

ハイ・イールド ボンド オープン Aコース／Bコース

運用報告書(全体版)

第43期（決算日2016年9月28日）

作成対象期間（2016年3月29日～2016年9月28日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

	Aコース	Bコース
商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	1995年3月29日から2020年3月30日までです。	
運用方針	主としてハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド受益証券に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 実質外貨建て資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
主な投資対象	ハイ・イールド ボンド オープン Aコース/Bコース	実質外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資制限	ハイ・イールド ボンド オープン マザーファンド	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、債券に直接投資する場合があります。 米国の米国ドル通貨表示の高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）を主要投資対象とします。
分配方針	株式への投資は転換社債を転換したもの等に限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。 外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したもの等に限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。	
	決算時に繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

＜Aコース＞

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込み	騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
39期(2014年9月29日)	8,505	195	△0.0	244.00	0.7	—	99.5	—	3,052
40期(2015年3月30日)	8,389	190	0.9	248.91	2.0	—	95.5	—	2,920
41期(2015年9月28日)	7,916	170	△3.6	240.67	△3.3	—	90.4	—	2,629
42期(2016年3月28日)	7,686	160	△0.9	240.84	0.1	—	94.7	—	2,509
43期(2016年9月28日)	8,120	135	7.4	262.52	9.0	—	92.9	—	2,586

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマーク（＝BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース)）は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Indexをもとに、当社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

* ベンチマークは設定時を100として指数化しています。

(出所) ブルームバーグ、(出所および許可) バンクオブアメリカ・メリルリンチ

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
	円	%		%	%	%	%	%
(期首) 2016年3月28日	7,686	—	240.84	—	—	94.7	—	—
3月末	7,691	0.1	241.06	0.1	—	94.1	—	—
4月末	7,886	2.6	248.78	3.3	—	94.0	—	—
5月末	7,938	3.3	250.05	3.8	—	96.4	—	—
6月末	7,956	3.5	251.34	4.4	—	92.4	—	—
7月末	8,152	6.1	258.18	7.2	—	95.6	—	—
8月末	8,280	7.7	263.03	9.2	—	94.9	—	—
(期末) 2016年9月28日	8,255	7.4	262.52	9.0	—	92.9	—	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＜Bコース＞

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
39期(2014年9月29日)	7,812	175	7.2	528.73	8.1	—	96.2	—	5,694
40期(2015年3月30日)	8,411	180	10.0	589.40	11.5	—	95.9	—	5,580
41期(2015年9月28日)	7,999	200	△2.5	577.30	△2.1	—	92.0	—	5,052
42期(2016年3月28日)	7,309	195	△6.2	546.55	△5.3	—	95.8	—	4,475
43期(2016年9月28日)	6,863	165	△3.8	531.44	△2.8	—	93.6	—	4,186

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマーク（＝BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)）は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Indexをもとに、当社が独自に円換算したものです。
* ベンチマークは設定時を100として指数化しています。
(出所) ブルームバーグ、(出所および許可) バンクオブアメリカ・メリルリンチ

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	標準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首)	円	%		%		%	%	%
2016年3月28日	7,309	—	546.55	—	—	95.8	—	—
3月末	7,266	△0.6	543.41	△0.6	—	95.0	—	—
4月末	7,276	△0.5	546.77	0.0	—	94.8	—	—
5月末	7,406	1.3	555.91	1.7	—	94.7	—	—
6月末	6,904	△5.5	518.89	△5.1	—	93.0	—	—
7月末	7,181	△1.8	541.42	△0.9	—	94.5	—	—
8月末	7,221	△1.2	545.71	△0.2	—	93.4	—	—
(期末)								
2016年9月28日	7,028	△3.8	531.44	△2.8	—	93.6	—	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

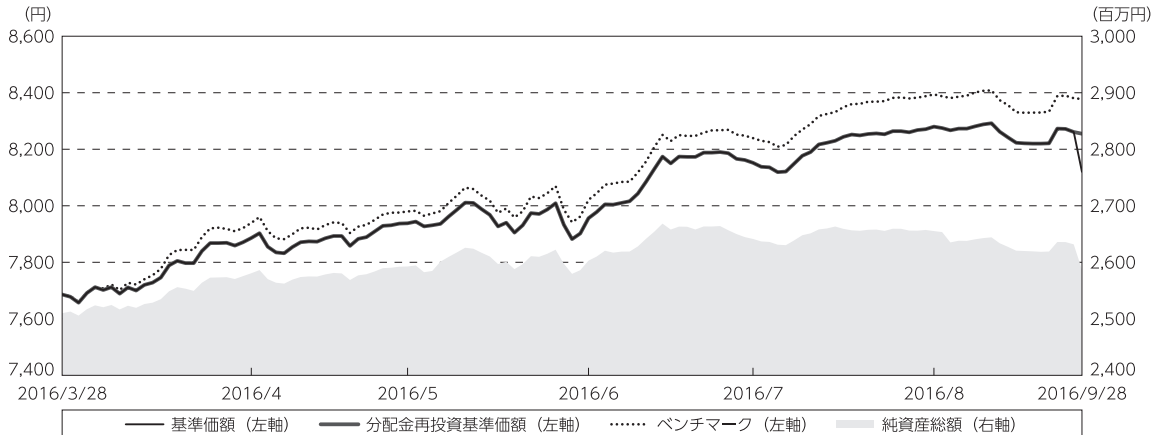
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<Aコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：7,686円

期 末：8,120円 (既払分配金(税込み)：135円)

騰落率： 7.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみな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すものです。作成期首(2016年3月28日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース)です。ベンチマークは、作成期首(2016年3月28日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の7,686円から当作成期末には8,120円となりました。

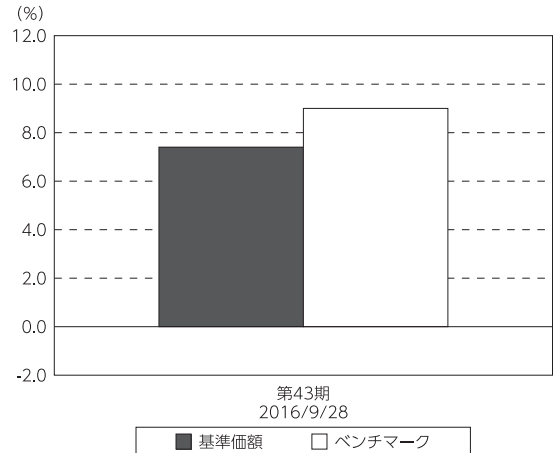
- ・原油を中心に商品価格が上昇したことなどを背景に、世界経済の先行き不透明感が後退したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・FOMC(米連邦公開市場委員会)において年内の利上げが緩やかなペースになるとの観測が市場で強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・EU(欧州連合)離脱をめぐる英国の国民投票において、EU離脱派が勝利したことなどを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・米国の企業決算が概ね好調だったことを背景として、米国の経済成長に対する楽観的な見方が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと

<Aコース>

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額（分配金込み）の騰落率は+7.4%となり、ベンチマーク（BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス（円ヘッジベース））の+9.0%を1.6ポイント下回りました。主な差異の要因は、B格の銘柄選択効果がマイナスに作用したことなどです。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス（円ヘッジベース）です。

◎分配金

収益分配金は、投資している債券から享受するインカムゲイン（利息収入）から、信託報酬等の経費や為替ヘッジコストを差し引いたものをベースに決定しました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第43期
	2016年3月29日～ 2016年9月28日
当期分配金 (対基準価額比率)	135 1.635%
当期の収益	135
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,952

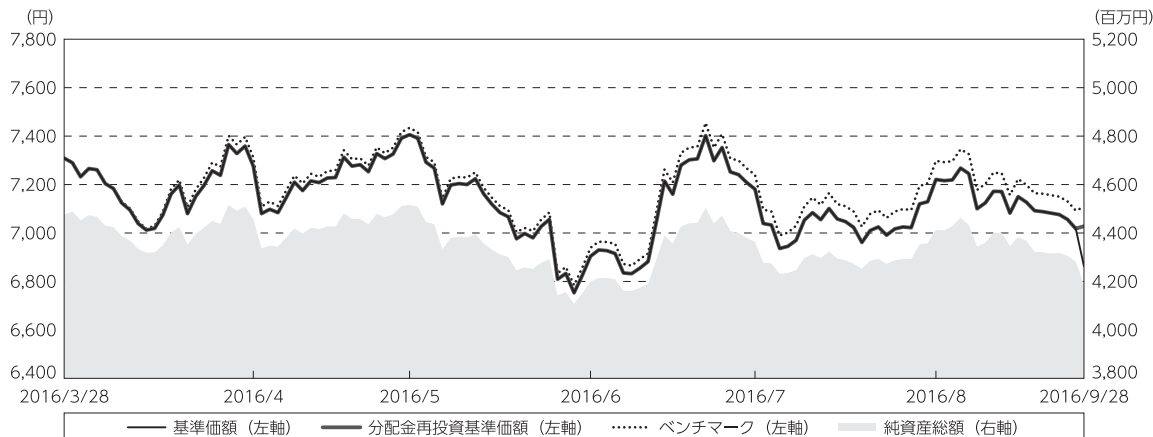
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てて算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<Bコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：7,309円

期 末：6,863円 (既払分配金(税込み)：165円)

騰落率：△ 3.8% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみな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すものです。作成期首(2016年3月28日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ベイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)です。ベンチマークは、作成期首(2016年3月28日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

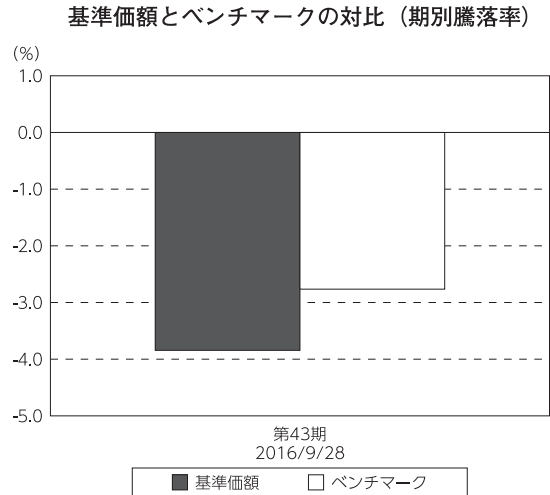
基準価額は当作成期首の7,309円から当作成期末には6,863円となりました。

- ・原油を中心に商品価格が上昇したことなどを背景に、世界経済の先行き不透明感が後退したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・FOMC(米連邦公開市場委員会)において年内の利上げが緩やかなペースになるとの観測が市場で強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・EU(欧州連合)離脱をめぐる英国の国民投票において、EU離脱派が勝利したことなどを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・米国の企業決算が概ね好調だったことを背景として、米国の経済成長に対する楽観的な見方が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・円・ドルの為替相場推移

<Bコース>

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額（分配金込み）の騰落率は-3.8%となり、ベンチマーク（BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス（円換算ベース））の-2.8%を1.0ポイント下回りました。主な差異の要因は、B格の銘柄選択効果がマイナスに作用したことなどです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス（円換算ベース）です。

◎分配金

収益分配金は、投資している債券から享受するインカムゲイン（利息収入）から、信託報酬等の経費を差し引いたものをベースに決定しました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第43期
	2016年3月29日～ 2016年9月28日
当期分配金	165
（対基準価額比率）	2.348%
当期の収益	162
当期の収益以外	2
翌期繰越分配対象額	1,114

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<Aコース/Bコース>

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間では上昇しました（トータルリターン・現地通貨ベース）。米国の主要経済指標、FRB（米連邦準備制度理事会）の動向や原油価格の動向などに左右されました。

為替市場は、当作成期間では、EU（欧州連合）離脱をめぐる英国の国民投票において、EU離脱派が勝利したこと、世界の金融市場でリスク回避的な姿勢が強まったことなどを背景に、ドルに対して円高が進行しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[ハイ・イールド ボンド オープンAコース]

主要投資対象である[ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド] 受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建て資産については為替ヘッジを活用し為替変動リスクの低減を図りました。

[ハイ・イールド ボンド オープンBコース]

主要投資対象である[ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド] 受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建て資産については為替ヘッジを行いませんでした。

[ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド]

・資産別組入比率

主要投資対象である米国ハイ・イールド・ボンドを高位に組み入れました。

・信用格付け別組入比率

信用格付け別組入比率を見ると、BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下、無格付けの組入比率は、当作成期末には1.1%、34.8%、50.9%、7.9%、0.4%としました。

<Aコース/Bコース>

◎今後の運用方針

[ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド]

- ・当ファンドでは個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なっていきます。また、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカム（利息）収入やキャピタル・ゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、米国経済の拡大や安定した企業業績を背景に当面は堅調に推移すると考えられます。デフォルト（債務不履行）率は、エネルギー関連企業が財務改善のための資本政策を実施したことなどを背景に、今後は低下すると予想しています。英国のEU（欧州連合）離脱問題以降、各国の中央銀行は緩和的な金融政策を維持しており、これらの政策がグローバル経済を下支えすると見ています。FRBは、堅調な労働市場を背景に利上げの条件は整いつつあるとしていますが、インフレ率の低さや米国経済の緩やかな成長を考慮すると、金利の引き上げペースは緩やかになると予想しています。また、エネルギー関連企業の選別については、流動性などのファンダメンタルズ（基礎的条件）を精査し、原油価格の変動に耐えられると判断した銘柄を組み入れる方針です。
- ・個別銘柄の選択にはより一層慎重に対応していきませんが、今後もキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。

[ハイ・イールド ボンド オープンAコース]

主要投資対象である [ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド] 受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建て資産については為替ヘッジを活用し為替変動リスクの低減を図る方針です。

[ハイ・イールド ボンド オープンBコース]

主要投資対象である [ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド] 受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建て資産については為替ヘッジを行なわない方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

<Aコース>

○1万口当たりの費用明細

(2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	68	0.855	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(44)	(0.555)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(22)	(0.272)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	2	0.028	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.027)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	70	0.883	
期中の平均基準価額は、7,983円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、この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。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2016年3月29日～2016年9月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	千口 52,755	千円 318,500	千口 29,406	千円 179,300

* 単位未満は切り捨て。

<Aコース>

○株式売買比率

(2016年3月29日～2016年9月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額		—千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		11,631千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		—

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月29日～2016年9月28日)

利害関係人との取引状況

<ハイ・イールド ボンド オープンAコース>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 —	百万円 —	% —	百万円 8,717	百万円 153	% 1.8

<ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 558	百万円 1,988	% 28.1	百万円 65	百万円 662	% 9.8

平均保有割合 12.6%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

<Aコース>

○組入資産の明細

(2016年9月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	396,199	419,548	2,528,406

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	2,528,406	95.2
コール・ローン等、その他	127,656	4.8
投資信託財産総額	2,656,062	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（20,828,896千円）の投資信託財産総額（21,210,239千円）に対する比率は98.2%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=100.55円。

＜Aコース＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,132,666,066
コール・ローン等	25,347,843
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	2,528,406,986
未収入金	2,578,911,237
(B) 負債	2,545,850,673
未払金	2,479,721,360
未払収益分配金	43,004,971
未払解約金	868,505
未払信託報酬	22,227,548
未払利息	36
その他未払費用	28,253
(C) 純資産総額(A-B)	2,586,815,393
元本	3,185,553,413
次期繰越損益金	△ 598,738,020
(D) 受益権総口数	3,185,553,413口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,120円

(注) 期首元本額は3,265,424,117円、期中追加設定元本額は51,571,095円、期中一部解約元本額は131,441,799円、1口当たり純資産額は0.8120円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額51,615,553円。(ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド)

(注) 分配金の計算過程(2016年3月29日～2016年9月28日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年3月29日～ 2016年9月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	70,349,030円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	725,880,281円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	505,825,507円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,302,054,818円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,087円
g. 分配金	43,004,971円
h. 分配金(1万口当たり)	135円

○損益の状況 (2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,342
支払利息	△ 6,342
(B) 有価証券売買損益	202,314,381
売買益	286,463,040
売買損	△ 84,148,659
(C) 信託報酬等	△ 22,266,601
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	180,041,438
(E) 前期繰越損益金	△ 363,522,234
(F) 追加信託差損益金	△ 372,252,253
(配当等相当額)	(725,661,641)
(売買損益相当額)	(△1,097,913,894)
(G) 計(D+E+F)	△ 555,733,049
(H) 収益分配金	△ 43,004,971
次期繰越損益金(G+H)	△ 598,738,020
追加信託差損益金	△ 372,252,253
(配当等相当額)	(725,880,281)
(売買損益相当額)	(△1,098,132,534)
分配準備積立金	533,169,566
繰越損益金	△ 759,655,333

* 損益の状況の中で(B)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。

* 損益の状況の中で(C)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。

* 損益の状況の中で(F)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。

<Aコース>

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	135円
------------------	------

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

<Bコース>

○1万口当たりの費用明細

(2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	62	0.855	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(40)	(0.555)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(20)	(0.272)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	2	0.027	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	64	0.882	
期中の平均基準価額は、7,209円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、この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。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2016年3月29日～2016年9月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	千口 21,424	千円 130,100	千口 51,905	千円 316,100

* 単位未満は切り捨て。

<Bコース>

○株式売買比率

(2016年3月29日～2016年9月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額		－千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		11,631千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		－

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月29日～2016年9月28日)

利害関係人との取引状況

<ハイ・イールド ボンド オープンBコース>

該当事項はございません。

<ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	うち利害関係人 との取引状況D		$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 1,988	百万円 558	% 28.1	百万円 662	百万円 65	% 9.8

平均保有割合 21.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	千口 714,765	千口 684,283	千円 4,123,837

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

<Bコース>

○投資信託財産の構成

(2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	4,123,837	95.3
コール・ローン等、その他	204,295	4.7
投資信託財産総額	4,328,132	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（20,828,896千円）の投資信託財産総額（21,210,239千円）に対する比率は98.2%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=100.55円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,328,132,175
コール・ローン等	42,994,812
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	4,123,837,363
未収入金	161,300,000
(B) 負債	141,761,959
未払収益分配金	100,644,503
未払解約金	3,930,871
未払信託報酬	37,139,272
未払利息	61
その他未払費用	47,252
(C) 純資産総額(A-B)	4,186,370,216
元本	6,099,666,903
次期繰越損益金	△1,913,296,687
(D) 受益権総口数	6,099,666,903口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,863円

(注) 期首元本額は6,124,186,975円、期中追加設定元本額は254,309,833円、期中一部解約元本額は278,829,905円、1口当たり純資産額は0.6863円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額51,615,553円。(ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド)

○損益の状況 (2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 10,859
支払利息	△ 10,859
(B) 有価証券売買損益	△ 129,204,716
売買益	3,623,990
売買損	△ 132,828,706
(C) 信託報酬等	△ 37,186,524
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 166,402,099
(E) 前期繰越損益金	△ 651,446,571
(F) 追加信託差損益金	△ 994,803,514
(配当等相当額)	(396,550,523)
(売買損益相当額)	(△1,391,354,037)
(G) 計(D+E+F)	△1,812,652,184
(H) 収益分配金	△ 100,644,503
次期繰越損益金(G+H)	△1,913,296,687
追加信託差損益金	△ 994,803,514
(配当等相当額)	(397,302,661)
(売買損益相当額)	(△1,392,106,175)
分配準備積立金	282,704,896
繰越損益金	△1,201,198,069

*損益の状況の中で(B)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。

*損益の状況の中で(C)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。

*損益の状況の中で(F)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。

<Bコース>

(注) 分配金の計算過程 (2016年3月29日～2016年9月28日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年3月29日～ 2016年9月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	99,109,140円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	397,302,661円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	284,240,259円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	780,652,060円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,279円
g. 分配金	100,644,503円
h. 分配金(1万口当たり)	165円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 (税込み)	165円
-----------------	------

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

運用報告書

第43期（決算日2016年9月28日）

作成対象期間（2016年3月29日～2016年9月28日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として米国ドル通貨表示の高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）に投資し、インカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得を目指します。 ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、企業調査およびクレジット分析により投資機会をとりえ、投資リスクを抑えることを目指します。 外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	米国の米国ドル通貨表示の高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債 組入比率	券 率	債 先物比率	純 資 産 額
	円	%	騰落率	騰落率					
39期(2014年9月29日)	60,239	8.1	528.73	8.1	—	97.2	—	19,868	
40期(2015年3月30日)	66,849	11.0	589.40	11.5	—	96.8	—	19,549	
41期(2015年9月28日)	65,725	△1.7	577.30	△2.1	—	92.7	—	20,953	
42期(2016年3月28日)	62,164	△5.4	546.55	△5.3	—	96.6	—	20,049	
43期(2016年9月28日)	60,265	△3.1	531.44	△2.8	—	95.0	—	20,786	

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*ベンチマーク (=BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)) は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Indexをもとに、当社が独自に円換算したものです。
*ベンチマークは設定時を100として指数化しています。
(出所) プルーフバーグ、(出所および許可) バンクオブアメリカ・メリルリンチ

○当期中の基準価額と市況等の推移

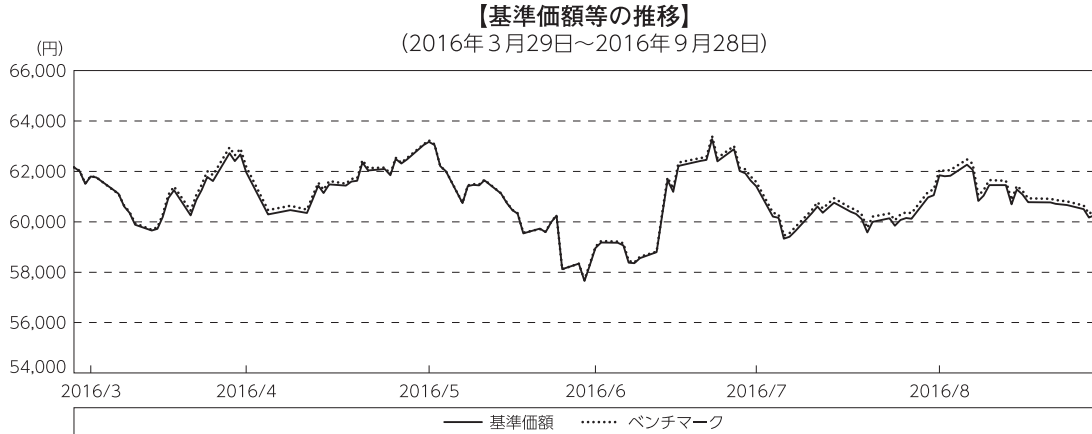
年月日	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債 組入比率	券 率	債 先物比率
	円	%	騰落率	騰落率				
(期首) 2016年3月28日	62,164	—	546.55	—	—	96.6	—	
3月末	61,804	△0.6	543.41	△0.6	—	95.9	—	
4月末	61,969	△0.3	546.77	0.0	—	95.5	—	
5月末	63,176	1.6	555.91	1.7	—	95.3	—	
6月末	58,956	△5.2	518.89	△5.1	—	93.5	—	
7月末	61,412	△1.2	541.42	△0.9	—	94.8	—	
8月末	61,843	△0.5	545.71	△0.2	—	93.6	—	
(期末) 2016年9月28日	60,265	△3.1	531.44	△2.8	—	95.0	—	

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス (円換算ベース) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の62,164円から当作成期末には60,265円となりました。

- ・原油を中心に商品価格が上昇したことなどを背景に、世界経済の先行き不透明感が後退したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・FOMC (米連邦公開市場委員会) において年内の利上げが緩やかなペースになるとの観測が市場で強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・EU (欧州連合) 離脱をめぐる英国の国民投票において、EU離脱派が勝利したことなどを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・米国の企業決算が概ね好調だったことを背景として、米国の経済成長に対する楽観的な見方が強まったことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・円・ドルの為替相場推移

○当ファンドのポートフォリオ

・資産別組入比率

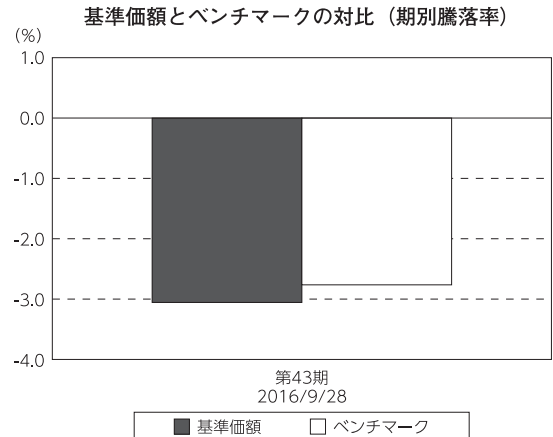
主要投資対象である米国ハイ・イールド・ボンドを高位に組入れました。

・信用格付け別組入比率

信用格付け別組入比率を見ると、BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下、無格付けの組入比率は、当作成期末には1.1%、34.8%、50.9%、7.9%、0.4%としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は-3.1%となり、ベンチマーク（BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)）の-2.8%を0.3ポイント下回りました。主な差異の要因は、B格の銘柄選択効果がマイナスに作用したことなどです。



(注) ベンチマークは、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-B レイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)です。

◎今後の運用方針

- ・当ファンドでは個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なっていきます。また、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカム（利息）収入やキャピタル・ゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、米国経済の拡大や安定した企業業績を背景に当面は堅調に推移すると考えられます。デフォルト（債務不履行）率は、エネルギー関連企業が財務改善のための資本政策を実施したことなどを背景に、今後は低下すると予想しています。英国のEU（欧州連合）離脱問題以降、各国の中央銀行は緩和的な金融政策を維持しており、これらの政策がグローバル経済を下支えすると見えています。FRBは、堅調な労働市場を背景に利上げの条件は整いつつあるとしていますが、インフレ率の低さや米国経済の緩やかな成長を考慮すると、金利の引き上げペースは緩やかになると予想しています。また、エネルギー関連企業の選別については、流動性などのファンダメンタルズ（基礎的条件）を精査し、原油価格の変動に耐えられると判断した銘柄を組み入れる方針です。
- ・個別銘柄の選択にはより一層慎重に対応していきますが、今後もキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いたします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 17	% 0.027	(a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(17)	(0.027)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	17	0.027	
期中の平均基準価額は、61,526円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2016年3月29日～2016年9月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 — (320)	千米ドル — (84)	百株 —	千米ドル —

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分です。

公社債

外 国	アメリカ	社債券（投資法人債券を含む）	買 付 額	売 付 額
			千米ドル	千米ドル
			48,321	25,120 (8,162)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○株式売買比率

(2016年3月29日～2016年9月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	一千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,631千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月29日～2016年9月28日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 1,988	百万円 558	% 28.1	百万円 662	百万円 65	% 9.8

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月28日現在)

外国株式

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) DENBURY RESOURCES INC	百株 —	百株 320	千米ドル 84	千円 8,462	石油・ガス・消耗燃料
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— —	320 1	84 —	8,462 <0.0%>

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	193,581	196,489	19,757,000	95.0	93.6	67.1	23.7	4.3
合 計	193,581	196,489	19,757,000	95.0	93.6	67.1	23.7	4.3

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*スタンダード・アンド・プアーズ、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。なお、無格付けが0.4%あります。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	1011778 BC / NEW RED FIN	4.625	750	780	78,429	2022/1/15
	A SCHULMAN INC	6.875	200	203	20,461	2023/6/1
	ABC SUPPLY CO INC	5.625	450	470	47,283	2021/4/15
	ABC SUPPLY CO INC	5.75	150	156	15,723	2023/12/15
	ACCESS MIDSTREAM PARTNER	4.875	500	507	50,994	2023/5/15
	ACCESS MIDSTREAM PARTNER	4.875	200	202	20,355	2024/3/15
	ACCURIDE CORP	9.5	150	151	15,214	2018/8/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	7.0	117	115	11,587	2024/7/1
	AES CORP/VA	6.0	50	52	5,310	2026/5/15
	AES CORPORATION	7.375	610	699	70,382	2021/7/1
	AIR CANADA	8.75	150	162	16,326	2020/4/1
	AIR CANADA	7.75	300	326	32,813	2021/4/15
	AIRCASTLE LTD	5.0	100	105	10,557	2023/4/1
	AK STEEL CORP	7.5	100	105	10,601	2023/7/15
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA	8.375	250	261	26,329	2019/11/1
	ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	6.625	275	288	28,999	2024/6/15
	ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	5.75	525	529	53,250	2025/3/15
	ALCOA NEDERLAND HOLDING	6.75	200	205	20,637	2024/9/30
	ALERIS INTL INC	7.875	126	128	12,922	2020/11/1
	ALERIS INTL INC	9.5	125	134	13,542	2021/4/1
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	5.375	650	637	64,050	2022/8/1
	ALLY FINANCIAL	8.0	1,045	1,191	119,785	2020/3/15
	ALLY FINANCIAL INC	3.25	500	504	50,714	2018/11/5
	ALLY FINANCIAL INC	7.5	759	863	86,811	2020/9/15
	ALLY FINANCIAL INC	8.0	425	527	53,003	2031/11/1
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	9.625	550	518	52,122	2018/10/15
	ALTICE FINANCING SA	7.5	400	417	41,929	2026/5/15
	ALTICE FINCO SA	7.625	200	201	20,285	2025/2/15
	ALTICE SA	7.75	950	1,010	101,612	2022/5/15
	ALTICE US FINANCE I CORP	5.5	200	205	20,688	2026/5/15
	AMC ENTERTAINMENT INC	5.75	500	503	50,652	2025/6/15
	AMC NETWORKS INC	5.0	575	575	57,816	2024/4/1
	AMERICAN AIRLINES GROUP	4.625	275	278	27,962	2020/3/1
	AMERICAN GREETINGS	7.375	625	653	65,671	2021/12/1
	AMERIGAS PART/FIN CORP	5.625	150	158	15,949	2024/5/20
	AMERIGAS PART/FIN CORP	5.875	150	159	16,025	2026/8/20
	AMN HEALTHCARE INC	5.125	200	202	20,311	2024/10/1
	AMSURG CORP	5.625	150	154	15,572	2020/11/30
	AMSURG CORP	5.625	225	229	23,104	2022/7/15
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.125	400	398	40,018	2021/4/15
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.125	200	196	19,758	2022/9/27
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.875	400	408	41,100	2025/5/14
	ANTERO MIDSTREAM PART/FI	5.375	275	275	27,720	2024/9/15
	ANTERO RESOURCES CORP	6.0	75	77	7,786	2020/12/1
	ANTERO RESOURCES CORP	5.375	225	226	22,793	2021/11/1

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)	ANTERO RESOURCES CORP	5.625	500	505	50,777	2023/6/1
		ANTERO RESOURCES FINANCE	5.125	400	399	40,119	2022/12/1
		APX GROUP INC	6.375	925	936	94,171	2019/12/1
		ARAMARK CORP	5.75	80	82	8,290	2020/3/15
		ARAMARK SERVICES INC	5.125	150	156	15,685	2024/1/15
		ARAMARK SERVICES INC	5.125	275	286	28,757	2024/1/15
		ARAMARK SERVICES INC	4.75	100	100	10,105	2026/6/1
		ARCELORMITTAL	8.0	625	668	67,242	2039/10/15
		ARGOS MERGER SUB INC	7.125	400	418	42,080	2023/3/15
		ARTESYN ESCROW INC	9.75	400	364	36,600	2020/10/15
		ASHTREAD CAPITAL INC	6.5	575	608	61,140	2022/7/15
		ASHTREAD CAPITAL INC	5.625	250	264	26,582	2024/10/1
		AURICO GOLD INC	7.75	150	156	15,685	2020/4/1
		AUS FINANCE PTY LTD	6.875	225	227	22,849	2019/11/1
		BALL CORP	4.375	200	214	21,567	2020/12/15
		BANK OF AMERICA CORP	6.25	650	679	68,303	2049/9/29
		BANK OF AMERICA CORP	8.0	375	383	38,601	2049/12/29
		BANK OF AMERICA CORP	6.3	100	109	10,959	2049/12/29
		BANKRATE INC	6.125	875	888	89,300	2018/8/15
		BARCLAYS BANK PLC	7.75	200	210	21,152	2023/4/10
		BARCLAYS PLC	8.25	400	403	40,579	2049/12/29
		BCD ACQUISITION INC	9.625	300	314	31,597	2023/9/15
		BEACON ROOFING SUPPLY IN	6.375	425	457	46,045	2023/10/1
		BEAZER HOMES USA	8.75	50	52	5,297	2022/3/15
		BLOCK COMMUNICATIONS INC	7.25	375	386	38,837	2020/2/1
		BLUELINE RENTAL FINANCE	7.0	75	64	6,504	2019/2/1
		BMC EAST LLC	5.5	150	150	15,101	2024/10/1
		BOMBARDIER INC	6.0	200	176	17,721	2022/10/15
		BOMBARDIER INC	6.125	85	74	7,489	2023/1/15
		BOMBARDIER INC	7.5	250	227	22,875	2025/3/15
		BOYD GAMING CORP	6.875	450	487	49,036	2023/5/15
		BOYD GAMING CORP	6.375	500	535	53,794	2026/4/1
		BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.5	225	232	23,359	2020/12/15
		BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.375	125	125	12,568	2025/5/15
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5.625	725	743	74,721	2024/9/1
		BUILDING MATERIALS CORP	5.375	718	739	74,360	2024/11/15
		CABLEVISION SYSTEMS CORP	8.625	500	525	52,851	2017/9/15
		CABLEVISION SYSTEMS CORP	5.875	625	573	57,659	2022/9/15
		CALATLANTIC GROUP INC	6.25	100	110	11,110	2021/12/15
		CALLON PETROLEUM CO	6.125	125	126	12,757	2024/10/1
		CALPINE CORP	6.0	175	183	18,454	2022/1/15
		CALPINE CORP	5.375	475	471	47,403	2023/1/15
		CALPINE CORP	5.75	375	368	37,093	2025/1/15
		CALPINE CORP	5.25	200	203	20,411	2026/6/1
		CARDTRONICS INC	5.125	275	282	28,411	2022/8/1
		CARMIKE CINEMAS INC	6.0	200	208	20,964	2023/6/15
		CARRIZO OIL & GAS INC	6.25	450	442	44,455	2023/4/15

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債類)	CASCADES INC	5.5	225	229	23,047	2022/7/15
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	250	260	26,210	2021/3/15
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	650	680	68,461	2022/9/30
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.125	250	260	26,221	2023/2/15
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.875	275	293	29,483	2024/4/1
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.5	150	156	15,723	2026/5/1
		CCO HOLDINGS LLC	5.75	1,600	1,688	169,728	2026/2/15
		CDW LLC/CDW FINANCE	6.0	500	535	53,857	2022/8/15
		CEB INC	5.625	200	197	19,858	2023/6/15
		CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	5.375	375	397	39,968	2024/6/1
		CEMEX FINANCE LLC	6.0	200	203	20,506	2024/4/1
		CENTENE CORP	5.625	300	319	32,158	2021/2/15
		CENTENE CORP	6.125	300	325	32,729	2024/2/15
		CENTRAL GARDEN & PET CO	6.125	150	161	16,213	2023/11/15
		CENTURY INTERMEDIATE HLD	9.75	175	179	18,014	2019/2/15
		CENTURYLINK INC	5.8	975	999	100,487	2022/3/15
		CENTURYLINK INC	6.75	200	207	20,864	2023/12/1
		CENTURYLINK INC	7.5	275	293	29,517	2024/4/1
		CENTURYLINK INC	7.6	425	370	37,285	2039/9/15
		CEQUEL COM ESCRW 1/CAP C	6.375	575	594	59,767	2020/9/15
		CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	175	176	17,728	2021/12/15
		CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	125	125	12,631	2021/12/15
		CHEMOURS CO	7.0	325	320	32,229	2025/5/15
		CHENIERE CORP CHRISTI HD	7.0	400	431	43,337	2024/6/30
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.625	50	45	4,575	2020/8/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.125	200	173	17,395	2021/2/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.375	250	206	20,738	2021/6/15
		CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	7.25	939	941	94,652	2019/11/15
		CHS/COMMUNITY HEALTH	6.875	1,050	878	88,289	2022/2/1
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	7.125	500	454	45,734	2020/7/15
		CHURCHILL DOWNS INC	5.375	200	209	21,014	2021/12/15
		CINEMARK USA INC	5.125	550	566	56,961	2022/12/15
		CIT GROUP INC	5.0	750	763	76,732	2017/5/15
		CIT GROUP INC	4.25	500	509	51,270	2017/8/15
		CIT GROUP INC	5.5	175	184	18,586	2019/2/15
		CIT GROUP INC	3.875	175	178	17,926	2019/2/19
		CITGO PETROLEUM CORP	6.25	275	268	26,959	2022/8/15
		CITIGROUP INC	5.95	650	672	67,595	2049/12/29
		CITIGROUP INC	6.25	150	161	16,236	2049/12/29
		CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	150	152	15,308	2022/11/15
		CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	600	625	62,894	2022/11/15
		CLOUD CRANE LLC	10.125	125	129	13,008	2024/8/1
		CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	6.375	50	25	2,576	2024/3/15
		CNG HOLDINGS INC	9.375	650	386	38,887	2020/5/15
		CNO FINANCIAL GROUP INC	5.25	250	250	25,168	2025/5/30
		COEUR D'ALENE MINES CORP	7.875	125	128	12,882	2021/2/1
		COGENT COMMUNICATIONS GR	5.375	150	155	15,610	2022/3/1

銘柄	銘柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	普通社債券 (含む投資法人債券)	COMMERCIAL METALS CO	4.875	100	100	10,055	2023/5/15
		COMMSCOPE INC	5.0	275	286	28,820	2021/6/15
		COMMSCOPE INC	5.5	275	289	29,137	2024/6/15
		COMMSCOPE TECH FINANCE L	6.0	300	321	32,276	2025/6/15
		COMMUNICATIONS SALES & L	6.0	75	78	7,861	2023/4/15
		COMMUNICATIONS SALES & L	8.25	125	130	13,165	2023/10/15
		COMPRESSCO PARTNERS/FINA	7.25	125	117	11,814	2022/8/15
		CONCHO RESOURCES INC	6.5	525	543	54,636	2022/1/15
		CONCHO RESOURCES INC	5.5	235	242	24,397	2022/10/1
		CONSOLIDATED COMMUNICATI	6.5	400	389	39,113	2022/10/1
		CONSOLIDATED ENERGY FIN	6.75	400	395	39,717	2019/10/15
		CONSTELLATION BRANDS INC	6.0	450	520	52,373	2022/5/1
		CONTINENTAL RESOURCES	7.125	175	181	18,212	2021/4/1
		CONTINENTAL RESOURCES	5.0	775	758	76,270	2022/9/15
		CONTINENTAL RESOURCES	4.5	150	142	14,290	2023/4/15
		COTT BEVERAGES INC	6.75	300	313	31,560	2020/1/1
		CREDIT SUISSE GROUP AG	6.25	200	190	19,188	2049/12/29
		CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.0	125	126	12,725	2020/12/15
		CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.125	125	125	12,568	2022/3/1
		CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.25	100	100	10,105	2023/4/1
		CTP TRANS PROD LLC/ FINA	8.25	100	78	7,905	2019/12/15
		CVR PARTNERS/CVR NITROGE	9.25	275	268	26,994	2023/6/15
		CVR REF LLC/COFF FIN INC	6.5	275	247	24,886	2022/11/1
		DAKOTA MERGER SUB INC	7.75	125	125	12,631	2023/9/1
		DANA HOLDING CORP	6.0	500	522	52,507	2023/9/15
		DENBURY RESOURCES INC	9.0	467	478	48,130	2021/5/15
		DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	5.875	400	422	42,501	2021/6/15
		DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	5.45	25	26	2,685	2023/6/15
		DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	7.125	400	438	44,113	2024/6/15
		DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	6.02	175	190	19,168	2026/6/15
		DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	8.1	125	146	14,692	2036/7/15
		DIEBOLD INC	8.5	75	77	7,795	2024/4/15
		DIGICEL LIMITED	6.0	525	473	47,641	2021/4/15
		DISH DBS CORP	4.25	350	360	36,199	2018/4/1
		DISH DBS CORP	7.875	1,250	1,400	140,770	2019/9/1
		DISH DBS CORP	5.125	350	362	36,424	2020/5/1
		DISH DBS CORP	5.875	175	179	18,036	2022/7/15
		DISH DBS CORP	7.75	350	372	37,480	2026/7/1
		DONNELLEY FINANCIAL SOL	8.25	325	329	33,128	2024/10/15
		DRIVETIME AUTO GP & ACCE	8.0	175	170	17,112	2021/6/1
		DUPONT FABROS TECH LP	5.875	175	183	18,456	2021/9/15
		DUPONT FABROS TECH LP	5.625	125	131	13,228	2023/6/15
		DYNEGY INC	6.75	275	283	28,549	2019/11/1
		DYNEGY INC	7.375	300	295	29,712	2022/11/1
		DYNEGY INC	7.625	315	307	30,881	2024/11/1
		EAGLE MATERIALS INC	4.5	100	101	10,189	2026/8/1
		EMI MUSIC PUBLISHING GRP	7.625	50	54	5,442	2024/6/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)	ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	5.375	225	197	19,852	2023/1/15
		ENDO FINANCE LLC	5.75	325	298	29,982	2022/1/15
		ENERGY TRANSFER EQUITY	7.5	50	54	5,505	2020/10/15
		ENERGY TRANSFER EQUITY	5.875	1,015	1,050	105,630	2024/1/15
		ENERSYS	5.0	100	100	10,092	2023/4/30
		ENLINK MIDSTREAM PARTNER	4.4	115	112	11,284	2024/4/1
		ENLINK MIDSTREAM PARTNER	5.05	125	108	10,942	2045/4/1
		ENSCO PLC	5.2	25	17	1,772	2025/3/15
		ENVISION HEALTHCARE CORP	5.125	225	223	22,454	2022/7/1
		EP ENER/EVEREST ACQ FIN	6.375	400	224	22,523	2023/6/15
		EQUINIX INC	5.375	350	373	37,560	2022/1/1
		EQUINIX INC	5.375	1,025	1,076	108,216	2023/4/1
		EQUINIX INC	5.875	475	509	51,223	2026/1/15
		ESH HOSPITALITY INC	5.25	550	547	55,025	2025/5/1
		FELCOR LODGING LP	6.0	525	547	55,032	2025/6/1
		FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	175	158	15,924	2022/1/15
		FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	250	220	22,121	2023/6/15
		FERRELLGAS PARTNERS LP	8.625	341	340	34,244	2020/6/15
		FIRST CASH FINANCIAL SER	6.75	75	78	7,918	2021/4/1
		FIRST DATA CORPORATION	6.75	438	455	45,776	2020/11/1
		FIRST DATA CORPORATION	5.0	375	381	38,318	2024/1/15
		FLY LEASING LTD	6.75	400	413	41,577	2020/12/15
		FMG RESOURCES AUG 2006	9.75	100	116	11,663	2022/3/1
		FRESENIUS MED CARE II	5.625	325	354	35,660	2019/7/31
		FRESENIUS MED CARE II	5.875	350	396	39,883	2022/1/31
		FRONTIER COMMUNICATIONS	10.5	1,000	1,061	106,708	2022/9/15
		FRONTIER COMMUNICATIONS	11.0	1,125	1,175	118,209	2025/9/15
		FTI CONSULTING INC	6.0	200	211	21,291	2022/11/15
		GANNETT CO INC	4.875	100	103	10,381	2021/9/15
		GANNETT CO INC	6.375	325	348	35,007	2023/10/15
		GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	225	208	20,983	2021/11/15
		GENON ESCROW CORP	9.875	925	684	68,826	2020/10/15
		GEO GROUP INC/THE	5.875	125	116	11,751	2022/1/15
		GEO GROUP INC/THE	6.0	150	129	13,008	2026/4/15
		GIBRALTAR STEEL CORP OF	6.25	100	104	10,457	2021/2/1
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.7	125	127	12,772	2049/12/29
		GOODYEAR TIRE & RUBBER	5.125	300	313	31,522	2023/11/15
		GOODYEAR TIRE & RUBBER	5.0	375	384	38,648	2026/5/31
		GRAFTECH INTERNATIONAL	6.375	175	134	13,505	2020/11/15
		GRAPHIC PACKAGING INTL	4.125	150	150	15,157	2024/8/15
		GRAY TELEVISION INC	5.125	150	147	14,856	2024/10/15
		GRAY TELEVISION INC	5.875	275	279	28,066	2026/7/15
		GREIF INC	7.75	250	281	28,311	2019/8/1
		GREYSTAR REAL ESTATE PAR	8.25	325	346	34,802	2022/12/1
		GRIFFON CORPORATION	5.25	200	200	20,185	2022/3/1
		GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	5.0	275	275	27,651	2022/6/1
		GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	5.25	150	151	15,233	2023/12/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	HALYARD HEALTH INC	6.25	200	204	20,512	2022/10/15
	HARLAND CLARKE HLDINGS	6.875	125	120	12,097	2020/3/1
	HARLAND CLARKE HOLDINGS	9.75	575	588	59,189	2018/8/1
	HCA HOLDINGS INC	6.25	225	242	24,377	2021/2/15
	HCA INC	3.75	525	540	54,372	2019/3/15
	HCA INC	7.5	900	1,028	103,390	2022/2/15
	HCA INC	5.875	720	763	76,739	2023/5/1
	HCA INC	5.375	500	513	51,594	2025/2/1
	HCA INC	5.875	450	474	47,736	2026/2/15
	HCA INC	5.25	450	474	47,736	2026/6/15
	HD SUPPLY INC	5.25	375	397	40,015	2021/12/15
	HD SUPPLY INC	5.75	250	261	26,331	2024/4/15
	HEALTHSOUTH CORP	5.75	575	594	59,803	2024/11/1
	HECLA MINING CO	6.875	325	325	32,760	2021/5/1
	HERTZ CORP	5.5	150	149	15,063	2024/10/15
	HEXION US FINANCE CORP	6.625	400	351	35,343	2020/4/15
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	7.625	350	359	36,116	2021/4/15
	HOLLY ENERGY PARTNERS LP	6.0	125	129	12,977	2024/8/1
	HUGHES SATELLITE SYSTEMS	7.625	500	531	53,480	2021/6/15
	HUGHES SATELLITE SYSTEMS	5.25	475	469	47,164	2026/8/1
	HUGHES SATELLITE SYSTEMS	6.625	475	458	46,089	2026/8/1
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	5.0	375	396	39,827	2025/11/15
	IAMGOLD CORP	6.75	575	564	56,804	2020/10/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	4.875	300	301	30,315	2019/3/15
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	6.0	375	376	37,891	2020/8/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	5.875	825	782	78,702	2022/2/1
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	4.0	300	240	24,207	2065/12/21
	IMS HEALTH INC	5.0	200	205	20,688	2026/10/15
	INEOS GROUP HOLDINGS SA	5.625	200	195	19,607	2024/8/1
	INFOR US INC	6.5	625	636	64,022	2022/5/15
	INMARSAT FINANCE PLC	6.5	125	125	12,568	2024/10/1
	INTELSAT JACKSON HLDG	5.5	675	467	47,000	2023/8/1
	INTELSAT JACKSON HLDG	8.0	25	25	2,527	2024/2/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.25	75	89	8,964	2020/12/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	5.875	500	553	55,679	2022/8/15
	INTREPID AVIATION GRP HL	6.875	525	476	47,905	2019/2/15
	INVENTIV HEALTH INC	9.0	250	257	25,875	2018/1/15
	IRON MOUNTAIN INC	6.0	625	660	66,457	2020/10/1
	IRON MOUNTAIN INC	4.375	400	414	41,627	2021/6/1
	IRON MOUNTAIN US HLDNGS	5.375	250	251	25,263	2026/6/1
	J. B. POINDEXTER & CO	9.0	225	239	24,066	2022/4/1
	JACK COOPER HOLDINGS COR	9.25	125	85	8,609	2020/6/1
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.75	200	211	21,276	2020/10/28
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.25	400	410	41,275	2024/4/3
	JC PENNEY CORP INC	5.875	75	77	7,839	2023/7/1
	JPMORGAN CHASE & CO	6.75	275	307	30,934	2049/1/29
	JPMORGAN CHASE & CO	5.0	525	519	52,260	2049/12/29

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	KB HOME	9.1	600	640	64,402	2017/9/15
	KB HOME	4.75	75	77	7,748	2019/5/15
	KB HOME	8.0	50	55	5,593	2020/3/15
	KB HOME	7.0	175	190	19,179	2021/12/15
	KCG HOLDINGS INC	6.875	125	123	12,458	2020/3/15
	KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	7.625	100	99	10,004	2021/8/15
	KENNEDY-WILSON INC	5.875	625	634	63,786	2024/4/1
	KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	5.0	200	208	20,964	2024/6/1
	KINDRED HEALTHCARE INC	8.0	225	227	22,906	2020/1/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	6.375	200	187	18,878	2022/4/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	8.75	125	125	12,584	2023/1/15
	KISSNER MILLING CO LTD	7.25	225	235	23,726	2019/6/1
	L BRANDS INC	6.875	350	379	38,183	2035/11/1
	L BRANDS INC	6.75	100	107	10,761	2036/7/1
	LADDER CAP FIN LLC/CORP	7.375	250	252	25,420	2017/10/1
	LAREDO PETROLEUM INC	7.375	400	406	40,823	2022/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	6.25	350	336	33,784	2023/3/15
	LENNAR CORP	6.95	275	295	29,725	2018/6/1
	LENNAR CORP	4.75	250	258	25,954	2022/11/15
	LENNAR CORP	4.875	375	385	38,743	2023/12/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.375	675	707	71,179	2022/8/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.625	350	365	36,732	2023/2/1
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.375	325	337	33,904	2024/1/15
	LIFEPOINT HEALTH INC	5.5	798	830	83,548	2021/12/1
	LIFEPOINT HEALTH INC	5.375	150	151	15,195	2024/5/1
	LIMITED BRANDS INC	8.5	600	703	70,736	2019/6/15
	LIMITED BRANDS INC	7.0	225	259	26,130	2020/5/1
	LIMITED BRANDS INC	5.625	275	307	30,937	2022/2/15
	LLOYDS BANKING	7.5	222	229	23,047	2049/6/27
	LOUISIANA-PACIFIC CORP	4.875	100	99	9,992	2024/9/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.75	350	343	34,488	2022/8/1
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.625	175	168	16,980	2023/10/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.5	200	188	18,903	2025/4/15
	MATADOR RESOURCES CO	6.875	75	77	7,824	2023/4/15
	MATCH GROUP INC	6.375	200	218	21,995	2024/6/1
	MATTAMY GROUP CORP	6.5	250	250	25,137	2020/11/15
	MDC PARTNERS INC	6.5	175	165	16,628	2024/5/1
	MEDIACOM LLC/CAPTL CORP	7.25	350	367	36,908	2022/2/15
	MEDNAX INC	5.25	200	210	21,115	2023/12/1
	MEG ENERGY CORP	6.5	325	251	25,244	2021/3/15
	MEG ENERGY CORP	6.375	750	555	55,805	2023/1/30
	MERCER INTL INC	7.0	150	155	15,648	2019/12/1
	MERCER INTL INC	7.75	150	159	15,987	2022/12/1
	MERITAGE HOMES CORP	7.0	225	251	25,282	2022/4/1
	MERITAGE HOMES CORP	6.0	150	159	16,062	2025/6/1
	MERITOR INC	6.25	125	119	12,003	2024/2/15
	MGIC INVESTMENT CORP	5.75	175	182	18,300	2023/8/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	MGM RESORTS INTL	6.75	575	646	64,971	2020/10/1
	MGM RESORTS INTL	6.625	375	424	42,702	2021/12/15
	MGM RESORTS INTL	7.75	275	318	32,006	2022/3/15
	MGM RESORTS INTL	4.625	175	170	17,178	2026/9/1
	MICRON TECHNOLOGY INC	7.5	200	222	22,372	2023/9/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.25	450	431	43,381	2024/1/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.5	525	513	51,666	2025/2/1
	MICROSEMI CORP	9.125	225	257	25,904	2023/4/15
	MIDCONTINENT COMM & FIN	6.875	200	214	21,517	2023/8/15
	MILLAR WESTERN FOREST	8.5	75	39	4,006	2021/4/1
	MOLINA HEALTHCARE INC	5.375	375	387	38,931	2022/11/15
	MPG HOLDCO I INC	7.375	225	231	23,245	2022/10/15
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.375	225	245	24,716	2024/3/1
	MRT MID PART/MRT MID FIN	7.25	300	285	28,656	2021/2/15
	MSCI INC	4.75	200	203	20,411	2026/8/1
	MULTI-COLOR CORP	6.125	300	315	31,673	2022/12/1
	MURPHY OIL CORP	4.7	625	594	59,794	2022/12/1
	MURPHY OIL CORP	6.875	550	570	57,384	2024/8/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	6.0	375	391	39,403	2022/4/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	5.75	125	129	13,040	2026/8/15
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	9.625	200	210	21,140	2019/5/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	500	480	48,264	2022/6/1
	NAVIENT CORP	6.625	50	50	5,077	2021/7/26
	NAVIENT CORP	7.25	100	99	9,998	2023/9/25
	NAVIENT CORP	5.875	800	732	73,602	2024/10/25
	NCR CORP	5.875	100	105	10,595	2021/12/15
	NCR CORP	6.375	450	479	48,188	2023/12/15
	NEPTUNE FINCO CORP	10.125	400	459	46,152	2023/1/15
	NEPTUNE FINCO CORP	10.875	400	470	47,258	2025/10/15
	NETFLIX INC	5.5	250	268	27,022	2022/2/15
	NEWFIELD EXPLORATION CO	5.375	125	124	12,474	2026/1/1
	NEXSTAR BROADCASTING INC	6.125	150	154	15,534	2022/2/15
	NEXSTAR ESCROW CORP	5.625	325	325	32,760	2024/8/1
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.0	775	800	80,458	2022/4/15
	NORTEK INC	8.5	500	521	52,411	2021/4/15
	NOVELIS CORP	6.25	250	261	26,268	2024/8/15
	NOVELIS CORP	5.875	475	478	48,119	2026/9/30
	NRG ENERGY INC	7.875	224	234	23,621	2021/5/15
	NRG ENERGY INC	7.25	350	357	35,896	2026/5/15
	NRG ENERGY INC	6.625	450	434	43,663	2027/1/15
	NRG YIELD OPERATING LLC	5.0	325	318	32,025	2026/9/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.0	2,075	2,114	212,597	2022/5/15
	NUMERICABLE-SFR SA	7.375	875	887	89,190	2026/5/1
	NWH ESCROW CORP	7.5	300	225	22,699	2021/8/1
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	4.125	200	210	21,140	2021/6/1
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	3.875	200	204	20,562	2022/9/1
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	4.625	200	211	21,291	2023/6/1

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債)					
	OASIS PETROLEUM INC	6.875	500	463	46,645	2022/3/15
	OPEN TEXT CORP	5.875	275	288	28,999	2026/6/1
	OWENS-BROCKWAY	5.0	800	851	85,568	2022/1/15
	OWENS-BROCKWAY	5.875	250	268	26,975	2023/8/15
	OWENS-BROCKWAY	6.375	400	441	44,417	2025/8/15
	PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	6.25	150	155	15,610	2024/6/1
	PBF LOGISTICS LP/FINANCE	6.875	350	337	33,960	2023/5/15
	PDC ENERGY INC	6.125	100	102	10,293	2024/9/15
	PENN NATIONAL GAMING INC	5.875	225	232	23,415	2021/11/1
	PENSKE AUTO GROUP INC	5.75	350	362	36,424	2022/10/1
	PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	5.5	225	225	22,623	2026/5/15
	PERSTORP HOLDING AB	8.75	200	200	20,115	2017/5/15
	PETROLEUM GEO-SERVICES	7.375	200	160	16,088	2018/12/15
	PINNACLE FOODS INC	5.875	100	107	10,771	2024/1/15
	PIONEER ENERGY SERVICES	6.125	125	83	8,421	2022/3/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.5	859	874	87,883	2020/11/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.75	325	329	33,168	2022/2/1
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.875	475	482	48,477	2023/2/15
	POST HOLDINGS INC	6.75	125	134	13,511	2021/12/1
	POST HOLDINGS INC	7.75	325	364	36,600	2024/3/15
	POST HOLDINGS INC	5.0	575	572	57,581	2026/8/15
	PRECISION DRILLING CORP	6.5	280	256	25,760	2021/12/15
	PRECISION DRILLING CORP	5.25	150	123	12,405	2024/11/15
	PRIME SECSRVC BRW/FINANC	9.25	525	569	57,275	2023/5/15
	PRODUCTION RES GROUP	8.875	500	297	29,913	2019/5/1
	PSPC ESCROW CORP	6.5	75	72	7,296	2022/2/1
	QORVO INC	6.75	325	352	35,395	2023/12/1
	QORVO INC	7.0	200	217	21,869	2025/12/1
	QUEBECOR MEDIA INC	5.75	250	260	26,237	2023/1/15
	RADIAN GROUP INC	5.25	275	289	29,102	2020/6/15
	RADIAN GROUP INC	7.0	200	224	22,598	2021/3/15
	RADIO SYSTEMS CORP	8.375	975	1,021	102,707	2019/11/1
	RANGE RESOURCES CORP	5.0	75	73	7,428	2022/8/15
	RANGE RESOURCES CORP	5.0	175	171	17,288	2023/3/15
	REALOGY GROUP/CO-ISSUER	5.25	300	316	31,786	2021/12/1
	REALOGY GROUP/CO-ISSUER	4.875	425	432	43,481	2023/6/1
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	350	360	36,248	2022/3/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	50	51	5,128	2023/6/15
	RESOLUTE FOREST PRODUCTS	5.875	550	473	47,560	2023/5/15
	REVLON ESCROW CORP	6.25	200	207	20,813	2024/8/1
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS	6.875	315	326	32,861	2021/2/15
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	5.75	650	670	67,399	2020/10/15
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	5.125	375	387	38,978	2023/7/15
	RICE ENERGY INC	6.25	125	129	13,040	2022/5/1
	RIVERS PITTSBURGH LP/FIN	6.125	75	77	7,748	2021/8/15
	ROSE ROCK MIDSTREAM/FIN	5.625	625	576	57,973	2022/7/15
	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	7.64	1,100	1,069	107,563	2049/3/29

銘柄	当	期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ						
普通社債券 (含む投資法人債券)	RSI HOME PRODUCTS INC	6.5	775	821	82,601	2023/3/15
	RYLAND GROUP	6.625	425	473	47,648	2020/5/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	800	851	85,568	2021/2/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	6.25	300	328	33,068	2022/3/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	700	747	75,135	2023/4/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.875	400	433	43,613	2026/6/30
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.0	425	433	43,588	2027/3/15
	SABRA HEALTH/CAPTL CORP	5.5	150	157	15,798	2021/2/1
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.75	311	325	32,756	2022/6/1
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.625	200	214	21,593	2025/12/1
	SANCHEZ ENERGY CORP	6.125	250	193	19,481	2023/1/15
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5.625	325	333	33,556	2019/10/1
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4.875	525	542	54,537	2022/7/15
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4.875	200	201	20,210	2024/9/1
	SCHAEFFLER VERWALTUNG ZW	4.125	200	203	20,418	2021/9/15
	SCHAEFFLER VERWALTUNG ZW	4.5	200	201	20,260	2023/9/15
	SCHAEFFLER VERWALTUNG ZW	4.75	200	201	20,260	2026/9/15
	SCOTTS MIRACLE-GRO CO	6.0	325	347	34,966	2023/10/15
	SEALED AIR CORP	5.125	200	213	21,467	2024/12/1
	SEALED AIR CORP	5.5	500	536	53,919	2025/9/15
	SENSATA TECH UK FIN CO	6.25	375	406	40,911	2026/2/15
	SERVICE CORP INTL	8.0	875	1,036	104,257	2021/11/15
	SERVICE CORP INTL	5.375	200	209	21,014	2022/1/15
	SESI LLC	6.375	300	297	29,938	2019/5/1
	SESI LLC	7.125	300	292	29,373	2021/12/15
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	5.875	150	150	15,120	2023/4/1
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	6.125	150	150	15,120	2025/4/1
	SILGAN HOLDINGS INC	5.0	325	333	33,577	2020/4/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.875	150	156	15,742	2026/3/15
	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.125	150	147	14,780	2027/2/15
	SIRIUS XM RADIO INC	5.875	225	231	23,291	2020/10/1
	SIRIUS XM RADIO INC	6.0	675	722	72,664	2024/7/15
	SIRIUS XM RADIO INC	5.375	375	387	38,931	2026/7/15
	SLM CORP	6.0	100	101	10,176	2017/1/25
	SLM CORP	5.5	200	203	20,436	2019/1/15
	SLM CORP	8.0	500	535	53,794	2020/3/25
	SLM CORP	6.125	400	374	37,605	2024/3/25
	SM ENERGY CO	6.5	175	173	17,464	2023/1/1
	SM ENERGY CO	6.75	350	348	35,082	2026/9/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	7.0	775	817	82,212	2022/7/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	5.0	125	124	12,505	2023/5/15
	SOUTHERN STAR CENT CORP	5.125	225	226	22,736	2022/7/15
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	7.5	25	26	2,633	2018/2/1
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	5.8	800	794	79,836	2020/1/23
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	4.1	125	113	11,374	2022/3/15
	SPCM SA	6.0	200	210	21,115	2022/1/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.625	75	80	8,125	2022/11/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債)					
	SPECTRUM BRANDS INC	5. 75	175	189	19,091	2025/7/15
	SPEEDWAY MOTORSPORTS INC	5. 125	125	128	12,882	2023/2/1
	SPRINT CAPITAL CORP	6. 875	325	303	30,513	2028/11/15
	SPRINT CAPITAL CORP	8. 75	750	761	76,543	2032/3/15
	SPRINT COMMUNICATIONS	6. 0	350	325	32,729	2022/11/15
	SPRINT CORP	7. 875	150	150	15,120	2023/9/15
	SPRINT CORP	7. 125	550	532	53,505	2024/6/15
	SPRINT NEXTEL CORP	8. 375	1,075	1,115	112,144	2017/8/15
	SPRINT NEXTEL CORP	9. 0	50	55	5,561	2018/11/15
	SPRINT NEXTEL CORP	7. 0	475	511	51,468	2020/3/1
	SPRINT NEXTEL CORP	7. 0	75	75	7,573	2020/8/15
	SPX FLOW INC	5. 625	125	126	12,678	2024/8/15
	SPX FLOW INC	5. 875	125	125	12,615	2026/8/15
	SS&C TECH HOLDINGS INC	5. 875	225	238	23,981	2023/7/15
	STANDARD INDUSTRIES INC	5. 125	150	159	15,996	2021/2/15
	STANDARD INDUSTRIES INC	5. 5	75	78	7,842	2023/2/15
	STANDARD PACIFIC CORP	8. 375	850	935	94,014	2018/5/15
	STEEL DYNAMICS INC	6. 375	275	290	29,206	2022/8/15
	SUBURBAN PROPANE PARTNRS	5. 5	250	254	25,577	2024/6/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	7. 5	650	664	66,828	2021/7/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	5. 5	75	71	7,183	2022/8/15
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7. 375	325	304	30,636	2020/2/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	5. 5	450	452	45,530	2020/8/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	6. 25	700	717	72,144	2021/4/15
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	6. 375	625	640	64,414	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6. 464	200	204	20,512	2019/4/28
	T-MOBILE USA INC	6. 542	500	517	52,060	2020/4/28
	T-MOBILE USA INC	6. 25	100	105	10,560	2021/4/1
	T-MOBILE USA INC	6. 125	525	558	56,154	2022/1/15
	T-MOBILE USA INC	6. 731	125	131	13,244	2022/4/28
	T-MOBILE USA INC	6. 0	450	476	47,948	2023/3/1
	T-MOBILE USA INC	6. 625	100	106	10,752	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6. 836	75	80	8,125	2023/4/28
	T-MOBILE USA INC	6. 375	450	485	48,810	2025/3/1
	T-MOBILE USA INC	6. 5	525	578	58,194	2026/1/15
	TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	5. 5	150	150	15,157	2024/9/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	4. 125	300	306	30,768	2019/11/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6. 875	425	440	44,336	2021/2/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6. 375	131	136	13,698	2022/8/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6. 75	250	266	26,834	2024/3/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	5. 125	200	199	20,084	2025/2/1
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	5. 625	200	206	20,763	2024/3/1
	TECK COMINCO LIMITED	6. 125	175	160	16,144	2035/10/1
	TECK RESOURCES LIMITED	8. 0	75	82	8,248	2021/6/1
	TECK RESOURCES LIMITED	4. 75	50	48	4,851	2022/1/15
	TECK RESOURCES LIMITED	8. 5	75	86	8,672	2024/6/1
	TEMPUR SEALY INTL INC	5. 5	275	283	28,549	2026/6/15

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日	
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)	TENASKA ALABAMA PART	7.0	183	190	19,110	2021/6/30
		TENET HEALTHCARE CORP	4.35028	225	227	22,825	2020/6/15
		TENET HEALTHCARE CORP	6.0	850	896	90,114	2020/10/1
		TENNECO INC	5.0	200	203	20,411	2026/7/15
		TERRAFORM GLOBAL OPERATI	9.75	275	284	28,619	2022/8/15
		TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.125	250	261	26,300	2021/10/15
		TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.375	225	240	24,207	2024/5/1
		THOMPSON CREEK METALS CO	7.375	275	279	28,066	2018/6/1
		TIME INC	5.75	225	219	22,058	2022/4/15
		TITAN INTERNATIONAL INC	6.875	100	93	9,426	2020/10/1
		TMS INTERNATIONAL CORP	7.625	75	63	6,353	2021/10/15
		TMX FIN LLC/TITLEMAX FIN	8.5	175	132	13,285	2018/9/15
		TOPAZ MARINE SA	8.625	200	195	19,614	2018/11/1
		TPC GROUP INC	8.75	550	431	43,343	2020/12/15
		TRAC INTERMODAL LLC/CORP	11.0	70	74	7,469	2019/8/15
		TRADER CORP	9.875	468	479	48,219	2018/8/15
		TRANSFIELD SERVICES LTD	8.375	125	133	13,448	2020/5/15
		TREEHOUSE FOODS INC	6.0	300	323	32,502	2024/2/15
		TRI POINTE HOLDINGS INC	4.375	225	231	23,267	2019/6/15
		TRI POINTE HOLDINGS INC	5.875	225	233	23,472	2024/6/15
		TRINIDAD DRILLING LTD	7.875	250	228	23,000	2019/1/15
		TRIUMPH GROUP INC	5.25	175	166	16,760	2022/6/1
		TULLOW OIL PLC	6.25	600	525	52,788	2022/4/15
		UNITED RENTALS NORTH AM	5.875	275	281	28,342	2026/9/15
		UNITYMEDIA HESSEN / NRW	5.5	675	705	70,925	2023/1/15
		UNITYMEDIA KABELBW GMBH	6.125	200	210	21,165	2025/1/15
		UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	7.625	300	286	28,807	2020/8/15
		UNIVISION COMMUNICATIONS	6.75	920	977	98,287	2022/9/15
		US AIRWAYS 2012-2C PTT	5.45	50	51	5,153	2018/6/3
		US CONCRETE INC	6.375	225	234	23,528	2024/6/1
		VALEANT PHARMACEUTICALS	6.75	425	400	40,276	2021/8/15
		VALVOLINE FINCO TWO LLC	5.5	75	78	7,899	2024/7/15
		VERITAS US INC/BERMUDA L	7.5	200	192	19,305	2023/2/1
		VERSOR MATERIALS INC	5.5	100	102	10,281	2024/9/30
		VIDEOTRON LTD	5.375	75	78	7,871	2024/6/15
		VIKING CRUISES LTD	8.5	350	357	35,896	2022/10/15
		VIKING CRUISES LTD	6.25	75	70	7,069	2025/5/15
		VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	6.375	400	422	42,432	2023/4/15
		VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	5.75	500	510	51,343	2025/1/15
		VPII ESCROW CORP	6.75	250	252	25,388	2018/8/15
		VPII ESCROW CORP	7.5	250	240	24,226	2021/7/15
		VRX ESCROW CORP	5.375	325	301	30,309	2020/3/15
		VRX ESCROW CORP	5.875	525	454	45,662	2023/5/15
		VRX ESCROW CORP	6.125	900	774	77,825	2025/4/15
		VTR FINANCE BV	6.875	200	208	20,914	2024/1/15
		WEATHERFORD BERMUDA	7.0	125	89	8,986	2038/3/15
		WELLCARE HEALTH PLANS IN	5.75	450	465	46,774	2020/11/15

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債株)					
	WESCO DISTRIBUTION INC	5.375	150	153	15,478	2021/12/15
	WEST CORP	5.375	950	925	93,015	2022/7/15
	WESTERN DIGITAL CORP	7.375	275	302	30,381	2023/4/1
	WESTERN DIGITAL CORP	10.5	700	811	81,558	2024/4/1
	WESTERN REFINING/WNRL FI	7.5	100	102	10,331	2023/2/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	5.75	75	76	7,692	2019/4/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	7.0	100	103	10,356	2022/8/15
	WILLIAMS COMPANIES INC	4.55	900	906	91,173	2024/6/24
	WILLIAMS COMPANIES INC	5.75	50	51	5,178	2044/6/24
	WILLIAMS PARTNERS ACMP	6.125	100	103	10,445	2022/7/15
	WINDSTREAM CORP	7.75	375	375	37,800	2021/10/1
	WINDSTREAM CORP	7.5	250	240	24,194	2022/6/1
	WINDSTREAM CORP	6.375	250	225	22,623	2023/8/1
	WMG ACQUISITION CORP	5.0	75	76	7,692	2023/8/1
	WOODSIDE HOMES CO LLC/FI	6.75	500	486	48,892	2021/12/15
	WPX ENERGY INC	6.0	1,125	1,091	109,725	2022/1/15
	WR GRACE & CO-CONN	5.125	225	240	24,150	2021/10/1
	XPO LOGISTICS INC	6.5	450	469	47,170	2022/6/15
	XPO LOGISTICS INC	6.125	125	129	12,977	2023/9/1
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	6.375	325	346	34,843	2025/5/15
	ZIGGO BOND FINANCE BV	5.875	200	201	20,210	2025/1/15
	ZIGGO BOND FINANCE BV	6.0	450	446	44,851	2027/1/15
	ZIGGO SECURED FINANCE BV	5.5	150	149	14,997	2027/1/15
合	計				19,757,000	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	8,462	0.0
公社債	19,757,000	93.1
コール・ローン等、その他	1,444,777	6.9
投資信託財産総額	21,210,239	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建て純資産（20,828,896千円）の投資信託財産総額（21,210,239千円）に対する比率は98.2%です。

* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝100.55円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,461,589,073
コール・ローン等	1,064,835,305
株式(評価額)	8,462,288
公社債(評価額)	19,757,000,773
未収入金	303,903,040
未収利息	320,230,702
前払費用	7,156,965
(B) 負債	675,082,878
未払金	366,982,500
未払解約金	308,100,000
未払利息	378
(C) 純資産総額(A-B)	20,786,506,195
元本	3,449,209,850
次期繰越損益金	17,337,296,345
(D) 受益権総口数	3,449,209,850口
1口当たり基準価額(C/D)	60,265円

(注) 期首元本額は3,225,331,881円、期中追加設定元本額は545,799,516円、期中一部解約元本額は321,921,547円、1口当たり純資産額は6.0265円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース 684,283,973円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Aコース (野村SMA・EW向け) 535,218,021円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Bコース (野村SMA・EW向け) 456,418,360円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンAコース (野村SMA向け) 445,088,418円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンAコース 419,548,160円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース (野村SMA向け) 408,623,769円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンDコース 269,944,188円
- ・ハイブリッド・インカムオープン 207,203,976円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンCコース 22,880,985円

○損益の状況 (2016年3月29日～2016年9月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	601,835,587
受取利息	600,139,379
その他収益金	1,770,656
支払利息	△ 74,448
(B) 有価証券売買損益	△ 1,200,191,023
売買益	1,155,446,401
売買損	△ 2,355,637,424
(C) 保管費用等	△ 5,512,991
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 603,868,427
(E) 前期繰越損益金	16,824,642,741
(F) 追加信託差損益金	2,758,700,484
(G) 解約差損益金	△ 1,642,178,453
(H) 計(D+E+F+G)	17,337,296,345
次期繰越損益金(H)	17,337,296,345

*損益の状況の中で(B)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。

*損益の状況の中で(F)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。

*損益の状況の中で(G)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

該当事項はございません。