
| | | KBC Group NV | | | | |
| | | 4.250% 期日 10/24/2025 | EUR | 4,400 | | 4,530 |
| | | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. | | | | |
| | | 3.250% 期日 11/12/2025 | | 1,400 | | 1,568 |
| | | 3.950% 期日 06/30/2022 | GBP | 800 | | 1,051 |
| | | Kennedy-Wilson, Inc. | | | | |
| | | 5.875% 期日 04/01/2024 | USD | 1,320 | | 1,274 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 |
|----|----|---|------|--------|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 |
| | | Kojamo OYJ | | | |
| | | 1.500% 期日 06/19/2024 | EUR | 1,200 | 1,356 |
| | | 1.625% 期日 03/07/2025 | | 2,400 | 2,684 |
| | | Liberty Living Finance PLC | | | |
| | | 2.625% 期日 11/28/2024 | GBP | 1,250 | 1,586 |
| | | 3.375% 期日 11/28/2029 | | 500 | 636 |
| | | Lifestorage LP | | | |
| | | 3.500% 期日 07/01/2026 | USD | 1,200 | 1,105 |
| | | LifeStorage LP | | | |
| | | 3.875% 期日 12/15/2027 | | 1,010 | 940 |
| | | Lincoln Finance Ltd. | | | |
| | | 6.875% 期日 04/15/2021 | EUR | 9,322 | 10,937 |
| | | Lloyds Bank PLC | | | |
| | | 2.833% 期日 05/07/2021 | USD | 4,000 | 4,007 |
| | | 3.300% 期日 05/07/2021 | | 9,600 | 9,526 |
| | | 12.000% 期日 12/16/2024 | | 200 | 241 |
| | | Lloyds Banking Group PLC | | | |
| | | 2.250% 期日 10/16/2024 | GBP | 6,600 | 8,187 |
| | | 2.907% 期日 11/07/2023 | USD | 3,500 | 3,330 |
| | | 3.574% 期日 11/07/2028 | | 5,600 | 5,043 |
| | | 4.000% 期日 03/07/2025 | AUD | 4,700 | 3,327 |
| | | 4.050% 期日 08/16/2023 | USD | 5,800 | 5,750 |
| | | 4.375% 期日 03/22/2028 | | 2,200 | 2,106 |
| | | 4.450% 期日 05/08/2025 | | 3,400 | 3,387 |
| | | 4.550% 期日 08/16/2028 | | 5,000 | 4,836 |
| | | 6.375% 期日 06/27/2020 | EUR | 1,400 | 1,670 |
| | | 7.000% 期日 06/27/2019 | GBP | 38,538 | 50,167 |
| | | 7.500% 期日 06/27/2024 | USD | 2,700 | 2,730 |
| | | 7.500% 期日 09/27/2025 | | 7,700 | 7,758 |
| | | 7.625% 期日 06/27/2023 | GBP | 8,311 | 11,296 |
| | | 7.875% 期日 06/27/2029 | | 4,600 | 6,570 |
| | | LoanCore Capital Markets LLC | | | |
| | | 6.875% 期日 06/01/2020 | USD | 1,900 | 1,920 |
| | | Meiji Yasuda Life Insurance Co. | | | |
| | | 5.100% 期日 04/26/2048 | | 3,400 | 3,375 |
| | | Merlin Properties Socimi S.A. | | | |
| | | 1.750% 期日 05/26/2025 | EUR | 1,710 | 1,902 |
| | | 1.875% 期日 11/02/2026 | | 700 | 767 |
| | | Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd. | | | |
| | | 2.652% 期日 09/19/2022 | USD | 1,100 | 1,048 |
| | | Mizuho Bank Ltd. | | | |
| | | 2.400% 期日 03/26/2020 | | 1,200 | 1,186 |
| | | Mizuho Financial Group, Inc. | | | |
| | | 2.601% 期日 09/11/2022 | | 4,700 | 4,491 |
| | | 3.211% 期日 09/11/2022 | | 10,200 | 10,226 |
| | | Morgan Stanley | | | |
| | | 2.891% 期日 02/10/2021 | | 12,900 | 12,909 |
| | | 3.125% 期日 01/23/2023 | | 12,900 | 12,496 |
| | | 3.772% 期日 01/24/2029 | | 3,600 | 3,415 |
| | | National Australia Bank Ltd. | | | |
| | | 1.375% 期日 07/12/2019 | | 600 | 594 |
| | | 2.625% 期日 07/23/2020 | | 250 | 247 |
| | | National Bank of Greece S.A. | | | |
| | | 2.750% 期日 10/19/2020 | EUR | 800 | 932 |
| | | Nationwide Building Society | | | |
| | | 3.766% 期日 03/08/2024 | USD | 5,600 | 5,452 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.302% 期日 03/08/2029 | | 6,400 | | 6,042 |
| | | Natwest Markets PLC | | | | |
| | | 0.581% 期日 09/27/2021 | EUR | 5,100 | | 5,785 |
| | | 0.625% 期日 03/02/2022 | | 300 | | 335 |
| | | Navient Corp. | | | | |
| | | 4.875% 期日 06/17/2019 | USD | 10,490 | | 10,542 |
| | | 5.000% 期日 10/26/2020 | | 4,474 | | 4,510 |
| | | 5.500% 期日 01/15/2019 | | 17,552 | | 17,640 |
| | | 5.625% 期日 08/01/2033 | | 1,468 | | 1,201 |
| | | 5.875% 期日 03/25/2021 | | 14,633 | | 14,834 |
| | | 6.500% 期日 06/15/2022 | | 3,440 | | 3,505 |
| | | 6.625% 期日 07/26/2021 | | 3,990 | | 4,115 |
| | | 7.250% 期日 01/25/2022 | | 5,900 | | 6,158 |
| | | 8.000% 期日 03/25/2020 | | 21,896 | | 22,909 |
| | | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | | |
| | | 2.000% 期日 10/01/2047 | DKK | 2,648 | | 405 |
| | | Nykredit Realkredit A/S | | | | |
| | | 2.500% 期日 10/01/2047 | | 9,787 | | 1,553 |
| | | Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust | | | | |
| | | 3.125% 期日 03/20/2022 | USD | 696 | | 682 |
| | | Oppenheimer Holdings, Inc. | | | | |
| | | 6.750% 期日 07/01/2022 | | 424 | | 429 |
| | | Physicians Realty LP | | | | |
| | | 3.950% 期日 01/15/2028 | | 1,828 | | 1,685 |
| | | 4.300% 期日 03/15/2027 | | 2,650 | | 2,523 |
| | | Preferred Term Securities XVIII Ltd. | | | | |
| | | 2.714% 期日 09/23/2035 | | 584 | | 561 |
| | | Preferred Term Securities XXIV Ltd. | | | | |
| | | 2.634% 期日 03/22/2037 | | 1,338 | | 1,244 |
| | | 2.714% 期日 03/22/2037 | | 4,918 | | 4,033 |
| | | Preferred Term Securities XXV Ltd. | | | | |
| | | 2.624% 期日 06/22/2037 | | 30,831 | | 28,211 |
| | | Preferred Term Securities XXVI Ltd. | | | | |
| | | 2.634% 期日 09/22/2037 | | 50,146 | | 45,883 |
| | | Prologis International Funding II S.A. | | | | |
| | | 1.750% 期日 03/15/2028 | EUR | 900 | | 1,003 |
| | | Provident Funding Associates LP | | | | |
| | | 6.375% 期日 06/15/2025 | USD | 172 | | 170 |
| | | Qatari Diar Finance Co. | | | | |
| | | 5.000% 期日 07/21/2020 | | 11,400 | | 11,670 |
| | | QNB Finance Ltd. | | | | |
| | | 3.688% 期日 02/12/2020 | | 79,800 | | 80,290 |
| | | 3.693% 期日 02/07/2020 | | 56,200 | | 56,554 |
| | | 4.096% 期日 04/01/2019 | | 600 | | 604 |
| | | Realkredit Danmark A/S | | | | |
| | | 2.500% 期日 07/01/2047 | DKK | 8,514 | | 1,351 |
| | | Reckson Operating Partnership LP | | | | |
| | | 7.750% 期日 03/15/2020 | USD | 500 | | 526 |
| | | Royal Bank of Scotland Group PLC | | | | |
| | | 2.000% 期日 03/08/2023 | EUR | 1,900 | | 2,200 |
| | | 2.000% 期日 03/04/2025 | | 21,750 | | 24,652 |
| | | 2.500% 期日 03/22/2023 | | 25,700 | | 30,357 |
| | | 3.498% 期日 05/15/2023 | USD | 4,414 | | 4,249 |
| | | 3.784% 期日 05/15/2023 | | 3,074 | | 3,091 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位:千) | 通貨 | (単位:千) |
| | | 3.875% 期日 09/12/2023 | | 7,700 | | 7,416 |
| | | 4.800% 期日 04/05/2026 | | 2,300 | | 2,271 |
| | | 5.076% 期日 01/27/2030 | | 10,700 | | 10,501 |
| | | 7.500% 期日 08/10/2020 | | 2,900 | | 2,955 |
| | | 8.000% 期日 08/10/2025 | | 6,760 | | 6,992 |
| | | 8.625% 期日 08/15/2021 | | 4,200 | | 4,426 |
| | | Sagax AB | | | | |
| | | 2.000% 期日 01/17/2024 | EUR | 1,600 | | 1,822 |
| | | Santander Holdings USA, Inc. | | | | |
| | | 3.400% 期日 01/18/2023 | USD | 14,048 | | 13,422 |
| | | 3.700% 期日 03/28/2022 | | 412 | | 405 |
| | | 4.400% 期日 07/13/2027 | | 1,284 | | 1,200 |
| | | 4.500% 期日 07/17/2025 | | 3,000 | | 2,938 |
| | | Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| | | 0.531% 期日 03/27/2024 | EUR | 2,800 | | 3,124 |
| | | 2.875% 期日 08/05/2021 | USD | 3,600 | | 3,492 |
| | | 2.920% 期日 05/08/2026 | GBP | 1,220 | | 1,535 |
| | | 3.373% 期日 01/05/2024 | USD | 55,550 | | 53,065 |
| | | 3.571% 期日 01/10/2023 | | 1,500 | | 1,450 |
| | | 3.625% 期日 01/14/2026 | GBP | 1,900 | | 2,498 |
| | | 3.823% 期日 11/03/2028 | USD | 3,400 | | 3,067 |
| | | 6.750% 期日 06/24/2024 | GBP | 16,360 | | 21,397 |
| | | 7.375% 期日 06/24/2022 | | 4,100 | | 5,456 |
| | | Santander UK PLC | | | | |
| | | 1.625% 期日 05/10/2021 | | 6,300 | | 8,021 |
| | | 2.941% 期日 06/01/2021 | USD | 2,200 | | 2,210 |
| | | 3.400% 期日 06/01/2021 | | 5,400 | | 5,364 |
| | | SBA Tower Trust | | | | |
| | | 2.877% 期日 07/09/2021 | | 1,500 | | 1,467 |
| | | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| | | 3.080% 期日 03/07/2019 | EUR | 5,200 | | 5,923 |
| | | 3.352% 期日 11/15/2019 | | 8,000 | | 9,216 |
| | | 4.150% 期日 03/06/2019 | USD | 4,200 | | 4,197 |
| | | 5.180% 期日 06/28/2019 | | 7,200 | | 7,237 |
| | | 5.717% 期日 06/16/2021 | | 900 | | 916 |
| | | 6.125% 期日 02/07/2022 | | 10,400 | | 10,685 |
| | | SELP Finance Sarl | | | | |
| | | 1.500% 期日 11/20/2025 | EUR | 1,500 | | 1,647 |
| | | SL Green Operating Partnership LP | | | | |
| | | 3.250% 期日 10/15/2022 | USD | 234 | | 226 |
| | | SL Green Realty Corp. | | | | |
| | | 4.500% 期日 12/01/2022 | | 1,420 | | 1,431 |
| | | SMBC Trust Account | | | | |
| | | 3.608% 期日 04/09/2021 | | 5,000 | | 5,008 |
| | | Societe Generale S.A. | | | | |
| | | 6.750% 期日 04/06/2028 | | 2,200 | | 1,944 |
| | | 7.375% 期日 10/04/2023 | | 11,200 | | 10,906 |
| | | 8.250% 期日 11/29/2018 | | 800 | | 803 |
| | | Society of Lloyd's | | | | |
| | | 4.750% 期日 10/30/2024 | GBP | 800 | | 1,085 |
| | | Springleaf Finance Corp. | | | | |
| | | 5.250% 期日 12/15/2019 | USD | 10,070 | | 10,196 |
| | | 5.625% 期日 03/15/2023 | | 27,700 | | 26,869 |
| | | 6.000% 期日 06/01/2020 | | 6,232 | | 6,388 |
| | | 6.125% 期日 05/15/2022 | | 14,223 | | 14,365 |
| | | 6.875% 期日 03/15/2025 | | 3,161 | | 3,035 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---------------------------------------|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 7.750% 期日 10/01/2021 | | 1,780 | | 1,887 |
| | | 8.250% 期日 12/15/2020 | | 23,219 | | 24,902 |
| | | Standard Chartered PLC | | | | |
| | | 3.558% 期日 01/20/2023 | | 2,470 | | 2,474 |
| | | 4.247% 期日 01/20/2023 | | 4,700 | | 4,699 |
| | | Starwood Property Trust, Inc. | | | | |
| | | 3.625% 期日 02/01/2021 | | 8,000 | | 7,790 |
| | | 4.750% 期日 03/15/2025 | | 1,152 | | 1,100 |
| | | 5.000% 期日 12/15/2021 | | 500 | | 499 |
| | | State Bank of India | | | | |
| | | 3.358% 期日 04/06/2020 | | 14,500 | | 14,546 |
| | | Stearns Holdings LLC | | | | |
| | | 9.375% 期日 08/15/2020 | | 1,580 | | 1,584 |
| | | STORE Capital Corp. | | | | |
| | | 4.500% 期日 03/15/2028 | | 1,348 | | 1,306 |
| | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | |
| | | 2.514% 期日 01/17/2020 | | 6,300 | | 6,246 |
| | | 2.799% 期日 01/17/2020 | | 6,300 | | 6,307 |
| | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | | |
| | | 3.102% 期日 01/17/2023 | | 6,300 | | 6,135 |
| | | 3.189% 期日 01/17/2023 | | 5,670 | | 5,673 |
| | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | |
| | | 1.950% 期日 09/19/2019 | | 2,490 | | 2,465 |
| | | 2.779% 期日 09/19/2019 | | 3,040 | | 3,046 |
| | | Summit Germany Ltd. | | | | |
| | | 2.000% 期日 01/31/2025 | EUR | 1,100 | | 1,190 |
| | | Tesco Property Finance 2 PLC | | | | |
| | | 6.052% 期日 10/13/2039 | GBP | 5,108 | | 7,852 |
| | | Tesco Property Finance 3 PLC | | | | |
| | | 5.744% 期日 04/13/2040 | | 166 | | 251 |
| | | Tesco Property Finance 4 PLC | | | | |
| | | 5.801% 期日 10/13/2040 | | 402 | | 612 |
| | | Tesco Property Finance 6 PLC | | | | |
| | | 5.411% 期日 07/13/2044 | | 2,637 | | 3,854 |
| | | TLG Immobilien AG | | | | |
| | | 1.375% 期日 11/27/2024 | EUR | 1,500 | | 1,663 |
| | | TP ICAP PLC | | | | |
| | | 5.250% 期日 01/26/2024 | GBP | 1,900 | | 2,330 |
| | | Tritax Big Box REIT PLC | | | | |
| | | 2.625% 期日 12/14/2026 | | 1,000 | | 1,261 |
| | | 3.125% 期日 12/14/2031 | | 800 | | 1,000 |
| | | Turkiye Garanti Bankasi A/S | | | | |
| | | 3.588% 期日 02/11/2019 | USD | 5,800 | | 5,753 |
| | | U.S. Capital Funding VI Ltd. | | | | |
| | | 2.694% 期日 07/10/2043 | | 28,305 | | 25,474 |
| | | UBS AG | | | | |
| | | 5.125% 期日 05/15/2024 | | 900 | | 898 |
| | | 7.625% 期日 08/17/2022 | | 6,000 | | 6,585 |
| | | UBS Group Funding Switzerland AG | | | | |
| | | 2.650% 期日 02/01/2022 | | 7,100 | | 6,856 |
| | | 2.859% 期日 08/15/2023 | | 1,000 | | 959 |
| | | 3.491% 期日 05/23/2023 | | 2,000 | | 1,956 |
| | | 4.125% 期日 09/24/2025 | | 2,870 | | 2,826 |
| | | 4.125% 期日 04/15/2026 | | 2,500 | | 2,456 |
| | | 4.253% 期日 03/23/2028 | | 1,800 | | 1,766 |
| | | 5.750% 期日 02/19/2022 | EUR | 3,200 | | 3,948 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 |
|----|------|--|------|--------|-----------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 |
| | | 7.000% 期日 02/19/2025 | USD | 200 | 209 |
| | | UDR, Inc. | | | |
| | | 3.500% 期日 01/15/2028 | | 410 | 382 |
| | | 4.625% 期日 01/10/2022 | | 103 | 105 |
| | | Unique Pub Finance Co. PLC | | | |
| | | 5.659% 期日 06/30/2027 | GBP | 2,308 | 3,259 |
| | | 6.542% 期日 03/30/2021 | | 736 | 988 |
| | | 7.395% 期日 03/28/2024 | | 1,886 | 2,678 |
| | | Ventas Realty LP | | | |
| | | 3.250% 期日 10/15/2026 | USD | 100 | 92 |
| | | VEREIT Operating Partnership LP | | | |
| | | 3.950% 期日 08/15/2027 | | 380 | 354 |
| | | VICI Properties 1 LLC | | | |
| | | 8.000% 期日 10/15/2023 | | 3,278 | 3,614 |
| | | Virgin Money Holdings UK PLC | | | |
| | | 8.750% 期日 11/10/2021 | GBP | 200 | 273 |
| | | Vornado Realty LP | | | |
| | | 3.500% 期日 01/15/2025 | USD | 528 | 504 |
| | | Wells Fargo & Co. | | | |
| | | 2.125% 期日 12/20/2023 | GBP | 2,100 | 2,670 |
| | | 3.000% 期日 10/23/2026 | USD | 2,810 | 2,573 |
| | | 3.268% 期日 02/11/2022 | | 6,670 | 6,726 |
| | | Wells Fargo Bank N.A. | | | |
| | | 2.977% 期日 07/23/2021 | | 4,700 | 4,704 |
| | | 3.325% 期日 07/23/2021 | | 10,600 | 10,566 |
| | | Welltower, Inc. | | | |
| | | 3.950% 期日 09/01/2023 | | 830 | 829 |
| | | 4.250% 期日 04/15/2028 | | 1,256 | 1,228 |
| | | Westfield America Management Ltd. | | | |
| | | 2.125% 期日 03/30/2025 | GBP | 500 | 629 |
| | | WeWork Cos., Inc. | | | |
| | | 7.875% 期日 05/01/2025 | USD | 1,344 | 1,240 |
| | | WPC Eurobond BV | | | |
| | | 2.125% 期日 04/15/2027 | EUR | 2,100 | 2,325 |
| | | 2.250% 期日 04/09/2026 | | 3,400 | 3,837 |
| | | | | | 2,402,158 |
| | 産業 | AA Bond Co. Ltd. | | | |
| | 9.9% | 2.750% 期日 07/31/2023 | GBP | 400 | 472 |
| | | 2.875% 期日 01/31/2022 | | 2,100 | 2,591 |
| | | 4.249% 期日 07/31/2020 | | 506 | 665 |
| | | 4.875% 期日 07/31/2024 | | 1,200 | 1,534 |
| | | AbbVie, Inc. | | | |
| | | 3.375% 期日 11/14/2021 | USD | 5,824 | 5,797 |
| | | 3.750% 期日 11/14/2023 | | 3,462 | 3,433 |
| | | 4.250% 期日 11/14/2028 | | 4,992 | 4,822 |
| | | Air Canada 2017-1 Class B Pass-Through Trust | | | |
| | | 3.700% 期日 01/15/2026 | | 366 | 352 |
| | | Allergan Funding SCS | | | |
| | | 0.031% 期日 06/01/2019 | EUR | 144 | 163 |
| | | 3.000% 期日 03/12/2020 | USD | 500 | 498 |
| | | Altice Financing S.A. | | | |
| | | 5.250% 期日 02/15/2023 | EUR | 10,200 | 11,998 |
| | | 6.625% 期日 02/15/2023 | USD | 13,930 | 13,823 |
| | | 7.500% 期日 05/15/2026 | | 1,000 | 942 |
| | | Altice France S.A. | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 5.625% 期日 05/15/2024 | EUR | 13,920 | | 16,312 |
| | | 5.875% 期日 02/01/2027 | | 24,000 | | 28,081 |
| | | 6.250% 期日 05/15/2024 | USD | 15,000 | | 14,437 |
| | | 7.375% 期日 05/01/2026 | | 14,133 | | 13,581 |
| | | 8.125% 期日 02/01/2027 | | 4,300 | | 4,268 |
| | | Altice Luxembourg S. A. | | | | |
| | | 7.250% 期日 05/15/2022 | EUR | 11,224 | | 12,480 |
| | | American Airlines 2017-2 Class AA Pass- Through Trust | | | | |
| | | 3.350% 期日 10/15/2029 | USD | 467 | | 444 |
| | | Andeavor Logistics LP | | | | |
| | | 3.500% 期日 12/01/2022 | | 144 | | 141 |
| | | 4.250% 期日 12/01/2027 | | 258 | | 246 |
| | | 5.500% 期日 10/15/2019 | | 200 | | 204 |
| | | AP Moller - Maersk A/S | | | | |
| | | 1.750% 期日 03/16/2026 | EUR | 2,900 | | 3,184 |
| | | 2.875% 期日 09/28/2020 | USD | 1,400 | | 1,379 |
| | | Arrow Electronics, Inc. | | | | |
| | | 3.250% 期日 09/08/2024 | | 479 | | 449 |
| | | Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | |
| | | 5.500% 期日 01/15/2023 | | 3,604 | | 3,595 |
| | | Bacardi Ltd. | | | | |
| | | 4.450% 期日 05/15/2025 | | 2,000 | | 1,969 |
| | | 4.700% 期日 05/15/2028 | | 2,600 | | 2,517 |
| | | Baidu, Inc. | | | | |
| | | 3.875% 期日 09/29/2023 | | 4,100 | | 4,052 |
| | | 4.375% 期日 03/29/2028 | | 1,400 | | 1,362 |
| | | Banff Merger Sub, Inc. | | | | |
| | | 9.750% 期日 09/01/2026 | | 2,425 | | 2,334 |
| | | BAT Capital Corp. | | | | |
| | | 2.297% 期日 08/14/2020 | | 300 | | 294 |
| | | Bausch Health Cos., Inc. | | | | |
| | | 5.500% 期日 11/01/2025 | | 210 | | 207 |
| | | 6.500% 期日 03/15/2022 | | 3,835 | | 3,979 |
| | | 7.000% 期日 03/15/2024 | | 901 | | 946 |
| | | Baxalta, Inc. | | | | |
| | | 2.875% 期日 06/23/2020 | | 828 | | 819 |
| | | Bayer U.S. Finance II LLC | | | | |
| | | 3.003% 期日 06/25/2021 | | 1,600 | | 1,601 |
| | | Boral Finance Pty Ltd. | | | | |
| | | 3.000% 期日 11/01/2022 | | 1,996 | | 1,922 |
| | | Boston Scientific Corp. | | | | |
| | | 3.375% 期日 05/15/2022 | | 2,260 | | 2,231 |
| | | 6.000% 期日 01/15/2020 | | 300 | | 309 |
| | | Broadcom Corp. | | | | |
| | | 2.200% 期日 01/15/2021 | | 100 | | 97 |
| | | 2.375% 期日 01/15/2020 | | 100 | | 99 |
| | | 2.650% 期日 01/15/2023 | | 6,325 | | 5,938 |
| | | 3.000% 期日 01/15/2022 | | 6,026 | | 5,838 |
| | | 3.625% 期日 01/15/2024 | | 1,487 | | 1,426 |
| | | 3.875% 期日 01/15/2027 | | 8,690 | | 7,993 |
| | | Bureau Veritas S. A. | | | | |
| | | 1.875% 期日 01/06/2025 | EUR | 3,200 | | 3,671 |
| | | Caesars Resort Collection LLC | | | | |
| | | 5.250% 期日 10/15/2025 | USD | 86 | | 80 |
| | | Campbell Soup Co. | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------------|------------|------------|------------|
| | | | 通貨 (単位: 千) | 通貨 (単位: 千) | 通貨 (単位: 千) | 通貨 (単位: 千) |
| | | 2.834% 期日 03/16/2020 | | 2,490 | | 2,486 |
| | | 2.964% 期日 03/15/2021 | | 2,030 | | 2,023 |
| | | 3.950% 期日 03/15/2025 | | 1,539 | | 1,464 |
| | | Celgene Corp. | | | | |
| | | 2.250% 期日 08/15/2021 | | 3,660 | | 3,535 |
| | | Central Nippon Expressway Co. Ltd. | | | | |
| | | 2.774% 期日 02/15/2022 | | 13,200 | | 13,138 |
| | | 2.881% 期日 08/04/2020 | | 7,800 | | 7,816 |
| | | Charles River Laboratories International, Inc. | | | | |
| | | 5.500% 期日 04/01/2026 | | 404 | | 404 |
| | | Charter Communications Operating LLC | | | | |
| | | 3.579% 期日 07/23/2020 | | 1,426 | | 1,424 |
| | | 4.191% 期日 02/01/2024 | | 4,202 | | 4,273 |
| | | 4.200% 期日 03/15/2028 | | 1,393 | | 1,307 |
| | | 4.464% 期日 07/23/2022 | | 1,687 | | 1,708 |
| | | 4.500% 期日 02/01/2024 | | 1,700 | | 1,705 |
| | | 4.908% 期日 07/23/2025 | | 992 | | 998 |
| | | Chesapeake Energy Corp. | | | | |
| | | 5.686% 期日 04/15/2019 | | 189 | | 190 |
| | | Christian Dior SE | | | | |
| | | 0.750% 期日 06/24/2021 | EUR | 300 | | 345 |
| | | 1.375% 期日 06/19/2019 | | 100 | | 114 |
| | | Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. | | | | |
| | | 6.500% 期日 11/15/2022 | USD | 1,370 | | 1,398 |
| | | 7.625% 期日 03/15/2020 | | 2,300 | | 2,303 |
| | | Cleveland-Cliffs, Inc. | | | | |
| | | 4.875% 期日 01/15/2024 | | 520 | | 498 |
| | | CNH Industrial Capital LLC | | | | |
| | | 4.375% 期日 11/06/2020 | | 300 | | 304 |
| | | 4.875% 期日 04/01/2021 | | 80 | | 82 |
| | | Comcast Corp. | | | | |
| | | 2.738% 期日 10/01/2020 | | 4,008 | | 4,011 |
| | | 2.848% 期日 10/01/2021 | | 2,242 | | 2,244 |
| | | 3.038% 期日 04/15/2024 | | 3,632 | | 3,614 |
| | | 3.700% 期日 04/15/2024 | | 3,180 | | 3,169 |
| | | Community Health Systems, Inc. | | | | |
| | | 5.125% 期日 08/01/2021 | | 17,507 | | 16,675 |
| | | 6.250% 期日 03/31/2023 | | 26,200 | | 24,194 |
| | | 8.625% 期日 01/15/2024 | | 10,517 | | 10,662 |
| | | Conagra Brands, Inc. | | | | |
| | | 2.908% 期日 10/09/2020 | | 180 | | 180 |
| | | CSCEC Finance Cayman I Ltd. | | | | |
| | | 2.950% 期日 11/19/2020 | | 400 | | 393 |
| | | CVS Health Corp. | | | | |
| | | 3.700% 期日 03/09/2023 | | 4,063 | | 4,013 |
| | | 4.300% 期日 03/25/2028 | | 5,980 | | 5,843 |
| | | CVS Pass-Through Trust | | | | |
| | | 7.507% 期日 01/10/2032 | | 722 | | 834 |
| | | DAE Funding LLC | | | | |
| | | 4.000% 期日 08/01/2020 | | 2,670 | | 2,653 |
| | | 4.500% 期日 08/01/2022 | | 13,832 | | 13,521 |
| | | 5.000% 期日 08/01/2024 | | 9,446 | | 9,233 |
| | | Davide Campari-Milano SpA | | | | |
| | | 2.750% 期日 09/30/2020 | EUR | 1,410 | | 1,673 |
| | | Dell International LLC | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.420% 期日 06/15/2021 | USD | 11,782 | | 11,887 |
| | | Delta Air Lines, Inc. | | | | |
| | | 2.875% 期日 03/13/2020 | | 1,720 | | 1,705 |
| | | 3.625% 期日 03/15/2022 | | 920 | | 905 |
| | | Diamond Resorts International, Inc. | | | | |
| | | 7.750% 期日 09/01/2023 | | 8,334 | | 8,574 |
| | | 10.750% 期日 09/01/2024 | | 260 | | 255 |
| | | Discovery Communications LLC | | | | |
| | | 2.750% 期日 11/15/2019 | | 304 | | 302 |
| | | 2.950% 期日 03/20/2023 | | 362 | | 344 |
| | | 3.950% 期日 03/20/2028 | | 528 | | 492 |
| | | DISH DBS Corp. | | | | |
| | | 5.125% 期日 05/01/2020 | | 4,588 | | 4,617 |
| | | 7.875% 期日 09/01/2019 | | 17,565 | | 18,132 |
| | | DP World Ltd. | | | | |
| | | 2.375% 期日 09/25/2026 | EUR | 2,200 | | 2,484 |
| | | 4.250% 期日 09/25/2030 | GBP | 1,100 | | 1,400 |
| | | DR Horton, Inc. | | | | |
| | | 4.000% 期日 02/15/2020 | USD | 290 | | 291 |
| | | DXC Technology Co. | | | | |
| | | 3.271% 期日 03/01/2021 | | 4,154 | | 4,154 |
| | | 4.750% 期日 04/15/2027 | | 310 | | 308 |
| | | Eastern Creation II Investment Holdings Ltd. | | | | |
| | | 2.750% 期日 09/26/2020 | | 2,300 | | 2,251 |
| | | Eastern Creation Investment Holdings Ltd. | | | | |
| | | 3.625% 期日 03/20/2019 | | 600 | | 599 |
| | | eBay, Inc. | | | | |
| | | 3.800% 期日 03/09/2022 | | 3,375 | | 3,385 |
| | | EI Group PLC | | | | |
| | | 6.375% 期日 02/15/2022 | GBP | 5,600 | | 7,401 |
| | | 6.500% 期日 12/06/2018 | | 1,051 | | 1,352 |
| | | 6.875% 期日 02/15/2021 | | 950 | | 1,320 |
| | | EMC Corp. | | | | |
| | | 2.650% 期日 06/01/2020 | USD | 31,268 | | 30,432 |
| | | Energy Transfer Operating LP | | | | |
| | | 4.150% 期日 10/01/2020 | | 100 | | 101 |
| | | 4.200% 期日 09/15/2023 | | 1,354 | | 1,349 |
| | | 4.950% 期日 06/15/2028 | | 1,962 | | 1,942 |
| | | 6.000% 期日 06/15/2048 | | 300 | | 298 |
| | | Energy Transfer Partners LP | | | | |
| | | 5.750% 期日 09/01/2020 | | 2,140 | | 2,207 |
| | | 5.875% 期日 03/01/2022 | | 450 | | 474 |
| | | EQT Corp. | | | | |
| | | 3.166% 期日 10/01/2020 | | 1,229 | | 1,229 |
| | | 4.875% 期日 11/15/2021 | | 200 | | 205 |
| | | Equifax, Inc. | | | | |
| | | 3.184% 期日 08/15/2021 | | 1,668 | | 1,679 |
| | | 3.600% 期日 08/15/2021 | | 586 | | 581 |
| | | Eurofins Scientific SE | | | | |
| | | 2.125% 期日 07/25/2024 | EUR | 800 | | 902 |
| | | Exela Intermediate LLC | | | | |
| | | 10.000% 期日 07/15/2023 | USD | 880 | | 919 |
| | | Ford Motor Credit Co. LLC | | | | |
| | | 2.597% 期日 11/04/2019 | | 1,300 | | 1,285 |
| | | 5.875% 期日 08/02/2021 | | 400 | | 414 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 8.125% 期日 01/15/2020 | | 1,600 | | 1,677 |
| | | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC | | | | |
| | | 6.500% 期日 10/01/2025 | | 5,520 | | 5,437 |
| | | 6.750% 期日 03/15/2022 | | 9,064 | | 9,302 |
| | | Fresenius Medical Care US Finance II, Inc. | | | | |
| | | 4.125% 期日 10/15/2020 | | 16 | | 16 |
| | | 5.625% 期日 07/31/2019 | | 374 | | 380 |
| | | Fresenius U. S. Finance II, Inc. | | | | |
| | | 4.250% 期日 02/01/2021 | | 190 | | 192 |
| | | G4S International Finance PLC | | | | |
| | | 1.500% 期日 01/09/2023 | EUR | 1,400 | | 1,607 |
| | | GATX Corp. | | | | |
| | | 3.061% 期日 11/05/2021 | USD | 3,900 | | 3,908 |
| | | General Electric Co. | | | | |
| | | 5.500% 期日 01/08/2020 | | 950 | | 969 |
| | | 5.550% 期日 05/04/2020 | | 150 | | 154 |
| | | General Mills, Inc. | | | | |
| | | 2.976% 期日 04/16/2021 | | 2,524 | | 2,523 |
| | | 3.200% 期日 04/16/2021 | | 451 | | 448 |
| | | General Motors Financial Co., Inc. | | | | |
| | | 3.150% 期日 01/15/2020 | | 125 | | 124 |
| | | 3.200% 期日 07/13/2020 | | 800 | | 793 |
| | | 3.550% 期日 04/09/2021 | | 1,110 | | 1,101 |
| | | Gerdau Holdings, Inc. | | | | |
| | | 7.000% 期日 01/20/2020 | | 7,200 | | 7,479 |
| | | Greene King Finance PLC | | | | |
| | | 4.064% 期日 03/15/2035 | GBP | 723 | | 984 |
| | | 5.106% 期日 03/15/2034 | | 150 | | 220 |
| | | 5.702% 期日 12/15/2034 | | 4,156 | | 5,016 |
| | | Halfmoon Parent, Inc. | | | | |
| | | 3.326% 期日 07/15/2023 | USD | 10,860 | | 10,858 |
| | | 3.750% 期日 07/15/2023 | | 13,332 | | 13,230 |
| | | Harris Corp. | | | | |
| | | 3.000% 期日 04/30/2020 | | 5,600 | | 5,598 |
| | | Harvest Operations Corp. | | | | |
| | | 2.330% 期日 04/14/2021 | | 2,884 | | 2,773 |
| | | HCA, Inc. | | | | |
| | | 4.250% 期日 10/15/2019 | | 2,710 | | 2,725 |
| | | 6.500% 期日 02/15/2020 | | 200 | | 207 |
| | | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | | |
| | | 5.125% 期日 05/01/2026 | | 2,766 | | 2,711 |
| | | HOCHTIEF AG | | | | |
| | | 2.625% 期日 05/28/2019 | EUR | 653 | | 750 |
| | | 3.875% 期日 03/20/2020 | | 7,453 | | 8,874 |
| | | Hyatt Hotels Corp. | | | | |
| | | 4.850% 期日 03/15/2026 | USD | 100 | | 102 |
| | | Hyundai Capital America | | | | |
| | | 3.137% 期日 09/18/2020 | | 3,198 | | 3,200 |
| | | iHeartCommunications, Inc. | | | | |
| | | 9.000% 期日 12/15/2019 | | 34,080 | | 24,708 |
| | | 9.000% 期日 03/01/2021 | | 48,736 | | 35,455 |
| | | 9.000% 期日 09/15/2022 | | 9,018 | | 6,538 |
| | | 10.625% 期日 03/15/2023 | | 4,560 | | 3,272 |
| | | 11.250% 期日 03/01/2021 | | 11,268 | | 7,993 |
| | | IHO Verwaltungs GmbH | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 |
|----|----|--|------|---------|------------|
| | | | 通貨 | (単位: 千) | 通貨 (単位: 千) |
| | | 3.750% 期日 09/15/2026 | EUR | 100 | 113 |
| | | IMCD NV | | | |
| | | 2.500% 期日 03/26/2025 | | 1,700 | 1,908 |
| | | Imperial Brands Finance PLC | | | |
| | | 2.950% 期日 07/21/2020 | USD | 1,300 | 1,284 |
| | | Incitec Pivot Finance LLC | | | |
| | | 6.000% 期日 12/10/2019 | | 160 | 164 |
| | | Intelsat Connect Finance S.A. | | | |
| | | 9.500% 期日 02/15/2023 | | 3,960 | 3,807 |
| | | Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | |
| | | 5.500% 期日 08/01/2023 | | 1,624 | 1,457 |
| | | 7.500% 期日 04/01/2021 | | 12,789 | 12,949 |
| | | 8.000% 期日 02/15/2024 | | 4,227 | 4,433 |
| | | 8.500% 期日 10/15/2024 | | 12,393 | 12,192 |
| | | 9.750% 期日 07/15/2025 | | 3,141 | 3,298 |
| | | Intelsat Luxembourg S.A. | | | |
| | | 7.750% 期日 06/01/2021 | | 15,908 | 15,113 |
| | | International Flavors & Fragrances, Inc. | | | |
| | | 3.400% 期日 09/25/2020 | | 1,750 | 1,750 |
| | | InterXion Holding NV | | | |
| | | 4.750% 期日 06/15/2025 | EUR | 400 | 474 |
| | | IQVIA, Inc. | | | |
| | | 2.875% 期日 09/15/2025 | | 400 | 444 |
| | | 3.250% 期日 03/15/2025 | | 500 | 574 |
| | | JT International Financial Services BV | | | |
| | | 1.125% 期日 09/28/2025 | | 1,100 | 1,254 |
| | | Kinder Morgan, Inc. | | | |
| | | 7.750% 期日 01/15/2032 | USD | 2,500 | 3,075 |
| | | Kraft Heinz Foods Co. | | | |
| | | 2.911% 期日 02/10/2021 | | 1,690 | 1,694 |
| | | Marriott Ownership Resorts, Inc. | | | |
| | | 6.500% 期日 09/15/2026 | | 2,004 | 2,029 |
| | | Martin Marietta Materials, Inc. | | | |
| | | 2.838% 期日 12/20/2019 | | 680 | 682 |
| | | 2.960% 期日 05/22/2020 | | 570 | 571 |
| | | MGM Resorts International | | | |
| | | 6.625% 期日 12/15/2021 | | 152 | 160 |
| | | 6.750% 期日 10/01/2020 | | 6,108 | 6,379 |
| | | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd. | | | |
| | | 3.500% 期日 07/30/2020 | | 1,600 | 1,587 |
| | | Mitchells & Butlers Finance PLC | | | |
| | | 2.784% 期日 12/15/2030 | | 659 | 621 |
| | | 6.013% 期日 12/15/2028 | GBP | 192 | 281 |
| | | Molnlycke Holding AB | | | |
| | | 1.875% 期日 02/28/2025 | EUR | 300 | 344 |
| | | MPLX LP | | | |
| | | 3.375% 期日 03/15/2023 | USD | 316 | 308 |
| | | NetApp, Inc. | | | |
| | | 3.300% 期日 09/29/2024 | | 2,610 | 2,494 |
| | | Netflix, Inc. | | | |
| | | 3.625% 期日 05/15/2027 | EUR | 7,727 | 8,704 |
| | | 4.625% 期日 05/15/2029 | | 4,800 | 5,465 |
| | | New Red Finance, Inc. | | | |
| | | 4.250% 期日 05/15/2024 | USD | 6,073 | 5,724 |
| | | Nexi Capital SpA | | | |
| | | 4.125% 期日 11/01/2023 | EUR | 100 | 114 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) |
| | | Nidec Corp. | | | | |
| | | 0.487% 期日 09/27/2021 | | 900 | | 1,026 |
| | | Nokia OYJ | | | | |
| | | 4.375% 期日 06/12/2027 | USD | 175 | | 165 |
| | | Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| | | 4.875% 期日 05/10/2028 | | 464 | | 455 |
| | | Ooredoo Tamweel Ltd. | | | | |
| | | 3.039% 期日 12/03/2018 | | 200 | | 200 |
| | | Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. | | | | |
| | | 6.625% 期日 05/15/2022 | | 5,091 | | 4,918 |
| | | Pacific National Finance Pty Ltd. | | | | |
| | | 4.625% 期日 09/23/2020 | | 530 | | 535 |
| | | Park Aerospace Holdings Ltd. | | | | |
| | | 3.625% 期日 03/15/2021 | | 18,709 | | 18,007 |
| | | 4.500% 期日 03/15/2023 | | 10,570 | | 10,082 |
| | | 5.250% 期日 08/15/2022 | | 48,447 | | 48,265 |
| | | 5.500% 期日 02/15/2024 | | 8,672 | | 8,609 |
| | | Pelabuhan Indonesia III Persero PT | | | | |
| | | 4.500% 期日 05/02/2023 | | 1,600 | | 1,563 |
| | | Petroleos de Venezuela S. A. | | | | |
| | | 5.375% 期日 04/12/2027 | | 11,932 | | 2,178 |
| | | 5.500% 期日 04/12/2037 | | 10,372 | | 1,919 |
| | | 6.000% 期日 05/16/2024 | | 8,083 | | 1,427 |
| | | 6.000% 期日 11/15/2026 | | 13,183 | | 2,323 |
| | | 9.000% 期日 11/17/2021 | | 400 | | 86 |
| | | 9.750% 期日 05/17/2035 | | 4,730 | | 1,029 |
| | | Petroleos Mexicanos | | | | |
| | | 6.500% 期日 03/13/2027 | | 2,620 | | 2,543 |
| | | 6.750% 期日 09/21/2047 | | 390 | | 336 |
| | | Petronas Capital Ltd. | | | | |
| | | 5.250% 期日 08/12/2019 | | 2,800 | | 2,847 |
| | | PetSmart, Inc. | | | | |
| | | 5.875% 期日 06/01/2025 | | 674 | | 529 |
| | | Phillips 66 | | | | |
| | | 3.086% 期日 04/15/2019 | | 1,000 | | 1,000 |
| | | 3.186% 期日 04/15/2020 | | 900 | | 900 |
| | | QGOG Constellation S. A. | | | | |
| | | 9.500% 期日 11/09/2024 | | 753 | | 365 |
| | | QUALCOMM, Inc. | | | | |
| | | 2.900% 期日 05/20/2024 | | 140 | | 133 |
| | | QVC, Inc. | | | | |
| | | 4.375% 期日 03/15/2023 | | 900 | | 885 |
| | | 4.450% 期日 02/15/2025 | | 660 | | 628 |
| | | 4.850% 期日 04/01/2024 | | 2,190 | | 2,162 |
| | | 5.125% 期日 07/02/2022 | | 3,400 | | 3,444 |
| | | 5.450% 期日 08/15/2034 | | 50 | | 44 |
| | | 5.950% 期日 03/15/2043 | | 8,100 | | 7,250 |
| | | Radiate Holdeco LLC | | | | |
| | | 6.875% 期日 02/15/2023 | | 3,210 | | 3,098 |
| | | RCI Banque S. A. | | | | |
| | | 0.250% 期日 07/12/2021 | EUR | 1,300 | | 1,460 |
| | | Refinitiv U. S. Holdings, Inc. | | | | |
| | | 4.500% 期日 05/15/2026 | | 15,630 | | 17,761 |
| | | 6.250% 期日 05/15/2026 | USD | 3,300 | | 3,288 |
| | | 6.875% 期日 11/15/2026 | EUR | 600 | | 678 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 |
|----|----|--|------|--------|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 |
| | | 8.250% 期日 11/15/2026 | USD | 850 | 829 |
| | | Rite Aid Corp. | | | |
| | | 6.125% 期日 04/01/2023 | | 4,940 | 4,221 |
| | | Roadster Finance DAC | | | |
| | | 1.625% 期日 12/09/2024 | EUR | 700 | 770 |
| | | 2.375% 期日 12/08/2027 | | 1,000 | 1,079 |
| | | Rockwell Collins, Inc. | | | |
| | | 2.800% 期日 03/15/2022 | USD | 194 | 188 |
| | | Russian Railways Via RZD Capital PLC | | | |
| | | 3.374% 期日 05/20/2021 | EUR | 7,700 | 9,130 |
| | | 7.487% 期日 03/25/2031 | GBP | 6,300 | 9,474 |
| | | Sands China Ltd. | | | |
| | | 4.600% 期日 08/08/2023 | USD | 4,200 | 4,153 |
| | | 5.125% 期日 08/08/2025 | | 5,200 | 5,106 |
| | | 5.400% 期日 08/08/2028 | | 7,000 | 6,707 |
| | | Scientific Games International, Inc. | | | |
| | | 3.375% 期日 02/15/2026 | EUR | 317 | 335 |
| | | SF Holding Investment Ltd. | | | |
| | | 4.125% 期日 07/26/2023 | USD | 2,200 | 2,186 |
| | | Shelf Drilling Holdings Ltd. | | | |
| | | 8.250% 期日 02/15/2025 | | 473 | 476 |
| | | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC | | | |
| | | 2.400% 期日 09/23/2021 | | 3,750 | 3,605 |
| | | SMBC Aviation Capital Finance DAC | | | |
| | | 2.650% 期日 07/15/2021 | | 400 | 386 |
| | | 3.000% 期日 07/15/2022 | | 300 | 288 |
| | | 4.125% 期日 07/15/2023 | | 200 | 199 |
| | | SoftBank Group Corp. | | | |
| | | 3.125% 期日 09/19/2025 | EUR | 9,400 | 9,903 |
| | | 4.000% 期日 04/20/2023 | | 35,726 | 42,108 |
| | | 4.000% 期日 09/19/2029 | | 1,700 | 1,692 |
| | | Spanish Broadcasting System, Inc. | | | |
| | | 12.500% 期日 04/15/2049 | USD | 818 | 832 |
| | | Spectra Energy Partners LP | | | |
| | | 3.016% 期日 06/05/2020 | | 500 | 501 |
| | | Spirit Issuer PLC | | | |
| | | 3.500% 期日 12/28/2031 | GBP | 1,060 | 1,334 |
| | | 6.582% 期日 03/28/2025 | | 248 | 320 |
| | | Sprint Spectrum Co. LLC | | | |
| | | 3.360% 期日 09/20/2021 | USD | 3,750 | 3,722 |
| | | 4.738% 期日 03/20/2025 | | 5,200 | 5,206 |
| | | 5.152% 期日 03/20/2028 | | 8,270 | 8,291 |
| | | Starfruit Finco BV | | | |
| | | 6.500% 期日 10/01/2026 | EUR | 900 | 1,000 |
| | | 8.000% 期日 10/01/2026 | USD | 900 | 875 |
| | | Sunoco Logistics Partners Operations LP | | | |
| | | 5.950% 期日 12/01/2025 | | 760 | 806 |
| | | Sunoco LP | | | |
| | | 4.875% 期日 01/15/2023 | | 1,110 | 1,072 |
| | | Syngenta Finance NV | | | |
| | | 3.698% 期日 04/24/2020 | | 600 | 598 |
| | | 3.933% 期日 04/23/2021 | | 1,600 | 1,593 |
| | | 4.441% 期日 04/24/2023 | | 5,300 | 5,220 |
| | | 4.892% 期日 04/24/2025 | | 800 | 771 |
| | | 5.182% 期日 04/24/2028 | | 1,800 | 1,706 |
| | | Tech Data Corp. | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位:千) | 通貨 | (単位:千) |
| | | 3.700% 期日 02/15/2022 | | 2,327 | | 2,279 |
| | | 4.950% 期日 02/15/2027 | | 910 | | 880 |
| | | Telefonica Emisiones SAU | | | | |
| | | 5.134% 期日 04/27/2020 | | 230 | | 236 |
| | | Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl | | | | |
| | | 5.500% 期日 03/01/2028 | | 1,600 | | 1,492 |
| | | Tencent Holdings Ltd. | | | | |
| | | 3.375% 期日 05/02/2019 | | 1,600 | | 1,602 |
| | | Tenet Healthcare Corp. | | | | |
| | | 4.625% 期日 07/15/2024 | | 1,702 | | 1,645 |
| | | Teva Pharmaceutical Finance IV BV | | | | |
| | | 3.650% 期日 11/10/2021 | | 418 | | 401 |
| | | Teva Pharmaceutical Finance IV LLC | | | | |
| | | 2.250% 期日 03/18/2020 | | 474 | | 460 |
| | | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV | | | | |
| | | 0.375% 期日 07/25/2020 | EUR | 4,800 | | 5,363 |
| | | 3.250% 期日 04/15/2022 | | 11,200 | | 13,102 |
| | | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV | | | | |
| | | 1.700% 期日 07/19/2019 | USD | 220 | | 216 |
| | | 2.800% 期日 07/21/2023 | | 208 | | 184 |
| | | Textron, Inc. | | | | |
| | | 2.891% 期日 11/10/2020 | | 3,770 | | 3,766 |
| | | Times Square Hotel Trust | | | | |
| | | 8.528% 期日 08/01/2026 | | 1,870 | | 2,154 |
| | | T-Mobile USA, Inc. | | | | |
| | | 4.750% 期日 02/01/2028 | | 728 | | 337 |
| | | Triumph Group, Inc. | | | | |
| | | 4.875% 期日 04/01/2021 | | 2,479 | | 2,347 |
| | | 5.250% 期日 06/01/2022 | | 486 | | 452 |
| | | Ubisoft Entertainment S.A. | | | | |
| | | 1.289% 期日 01/30/2023 | EUR | 1,800 | | 2,041 |
| | | UCB S.A. | | | | |
| | | 1.875% 期日 04/02/2022 | | 1,500 | | 1,766 |
| | | 3.750% 期日 03/27/2020 | | 376 | | 447 |
| | | 4.125% 期日 01/04/2021 | | 150 | | 184 |
| | | United Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust | | | | |
| | | 3.100% 期日 07/07/2028 | USD | 256 | | 242 |
| | | United Group BV | | | | |
| | | 4.375% 期日 07/01/2022 | EUR | 1,100 | | 1,287 |
| | | 4.875% 期日 07/01/2024 | | 1,100 | | 1,291 |
| | | United Technologies Corp. | | | | |
| | | 2.965% 期日 08/16/2021 | USD | 1,428 | | 1,430 |
| | | 3.350% 期日 08/16/2021 | | 292 | | 291 |
| | | 3.650% 期日 08/16/2023 | | 4,868 | | 4,828 |
| | | 4.125% 期日 11/16/2028 | | 3,448 | | 3,393 |
| | | 4.450% 期日 11/16/2038 | | 564 | | 547 |
| | | 4.625% 期日 11/16/2048 | | 1,028 | | 993 |
| | | Univision Communications, Inc. | | | | |
| | | 5.125% 期日 05/15/2023 | | 530 | | 501 |
| | | 5.125% 期日 02/15/2025 | | 14,170 | | 12,987 |
| | | UPCB Finance VII Ltd. | | | | |
| | | 3.625% 期日 06/15/2029 | EUR | 8,151 | | 9,146 |
| | | ViaSat, Inc. | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|------|---------------------------------------|------|--------|----|------------------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 5.625% 期日 09/15/2025 | USD | 3,698 | | 3,444 |
| | | Virgin Media Secured Finance PLC | | | | |
| | | 5.000% 期日 04/15/2027 | GBP | 3,760 | | 4,748 |
| | | 5.500% 期日 01/15/2025 | | 9,450 | | 12,347 |
| | | VMware, Inc. | | | | |
| | | 2.300% 期日 08/21/2020 | USD | 654 | | 639 |
| | | 2.950% 期日 08/21/2022 | | 5,956 | | 5,707 |
| | | 3.900% 期日 08/21/2027 | | 540 | | 494 |
| | | Volkswagen Bank GmbH | | | | |
| | | 0.101% 期日 06/15/2021 | EUR | 900 | | 1,014 |
| | | Volkswagen Financial Services AG | | | | |
| | | 0.250% 期日 10/16/2020 | | 7,960 | | 9,010 |
| | | Volkswagen Financial Services NV | | | | |
| | | 1.875% 期日 09/07/2021 | GBP | 1,800 | | 2,286 |
| | | Volkswagen Leasing GmbH | | | | |
| | | 0.132% 期日 07/06/2021 | EUR | 1,000 | | 1,127 |
| | | 0.250% 期日 02/16/2021 | | 4,688 | | 5,293 |
| | | 1.000% 期日 02/16/2023 | | 2,464 | | 2,762 |
| | | Warner Media LLC | | | | |
| | | 3.800% 期日 02/15/2027 | USD | 246 | | 231 |
| | | Western Digital Corp. | | | | |
| | | 4.750% 期日 02/15/2026 | | 5,260 | | 4,865 |
| | | Westmoreland Coal Co. | | | | |
| | | 8.750% 期日 01/01/2022 | | 685 | | 271 |
| | | Wind Tre SpA | | | | |
| | | 2.625% 期日 01/20/2023 | EUR | 2,400 | | 2,535 |
| | | 2.750% 期日 01/20/2024 | | 1,400 | | 1,472 |
| | | 3.125% 期日 01/20/2025 | | 1,200 | | 1,241 |
| | | 5.000% 期日 01/20/2026 | USD | 1,000 | | 856 |
| | | Wyndham Destinations, Inc. | | | | |
| | | 5.400% 期日 04/01/2024 | | 172 | | 166 |
| | | 5.750% 期日 04/01/2027 | | 196 | | 182 |
| | | Wynn Macau Ltd. | | | | |
| | | 4.875% 期日 10/01/2024 | | 400 | | 364 |
| | | 5.500% 期日 10/01/2027 | | 600 | | 543 |
| | | Yara International ASA | | | | |
| | | 4.750% 期日 06/01/2028 | | 2,205 | | 2,187 |
| | | Zimmer Biomet Holdings, Inc. | | | | |
| | | 3.375% 期日 11/30/2021 | | 124 | | 122 |
| | | | | | | <u>1,165,963</u> |
| | 公共事業 | AT&T, Inc. | | | | |
| | 2.7% | 3.386% 期日 07/15/2021 | | 3,419 | | 3,457 |
| | | 3.450% 期日 09/19/2023 | AUD | 3,630 | | 2,565 |
| | | 3.514% 期日 06/12/2024 | USD | 6,982 | | 7,007 |
| | | 4.100% 期日 01/19/2026 | AUD | 3,630 | | 2,558 |
| | | 4.900% 期日 08/15/2037 | USD | 3,020 | | 2,779 |
| | | 5.000% 期日 03/01/2021 | | 61 | | 63 |
| | | 5.300% 期日 08/15/2058 | | 2,590 | | 2,361 |
| | | 5.650% 期日 02/15/2047 | | 44 | | 43 |
| | | BellSouth LLC | | | | |
| | | 4.333% 期日 04/26/2021 | | 28,100 | | 28,285 |
| | | China Resources Gas Group Ltd. | | | | |
| | | 4.500% 期日 04/05/2022 | | 400 | | 404 |
| | | CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd. | | | | |
| | | 2.625% 期日 05/05/2020 | | 400 | | 395 |
| | | Dominion Energy, Inc. | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 2.914% 期日 05/15/2020 | | 9,370 | | 9,371 |
| | | Duke Energy Corp. | | | | |
| | | 2.819% 期日 05/14/2021 | | 3,100 | | 3,109 |
| | | 3.050% 期日 08/15/2022 | | 600 | | 587 |
| | | Duquesne Light Holdings, Inc. | | | | |
| | | 6.400% 期日 09/15/2020 | | 1,000 | | 1,046 |
| | | El Paso Natural Gas Co. LLC | | | | |
| | | 8.625% 期日 01/15/2022 | | 1,900 | | 2,162 |
| | | Enable Midstream Partners LP | | | | |
| | | 4.950% 期日 05/15/2028 | | 1,249 | | 1,224 |
| | | Enbridge, Inc. | | | | |
| | | 2.814% 期日 01/10/2020 | | 8,800 | | 8,788 |
| | | 3.034% 期日 06/15/2020 | | 4,400 | | 4,406 |
| | | Florida Gas Transmission Co. LLC | | | | |
| | | 5.450% 期日 07/15/2020 | | 790 | | 813 |
| | | Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. | | | | |
| | | 4.375% 期日 09/19/2022 | | 5,550 | | 5,446 |
| | | 6.000% 期日 11/27/2023 | | 11,200 | | 11,574 |
| | | Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| | | 3.375% 期日 11/30/2018 | CHF | 1,100 | | 1,096 |
| | | 3.389% 期日 03/20/2020 | EUR | 4,900 | | 5,761 |
| | | 3.600% 期日 02/26/2021 | | 5,500 | | 6,600 |
| | | 4.950% 期日 02/06/2028 | USD | 200 | | 191 |
| | | 5.338% 期日 09/25/2020 | GBP | 1,230 | | 1,644 |
| | | 5.999% 期日 01/23/2021 | USD | 2,322 | | 2,385 |
| | | 6.510% 期日 03/07/2022 | | 6,398 | | 6,711 |
| | | 7.288% 期日 08/16/2037 | | 500 | | 553 |
| | | 8.625% 期日 04/28/2034 | | 2,372 | | 2,909 |
| | | 9.250% 期日 04/23/2019 | | 20,950 | | 21,456 |
| | | Global Switch Holdings Ltd. | | | | |
| | | 2.250% 期日 05/31/2027 | EUR | 100 | | 112 |
| | | Iberdrola Finance Ireland DAC | | | | |
| | | 5.000% 期日 09/11/2019 | USD | 2,000 | | 2,031 |
| | | Israel Electric Corp. Ltd. | | | | |
| | | 7.250% 期日 01/15/2019 | | 557 | | 562 |
| | | Kinder Morgan Energy Partners LP | | | | |
| | | 6.850% 期日 02/15/2020 | | 2,750 | | 2,869 |
| | | Korea National Oil Corp. | | | | |
| | | 2.125% 期日 04/14/2021 | | 600 | | 579 |
| | | Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd. | | | | |
| | | 6.350% 期日 12/01/2021 | | 491 | | 485 |
| | | Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. | | | | |
| | | 6.720% 期日 12/01/2022 | | 232 | | 223 |
| | | ONEOK, Inc. | | | | |
| | | 4.550% 期日 07/15/2028 | | 1,446 | | 1,418 |
| | | 5.200% 期日 07/15/2048 | | 1,180 | | 1,145 |
| | | Petrobras Global Finance BV | | | | |
| | | 5.299% 期日 01/27/2025 | | 535 | | 512 |
| | | 5.875% 期日 03/07/2022 | EUR | 800 | | 1,021 |
| | | 5.999% 期日 01/27/2028 | USD | 11,921 | | 11,337 |
| | | 6.125% 期日 01/17/2022 | | 6,576 | | 6,831 |
| | | 6.250% 期日 12/14/2026 | GBP | 2,831 | | 3,771 |
| | | 6.625% 期日 01/16/2034 | | 2,900 | | 3,754 |
| | | 6.850% 期日 06/05/2115 | USD | 990 | | 881 |
| | | 7.375% 期日 01/17/2027 | | 18,022 | | 18,713 |
| | | 8.375% 期日 12/10/2018 | | 1,000 | | 1,006 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|--------------------|----|--|-----------|------------------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | 8.750% 期日 05/23/2026 | 2,340 | 2,618 |
| | | Plains All American Pipeline LP | | |
| | | 6.650% 期日 01/15/2037 | 416 | 446 |
| | | Rio Oil Finance Trust Series 2014-1 | | |
| | | 9.250% 期日 07/06/2024 | 2,992 | 3,205 |
| | | Rio Oil Finance Trust Series 2014-3 | | |
| | | 9.750% 期日 01/06/2027 | 896 | 975 |
| | | Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 | | |
| | | 8.200% 期日 04/06/2028 | 2,800 | 2,918 |
| | | Rockpoint Gas Storage Canada Ltd. | | |
| | | 7.000% 期日 03/31/2023 | 150 | 150 |
| | | Rosneft Finance S.A. | | |
| | | 7.250% 期日 02/02/2020 | 750 | 775 |
| | | Sabine Pass Liquefaction LLC | | |
| | | 5.625% 期日 02/01/2021 | 664 | 687 |
| | | Sempra Energy | | |
| | | 2.784% 期日 03/15/2021 | 8,200 | 8,197 |
| | | SGSP Australia Assets Pty Ltd. | | |
| | | 3.300% 期日 04/09/2023 | 250 | 243 |
| | | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd. | | |
| | | 2.500% 期日 04/28/2020 | 200 | 197 |
| | | Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd. | | |
| | | 1.750% 期日 09/29/2019 | 200 | 197 |
| | | 2.125% 期日 05/03/2019 | 200 | 199 |
| | | Southern Co. | | |
| | | 2.750% 期日 06/15/2020 | 396 | 392 |
| | | Sprint Capital Corp. | | |
| | | 6.900% 期日 05/01/2019 | 33,951 | 34,480 |
| | | Sprint Communications, Inc. | | |
| | | 7.000% 期日 08/15/2020 | 17,292 | 17,940 |
| | | 9.000% 期日 11/15/2018 | 1,349 | 1,353 |
| | | Sprint Corp. | | |
| | | 7.250% 期日 09/15/2021 | 24,594 | 25,762 |
| | | 7.625% 期日 03/01/2026 | 4,122 | 4,297 |
| | | State Grid Overseas Investment 2014 Ltd. | | |
| | | 2.750% 期日 05/07/2019 | 900 | 897 |
| | | State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. | | |
| | | 2.250% 期日 05/04/2020 | 200 | 196 |
| | | Transocean Phoenix 2 Ltd. | | |
| | | 7.750% 期日 10/15/2024 | 1,680 | 1,743 |
| | | Transocean Proteus Ltd. | | |
| | | 6.250% 期日 12/01/2024 | 46 | 46 |
| | | Verizon Communications, Inc. | | |
| | | 2.875% 期日 01/15/2038 | EUR 1,680 | 1,873 |
| | | 3.375% 期日 10/27/2036 | GBP 680 | 853 |
| | | 5.250% 期日 03/16/2037 | USD 1,690 | 1,743 |
| | | | | <u>317,381</u> |
| | | 社債券等合計 | | <u>3,885,502</u> |
| | | (原価：4,003,507米ドル) | | |
| 転換社債及び短期証券 0.0% | | Caesars Entertainment Corp. | | |
| | | 5.000% 期日 10/01/2024 | 2,906 | 4,157 |
| | | 転換社債及び短期証券合計 | | <u>4,157</u> |
| | | (原価：4,695米ドル) | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|--|-------|--|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| 地方債 0.5% | | Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010 | | |
| | | 6.630% 期日 02/01/2035 | 655 | 684 |
| | | 6.725% 期日 04/01/2035 | 280 | 294 |
| | | 7.350% 期日 07/01/2035 | 545 | 594 |
| | | Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2003 | | |
| | | 5.100% 期日 06/01/2033 | 1,740 | 1,645 |
| | | Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2014 | | |
| | | 6.314% 期日 01/01/2044 | 220 | 214 |
| | | Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015 | | |
| | | 7.375% 期日 01/01/2033 | 440 | 476 |
| | | 7.750% 期日 01/01/2042 | 780 | 828 |
| | | Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017 | | |
| | | 7.045% 期日 01/01/2029 | 370 | 391 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2001 | | |
| | | 5.125% 期日 07/01/2031 | 17,360 | 10,459 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2006 | | |
| | | 5.000% 期日 07/01/2031 | 420 | 253 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2023 | 500 | 301 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2026 | 1,000 | 603 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2049 | 610 | 366 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2007 | | |
| | | 5.000% 期日 07/01/2027 | 700 | 422 |
| | | 5.000% 期日 07/01/2028 | 75 | 45 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2032 | 400 | 241 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2034 | 400 | 241 |
| | | 5.250% 期日 07/01/2037 | 410 | 247 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2008 | | |
| | | 5.000% 期日 07/01/2023 | 300 | 181 |
| | | 5.125% 期日 07/01/2028 | 130 | 78 |
| | | 5.500% 期日 07/01/2032 | 10,780 | 6,495 |
| | | 5.700% 期日 07/01/2023 | 685 | 385 |
| | | 6.000% 期日 07/01/2038 | 4,070 | 2,452 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2009 | | |
| 5.750% 期日 07/01/2038 | 550 | 331 | | |
| 6.000% 期日 07/01/2039 | 215 | 130 | | |
| 6.500% 期日 07/01/2037 | 400 | 241 | | |
| Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2011 | | | | |
| 5.375% 期日 07/01/2030 | 685 | 403 | | |
| 5.750% 期日 07/01/2041 | 1,900 | 1,116 | | |
| 6.500% 期日 07/01/2040 | 120 | 71 | | |
| Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2012 | | | | |
| 4.125% 期日 07/01/2022 | 500 | 276 | | |
| 5.000% 期日 07/01/2021 | 1,010 | 593 | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|-----------------|----|---|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | 5.000% 期日 07/01/2041 | 3,660 | 2,150 |
| | | 5.125% 期日 07/01/2037 | 800 | 470 |
| | | 5.500% 期日 07/01/2026 | 1,900 | 1,116 |
| | | 5.500% 期日 07/01/2039 | 4,215 | 2,476 |
| | | Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2014 | | |
| | | 8.000% 期日 07/01/2035 | 13,450 | 7,969 |
| | | Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 | | |
| | | 6.050% 期日 07/01/2032 | 800 | 499 |
| | | Puerto Rico Electric Power Authority, General Obligation Bonds, Series 2010 | | |
| | | 6.125% 期日 07/01/2040 | 3,000 | 1,871 |
| | | Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2016 | | |
| | | 3.031% 期日 09/25/2056 | 1,245 | 1,246 |
| | | Salt Lake, Utah, Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2017 | | |
| | | 3.031% 期日 01/25/2057 | 11,479 | 11,494 |
| | | Travis, Texas, Texas Public Finance Authority Revenue Bonds, Series 2014 | | |
| | | 8.250% 期日 07/01/2024 | 400 | 408 |
| | | 地方債合計 (原価：37,558米ドル) | | 60,755 |
| 米国政府機関債 9.8% | | Fannie Mae | | |
| | | 2.500% 期日 10/01/2022 | 377 | 371 |
| | | 2.581% 期日 05/25/2048 | 5,795 | 5,776 |
| | | 3.000% 期日 05/25/2048 | 14,487 | 13,659 |
| | | 3.500% 期日 08/01/2042 | 63 | 62 |
| | | 3.500% 期日 09/01/2047 | 962 | 938 |
| | | 3.500% 期日 03/01/2048 | 250 | 243 |
| | | 3.500% 期日 04/01/2048 | 487 | 475 |
| | | 3.919% 期日 05/25/2048 | 5,795 | 1,086 |
| | | 4.000% 期日 07/01/2040 | 154 | 155 |
| | | 4.000% 期日 12/01/2041 | 195 | 194 |
| | | 4.000% 期日 07/01/2042 | 324 | 323 |
| | | 4.000% 期日 08/01/2042 | 88 | 88 |
| | | 4.000% 期日 09/01/2042 | 342 | 341 |
| | | 4.000% 期日 07/01/2045 | 2,839 | 2,852 |
| | | 4.000% 期日 11/01/2045 | 499 | 500 |
| | | 4.000% 期日 03/01/2047 | 288 | 289 |
| | | 4.000% 期日 04/01/2047 | 1,035 | 1,040 |
| | | 4.000% 期日 08/01/2047 | 24,296 | 24,321 |
| | | 4.000% 期日 12/01/2047 | 295 | 295 |
| | | 4.000% 期日 01/01/2048 | 250 | 250 |
| | | 4.000% 期日 08/01/2048 | 3,994 | 3,998 |
| | | 4.000% 期日 09/01/2048 | 30,204 | 30,233 |
| | | 4.500% 期日 05/01/2033 | 20 | 20 |
| | | 4.500% 期日 07/01/2033 | 37 | 38 |
| | | 4.500% 期日 05/01/2034 | 10 | 10 |
| | | 4.500% 期日 05/01/2035 | 7 | 7 |
| | | 4.500% 期日 09/01/2035 | 8 | 9 |
| | | 4.500% 期日 02/01/2038 | 2 | 2 |
| | | 4.500% 期日 01/01/2041 | 533 | 539 |
| | | 4.750% 期日 06/01/2033 | 216 | 218 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|----------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) |
| | | 5.000% 期日 10/01/2035 | | 78 | | 79 |
| | | 5.000% 期日 12/01/2035 | | 312 | | 319 |
| | | 5.000% 期日 10/01/2036 | | 7 | | 8 |
| | | 5.000% 期日 05/01/2038 | | 4 | | 4 |
| | | 5.000% 期日 11/01/2039 | | 12 | | 13 |
| | | 5.000% 期日 10/01/2051 | | 458 | | 471 |
| | | 5.500% 期日 07/01/2033 | | 45 | | 47 |
| | | 5.500% 期日 06/01/2035 | | 847 | | 882 |
| | | 5.500% 期日 04/01/2036 | | 2 | | 2 |
| | | 5.500% 期日 11/01/2036 | | 11 | | 12 |
| | | 5.500% 期日 03/01/2037 | | 20 | | 20 |
| | | 5.500% 期日 09/01/2037 | | 25 | | 26 |
| | | 5.500% 期日 02/01/2038 | | 4 | | 4 |
| | | 5.500% 期日 04/01/2038 | | 35 | | 36 |
| | | 6.000% 期日 08/01/2031 | | 31 | | 31 |
| | | 6.000% 期日 06/01/2032 | | 8 | | 8 |
| | | 6.000% 期日 09/01/2039 | | 425 | | 446 |
| | | 6.000% 期日 10/01/2047 | | 28 | | 29 |
| | | 6.500% 期日 01/01/2037 | | 5 | | 6 |
| | | 6.500% 期日 10/01/2037 | | 13 | | 14 |
| | | 7.000% 期日 09/01/2031 | | 38 | | 38 |
| | | 7.000% 期日 05/01/2037 | | 3 | | 3 |
| | | 7.500% 期日 09/01/2032 | | 12 | | 12 |
| | | Fannie Mae, TBA | | | | |
| | | 2.500% 期日 12/01/2033 | | 3,000 | | 2,869 |
| | | 3.000% 期日 12/01/2033 | | 9,500 | | 9,310 |
| | | 3.000% 期日 12/01/2048 | | 107,600 | | 101,649 |
| | | 3.000% 期日 01/01/2049 | | 5,000 | | 4,719 |
| | | 3.500% 期日 12/01/2048 | | 251,000 | | 244,012 |
| | | 3.500% 期日 01/01/2049 | | 148,000 | | 143,741 |
| | | 4.000% 期日 12/01/2048 | | 209,825 | | 209,566 |
| | | 4.000% 期日 01/01/2049 | | 173,675 | | 173,264 |
| | | Freddie Mac | | | | |
| | | 3.000% 期日 11/01/2046 | | 227 | | 215 |
| | | 3.000% 期日 12/01/2047 | | 8,620 | | 8,161 |
| | | 3.000% 期日 03/01/2048 | | 500 | | 473 |
| | | 3.000% 期日 06/01/2048 | | 26,680 | | 25,259 |
| | | 3.000% 期日 07/01/2048 | | 60,396 | | 57,180 |
| | | 3.000% 期日 09/01/2048 | | 377 | | 357 |
| | | 3.500% 期日 10/01/2047 | | 9,419 | | 9,178 |
| | | 3.500% 期日 12/01/2047 | | 3,609 | | 3,516 |
| | | 3.500% 期日 03/01/2048 | | 11,542 | | 11,246 |
| | | 3.500% 期日 04/01/2048 | | 4,416 | | 4,303 |
| | | 3.500% 期日 10/01/2048 | | 9,969 | | 9,712 |
| | | 4.000% 期日 09/01/2033 | | 6 | | 6 |
| | | 4.271% 期日 06/15/2042 | | 88 | | 16 |
| | | 4.500% 期日 12/01/2019 | | 1 | | 1 |
| | | 4.500% 期日 05/01/2036 | | 6 | | 6 |
| | | 5.000% 期日 06/01/2034 | | 483 | | 495 |
| | | 5.000% 期日 08/01/2035 | | 99 | | 101 |
| | | 5.000% 期日 01/01/2037 | | 4 | | 4 |
| | | 5.000% 期日 01/01/2038 | | 4 | | 4 |
| | | 5.500% 期日 01/01/2035 | | 1,561 | | 1,637 |
| | | 5.500% 期日 05/01/2037 | | 7 | | 7 |
| | | 5.500% 期日 06/01/2037 | | 279 | | 291 |
| | | 5.500% 期日 07/01/2037 | | 41 | | 42 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|----|----|---|------------|------------|
| | | | 通貨 (単位: 千) | 時価 (単位: 千) |
| | | 5.750% 期日 05/01/2037 | 443 | 474 |
| | | 6.000% 期日 07/01/2037 | 52 | 54 |
| | | Freddie Mac, TBA | | |
| | | 3.500% 期日 11/01/2048 | 20,000 | 19,469 |
| | | 3.500% 期日 12/01/2048 | 15,000 | 14,585 |
| | | Ginnie Mae | | |
| | | 4.500% 期日 01/20/2040 | 250 | 256 |
| | | 4.500% 期日 03/20/2040 | 39 | 39 |
| | | 5.000% 期日 08/20/2030 | 849 | 892 |
| | | 5.000% 期日 05/20/2040 | 680 | 698 |
| | | 5.000% 期日 11/20/2040 | 39 | 40 |
| | | 5.000% 期日 04/20/2041 | 27 | 27 |
| | | 5.500% 期日 05/20/2038 | 14 | 14 |
| | | 5.500% 期日 06/20/2038 | 216 | 222 |
| | | 5.500% 期日 07/20/2038 | 86 | 87 |
| | | 5.500% 期日 08/20/2038 | 664 | 683 |
| | | 5.500% 期日 09/20/2038 | 406 | 417 |
| | | 5.500% 期日 10/20/2038 | 47 | 48 |
| | | 5.500% 期日 01/20/2039 | 12 | 12 |
| | | 5.500% 期日 02/20/2039 | 84 | 86 |
| | | 5.500% 期日 07/20/2039 | 65 | 67 |
| | | 5.500% 期日 09/20/2039 | 165 | 170 |
| | | 5.500% 期日 10/20/2039 | 288 | 295 |
| | | 5.500% 期日 11/20/2039 | 435 | 446 |
| | | 5.500% 期日 12/20/2039 | 28 | 29 |
| | | 5.500% 期日 01/20/2040 | 365 | 374 |
| | | 5.500% 期日 06/20/2040 | 573 | 607 |
| | | 5.500% 期日 07/20/2040 | 543 | 557 |
| | | 米国政府機関債合計 | | 1,152,830 |
| | | (原価: 1,158,405米ドル) | | |
| | | Treasury Inflation Protected Securities | | |
| | | 0.125% 期日 04/15/2020 | 1,184 | 1,164 |
| | | 0.375% 期日 01/15/2027 | 5 | 5 |
| | | 0.625% 期日 07/15/2021 | 78 | 78 |
| | | 2.375% 期日 01/15/2025 | 26,513 | 28,587 |
| | | U. S. Treasury Bonds | | |
| | | 2.125% 期日 08/15/2021 | 65,100 | 63,710 |
| | | 2.250% 期日 08/15/2046 | 100 | 79 |
| | | 2.500% 期日 05/15/2024 | 98,000 | 95,410 |
| | | 2.750% 期日 08/15/2047 | 2,830 | 2,490 |
| | | 3.000% 期日 08/15/2048 | 230 | 213 |
| | | 3.125% 期日 05/15/2048 | 180 | 171 |
| | | U. S. Treasury Notes | | |
| | | 1.125% 期日 09/30/2021 | 37,390 | 35,515 |
| | | 1.375% 期日 08/31/2023 | 56,200 | 52,141 |
| | | 1.500% 期日 01/31/2022 | 200 | 191 |
| | | 1.625% 期日 02/15/2026 | 2,200 | 1,991 |
| | | 1.750% 期日 11/30/2021 | 26,400 | 25,482 |
| | | 1.750% 期日 03/31/2022 | 9,300 | 8,939 |
| | | 1.750% 期日 05/15/2022 | 5,400 | 5,182 |
| | | 1.750% 期日 09/30/2022 | 11,500 | 10,984 |
| | | 1.875% 期日 08/31/2022 | 24,200 | 23,245 |
| | | 2.000% 期日 10/31/2021 | 2,700 | 2,628 |
| | | 2.000% 期日 07/31/2022 | 7,400 | 7,149 |
| | | 2.000% 期日 05/31/2024 | 33,500 | 31,757 |
| | | 2.000% 期日 06/30/2024 | 142,800 | 135,225 |

米国財務省証券
9.3%

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|---------|----|---|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | 2.000% 期日 02/15/2025 | 11,021 | 10,355 |
| | | 2.000% 期日 08/15/2025 | 1,400 | 1,308 |
| | | 2.000% 期日 11/15/2026 | 800 | 737 |
| | | 2.125% 期日 12/31/2021 | 30,200 | 29,461 |
| | | 2.125% 期日 06/30/2022 | 19,600 | 19,035 |
| | | 2.125% 期日 07/31/2024 | 21,800 | 20,761 |
| | | 2.125% 期日 09/30/2024 | 117,000 | 111,237 |
| | | 2.250% 期日 12/31/2023 | 89,100 | 85,933 |
| | | 2.250% 期日 10/31/2024 | 203,550 | 194,756 |
| | | 2.250% 期日 11/15/2024 | 63,300 | 60,531 |
| | | 2.250% 期日 02/15/2027 | 28,000 | 26,220 |
| | | 2.375% 期日 05/15/2027 | 5,836 | 5,509 |
| | | 2.750% 期日 02/15/2024 | 2,800 | 2,765 |
| | | 米国財務省証券合計 | | 1,100,944 |
| | | (原価：1,146,414米ドル) | | |
| モーゲージ証券 | | Accredited Mortgage Loan Trust | | |
| 36.8% | | 3.226% 期日 07/25/2035 | 9,806 | 9,699 |
| | | 3.976% 期日 07/25/2035 | 715 | 626 |
| | | ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust | | |
| | | 2.436% 期日 08/25/2036 | 8,447 | 8,226 |
| | | 3.076% 期日 01/25/2035 | 1,336 | 1,325 |
| | | 3.106% 期日 02/25/2034 | 6,677 | 6,541 |
| | | 3.181% 期日 08/25/2035 | 5,023 | 4,848 |
| | | Adjustable Rate Mortgage Trust | | |
| | | 3.231% 期日 08/25/2035 | 7,287 | 7,079 |
| | | AFC Home Equity Loan Trust | | |
| | | 3.091% 期日 06/25/2029 | 2,523 | 2,231 |
| | | ALESCO Preferred Funding X I Ltd. | | |
| | | 2.816% 期日 12/23/2036 | 5,000 | 4,250 |
| | | Alternative Loan Trust | | |
| | | 2.451% 期日 01/25/2037 | 10,297 | 10,096 |
| | | 2.451% 期日 07/25/2046 | 9,685 | 9,317 |
| | | 2.461% 期日 07/25/2036 | 13,513 | 12,684 |
| | | 2.470% 期日 09/20/2046 | 2,554 | 2,192 |
| | | 2.471% 期日 08/25/2046 | 19,178 | 15,325 |
| | | 2.481% 期日 05/25/2036 | 23,118 | 20,769 |
| | | 2.490% 期日 03/20/2046 | 11,026 | 10,041 |
| | | 2.531% 期日 12/25/2046 | 26,525 | 24,008 |
| | | 2.551% 期日 07/25/2036 | 23,331 | 18,905 |
| | | 2.881% 期日 01/25/2036 | 3,845 | 3,738 |
| | | 3.296% 期日 08/25/2035 | 787 | 738 |
| | | 3.796% 期日 08/25/2035 | 857 | 816 |
| | | 4.358% 期日 09/25/2034 | 1,859 | 1,813 |
| | | 5.500% 期日 06/25/2035 | 9,338 | 9,336 |
| | | 5.500% 期日 08/25/2035 | 117 | 113 |
| | | 5.500% 期日 02/25/2036 | 27 | 24 |
| | | 6.000% 期日 07/25/2037 | 34,803 | 25,959 |
| | | 7.000% 期日 10/25/2037 | 41,809 | 26,317 |
| | | Ameriquest Mortgage Securities Trust | | |
| | | 2.621% 期日 04/25/2036 | 10,400 | 10,272 |
| | | 2.691% 期日 03/25/2036 | 27,500 | 25,953 |
| | | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. | | |
| | | Asset-Backed Pass-Through Certificates | | |
| | | 3.287% 期日 09/25/2032 | 635 | 638 |
| | | 4.036% 期日 10/25/2034 | 9,000 | 7,776 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|----|----|--|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | Argent Mortgage Loan Trust | | |
| | | 2.521% 期日 05/25/2035 | 35,304 | 33,657 |
| | | Argent Securities Trust | | |
| | | 2.461% 期日 04/25/2036 | 8,935 | 3,829 |
| | | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | |
| | | 2.791% 期日 10/25/2035 | 36,400 | 35,618 |
| | | 4.467% 期日 09/25/2033 | 2,189 | 2,207 |
| | | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | |
| | | 2.941% 期日 03/25/2035 | 9,929 | 9,925 |
| | | 3.016% 期日 06/25/2035 | 12,354 | 12,118 |
| | | Asset-Backed Pass-Through Certificates | | |
| | | 3.331% 期日 04/25/2035 | 7,004 | 6,919 |
| | | Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust | | |
| | | 2.591% 期日 05/25/2036 | 15,933 | 13,122 |
| | | Atrium Hotel Portfolio Trust | | |
| | | 3.710% 期日 06/15/2035 | 18,395 | 18,429 |
| | | Banc of America Alternative Loan Trust | | |
| | | 5.586% 期日 04/25/2022 | 270 | 268 |
| | | 6.000% 期日 07/25/2046 | 3,203 | 2,847 |
| | | Banc of America Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 6.041% 期日 09/10/2045 | 8,787 | 8,998 |
| | | BCAP LLC Trust | | |
| | | 2.365% 期日 07/26/2036 | 547 | 527 |
| | | 5.876% 期日 04/26/2037 | 5,375 | 4,421 |
| | | 6.183% 期日 04/26/2036 | 9,239 | 7,686 |
| | | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | |
| | | 4.189% 期日 11/25/2034 | 376 | 368 |
| | | Bear Stearns Alternative-A Trust | | |
| | | 2.451% 期日 04/25/2037 | 12,799 | 10,113 |
| | | 2.491% 期日 11/25/2046 | 9,146 | 9,282 |
| | | Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust | | |
| | | 2.481% 期日 04/25/2037 | 4,996 | 6,669 |
| | | 2.521% 期日 02/25/2037 | 8,735 | 9,686 |
| | | 2.641% 期日 04/25/2036 | 12,900 | 12,812 |
| | | 2.681% 期日 02/25/2036 | 7,436 | 7,390 |
| | | 2.681% 期日 05/25/2036 | 14,013 | 7,741 |
| | | 2.711% 期日 12/25/2035 | 9,109 | 9,151 |
| | | 2.781% 期日 12/25/2035 | 3,782 | 3,785 |
| | | 2.981% 期日 11/25/2035 | 5,796 | 4,692 |
| | | 3.001% 期日 12/25/2035 | 10,390 | 8,141 |
| | | 3.331% 期日 08/25/2037 | 27,600 | 24,956 |
| | | 4.319% 期日 05/25/2036 | 14,013 | 706 |
| | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | |
| | | 2.541% 期日 10/25/2036 | 6,408 | 6,420 |
| | | 4.241% 期日 06/25/2035 | 3,853 | 3,773 |
| | | Bear Stearns Mortgage Funding Trust | | |
| | | 2.481% 期日 02/25/2037 | 10,666 | 10,995 |
| | | Bspirt Issuer Ltd. | | |
| | | 3.630% 期日 06/15/2027 | 2,283 | 2,287 |
| | | 4.680% 期日 06/15/2027 | 1,300 | 1,310 |
| | | BX Trust | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|----|----|--|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | 3.160% 期日 07/15/2034 | 8,592 | 8,593 |
| | | 3.200% 期日 07/15/2034 | 7,271 | 7,270 |
| | | 3.430% 期日 07/15/2034 | 2,261 | 2,262 |
| | | Caesars Palace Las Vegas Trust | | |
| | | 4.354% 期日 10/15/2034 | 9,700 | 9,593 |
| | | CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage | | |
| | | 5.540% 期日 01/25/2039 | 2,052 | 1,717 |
| | | Centex Home Equity Loan Trust | | |
| | | 2.926% 期日 03/25/2035 | 5,514 | 5,461 |
| | | CGGS Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 3.180% 期日 02/15/2037 | 23,290 | 23,293 |
| | | 3.630% 期日 02/15/2037 | 9,280 | 9,310 |
| | | 4.580% 期日 02/15/2037 | 22,780 | 22,885 |
| | | CGMS Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 3.380% 期日 07/15/2030 | 16,004 | 15,952 |
| | | ChaseFlex Trust | | |
| | | 2.581% 期日 07/25/2037 | 1,694 | 1,594 |
| | | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates | | |
| | | 2.641% 期日 03/25/2035 | 843 | 849 |
| | | CIT Mortgage Loan Trust | | |
| | | 3.631% 期日 10/25/2037 | 20,578 | 20,847 |
| | | Citigroup Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 0.254% 期日 03/10/2047 | 25,400 | 405 |
| | | Citigroup Mortgage Loan Trust | | |
| | | 2.356% 期日 08/25/2036 | 15,558 | 7,459 |
| | | 2.421% 期日 12/25/2036 | 6,734 | 6,572 |
| | | 2.681% 期日 03/25/2037 | 15,986 | 15,916 |
| | | 2.791% 期日 01/25/2036 | 40 | 41 |
| | | 2.901% 期日 12/25/2035 | 3,641 | 3,656 |
| | | 3.841% 期日 08/25/2036 | 8,825 | 8,649 |
| | | 6.750% 期日 05/25/2036 | 14,014 | 10,601 |
| | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | |
| | | 2.541% 期日 01/25/2037 | 1,860 | 1,842 |
| | | 2.861% 期日 07/25/2035 | 3,174 | 3,198 |
| | | 3.316% 期日 05/25/2035 | 6,300 | 6,124 |
| | | Civic Mortgage LLC | | |
| | | 4.350% 期日 11/25/2022 | 1,800 | 1,800 |
| | | COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 5.617% 期日 04/15/2047 | 17,300 | 17,457 |
| | | Commercial Mortgage Trust | | |
| | | 0.149% 期日 04/10/2047 | 33,000 | 307 |
| | | Conseco Financial Corp. | | |
| | | 6.870% 期日 04/01/2030 | 4,903 | 5,196 |
| | | 6.920% 期日 12/01/2030 | 3,071 | 3,383 |
| | | 7.500% 期日 03/01/2030 | 60,063 | 42,630 |
| | | 7.600% 期日 04/15/2026 | 5,036 | 4,065 |
| | | 7.700% 期日 09/15/2026 | 2,218 | 2,382 |
| | | Countrywide Asset-Backed Certificates | | |
| | | 2.421% 期日 06/25/2035 | 2,718 | 2,488 |
| | | 2.421% 期日 06/25/2037 | 22,935 | 21,767 |
| | | 2.421% 期日 07/25/2037 | 3,183 | 2,819 |
| | | 2.431% 期日 04/25/2047 | 8,451 | 8,144 |
| | | 2.441% 期日 05/25/2037 | 24,425 | 24,082 |
| | | 2.451% 期日 06/25/2047 | 2,477 | 2,462 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) |
| | | 2.461% 期日 11/25/2047 | | 16,875 | | 15,141 |
| | | 2.501% 期日 08/25/2037 | | 25,800 | | 22,917 |
| | | 2.511% 期日 05/25/2037 | | 12,783 | | 11,726 |
| | | 2.511% 期日 10/25/2047 | | 29,628 | | 28,727 |
| | | 2.521% 期日 05/25/2036 | | 10,519 | | 7,593 |
| | | 2.631% 期日 03/25/2036 | | 2,010 | | 1,841 |
| | | 2.681% 期日 06/25/2036 | | 6,300 | | 6,215 |
| | | 2.701% 期日 01/25/2045 | | 7,235 | | 7,221 |
| | | 2.721% 期日 04/25/2036 | | 10,000 | | 10,006 |
| | | 2.794% 期日 08/26/2033 | | 478 | | 456 |
| | | 3.011% 期日 06/25/2035 | | 7,000 | | 6,458 |
| | | 3.031% 期日 02/25/2034 | | 9,373 | | 9,333 |
| | | 3.436% 期日 06/25/2033 | | 831 | | 797 |
| | | 3.886% 期日 01/25/2034 | | 478 | | 477 |
| | | Countrywide Home Loan Mortgage Pass- Through Trust | | | | |
| | | 3.935% 期日 06/25/2034 | | 2 | | 3 |
| | | 4.163% 期日 11/25/2034 | | 20 | | 20 |
| | | 5.500% 期日 11/25/2035 | | 9,828 | | 8,361 |
| | | 6.000% 期日 07/25/2036 | | 39,450 | | 33,487 |
| | | 6.000% 期日 11/25/2037 | | 7,975 | | 6,856 |
| | | Credit Suisse Mortgage Capital | | | | |
| | | 2.386% 期日 11/27/2036 | | 8,096 | | 8,380 |
| | | 3.000% 期日 01/29/2036 | | 2,885 | | 2,886 |
| | | 3.000% 期日 06/27/2037 | | 7,757 | | 7,704 |
| | | 3.000% 期日 07/25/2037 | | 576 | | 574 |
| | | 3.955% 期日 08/28/2036 | | 2,320 | | 2,327 |
| | | 6.419% 期日 10/26/2036 | | 392 | | 354 |
| | | Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | | |
| | | 0.000% 期日 01/25/2058 | | 81 | | 80 |
| | | 0.000% 期日 04/25/2058 | | 3 | | 3 |
| | | 3.030% 期日 07/15/2032 | | 5,200 | | 5,202 |
| | | 3.280% 期日 07/15/2032 | | 4,000 | | 4,002 |
| | | 3.480% 期日 07/15/2032 | | 2,400 | | 2,402 |
| | | 3.530% 期日 01/25/2058 | | 28,029 | | 25,108 |
| | | 3.703% 期日 04/25/2058 | | 81,424 | | 80,714 |
| | | 4.057% 期日 06/01/2050 | | 174,245 | | 179,311 |
| | | 4.195% 期日 06/25/2050 | | 44,492 | | 33,842 |
| | | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | | |
| | | 6.980% 期日 03/25/2046 | | 4,266 | | 4,298 |
| | | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | | |
| | | 2.431% 期日 07/25/2036 | | 5,353 | | 5,326 |
| | | CS First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | |
| | | 4.731% 期日 01/25/2033 | | 2,644 | | 2,558 |
| | | CWABS Asset-Backed Certificates Trust | | | | |
| | | 2.521% 期日 03/25/2037 | | 33,000 | | 30,769 |
| | | 2.521% 期日 03/25/2047 | | 26,535 | | 23,591 |
| | | 3.001% 期日 05/25/2036 | | 3,028 | | 1,201 |
| | | 3.331% 期日 03/25/2035 | | 5,500 | | 5,553 |
| | | 3.406% 期日 12/25/2034 | | 2,294 | | 2,338 |
| | | 4.561% 期日 06/25/2035 | | 8,644 | | 7,865 |
| | | CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust | | | | |
| | | 2.530% 期日 03/15/2030 | | 7,723 | | 7,714 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.441% 期日 03/25/2037 | | 15,112 | | 10,568 |
| | | 2.611% 期日 08/25/2037 | | 44,195 | | 38,975 |
| | | Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 4.409% 期日 10/25/2035 | | 17,707 | | 17,204 |
| | | Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp. | | | | |
| | | 2.456% 期日 11/27/2036 | | 6,595 | | 6,435 |
| | | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.472% 期日 10/19/2036 | | 14,386 | | 12,837 |
| | | 2.582% 期日 10/19/2045 | | 4,694 | | 4,719 |
| | | 2.612% 期日 09/19/2045 | | 9,020 | | 7,573 |
| | | Dragon Finance BV | | | | |
| | | 1.911% 期日 07/13/2023 | GBP | 219 | | 272 |
| | | Dutch Property Finance BV | | | | |
| | | 0.363% 期日 01/28/2048 | EUR | 22,500 | | 25,576 |
| | | EMC Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 3.337% 期日 04/25/2042 | USD | 10,016 | | 8,531 |
| | | 3.787% 期日 04/25/2042 | | 345 | | 345 |
| | | Encore Credit Receivables Trust | | | | |
| | | 3.211% 期日 11/25/2035 | | 6,510 | | 6,397 |
| | | Eurosail PLC | | | | |
| | | 0.972% 期日 09/10/2044 | GBP | 1,001 | | 1,272 |
| | | Eurosail-UK PLC | | | | |
| | | 1.570% 期日 09/13/2045 | | 6,707 | | 8,346 |
| | | 1.750% 期日 06/13/2045 | | 16,646 | | 21,139 |
| | | FBR Securitization Trust | | | | |
| | | 2.956% 期日 10/25/2035 | USD | 20,968 | | 15,112 |
| | | 2.961% 期日 10/25/2035 | | 15,721 | | 15,608 |
| | | 3.046% 期日 09/25/2035 | | 7,500 | | 7,016 |
| | | Finsbury Square PLC | | | | |
| | | 1.451% 期日 09/12/2065 | GBP | 35,762 | | 45,588 |
| | | First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.431% 期日 07/25/2036 | USD | 1,084 | | 1,080 |
| | | 2.441% 期日 04/25/2036 | | 7,476 | | 7,305 |
| | | 2.741% 期日 01/25/2036 | | 10,000 | | 9,302 |
| | | 2.986% 期日 05/25/2036 | | 6,259 | | 6,331 |
| | | 3.136% 期日 04/25/2035 | | 5,000 | | 5,028 |
| | | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | | |
| | | 2.719% 期日 05/25/2035 | | 2,655 | | 209 |
| | | 2.781% 期日 05/25/2035 | | 2,656 | | 2,178 |
| | | 6.000% 期日 08/25/2036 | | 7,764 | | 6,315 |
| | | Fremont Home Loan Trust | | | | |
| | | 2.421% 期日 02/25/2037 | | 11,247 | | 8,952 |
| | | 3.301% 期日 01/25/2035 | | 6,493 | | 6,113 |
| | | GE Business Loan Trust | | | | |
| | | 0.718% 期日 11/15/2034 | | 2,979 | | 2,929 |
| | | GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. | | | | |
| | | 5.456% 期日 03/10/2051 | | 12,562 | | 11,993 |
| | | Great Wolf Trust | | | | |
| | | 3.280% 期日 09/15/2034 | | 8,400 | | 8,410 |
| | | 3.480% 期日 09/15/2034 | | 13,900 | | 13,895 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | GreenPoint Mortgage Funding Trust | | | | |
| | | 2.841% 期日 11/25/2045 | | 110 | | 94 |
| | | Grifonas Finance PLC | | | | |
| | | 0.014% 期日 08/28/2039 | EUR | 1,124 | | 1,159 |
| | | GS Mortgage Securities Corp. II | | | | |
| | | 3.419% 期日 10/10/2032 | USD | 3,300 | | 3,265 |
| | | 4.591% 期日 10/10/2032 | | 7,600 | | 7,366 |
| | | GSAA Home Equity Trust | | | | |
| | | 6.500% 期日 11/25/2037 | | 25 | | 19 |
| | | GSAMP Trust | | | | |
| | | 2.431% 期日 06/25/2036 | | 4,450 | | 4,423 |
| | | 2.441% 期日 01/25/2037 | | 24,439 | | 16,597 |
| | | 2.441% 期日 05/25/2046 | | 1,352 | | 1,342 |
| | | 2.541% 期日 06/25/2036 | | 20,000 | | 19,072 |
| | | 2.926% 期日 11/25/2035 | | 7,838 | | 5,850 |
| | | GSMSC Resecuritization Trust | | | | |
| | | 2.396% 期日 09/26/2036 | | 5,801 | | 4,170 |
| | | 6.259% 期日 04/26/2037 | | 37,656 | | 13,057 |
| | | GSR Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.581% 期日 03/25/2037 | | 11,057 | | 4,391 |
| | | 4.419% 期日 03/25/2037 | | 11,057 | | 2,090 |
| | | HarborView Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.522% 期日 12/19/2036 | | 1,718 | | 1,599 |
| | | 2.842% 期日 02/19/2036 | | 20,292 | | 18,803 |
| | | 2.922% 期日 08/19/2045 | | 13,914 | | 13,563 |
| | | Hawksmoor Mortgages PLC | | | | |
| | | 2.206% 期日 05/25/2053 | GBP | 7,174 | | 9,214 |
| | | Home Equity Asset Trust | | | | |
| | | 2.521% 期日 10/25/2036 | USD | 23,475 | | 9,736 |
| | | 2.591% 期日 07/25/2036 | | 415 | | 417 |
| | | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | |
| | | 2.421% 期日 11/25/2036 | | 21,779 | | 20,701 |
| | | 2.461% 期日 06/25/2036 | | 5,268 | | 5,115 |
| | | 2.521% 期日 04/25/2037 | | 18,323 | | 13,829 |
| | | 3.271% 期日 08/25/2035 | | 5,750 | | 5,687 |
| | | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | | |
| | | 2.531% 期日 05/25/2037 | | 7,197 | | 6,611 |
| | | Hyatt Hotel Portfolio Trust | | | | |
| | | 2.938% 期日 08/09/2032 | | 2,900 | | 2,895 |
| | | 4.134% 期日 08/09/2032 | | 1,967 | | 1,969 |
| | | Impac CMB Trust | | | | |
| | | 2.961% 期日 01/25/2035 | | 22,388 | | 22,063 |
| | | Impac Secured Assets Trust | | | | |
| | | 2.471% 期日 01/25/2037 | | 5,256 | | 4,435 |
| | | IMT Trust | | | | |
| | | 2.980% 期日 06/15/2034 | | 2,400 | | 2,401 |
| | | 3.230% 期日 06/15/2034 | | 1,800 | | 1,801 |
| | | 3.380% 期日 06/15/2034 | | 1,100 | | 1,101 |
| | | IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 6.500% 期日 10/25/2037 | | 11,546 | | 10,037 |
| | | IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 3.700% 期日 06/25/2037 | | 14,208 | | 12,296 |
| | | IndyMac INDX Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.461% 期日 02/25/2037 | | 42,870 | | 40,500 |
| | | 2.471% 期日 10/25/2036 | | 8,117 | | 5,424 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称: ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|---------|----|---------|
| | | | 通貨 | (単位: 千) | 通貨 | (単位: 千) |
| | | 3.537% 期日 07/25/2037 | | 33,248 | | 31,543 |
| | | 3.566% 期日 04/25/2037 | | 12,315 | | 11,525 |
| | | 3.620% 期日 04/25/2037 | | 24,087 | | 22,386 |
| | | 3.736% 期日 03/25/2036 | | 7,884 | | 7,203 |
| | | 3.895% 期日 11/25/2036 | | 21,936 | | 18,987 |
| | | IXIS Real Estate Capital Trust | | | | |
| | | 3.046% 期日 12/25/2035 | | 10,012 | | 9,917 |
| | | Jefferies Resecuritization Trust | | | | |
| | | 7.511% 期日 06/25/2047 | | 1,110 | | 994 |
| | | JP Morgan Alternative Loan Trust | | | | |
| | | 2.561% 期日 04/25/2047 | | 4,680 | | 4,616 |
| | | 3.725% 期日 03/25/2036 | | 727 | | 682 |
| | | 5.730% 期日 03/25/2036 | | 456 | | 495 |
| | | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | | |
| | | 3.130% 期日 10/15/2032 | | 11,125 | | 11,129 |
| | | 3.380% 期日 10/15/2032 | | 7,000 | | 7,006 |
| | | 3.680% 期日 10/15/2032 | | 7,200 | | 7,213 |
| | | 4.420% 期日 10/15/2032 | | 11,000 | | 11,042 |
| | | 5.337% 期日 05/15/2047 | | 332 | | 333 |
| | | JP Morgan Mortgage Acquisition Corp. | | | | |
| | | 2.461% 期日 03/25/2036 | | 17,779 | | 17,510 |
| | | JP Morgan Mortgage Acquisition Trust | | | | |
| | | 2.481% 期日 05/25/2036 | | 6,835 | | 6,828 |
| | | 2.531% 期日 07/25/2036 | | 11,062 | | 10,920 |
| | | 2.551% 期日 05/25/2036 | | 12,851 | | 12,381 |
| | | 2.551% 期日 08/25/2036 | | 8,600 | | 6,718 |
| | | 2.551% 期日 06/25/2037 | | 34,606 | | 32,386 |
| | | 2.561% 期日 06/25/2037 | | 22,826 | | 19,293 |
| | | JP Morgan Mortgage Trust | | | | |
| | | 2.581% 期日 10/25/2035 | | 8,776 | | 7,388 |
| | | 4.090% 期日 01/25/2037 | | 1,160 | | 1,113 |
| | | JP Morgan Resecuritization Trust | | | | |
| | | 3.348% 期日 05/26/2037 | | 13,440 | | 11,135 |
| | | 3.710% 期日 02/26/2037 | | 5,471 | | 5,343 |
| | | Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC | | | | |
| | | 0.000% 期日 06/15/2045 | EUR | 6,200 | | 6,604 |
| | | LB-UBS Commercial Mortgage Trust | | | | |
| | | 6.114% 期日 07/15/2040 | USD | 67 | | 67 |
| | | Legacy Mortgage Asset Trust | | | | |
| | | 3.992% 期日 01/28/2070 | | 188,992 | | 193,571 |
| | | Lehman XS Trust | | | | |
| | | 2.471% 期日 09/25/2036 | | 11,916 | | 10,418 |
| | | 2.471% 期日 12/25/2036 | | 11,694 | | 8,387 |
| | | 2.481% 期日 02/25/2037 | | 24,317 | | 23,213 |
| | | 2.541% 期日 02/25/2047 | | 26,054 | | 23,848 |
| | | 6.500% 期日 06/25/2046 | | 7,979 | | 7,366 |
| | | Liberty Funding Pty Ltd. | | | | |
| | | 2.510% 期日 10/10/2049 | AUD | 82 | | 58 |
| | | 3.120% 期日 10/10/2049 | | 16,500 | | 11,674 |
| | | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.471% 期日 02/25/2036 | USD | 7,350 | | 6,188 |
| | | 2.471% 期日 03/25/2046 | | 39,228 | | 19,069 |
| | | 2.761% 期日 01/25/2046 | | 310 | | 311 |
| | | 4.381% 期日 06/25/2034 | | 1,252 | | 1,249 |
| | | Madison Avenue Manufactured Housing | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|----|----|--|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | Contract Trust | | |
| | | 5.531% 期日 03/25/2032 | 3,600 | 3,684 |
| | | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | |
| | | 3.742% 期日 04/25/2034 | 4 | 4 |
| | | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | |
| | | 2.501% 期日 11/25/2036 | 37 | 26 |
| | | 2.651% 期日 01/25/2036 | 7,500 | 6,865 |
| | | 3.431% 期日 08/25/2037 | 18,185 | 15,756 |
| | | MASTR Specialized Loan Trust | | |
| | | 2.761% 期日 02/25/2036 | 5,799 | 5,103 |
| | | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust | | |
| | | 3.281% 期日 10/25/2037 | 17,806 | 18,018 |
| | | 3.781% 期日 10/25/2037 | 30,178 | 30,428 |
| | | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | |
| | | 2.421% 期日 05/25/2037 | 24,827 | 15,229 |
| | | 2.661% 期日 08/25/2035 | 30 | 30 |
| | | 3.001% 期日 07/25/2034 | 5,835 | 5,703 |
| | | 3.076% 期日 09/25/2035 | 6,596 | 6,583 |
| | | 3.361% 期日 10/25/2035 | 2,353 | 2,338 |
| | | 4.101% 期日 02/25/2033 | 30 | 29 |
| | | Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust | | |
| | | 2.406% 期日 07/25/2036 | 8,517 | 7,536 |
| | | 2.431% 期日 07/25/2036 | 58,767 | 30,727 |
| | | 2.521% 期日 06/25/2036 | 32,000 | 26,847 |
| | | 2.531% 期日 07/25/2036 | 58,479 | 31,105 |
| | | 2.551% 期日 03/25/2036 | 9,601 | 9,471 |
| | | 2.986% 期日 07/25/2035 | 3,105 | 3,113 |
| | | 3.016% 期日 07/25/2035 | 6,912 | 6,745 |
| | | 3.196% 期日 11/25/2034 | 3,529 | 3,500 |
| | | 3.281% 期日 03/25/2033 | 131 | 129 |
| | | 3.281% 期日 07/25/2037 | 549 | 541 |
| | | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust | | |
| | | 0.827% 期日 11/15/2052 | 138,566 | 7,637 |
| | | Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust | | |
| | | 2.641% 期日 02/25/2036 | 18,299 | 13,836 |
| | | Morgan Stanley Dean Witter Capital I Trust | | |
| | | 7.602% 期日 07/15/2033 | 4,175 | 4,384 |
| | | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | |
| | | 2.621% 期日 02/25/2036 | 13,790 | 13,072 |
| | | Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital | | |
| | | 2.511% 期日 07/25/203 | 13,212 | 7,428 |
| | | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | |
| | | 3.681% 期日 11/25/2037 | 2,337 | 1,998 |
| | | 6.000% 期日 12/25/2035 | 974 | 770 |
| | | Morgan Stanley Reremic Trust | | |
| | | 2.376% 期日 11/26/2036 | 12,808 | 12,330 |
| | | Mortgage Loan Trust | | |
| | | 4.870% 期日 03/25/2034 | 3,310 | 3,238 |
| | | Motel 6 Trust | | |
| | | 3.200% 期日 08/15/2034 | 29,871 | 29,888 |
| | | 3.470% 期日 08/15/2034 | 26,197 | 26,213 |
| | | 4.430% 期日 08/15/2034 | 2,707 | 2,714 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) | 通貨 (単位：千) |
| | | Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates | | | | |
| | | 6.450% 期日 01/22/2026 | | 195 | | 198 |
| | | Natixis Commercial Mortgage Securities Trust | | | | |
| | | 3.030% 期日 02/15/2033 | | 9,300 | | 9,305 |
| | | 3.380% 期日 02/15/2033 | | 8,265 | | 8,269 |
| | | 3.790% 期日 11/15/2032 | | 1,400 | | 1,352 |
| | | 4.330% 期日 02/15/2033 | | 3,600 | | 3,607 |
| | | New York Mortgage Trust | | | | |
| | | 2.821% 期日 04/25/2035 | | 1,766 | | 1,713 |
| | | Newgate Funding PLC | | | | |
| | | 0.957% 期日 12/15/2050 | GBP | 22,200 | | 26,022 |
| | | Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust | | | | |
| | | 5.034% 期日 05/25/2035 | USD | 5,014 | | 3,735 |
| | | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | | |
| | | 2.791% 期日 05/25/2035 | | 7,400 | | 7,061 |
| | | 5.745% 期日 10/25/2036 | | 25,528 | | 10,394 |
| | | Nomura Resecuritization Trust | | | | |
| | | 1.535% 期日 03/26/2037 | | 8,819 | | 5,324 |
| | | 3.752% 期日 11/26/2036 | | 3,892 | | 3,900 |
| | | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | |
| | | 2.441% 期日 10/25/2036 | | 7,084 | | 4,473 |
| | | 2.481% 期日 09/25/2037 | | 43,034 | | 41,896 |
| | | 2.601% 期日 05/25/2036 | | 17,302 | | 17,126 |
| | | 3.001% 期日 10/25/2035 | | 2,500 | | 2,416 |
| | | Oncilla Mortgage Funding PLC | | | | |
| | | 2.201% 期日 12/12/2043 | GBP | 10,392 | | 13,395 |
| | | Option One Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.381% 期日 02/25/2037 | USD | 6,524 | | 4,128 |
| | | 2.401% 期日 03/25/2037 | | 18,657 | | 16,938 |
| | | 2.421% 期日 03/25/2037 | | 53,319 | | 48,047 |
| | | Paragon Mortgages No.13 PLC | | | | |
| | | 1.042% 期日 01/15/2039 | GBP | 3,995 | | 4,877 |
| | | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | |
| | | 2.771% 期日 09/25/2035 | USD | 4,713 | | 4,722 |
| | | 2.801% 期日 09/25/2035 | | 25,075 | | 21,813 |
| | | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust | | | | |
| | | 2.441% 期日 09/25/2036 | | 28,896 | | 8,890 |
| | | PPF Ltd. | | | | |
| | | 3.160% 期日 07/14/2035 | | 5,513 | | 5,518 |
| | | 3.530% 期日 07/14/2035 | | 3,139 | | 3,144 |
| | | Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust | | | | |
| | | 2.591% 期日 11/25/2036 | | 11,582 | | 8,407 |
| | | 5.250% 期日 07/25/2035 | | 9,601 | | 7,766 |
| | | Precise Mortgage Funding PLC | | | | |
| | | 1.451% 期日 12/12/2054 | GBP | 6,096 | | 7,753 |
| | | Quest Trust | | | | |
| | | 3.706% 期日 03/25/2035 | USD | 6,060 | | 5,761 |
| | | RAAC Trust | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 2.751% 期日 02/25/2036 | | 6,250 | | 5,964 |
| | | 3.031% 期日 06/25/2047 | | 23,049 | | 16,106 |
| | | RBSGC Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 6.000% 期日 01/25/2037 | | 9 | | 8 |
| | | RBSSP Resecuritization Trust | | | | |
| | | 2.718% 期日 04/26/2037 | | 177 | | 177 |
| | | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | |
| | | 2.641% 期日 11/25/2034 | | 63 | | 59 |
| | | 3.281% 期日 09/25/2037 | | 60 | | 49 |
| | | 5.612% 期日 04/25/2037 | | 10,165 | | 4,854 |
| | | 5.675% 期日 06/25/2037 | | 3,910 | | 1,756 |
| | | Renoir CDO BV | | | | |
| | | 0.532% 期日 10/07/2095 | EUR | 3,624 | | 4,108 |
| | | 1.582% 期日 10/07/2095 | | 5,490 | | 6,212 |
| | | 5.184% 期日 10/07/2095 | | 5,159 | | 5,898 |
| | | Residential Accredited Securities Corporation Trust | | | | |
| | | 2.431% 期日 01/25/2037 | USD | 2,188 | | 2,172 |
| | | 2.441% 期日 11/25/2036 | | 6,969 | | 6,679 |
| | | 2.501% 期日 02/25/2037 | | 14,000 | | 13,029 |
| | | 2.581% 期日 01/25/2037 | | 36,989 | | 21,863 |
| | | 2.611% 期日 04/25/2036 | | 17,500 | | 17,420 |
| | | 2.931% 期日 09/25/2035 | | 7,400 | | 7,350 |
| | | 3.046% 期日 03/25/2034 | | 4,110 | | 4,125 |
| | | 3.856% 期日 04/25/2034 | | 1,804 | | 1,702 |
| | | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | |
| | | 2.501% 期日 10/25/2034 | | 2,267 | | 2,219 |
| | | 2.621% 期日 12/25/2035 | | 17,489 | | 14,949 |
| | | 2.781% 期日 09/25/2035 | | 12,591 | | 12,233 |
| | | 2.941% 期日 10/25/2035 | | 4,024 | | 4,047 |
| | | 2.956% 期日 11/25/2035 | | 13,000 | | 12,817 |
| | | Residential Asset Securitization Trust | | | | |
| | | 5.500% 期日 10/25/2035 | | 4,618 | | 4,387 |
| | | Residential Mortgage Securities 29 PLC | | | | |
| | | 1.754% 期日 12/20/2046 | GBP | 10,233 | | 13,106 |
| | | Residential Mortgage Securities 30 PLC | | | | |
| | | 1.604% 期日 03/20/2050 | | 12,593 | | 16,069 |
| | | Ripon Mortgages PLC | | | | |
| | | 1.605% 期日 08/20/2056 | | 21,413 | | 27,382 |
| | | Rochester Financing No. 2 PLC | | | | |
| | | 2.100% 期日 06/20/2045 | | 8,048 | | 10,357 |
| | | Saxon Asset Securities Trust | | | | |
| | | 3.076% 期日 03/25/2035 | USD | 2,192 | | 2,147 |
| | | 3.331% 期日 06/25/2033 | | 1,280 | | 1,282 |
| | | 4.031% 期日 12/25/2037 | | 6,794 | | 6,811 |
| | | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | |
| | | 2.551% 期日 03/25/2036 | | 9,546 | | 8,872 |
| | | 3.331% 期日 03/25/2035 | | 8,650 | | 8,065 |
| | | Sequoia Mortgage Trust | | | | |
| | | 2.480% 期日 05/20/2035 | | 3,467 | | 3,428 |
| | | 2.800% 期日 06/20/2034 | | 55 | | 53 |
| | | Sestante Finance Srl | | | | |
| | | 0.000% 期日 07/23/2046 | EUR | 13,850 | | 13,458 |
| | | SG Mortgage Securities Trust | | | | |
| | | 2.461% 期日 02/25/2036 | USD | 6,272 | | 4,232 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | Slate No.1 PLC | | | | |
| | | 2.258% 期日 01/24/2051 | GBP | 7,819 | | 10,036 |
| | | 2.658% 期日 01/24/2051 | | 2,600 | | 3,346 |
| | | Slate No.2 PLC | | | | |
| | | 0.000% 期日 10/24/2044 | | 1 | | 13,082 |
| | | Soundview Home Loan Trust | | | | |
| | | 2.521% 期日 07/25/2036 | USD | 24,020 | | 21,948 |
| | | 2.561% 期日 06/25/2036 | | 5,699 | | 2,577 |
| | | 2.591% 期日 06/25/2036 | | 44,153 | | 24,112 |
| | | 2.931% 期日 03/25/2036 | | 8,102 | | 4,735 |
| | | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | | |
| | | 3.256% 期日 12/25/2035 | | 2,649 | | 2,649 |
| | | 3.261% 期日 10/25/2035 | | 3,332 | | 3,280 |
| | | Stonemont Portfolio Trust | | | | |
| | | 3.130% 期日 08/20/2030 | | 26,145 | | 26,152 |
| | | 3.380% 期日 08/20/2030 | | 11,233 | | 11,244 |
| | | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.601% 期日 10/25/2035 | | 9,713 | | 9,131 |
| | | 2.931% 期日 08/25/2035 | | 15,092 | | 13,022 |
| | | 3.346% 期日 05/25/2035 | | 123 | | 106 |
| | | 3.944% 期日 06/25/2037 | | 9,836 | | 9,625 |
| | | 4.997% 期日 07/25/2035 | | 3,721 | | 2,898 |
| | | Structured Asset Investment Loan Trust | | | | |
| | | 2.431% 期日 06/25/2036 | | 13,010 | | 12,660 |
| | | 3.001% 期日 04/25/2035 | | 4,440 | | 4,455 |
| | | 3.081% 期日 02/25/2034 | | 33,062 | | 33,127 |
| | | 3.481% 期日 12/25/2034 | | 10,983 | | 10,999 |
| | | Structured Asset Mortgage Investments II Trust | | | | |
| | | 2.491% 期日 09/25/2047 | | 39,499 | | 39,079 |
| | | 2.957% 期日 04/19/2035 | | 4,262 | | 4,146 |
| | | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | | |
| | | 2.942% 期日 09/19/2032 | | 58 | | 57 |
| | | Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.411% 期日 05/25/2036 | | 15,978 | | 15,254 |
| | | 2.531% 期日 05/25/2036 | | 5,945 | | 5,327 |
| | | 2.541% 期日 04/25/2036 | | 999 | | 994 |
| | | 2.591% 期日 07/25/2036 | | 38,871 | | 37,921 |
| | | 2.781% 期日 04/25/2031 | | 8,945 | | 8,833 |
| | | 3.211% 期日 11/25/2035 | | 19,865 | | 19,844 |
| | | Sutherland Commercial Mortgage Loans | | | | |
| | | 3.192% 期日 05/25/2037 | | 1,992 | | 1,998 |
| | | Taurus CMBS UK DAC | | | | |
| | | 2.202% 期日 05/01/2022 | GBP | 661 | | 845 |
| | | Taurus UK DAC | | | | |
| | | 1.654% 期日 11/17/2027 | | 11,540 | | 14,728 |
| | | Terwin Mortgage Trust | | | | |
| | | 3.661% 期日 03/25/2035 | USD | 2,436 | | 2,345 |
| | | Theatre Hospitals No.1 PLC | | | | |
| | | 3.813% 期日 10/15/2031 | GBP | 1,410 | | 1,679 |
| | | Theatre Hospitals No.2 PLC | | | | |
| | | 3.813% 期日 10/15/2031 | | 663 | | 792 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----------------|----|--|------|--------|----|-----------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | Trinidad Mortgage Securities PLC | | | | |
| | | 1.608% 期日 01/24/2059 | | 38,949 | | 49,538 |
| | | Trinity Square PLC | | | | |
| | | 1.963% 期日 07/15/2051 | | 596 | | 766 |
| | | Truman Capital Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 2.541% 期日 03/25/2036 | USD | 3,171 | | 3,120 |
| | | Twin Bridges PLC | | | | |
| | | 1.582% 期日 09/12/2044 | GBP | 17,572 | | 22,433 |
| | | VOLT LX LLC | | | | |
| | | 3.250% 期日 06/25/2047 | USD | 18,745 | | 18,642 |
| | | VOLT LXIV LLC | | | | |
| | | 3.375% 期日 10/25/2047 | | 3,493 | | 3,473 |
| | | Waldorf Astoria Boca Raton Trust | | | | |
| | | 3.630% 期日 06/15/2029 | | 6,100 | | 6,107 |
| | | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| | | 3.001% 期日 01/25/2045 | | 153 | | 148 |
| | | Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC | | | | |
| | | 0.000% 期日 12/31/2049 | GBP | 1 | | 571 |
| | | 0.000% 期日 12/31/2049 | | 1 | | 3,557 |
| | | 1.604% 期日 12/21/2049 | | 50,326 | | 63,924 |
| | | 2.304% 期日 12/21/2049 | | 4,921 | | 6,301 |
| | | 2.804% 期日 12/21/2049 | | 2,460 | | 3,156 |
| | | 3.304% 期日 12/21/2049 | | 1,406 | | 1,804 |
| | | 3.804% 期日 12/21/2049 | | 1,406 | | 1,807 |
| | | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust | | | | |
| | | 2.796% 期日 10/25/2046 | USD | 19,587 | | 13,981 |
| | | 5.500% 期日 11/25/2035 | | 135 | | 126 |
| | | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | | |
| | | 2.491% 期日 03/25/2037 | | 2,671 | | 2,548 |
| | | 2.551% 期日 07/25/2036 | | 10,000 | | 9,876 |
| | | Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | |
| | | 2.581% 期日 04/25/2034 | | 7,703 | | 7,547 |
| | | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | | |
| | | 4.345% 期日 05/25/2036 | | 24,548 | | 24,941 |
| | | 4.737% 期日 10/25/2036 | | 4,469 | | 4,510 |
| | | 4.739% 期日 10/25/2036 | | 515 | | 495 |
| | | WFCG Commercial Mortgage Trust | | | | |
| | | 6.000% 期日 11/15/2029 | | 3,455 | | 3,451 |
| | | WFRBS Commercial Mortgage Trust | | | | |
| | | 0.431% 期日 03/15/2047 | | 8,800 | | 203 |
| | | モーゲージ証券合計 (原価4,322,419米ドル) | | | | 4,334,529 |
| 資産担保証券 7.9% | | AASET Trust | | | | |
| | | 3.967% 期日 05/16/2042 | | 439 | | 435 |
| | | Aircraft Certificate Owner Trust | | | | |
| | | 7.001% 期日 09/20/2022 | | 564 | | 578 |
| | | American Homes 4 Rent Trust | | | | |
| | | 6.231% 期日 10/17/2036 | | 1,150 | | 1,237 |
| | | Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 3.270% 期日 08/15/2027 | | 7,960 | | 7,974 |
| | | Avant Loans Funding Trust | | | | |
| | | 2.290% 期日 06/15/2020 | | 386 | | 385 |
| | | Avery Point III CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.565% 期日 01/18/2025 | | 2,024 | | 2,027 |
| | | B&M CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.166% 期日 04/16/2026 | | 14,726 | | 14,716 |
| | | BFNS | | | | |
| | | 3.994% 期日 01/25/2029 | | 55,050 | | 55,028 |
| | | Black Diamond CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.499% 期日 02/06/2026 | | 6,329 | | 6,335 |
| | | BSPRT Issuer Ltd. | | | | |
| | | 3.330% 期日 03/15/2028 | | 17,350 | | 17,392 |
| | | 4.830% 期日 03/15/2028 | | 8,960 | | 9,011 |
| | | 5.730% 期日 03/15/2028 | | 4,050 | | 4,085 |
| | | Business Loan Express Business Loan Trust | | | | |
| | | 2.571% 期日 09/25/2038 | | 2,479 | | 2,363 |
| | | 2.831% 期日 09/25/2038 | | 1,202 | | 1,119 |
| | | 3.381% 期日 09/25/2038 | | 87 | | 82 |
| | | Cairn CLO III BV | | | | |
| | | 0.650% 期日 10/20/2028 | EUR | 9,400 | | 10,639 |
| | | Cairn CLO VI BV | | | | |
| | | 0.790% 期日 07/25/2029 | | 5,520 | | 6,261 |
| | | Capitalsource Real Estate Loan Trust | | | | |
| | | 2.859% 期日 01/20/2037 | USD | 7,962 | | 7,962 |
| | | 2.981% 期日 01/20/2037 | | 16,100 | | 15,448 |
| | | 3.081% 期日 01/20/2037 | | 4,800 | | 4,534 |
| | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | |
| | | 0.664% 期日 08/15/2027 | EUR | 7,400 | | 8,394 |
| | | Castlelake Aircraft Securitization Trust | | | | |
| | | 4.125% 期日 06/15/2043 | USD | 3,710 | | 3,693 |
| | | Catamaran CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.359% 期日 01/27/2028 | | 7,200 | | 7,177 |
| | | Cavendish Square Funding PLC | | | | |
| | | 0.281% 期日 02/11/2055 | EUR | 1,143 | | 1,288 |
| | | 0.621% 期日 02/11/2055 | | 1,500 | | 1,657 |
| | | CPS Auto Receivables Trust | | | | |
| | | 1.870% 期日 03/15/2021 | USD | 598 | | 596 |
| | | Crown Point CLO 5 Ltd. | | | | |
| | | 3.389% 期日 07/17/2028 | | 6,300 | | 6,300 |
| | | Denali Capital CLO X LLC | | | | |
| | | 3.558% 期日 10/26/2027 | | 11,000 | | 11,004 |
| | | Dryden 35 Euro CLO BV | | | | |
| | | 0.679% 期日 05/17/2027 | EUR | 17,285 | | 19,607 |
| | | Emerson Park CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.636% 期日 07/15/2025 | USD | 13,030 | | 13,042 |
| | | Euromax VI ABS Ltd. | | | | |
| | | 0.000% 期日 04/18/2097 | EUR | 65 | | 73 |
| | | FAB CBO BV | | | | |
| | | 0.734% 期日 08/20/2080 | | 500 | | 521 |
| | | FAB UK Ltd. | | | | |
| | | 1.250% 期日 12/06/2045 | GBP | 2,104 | | 2,571 |
| | | Figueroa CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.188% 期日 06/20/2027 | USD | 19,900 | | 19,906 |
| | | Gateway Casinos & Entertainment Ltd. | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|--|------|--------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 5.000% 期日 03/12/2038 | CAD | 9,227 | | 6,910 |
| | | Goodgreen | | | | |
| | | 3.930% 期日 10/15/2053 | USD | 10,618 | | 10,546 |
| | | Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. | | | | |
| | | 3.543% 期日 08/01/2025 | | 2,538 | | 2,542 |
| | | 3.569% 期日 10/22/2025 | | 5,800 | | 5,800 |
| | | Harley Marine Financing LLC | | | | |
| | | 5.682% 期日 05/15/2043 | | 5,826 | | 5,397 |
| | | JMP Credit Advisors CLO IIIIR Ltd. | | | | |
| | | 3.299% 期日 01/17/2028 | | 32,994 | | 32,996 |
| | | LP Credit Card Asset-Backed Securities Master Trust | | | | |
| | | 3.830% 期日 08/20/2024 | | 7,922 | | 7,926 |
| | | METAL LLC | | | | |
| | | 4.581% 期日 10/15/2042 | | 17,295 | | 17,228 |
| | | MMcapS Funding XVII Ltd. | | | | |
| | | 2.671% 期日 12/01/2035 | | 1,063 | | 1,041 |
| | | Monarch Grove CLO | | | | |
| | | 3.370% 期日 01/25/2028 | | 20,900 | | 20,832 |
| | | National Collegiate Student Loan Trust | | | | |
| | | 2.456% 期日 07/25/2030 | | 2,718 | | 2,682 |
| | | 2.491% 期日 11/25/2027 | | 791 | | 790 |
| | | 2.557% 期日 03/26/2029 | | 19,012 | | 18,797 |
| | | 2.571% 期日 10/25/2033 | | 19,278 | | 18,657 |
| | | 2.753% 期日 06/25/2029 | | 4,962 | | 4,914 |
| | | Navient Private Education Loan Trust | | | | |
| | | 4.430% 期日 12/15/2045 | | 8,205 | | 8,569 |
| | | Navient Student Loan Trust | | | | |
| | | 3.437% 期日 03/25/2066 | | 2,649 | | 2,697 |
| | | Nelnet Student Loan Trust | | | | |
| | | 2.881% 期日 03/25/2030 | | 7,815 | | 7,863 |
| | | 3.081% 期日 09/25/2065 | | 5,641 | | 5,695 |
| | | 3.270% 期日 07/27/2048 | | 4,293 | | 4,335 |
| | | OCP CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.299% 期日 04/17/2027 | | 16,800 | | 16,810 |
| | | 3.328% 期日 10/26/2027 | | 25,200 | | 25,207 |
| | | Octagon Investment Partners XXIII Ltd. | | | | |
| | | 3.286% 期日 07/15/2027 | | 25,300 | | 25,306 |
| | | Pangaea ABS SPV | | | | |
| | | 0.041% 期日 12/28/2096 | EUR | 79 | | 90 |
| | | 0.151% 期日 12/28/2096 | | 9,900 | | 11,084 |
| | | Penta CLO 2 BV | | | | |
| | | 0.790% 期日 08/04/2028 | | 16,600 | | 18,825 |
| | | Sapphire Aviation Finance | | | | |
| | | 4.250% 期日 03/15/2040 | USD | 34,535 | | 34,601 |
| | | Saranac CLO III Ltd. | | | | |
| | | 3.466% 期日 06/22/2030 | | 27,300 | | 27,327 |
| | | SCF RC Funding II LLC | | | | |
| | | 4.100% 期日 06/25/2047 | | 4,605 | | 4,510 |
| | | Securitized Term Auto Receivables Trust | | | | |
| | | 1.775% 期日 01/27/2020 | | 723 | | 722 |
| | | SLM Private Credit Student Loan Trust | | | | |
| | | 2.534% 期日 06/15/2023 | | 5,300 | | 5,294 |
| | | Sofi Consumer Loan Program LLC | | | | |
| | | 2.770% 期日 05/25/2026 | | 2,134 | | 2,114 |
| | | SoFi Professional Loan Program LLC | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|-------|----|---|------|--------|----|---------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 2.650% 期日 09/25/2040 | | 3,200 | | 3,099 |
| | | Sorrento Park CLO DAC | | | | |
| | | 0.631% 期日 11/16/2027 | EUR | 21,650 | | 24,531 |
| | | Spirit Master Funding LLC | | | | |
| | | 4.360% 期日 12/20/2047 | USD | 20,143 | | 19,997 |
| | | SpringCastle America Funding LLC | | | | |
| | | 3.050% 期日 04/25/2029 | | 2,012 | | 1,999 |
| | | Springleaf Funding Trust | | | | |
| | | 2.680% 期日 07/15/2030 | | 22,700 | | 22,234 |
| | | St Paul's CLO VI DAC | | | | |
| | | 0.850% 期日 08/20/2030 | EUR | 3,600 | | 4,084 |
| | | Starwood Waypoint Homes Trust | | | | |
| | | 3.230% 期日 01/17/2035 | USD | 11,702 | | 11,690 |
| | | 3.450% 期日 01/17/2035 | | 1,400 | | 1,400 |
| | | 3.680% 期日 01/17/2035 | | 4,727 | | 4,732 |
| | | 4.230% 期日 01/17/2035 | | 8,600 | | 8,643 |
| | | Taberna Preferred Funding I Ltd. | | | | |
| | | 2.807% 期日 07/05/2035 | | 2,680 | | 2,546 |
| | | 2.878% 期日 07/05/2035 | | 6,641 | | 6,309 |
| | | Telos CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.399% 期日 04/17/2028 | | 24,100 | | 24,099 |
| | | 3.719% 期日 01/17/2027 | | 17,200 | | 17,220 |
| | | Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. | | | | |
| | | 4.212% 期日 05/17/2032 | | 800 | | 800 |
| | | TICP CLO III-2 Ltd. | | | | |
| | | 3.309% 期日 04/20/2028 | | 33,600 | | 33,530 |
| | | Tikehau CLO BV | | | | |
| | | 0.600% 期日 08/04/2028 | EUR | 1,600 | | 1,815 |
| | | Tralee CLO V Ltd. | | | | |
| | | 3.869% 期日 10/20/2028 | USD | 5,250 | | 5,250 |
| | | Tropic CDO V Ltd. | | | | |
| | | 2.756% 期日 07/15/2036 | | 13,458 | | 12,382 |
| | | TruPS Financials Note Securitization Ltd. | | | | |
| | | 3.566% 期日 03/30/2039 | | 25,178 | | 24,926 |
| | | 3.908% 期日 09/20/2039 | | 6,417 | | 6,417 |
| | | 4.299% 期日 04/20/2038 | | 5,814 | | 5,872 |
| | | Venture XVII CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.316% 期日 04/15/2027 | | 36,720 | | 36,545 |
| | | Vertical Bridge CC LLC | | | | |
| | | 5.193% 期日 10/15/2046 | | 391 | | 393 |
| | | Z Capital Credit Partners CLO Ltd. | | | | |
| | | 3.386% 期日 07/16/2027 | | 35,115 | | 35,061 |
| | | 資産担保証券合計 | | | | 937,121 |
| | | (原価：934,287米ドル) | | | | |
| ソブリン債 | | Abu Dhabi Government International Bond | | | | |
| 3.9% | | 2.500% 期日 10/11/2022 | | 9,700 | | 9,315 |
| | | 3.125% 期日 10/11/2027 | | 30,800 | | 28,667 |
| | | 4.125% 期日 10/11/2047 | | 6,100 | | 5,660 |
| | | Argentina Bocon | | | | |
| | | 41.328% 期日 10/04/2022 | ARS | 1,070 | | 50 |
| | | Argentina Government International Bond | | | | |
| | | 2.260% 期日 12/31/2038 | EUR | 10,385 | | 6,622 |
| | | 2.500% 期日 12/31/2038 | USD | 22,724 | | 12,742 |
| | | 3.375% 期日 01/15/2023 | EUR | 7,700 | | 7,327 |
| | | 3.875% 期日 01/15/2022 | | 10,500 | | 10,679 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|----|---------------------------------------|------|---------|----|--------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 4.625% 期日 01/11/2023 | USD | 17,714 | | 15,024 |
| | | 5.250% 期日 01/15/2028 | EUR | 1,200 | | 1,049 |
| | | 5.625% 期日 01/26/2022 | USD | 15,410 | | 13,888 |
| | | 5.875% 期日 01/11/2028 | | 12,900 | | 9,965 |
| | | 6.250% 期日 04/22/2019 | | 1,650 | | 1,663 |
| | | 6.250% 期日 11/09/2047 | EUR | 900 | | 758 |
| | | 6.875% 期日 01/26/2027 | USD | 5,000 | | 4,178 |
| | | 6.875% 期日 01/11/2048 | | 900 | | 664 |
| | | 7.125% 期日 07/06/2036 | | 7,100 | | 5,431 |
| | | 7.500% 期日 04/22/2026 | | 4,750 | | 4,156 |
| | | 7.820% 期日 12/31/2033 | EUR | 21,712 | | 22,307 |
| | | 49.933% 期日 03/01/2020 | ARS | 28,000 | | 841 |
| | | 50.575% 期日 03/11/2019 | | 17,936 | | 533 |
| | | 52.756% 期日 04/03/2022 | | 772,656 | | 22,080 |
| | | Argentina POM Politica Monetaria | | | | |
| | | 68.593% 期日 06/21/2020 | | 903,382 | | 30,280 |
| | | Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| | | 4.900% 期日 09/15/2021 | EUR | 1,350 | | 1,646 |
| | | 4.950% 期日 02/11/2020 | | 250 | | 297 |
| | | 6.350% 期日 11/30/2041 | | 250 | | 364 |
| | | Corp. Andina de Fomento | | | | |
| | | 3.950% 期日 10/15/2021 | MXN | 736 | | 35 |
| | | Corp. Financiera de Desarrollo S.A. | | | | |
| | | 3.250% 期日 07/15/2019 | USD | 7,000 | | 7,003 |
| | | Croatia Government International Bond | | | | |
| | | 6.750% 期日 11/05/2019 | | 12,900 | | 13,310 |
| | | Export-Import Bank of India | | | | |
| | | 2.750% 期日 08/12/2020 | | 630 | | 618 |
| | | 3.875% 期日 10/02/2019 | | 200 | | 201 |
| | | Greece Government International Bond | | | | |
| | | 4.750% 期日 04/17/2019 | EUR | 14,004 | | 16,142 |
| | | Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | | | |
| | | 3.917% 期日 02/26/2019 | USD | 470 | | 471 |
| | | KSA Sukuk Ltd. | | | | |
| | | 2.894% 期日 04/20/2022 | | 5,200 | | 5,028 |
| | | Kuwait International Government Bond | | | | |
| | | 2.750% 期日 03/20/2022 | | 4,460 | | 4,343 |
| | | 3.500% 期日 03/20/2027 | | 13,800 | | 13,434 |
| | | Peru Government International Bond | | | | |
| | | 5.700% 期日 08/12/2024 | PEN | 13,000 | | 3,988 |
| | | 6.150% 期日 08/12/2032 | | 46,805 | | 13,810 |
| | | 8.200% 期日 08/12/2026 | | 12,400 | | 4,307 |
| | | Qatar Government International Bond | | | | |
| | | 3.875% 期日 04/23/2023 | USD | 10,300 | | 10,338 |
| | | 4.500% 期日 04/23/2028 | | 3,200 | | 3,272 |
| | | 5.103% 期日 04/23/2048 | | 5,600 | | 5,698 |
| | | Russia Government International Bond | | | | |
| | | 3.500% 期日 01/16/2019 | | 1,400 | | 1,401 |
| | | 5.000% 期日 04/29/2020 | | 700 | | 713 |
| | | Saudi Government International Bond | | | | |
| | | 2.375% 期日 10/26/2021 | | 3,500 | | 3,349 |
| | | 2.875% 期日 03/04/2023 | | 8,200 | | 7,807 |
| | | 4.000% 期日 04/17/2025 | | 61,000 | | 60,007 |
| | | 4.500% 期日 04/17/2030 | | 21,500 | | 21,233 |
| | | 4.500% 期日 10/26/2046 | | 4,100 | | 3,728 |
| | | 4.625% 期日 10/04/2047 | | 6,400 | | 5,888 |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | |
|---------|--------|---|------------|-----------|
| | | | 通貨 (単位：千) | 時価 (単位：千) |
| | | 5.000% 期日 04/17/2049 | 14,400 | 13,859 |
| | | Serbia Government International Bond | | |
| | | 4.875% 期日 02/25/2020 | 4,500 | 4,543 |
| | | 7.250% 期日 09/28/2021 | 4,300 | 4,645 |
| | | Tanzania Government International Bond | | |
| | | 8.544% 期日 03/09/2020 | 500 | 513 |
| | | Turkey Government International Bond | | |
| | | 5.625% 期日 03/30/2021 | 4,700 | 4,593 |
| | | 7.500% 期日 11/07/2019 | 900 | 912 |
| | | Ukraine Government International Bond | | |
| | | 7.750% 期日 09/01/2023 | 4,390 | 4,188 |
| | | Venezuela Government International Bond | | |
| | | 6.000% 期日 12/09/2020 | 3,367 | 842 |
| | | 7.000% 期日 03/31/2038 | 1,883 | 467 |
| | | 7.650% 期日 04/21/2025 | 5,349 | 1,371 |
| | | 7.750% 期日 10/13/2019 | 1,200 | 302 |
| | | 8.250% 期日 10/13/2024 | 5,591 | 1,426 |
| | | 9.000% 期日 05/07/2023 | 3,161 | 814 |
| | | 9.250% 期日 09/15/2027 | 4,274 | 1,101 |
| | | 9.250% 期日 05/07/2028 | 6,512 | 1,661 |
| | | 11.750% 期日 10/21/2026 | 680 | 176 |
| | | 11.950% 期日 08/05/2031 | 500 | 129 |
| | | ソブリン債合計 | | 463,852 |
| | | (原価：528,831米ドル) | | |
| | | | 株式数 | |
| 普通株式 | | Caesars Entertainment Corp. | 1,078,632 | 9,265 |
| 0.2% | | Eurobank Ergasias S.A. | 10,169,333 | 6,858 |
| | | National Bank of Greece S.A. | 102,570 | 178 |
| | | Towergate Finance PLC | 1,237,781 | 1,993 |
| | | 普通株式合計 | | 18,294 |
| | | (原価：22,559米ドル) | | |
| 商業不動産株式 | | VICI Properties, Inc. | 760,482 | 16,419 |
| 0.1% | | 商業不動産株式合計 | | 16,419 |
| | | (原価：5,574米ドル) | | |
| 株式リンク証券 | | Sequa Corp. | | |
| 0.0% | | 04/28/2024 | 42,000 | 4 |
| | | 株式リンク証券合計 | | 4 |
| | | (原価：0米ドル) | | |
| 優先証券 | | Nationwide Building Society | | |
| 0.2% | | 10.250% | 75,650 | 14,257 |
| | | Sequa Corp. | | |
| | | 9.000% | 862 | 636 |
| | | Stichting AK Rabobank Certificaten | | |
| | | 6.500% | 17,310 | 2,217 |
| | | 優先証券合計 | | 17,110 |
| | | (原価：19,068米ドル) | | |
| 短期証券 | 銀行引受手形 | Bank of Montreal | 元本金額 | |
| 3.3% | 0.4% | 0.000% 期日 12/03/2018 | CAD 3,820 | 2,904 |
| | | 1.735% 期日 11/01/2018 | 19,000 | 14,467 |
| | | FirstBank | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|------|-------|---|------|-----------|----|----------------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 1.982% 期日 11/30/2018 | | 4,580 | | 3,482 |
| | | HSBC Bank Canada | | | | |
| | | 1.752% 期日 11/02/2018 | | 9,800 | | 7,462 |
| | | 2.017% 期日 11/28/2018 | | 3,620 | | 2,753 |
| | | Royal Bank of Canada | | | | |
| | | 1.747% 期日 11/05/2018 | | 3,800 | | 2,893 |
| | | 1.991% 期日 11/30/2018 | | 4,580 | | 3,483 |
| | | TD Bank | | | | |
| | | 1.727% 期日 11/05/2018 | | 6,900 | | 5,253 |
| | | 1.739% 期日 11/01/2018 | | 6,400 | | 4,873 |
| | | 1.957% 期日 11/30/2018 | | 520 | | 395 |
| | | | | | | <u>47,965</u> |
| | 手形 | Keurig Dr Pepper | | | | |
| 0.0% | | 2.486% 期日 11/02/2018 | USD | 1,500 | | 1,500 |
| | | | | | | <u>1,500</u> |
| | 短期債券 | Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER | | | | |
| 0.1% | | 3.750% 期日 02/08/2019 | ARS | 3,110 | | 113 |
| | | Harris Corp. | | | | |
| | | 2.786% 期日 02/27/2019 | USD | 6,800 | | 6,803 |
| | | | | | | <u>6,916</u> |
| | レポ取引 | | | | | |
| 1.3% | | | | | | <u>157,400</u> |
| | 定期性預金 | Bank of Nova Scotia | | | | |
| 0.6% | | 1.690% 期日 11/01/2018 | | 967 | | 967 |
| | | Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | | | | |
| | | (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | 1,168,895 | | 10,358 |
| | | Brown Brothers Harriman & Co. | | | | |
| | | (0.800%) 期日 11/01/2018 | DKK | 4,634 | | 704 |
| | | (0.800%) 期日 11/01/2018 | SEK | 1 | | 0 |
| | | (0.570%) 期日 11/01/2018 | EUR | 30 | | 34 |
| | | (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | 586 | | 5 |
| | | 0.360% 期日 11/01/2018 | GBP | 36 | | 46 |
| | | 0.770% 期日 11/01/2018 | AUD | 59 | | 42 |
| | | 0.850% 期日 11/01/2018 | CAD | 1 | | 1 |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 5 | | 5 |
| | | 5.190% 期日 11/01/2018 | ZAR | 6,355 | | 430 |
| | | Citibank N.A. | | | | |
| | | (0.570%) 期日 11/01/2018 | EUR | 333 | | 378 |
| | | 0.360% 期日 11/01/2018 | GBP | 611 | | 780 |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 4,033 | | 4,033 |
| | | DBS Bank Ltd. | | | | |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | | 1,039 | | 1,039 |
| | | HSBC Bank | | | | |
| | | (0.570%) 期日 11/01/2018 | EUR | 740 | | 838 |
| | | 0.360% 期日 11/01/2018 | GBP | 653 | | 834 |
| | | JPMorgan Chase & Co. | | | | |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 8,577 | | 8,577 |
| | | National Australia Bank Ltd. | | | | |
| | | 0.770% 期日 11/01/2018 | AUD | 8,679 | | 6,151 |
| | | Royal Bank of Canada | | | | |

りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) 【愛称：ボンドマスター2016-09 (為替ヘッジなし)】

| 種類 | 業種 | 銘柄 | 額面金額 | | 時価 | |
|----|--------------------|---------------------------------|------|-----------|-----|--------------------|
| | | | 通貨 | (単位：千) | 通貨 | (単位：千) |
| | | 0.850% 期日 11/01/2018 | CAD | 12 | | 9 |
| | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | |
| | | (0.570%) 期日 11/01/2018 | EUR | 684 | | 775 |
| | | (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | 258,864 | | 2,294 |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 9,870 | | 9,870 |
| | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | |
| | | (0.570%) 期日 11/01/2018 | EUR | 3,591 | | 4,069 |
| | | (0.300%) 期日 11/01/2018 | JPY | 1,098,902 | | 9,737 |
| | | 1.690% 期日 11/01/2018 | USD | 7,668 | | 7,668 |
| | | | | | | <u>69,644</u> |
| | アルゼンチン短期国債 | 54.730% 期日 12/28/2018 | ARS | 1,054,643 | | 31,076 |
| | 0.5% | 43.066% 期日 11/21/2018 | | 41,672 | | 1,125 |
| | | 50.008% 期日 03/29/2019 | | 179,403 | | 5,040 |
| | | 50.031% 期日 01/31/2019 | | 266,914 | | 7,794 |
| | | 51.669% 期日 04/30/2019 | | 10,025 | | 284 |
| | | 55.179% 期日 02/28/2019 | | 533,901 | | 15,559 |
| | | | | | | <u>60,878</u> |
| | ギリシャ短期国債 | 0.697% 期日 11/02/2018 | EUR | 8,630 | | 9,778 |
| | 0.3% | 1.250% 期日 03/15/2019 | | 21,996 | | 24,846 |
| | | | | | | <u>34,624</u> |
| | ナイジェリア 公開市場操作国債 | 13.096% 期日 01/10/2019 | NGN | 248,200 | | 667 |
| | 0.0% | | | | | <u>667</u> |
| | ナイジェリア短期国債 | 12.708% 期日 11/01/2018 | | 546,100 | | 1,504 |
| | 0.1% | 12.718% 期日 12/13/2018 | | 591,100 | | 1,605 |
| | | 13.096% 期日 01/17/2019 | | 620,000 | | 1,663 |
| | | 13.536% 期日 01/31/2019 | | 625,950 | | 1,672 |
| | | 15.662% 期日 11/29/2018 | | 837,600 | | 2,287 |
| | | | | | | <u>8,731</u> |
| | | 短期証券合計 | | | | <u>388,325</u> |
| | | (原価：389,192米ドル) | | | | |
| | | 投資有価証券合計 110.5% | | | USD | 13,026,164 |
| | | (原価：13,230,824米ドル) | | | | |
| | | 金融デリバティブ商品 0.5% | | | | 61,940 |
| | | (原価またはプレミアム(純額)(44,560)米ドル) | | | | |
| | | その他の資産および負債 (純額) (11.0%) | | | | <u>(1,299,588)</u> |
| | | 純資産 100.0% | | | USD | <u>11,788,516</u> |

マネー・オープン・マザーファンド

第7期 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限 (設定日: 2012年7月27日) |
| 運用方針 | 主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 債券組入比率 | 純資産総額 |
|----------------|--------|-------|--------|-------|
| | 円 | 期中騰落率 | | |
| 3期 (2015年3月2日) | 10,021 | 0.1 | 98.6 | 75 |
| 4期 (2016年3月1日) | 10,025 | 0.0 | 83.9 | 75 |
| 5期 (2017年3月1日) | 10,016 | △0.1 | 69.8 | 75 |
| 6期 (2018年3月1日) | 10,009 | △0.1 | 72.4 | 75 |
| 7期 (2019年3月1日) | 10,002 | △0.1 | 72.4 | 75 |

※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を記載しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

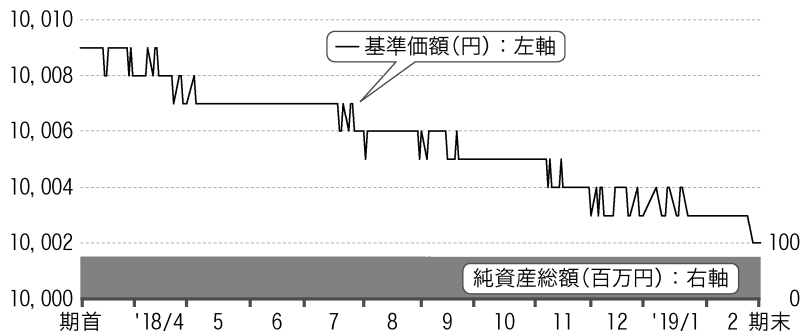
| 年月日 | 基準価額 | | 債券組入率 |
|-------------------|--------|------|-------|
| | 円 | 騰落率 | |
| (期首) 2018年3月1日 | 10,009 | — | 72.4 |
| 3月末 | 10,008 | △0.0 | 72.3 |
| 4月末 | 10,007 | △0.0 | 72.5 |
| 5月末 | 10,007 | △0.0 | 72.4 |
| 6月末 | 10,007 | △0.0 | 72.3 |
| 7月末 | 10,006 | △0.0 | 72.5 |
| 8月末 | 10,006 | △0.0 | 72.4 |
| 9月末 | 10,005 | △0.0 | 72.4 |
| 10月末 | 10,005 | △0.0 | 72.3 |
| 11月末 | 10,003 | △0.1 | 72.4 |
| 12月末 | 10,003 | △0.1 | 72.4 |
| 2019年1月末 | 10,003 | △0.1 | 72.3 |
| 2月末 | 10,002 | △0.1 | 53.6 |
| (期末) 2019年3月1日 | 10,002 | △0.1 | 72.4 |

※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 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 10,009円 |
| 期末 | 10,002円 |
| 騰落率 | -0.1% |

▶ 基準価額の主な変動要因 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

当期の短期金利は小幅上昇しましたが、マイナス圏での推移は継続しました。

物価上昇率が目標とする2%まで乖離がある状態が続いたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

日銀は需給動向を勘案しながら短期国債の買入れを調整したことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りはマイナス圏でのレンジ推移となりました。国庫短期証券3ヵ月物利回りは期首-0.200%に対し、期末には-0.180%へ小幅上昇しました。

▶ ポートフォリオについて (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、残存0年から1年3カ月の円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを継続しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2018年3月2日から2019年3月1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

日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナス圏で推移しています。

残存0年から1年3カ月の公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 1円 (1) | 0.009% (0.009) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 1 | 0.009 | |

期中の平均基準価額は10,005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。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|---------|--------------|---------------------|
| 国内 | 特 殊 債 券 | 千円 54,813 | 千円 - (54,000) |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※()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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年3月2日から2019年3月1日まで)

当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
(2018年3月2日から2019年3月1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 (2019年3月1日現在)

公社債

A 債券種類別開示／国内(邦貨建)公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------|---------------|---------------|---------------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 特 殊 債 券 (除 く 金 融 債) | 千円 54,000 (54,000) | 千円 54,480 (54,480) | % 72.4 (72.4) | % — (—) | % — (—) | % — (—) | % 72.4 (72.4) |
| 合 計 | 54,000 (54,000) | 54,480 (54,480) | 72.4 (72.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 72.4 (72.4) |

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※一印は組入れなし。

B 個別銘柄開示／国内(邦貨建)公社債

| 種 類 | 銘 柄 | 期 | | 末 | |
|--------------------------|----------------------------|-----|--------------|--------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特 殊 債 券 (除 く 金 融 債) | 第5回 政府保証阪神高速道路債券 | 1.3 | 千円 14,000 | 千円 14,196 | 2020/3/18 |
| | 第8回 政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 1.5 | 12,000 | 12,042 | 2019/5/24 |
| | 第95回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.2 | 14,000 | 14,143 | 2019/12/27 |
| | 第3回 政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.5 | 14,000 | 14,099 | 2019/8/16 |
| 合 計 | 計 | — | 54,000 | 54,480 | — |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 投資信託財産の構成

(2019年3月1日現在)

| 項 目 | 期 | | 末 | |
|-------------------------|--------------|-----------|--------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 54,480 | % 60.9 | 千円 34,916 | % 39.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 34,916 | 39.1 | 89,396 | 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 89,396 | 100.0 | | |

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年3月1日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-------------------------------|-------------|
| (A) 資 産 | 89,396,861円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 34,735,145 |
| 公 社 債 (評 価 額) | 54,480,980 |
| 未 収 利 息 | 180,736 |
| (B) 負 債 | 14,197,033 |
| 未 払 金 | 14,196,700 |
| 未 払 利 息 | 28 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 305 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 75,199,828 |
| 元 本 | 75,182,674 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 17,154 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 75,182,674口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 10,002円 |

※当期における期首元本額75,202,622円、期中追加設定元本額21,899,061円、期中一部解約元本額21,919,009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。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|---------------------------------------|-------------|
| アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型 (通貨アクティブヘッジコース) | 8,100,949円 |
| メキシコ債券ファンド (毎月分配型) | 9,994,004円 |
| メキシコ債券ファンド (資産成長型) | 4,997,002円 |
| 日興エドモンドゥ・ロスチャイルド・ラグジュアリーファンド | 29,982,011円 |
| SMBC・日興資産成長ナビゲーション | 2,798,587円 |
| アジア・ハイイールド債券ファンド毎月分配型 (ヘッジなしコース) | 29,944円 |
| 三井住友・グローバルC B戦略ファンド (為替ヘッジあり) | 419,777円 |
| 三井住友・グローバルC B戦略ファンド (為替ヘッジなし) | 299,837円 |
| ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド (為替ヘッジなし) | 1,589,191円 |
| ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド (限定為替ヘッジ) | 269,851円 |
| あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-02 | 619,672円 |
| あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-05 | 969,499円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-05 (為替ヘッジあり) | 1,759,104円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-05 (為替ヘッジなし) | 529,719円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジあり) | 5,797,087円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09 (為替ヘッジなし) | 409,781円 |
| あしぎん世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-09 | 1,039,466円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-12 (為替ヘッジあり) | 5,027,477円 |
| りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-12 (為替ヘッジなし) | 549,716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2018年3月2日 至2019年3月1日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-----------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 767,137円 |
| 受 取 利 息 | 782,355 |
| 支 払 利 息 | △ 15,218 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 810,520 |
| 売 買 損 益 | △ 810,520 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 6,565 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 49,948 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 67,122 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 10,939 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 10,959 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 17,154 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 17,154 |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※信託報酬等には、保管費用等を含めて表示しています。

※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。

※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>

一般社団法人投資信託協会規則の「信用リスク集中回避のための投資制限」に適合するよう、所要の変更を行いました。(適用日：2018年3月23日)