

ハイ・イールド ボンド オープン (隔月分配型) Cコース／Dコース

運用報告書(全体版)

第81期(決算日2015年5月28日) 第82期(決算日2015年7月28日) 第83期(決算日2015年9月28日)

作成対象期間(2015年3月31日～2015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。

	Cコース	Dコース
商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2001年10月1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(隔月分配型) Cコース/Dコース	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もあります。
	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	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	ハイ・イールド ボンド オープン(隔月分配型) Cコース/Dコース	株式への投資は転換社債を転換したもの等に限る、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。
	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したもの等に限る、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。
分配方針	年6回の毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等から、原則として配当等収益等を中心に分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。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/>

<Cコース>

○最近15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	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
69期(2013年5月28日)	10,807	95	2.0	224.64	1.9	—	96.0	—	152
70期(2013年7月29日)	10,524	95	△1.7	220.93	△1.7	—	92.0	—	141
71期(2013年9月30日)	10,440	95	0.1	221.59	0.3	—	94.9	—	139
72期(2013年11月28日)	10,591	95	2.4	227.36	2.6	—	96.2	—	140
73期(2014年1月28日)	10,600	95	1.0	229.94	1.1	—	93.2	—	140
74期(2014年3月28日)	10,699	95	1.8	234.83	2.1	—	92.8	—	141
75期(2014年5月28日)	10,729	95	1.2	238.49	1.6	—	93.2	—	145
76期(2014年7月28日)	10,666	95	0.3	239.64	0.5	—	94.6	—	141
77期(2014年9月29日)	10,410	95	△1.5	236.46	△1.3	—	98.6	—	137
78期(2014年11月28日)	10,390	95	0.7	238.93	1.0	—	99.8	—	138
79期(2015年1月28日)	10,159	95	△1.3	236.98	△0.8	—	96.1	—	135
80期(2015年3月30日)	10,213	95	1.5	241.22	1.8	—	95.8	—	134
81期(2015年5月28日)	10,244	95	1.2	244.64	1.4	—	94.3	—	126
82期(2015年7月28日)	9,879	95	△2.6	238.36	△2.6	—	90.8	—	120
83期(2015年9月28日)	9,557	95	△2.3	233.23	△2.1	—	91.6	—	111

* 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

<Cコース>

○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		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				
第81期	(期 首) 2015年 3 月 30日	円 10,213	% —	241.22	% —	% —	% 95.8	% —
	3 月末	10,230	0.2	241.53	0.1	—	96.6	—
	4 月末	10,323	1.1	244.06	1.2	—	93.3	—
	(期 末) 2015年 5 月 28日	10,339	1.2	244.64	1.4	—	94.3	—
第82期	(期 首) 2015年 5 月 28日	10,244	—	244.64	—	—	94.3	—
	5 月末	10,247	0.0	244.68	0.0	—	94.6	—
	6 月末	10,093	△1.5	241.09	△1.5	—	91.7	—
	(期 末) 2015年 7 月 28日	9,974	△2.6	238.36	△2.6	—	90.8	—
第83期	(期 首) 2015年 7 月 28日	9,879	—	238.36	—	—	90.8	—
	7 月末	9,944	0.7	240.21	0.8	—	92.6	—
	8 月末	9,781	△1.0	236.18	△0.9	—	90.1	—
	(期 末) 2015年 9 月 28日	9,652	△2.3	233.23	△2.1	—	91.6	—

* 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。

<Dコース>

○最近15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	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
69期(2013年5月28日)	8,687	75	9.7	238.60	9.9	—	96.8	—	2,766
70期(2013年7月29日)	8,165	75	△5.1	226.26	△5.2	—	92.9	—	2,546
71期(2013年9月30日)	8,081	75	△0.1	226.54	0.1	—	95.8	—	2,435
72期(2013年11月28日)	8,545	75	6.7	242.53	7.1	—	93.7	—	2,499
73期(2014年1月28日)	8,617	75	1.7	247.25	1.9	—	92.8	—	2,478
74期(2014年3月28日)	8,647	75	1.2	251.01	1.5	—	93.6	—	2,446
75期(2014年5月28日)	8,669	75	1.1	254.74	1.5	—	93.2	—	2,422
76期(2014年7月28日)	8,611	75	0.2	255.82	0.4	—	94.8	—	2,359
77期(2014年9月29日)	9,027	75	5.7	271.37	6.1	—	96.3	—	2,406
78期(2014年11月28日)	9,737	75	8.7	296.57	9.3	—	96.3	—	2,493
79期(2015年1月28日)	9,508	75	△1.6	293.27	△1.1	—	95.8	—	2,399
80期(2015年3月30日)	9,696	75	2.8	302.51	3.2	—	95.9	—	2,377
81期(2015年5月28日)	10,103	75	5.0	318.59	5.3	—	91.7	—	2,398
82期(2015年7月28日)	9,739	75	△2.9	309.47	△2.9	—	89.6	—	2,238
83期(2015年9月28日)	9,239	75	△4.4	296.30	△4.3	—	91.9	—	2,073

* 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

<Dコース>

○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		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	債 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率				
第81期	(期 首) 2015年 3 月30日	円 9,696	% —	302.51	% —	% —	% 95.9	% —
	3 月末	9,779	0.9	305.21	0.9	—	96.0	—
	4 月末	9,788	0.9	305.78	1.1	—	93.4	—
	(期 末) 2015年 5 月28日	10,178	5.0	318.59	5.3	—	91.7	—
第82期	(期 首) 2015年 5 月28日	10,103	—	318.59	—	—	91.7	—
	5 月末	10,111	0.1	318.83	0.1	—	91.9	—
	6 月末	9,867	△2.3	311.04	△2.4	—	90.6	—
	(期 末) 2015年 7 月28日	9,814	△2.9	309.47	△2.9	—	89.6	—
第83期	(期 首) 2015年 7 月28日	9,739	—	309.47	—	—	89.6	—
	7 月末	9,870	1.3	314.11	1.5	—	90.7	—
	8 月末	9,495	△2.5	301.82	△2.5	—	91.5	—
	(期 末) 2015年 9 月28日	9,314	△4.4	296.30	△4.3	—	91.9	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

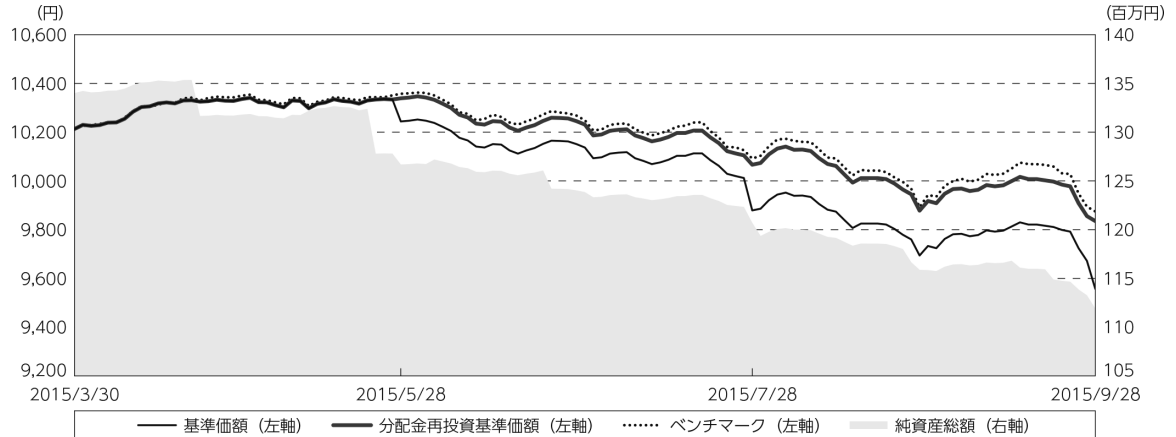
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<Cコース>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第81期首：10,213円

第83期末：9,557円 (既払分配金 (税込み) : 285円)

騰落率：△ 3.7% (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 (2015年3月30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 (2015年3月30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10,213円から当作成期末には9,557円となりました。

- ・一部米国企業の決算が好調な内容だったことや、原油価格の下げ止まりなどを受けて、投資家のリスク許容度が改善したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・イエレンFRB (米連邦準備制度理事会) 議長が議会証言において、年内に政策金利を引き上げる可能性が高いとの認識を示したことなどを背景に、FRBによる政策金利引き上げ懸念が高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
- ・中国株式市場が大幅下落となったことや原油価格などの商品価格が下落したことなどをを受けて、世界経済の先行き不透明感が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと

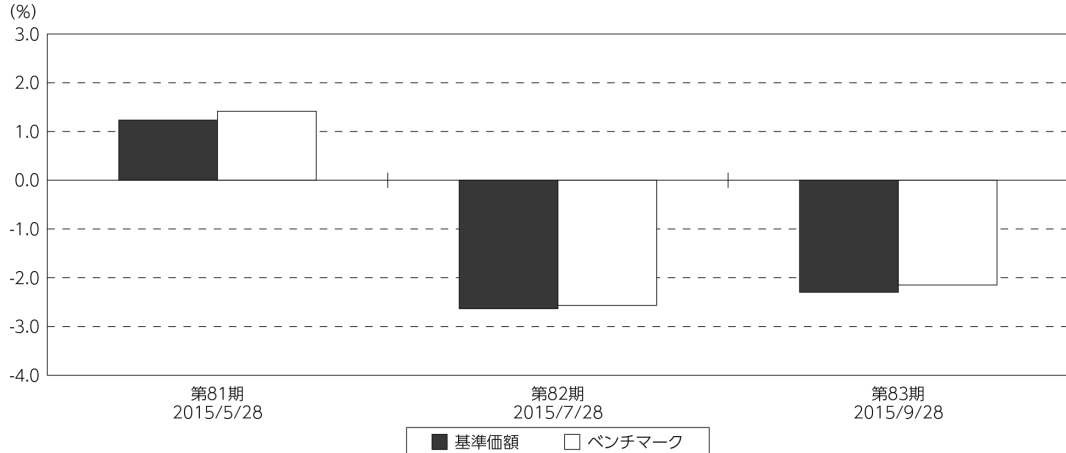
<Cコース>

○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-3.7%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-3.3%を0.4ポイント下回りました。主な差異の要因は、B格およびBB格銘柄における銘柄選択がプラスに寄与したものの、設定解約の影響がマイナスに作用したことなどです。

* 基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

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。

<Cコース>

◎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81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
当期分配金	95	95	95
(対基準価額比率)	0.919%	0.952%	0.984%
当期の収益	90	75	74
当期の収益以外	4	19	20
翌期繰越分配対象額	3,730	3,711	3,690

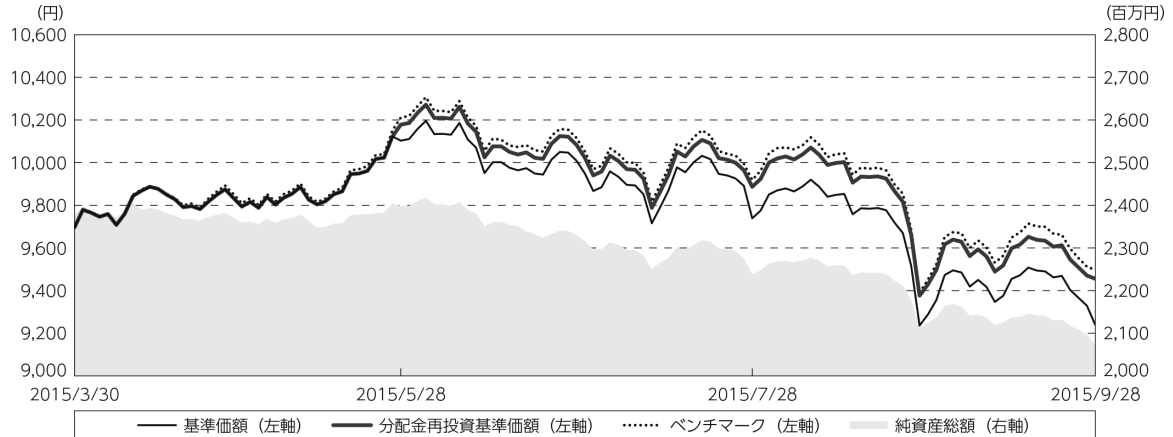
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

<Dコース>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第81期首：9,696円

第83期末：9,239円 (既払分配金 (税込み) : 225円)

騰落率：△ 2.5% (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 (2015年3月30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 (円換算ベース) です。ベンチマークは、作成期首 (2015年3月30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9,696円から当作成期末には9,239円となりました。

- 一部米国企業の決算が好調な内容だったことや、原油価格の下げ止まりなどを受けて、投資家のリスク許容度が改善したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- イエレンFRB (米連邦準備制度理事会) 議長が議会証言において、年内に政策金利を引き上げる可能性が高いとの認識を示したことなどを背景に、FRBによる政策金利引き上げ懸念が高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
- 中国株式市場が大幅下落となったことや原油価格などの商品価格が下落したことなどをを受けて、世界経済の先行き不透明感が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- 円/ドルの為替相場推移

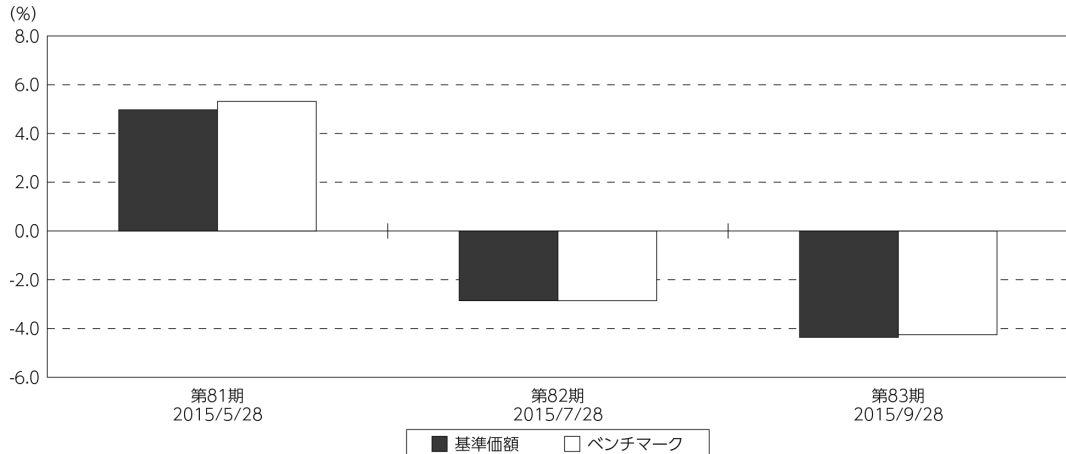
<Dコース>

○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-2.5%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-2.1%を0.4ポイント下回りました。主な差異の要因は、B格およびBB格銘柄における銘柄選択がプラスに寄与したものの、設定解約の影響がマイナスに作用したことなどです。

* 基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

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（円換算ベース）です。

<Dコース>

◎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81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
当期分配金 (対基準価額比率)	75 0.737%	75 0.764%	75 0.805%
当期の収益	75	71	72
当期の収益以外	－	3	2
翌期繰越分配対象額	2,277	2,273	2,271

(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。

<Cコース/Dコース>

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間では下落しました（トータルリターン・現地通貨ベース）。米国の主要経済指標や米国の企業決算、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、FRBの利上げ観測などを背景に、ドルに対して円安が進行しました。

○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C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D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2.3%、29.2%、55.5%、5.6%、0.0%としました。

<Cコース/D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、企業利益の増加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、エネルギーセクターでの上昇が予想されますが、米国ハイ・イールド債市場全体では、好調な米国景気を背景に今後も低水準で推移すると考えられます。FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げのタイミングについては見方が分かれますが、いずれにしても、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、金利上昇は緩やかなペースになると予想されます。その為、金利の急上昇に伴う米国ハイ・イールド債券の価格下落が起こる可能性は低いと考えます。業種別ではエネルギーセクターの中でも、財務状況や投資計画が健全な企業に投資機会があると判断しておりますが、エネルギーセクターのデフォルト率は今後上昇することが予想されており、慎重に銘柄を選定していく方針です。
- ・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。

[ハイ・イールド ボンド オープンC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D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、よろしくお願いいたします。

<Cコース>

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月31日～2015年9月28日)

項 目	第81期～第83期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 85	% 0.843	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(55)	(0.548)	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)	(27)	(0.269)	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)	(3)	(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	3	0.027	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(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	88	0.870	
作成期間の平均基準価額は、10,103円です。			

*作成期間の費用（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）を作成期間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

(2015年3月31日～2015年9月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第81期～第83期			
	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 469	千円 3,200	千口 3,488	千円 23,900

*単位未満は切り捨て。

<Cコース>

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月31日～2015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Cコース>

区 分	第81期～第83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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 304	百万円 7	% 2.3	百万円 280	百万円 -	% -

<ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド>

区 分	第81期～第83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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 2,911	百万円 735	% 25.2	百万円 1,139	百万円 48	% 4.2

平均保有割合 0.6%

※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。

○組入資産の明細

(2015年9月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第80期末		第83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 19,841		千口 16,822	千円 110,565

*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。

＜Cコース＞

○投資信託財産の構成

(2015年9月28日現在)

項 目	第83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	110,565	97.5
コール・ローン等、その他	2,842	2.5
投資信託財産総額	113,407	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、第83期末における外貨建て純資産（21,053,346千円）の投資信託財産総額（21,398,615千円）に対する比率は98.4%です。

*外貨建て資産は、第83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=120.40円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第81期末	第82期末	第83期末
	2015年5月28日現在	2015年7月28日現在	2015年9月28日現在
	円	円	円
(A) 資産	255,633,288	241,565,860	221,981,080
コール・ローン等	1,155,240	1,255,188	1,101,565
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	129,121,196	121,188,630	110,565,217
未収入金	125,356,850	119,122,040	110,314,296
未収利息	2	2	2
(B) 負債	128,951,109	120,857,918	110,068,123
未払金	127,412,070	119,343,608	108,617,820
未払収益分配金	1,174,828	1,160,724	1,112,485
未払信託報酬	363,775	353,153	337,408
その他未払費用	436	433	410
(C) 純資産総額(A-B)	126,682,179	120,707,942	111,912,957
元本	123,666,156	122,181,504	117,103,771
次期繰越損益金	3,016,023	△ 1,473,562	△ 5,190,814
(D) 受益権総口数	123,666,156口	122,181,504口	117,103,771口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,244円	9,879円	9,557円

(注) 第81期首元本額131百万円、第81～第83期中追加設定元本額1百万円、第81～第83期中一部解約元本額15百万円、第83期末計算口数当たり純資産額9,557円。

(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52,550,319円。(ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド)

<Cコース>

○損益の状況

項 目	第81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
	円	円	円
(A) 配当等収益	104	118	125
受取利息	104	118	125
(B) 有価証券売買損益	1,916,530	△ 2,939,357	△ 2,328,313
売買益	7,759,449	2,537,959	4,484,381
売買損	△ 5,842,919	△ 5,477,316	△ 6,812,694
(C) 信託報酬等	△ 364,211	△ 353,586	△ 337,818
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	1,552,423	△ 3,292,825	△ 2,666,006
(E) 前期繰越損益金	1,264,856	1,615,349	△ 2,720,249
(F) 追加信託差損益金	1,373,572	1,364,638	1,307,926
(配当等相当額)	(32,235,651)	(31,911,537)	(30,592,335)
(売買損益相当額)	(△30,862,079)	(△30,546,899)	(△29,284,409)
(G) 計(D+E+F)	4,190,851	△ 312,838	△ 4,078,329
(H) 収益分配金	△ 1,174,828	△ 1,160,724	△ 1,112,485
次期繰越損益金(G+H)	3,016,023	△ 1,473,562	△ 5,190,814
追加信託差損益金	1,373,572	1,364,638	1,307,926
(配当等相当額)	(32,236,025)	(31,918,833)	(30,592,335)
(売買損益相当額)	(△30,862,453)	(△30,554,195)	(△29,284,409)
分配準備積立金	13,902,938	13,429,889	12,627,289
繰越損益金	△12,260,487	△16,268,089	△19,126,029

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 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。

(注) 分配金の計算過程(2015年3月31日～2015年9月28日)は以下の通りです。

項 目	第81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,123,705円	917,088円	868,010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	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	32,236,025円	31,918,833円	30,592,335円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	13,954,061円	13,673,525円	12,871,764円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	47,313,791円	46,509,446円	44,332,109円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,825円	3,806円	3,785円
g. 分配金	1,174,828円	1,160,724円	1,112,485円
h. 分配金(1万円当たり)	95円	95円	95円

<Cコース>

○分配金のお知らせ

	第81期	第82期	第83期
1 万口当たり分配金 (税込み)	95円	95円	95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

信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2015年6月19日>

<Dコース>

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月31日～2015年9月28日)

項 目	第81期～第83期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 83	% 0.843	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(54)	(0.548)	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)	(26)	(0.269)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、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)	(3)	(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	3	0.027	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.025)	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	86	0.870	
作成期間の平均基準価額は、9,818円です。			

*作成期間の費用（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）を作成期間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

(2015年3月31日～2015年9月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第81期～第83期			
	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 945	千円 6,600	千口 40,466	千円 276,700

*単位未満は切り捨て。

<Dコース>

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月31日～2015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D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	第81期～第83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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 2,911	百万円 735	% 25.2	百万円 1,139	百万円 48	% 4.2

平均保有割合 10.7%

※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

(2015年9月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第80期末	第83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 352,233	千口 312,712	千円 2,055,304

*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。

<Dコース>

○投資信託財産の構成

(2015年9月28日現在)

項 目	第83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	2,055,304	97.7
コール・ローン等、その他	47,902	2.3
投資信託財産総額	2,103,206	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、第83期末における外貨建て純資産（21,053,346千円）の投資信託財産総額（21,398,615千円）に対する比率は98.4%です。

*外貨建て資産は、第83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=120.40円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第81期末	第82期末	第83期末
	2015年5月28日現在	2015年7月28日現在	2015年9月28日現在
	円	円	円
(A) 資産	2,426,123,101	2,274,197,281	2,103,206,726
コール・ローン等	23,630,430	22,102,735	21,301,777
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	2,377,992,628	2,217,394,506	2,055,304,910
未収入金	24,500,000	34,700,000	26,600,000
未収利息	43	40	39
(B) 負債	27,297,342	35,970,208	30,193,103
未払収益分配金	17,806,986	17,236,421	16,828,251
未払解約金	2,976,772	12,112,996	7,065,216
未払信託報酬	6,505,319	6,612,389	6,291,644
その他未払費用	8,265	8,402	7,992
(C) 純資産総額(A-B)	2,398,825,759	2,238,227,073	2,073,013,623
元本	2,374,264,874	2,298,189,482	2,243,766,828
次期繰越損益金	24,560,885	△ 59,962,409	△ 170,753,205
(D) 受益権総口数	2,374,264,874口	2,298,189,482口	2,243,766,828口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,103円	9,739円	9,239円

(注) 第81期首元本額2,451百万円、第81～第83期中追加設定元本額13百万円、第81～第83期中一部解約元本額221百万円、第83期末計算口数当たり純資産額9,239円。

(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52,550,319円。(ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド)

<Dコース>

○損益の状況

項 目	第81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
	円	円	円
(A) 配当等収益	2,277	2,555	2,445
受取利息	2,277	2,555	2,445
(B) 有価証券売買損益	120,940,957	△ 59,791,193	△ 89,035,522
売買益	122,243,729	1,294,615	1,487,712
売買損	△ 1,302,772	△ 61,085,808	△ 90,523,234
(C) 信託報酬等	△ 6,513,584	△ 6,620,791	△ 6,299,636
(D) 当期損益金(A+B+C)	114,429,650	△ 66,409,429	△ 95,332,713
(E) 前期繰越損益金	△ 51,046,260	43,944,396	△ 38,710,961
(F) 追加信託差損益金	△ 21,015,519	△ 20,260,955	△ 19,881,280
(配当等相当額)	(281,501,317)	(273,463,443)	(267,328,915)
(売買損益相当額)	(△302,516,836)	(△293,724,398)	(△287,210,195)
(G) 計(D+E+F)	42,367,871	△ 42,725,988	△153,924,954
(H) 収益分配金	△ 17,806,986	△ 17,236,421	△ 16,828,251
次期繰越損益金(G+H)	24,560,885	△ 59,962,409	△170,753,205
追加信託差損益金	△ 21,015,519	△ 20,260,955	△ 19,881,280
(配当等相当額)	(281,507,305)	(273,489,594)	(267,368,871)
(売買損益相当額)	(△302,522,824)	(△293,750,549)	(△287,250,151)
分配準備積立金	259,160,370	249,021,373	242,296,170
繰越損益金	△213,583,966	△288,722,827	△393,168,095

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 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。

(注) 分配金の計算過程(2015年3月31日～2015年9月28日)は以下の通りです。

項 目	第81期	第82期	第83期
	2015年3月31日～ 2015年5月28日	2015年5月29日～ 2015年7月28日	2015年7月29日～ 2015年9月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	23,914,953円	16,377,471円	16,315,764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	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	281,507,305円	273,489,594円	267,368,871円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	253,052,403円	249,880,323円	242,808,657円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	558,474,661円	539,747,388円	526,493,292円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,352円	2,348円	2,346円
g. 分配金	17,806,986円	17,236,421円	16,828,251円
h. 分配金(1万口当たり)	75円	75円	75円

<Dコース>

○分配金のお知らせ

	第81期	第82期	第83期
1 万口当たり分配金 (税込み)	75円	75円	75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

信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2015年6月19日>

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41期（決算日2015年9月28日）

作成対象期間（2015年3月31日～2015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	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率				
37期(2013年9月30日)	50,297	4.8	441.40	4.3	—	96.8	—	18,142
38期(2014年3月28日)	55,733	10.8	489.07	10.8	—	94.5	—	19,469
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

*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

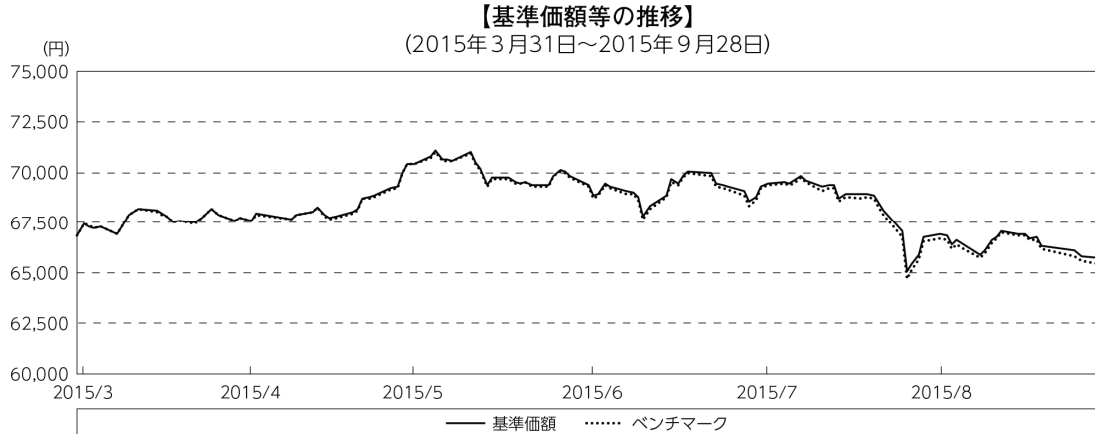
年月日	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(期首) 2015年3月30日	66,849	—	589.40	—	—	96.8	—
3月末	67,425	0.9	594.67	0.9	—	96.9	—
4月末	67,582	1.1	595.78	1.1	—	94.2	—
5月末	70,461	5.4	621.20	5.4	—	92.7	—
6月末	68,847	3.0	606.03	2.8	—	91.3	—
7月末	69,494	4.0	612.01	3.8	—	91.5	—
8月末	66,925	0.1	588.06	△0.2	—	92.2	—
(期末) 2015年9月28日	65,725	△1.7	577.30	△2.1	—	92.7	—

*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・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。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。

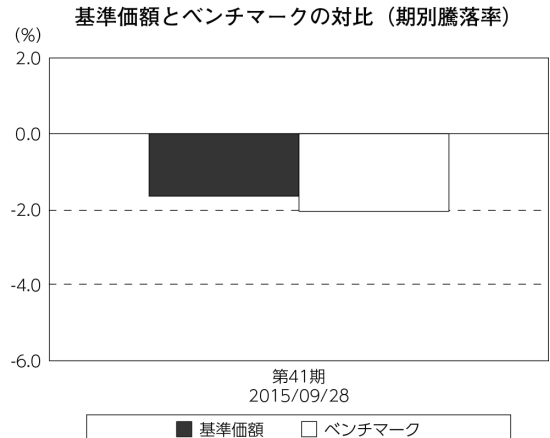
○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の66,849円から当作成期末には65,725円となりました。

- ・一部米国企業の決算が好調な内容だったことや、原油価格の下げ止まりなどを受けて、投資家のリスク許容度が改善したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・イエレンFRB（米連邦準備制度理事会）議長が議会証言において、年内に政策金利を引き上げる可能性が高いとの認識を示したことなどを背景に、FRBによる政策金利引き上げ懸念が高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
- ・中国株式市場が大幅下落となったことや原油価格などの商品価格が下落したことなどを背景に、世界経済の先行き不透明感が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・円／ドルの為替相場推移

○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-1.7%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-2.1%を0.4ポイント上回りました。主な差異の要因は、B格およびBB格銘柄における銘柄選択がプラ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、企業利益の増加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、エネルギーセクターでの上昇が予想されますが、米国ハイ・イールド債市場全体では、好調な米国景気を背景に今後も低水準で推移すると考えられます。FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げのタイミングについては見方が分かれますが、いずれにしても、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、金利上昇は緩やかなペースになると予想されます。その為、金利の急上昇に伴う米国ハイ・イールド債券の価格下落が起こる可能性は低いと考えます。業種別ではエネルギーセクターの中でも、財務状況や投資計画が健全な企業に投資機会があると判断しておりますが、エネルギーセクターのデフォルト率は今後上昇することが予想されており、慎重に銘柄を選定していく方針です。
- ・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。

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

(2015年3月31日～2015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 18	% 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)	(18)	(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
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	18	0.027	
期中の平均基準価額は、68,455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

(2015年3月31日～2015年9月28日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券（投資法人債券を含む）	千米ドル 43,104 (0.00536)	千米ドル 20,319 (9,978)

*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。ただし、数値が単位未満の場合は小数で記載。

*（ ）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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月31日～2015年9月28日)

利害関係人との取引状況

区 分	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	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	百万円 2,911	百万円 735	25.2	百万円 1,139	百万円 48	4.2

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

(2015年9月28日現在)

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	167,890	161,303	19,420,891	92.7	90.4	66.2	23.6	2.8
合 計	167,890	161,303	19,420,891	92.7	90.4	66.2	23.6	2.8

* 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。

(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	
		%	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)					
	1011778 BC / NEW RED FIN	4.625	575	569	68,537	2022/1/15
	A SCHULMAN INC	6.875	200	193	23,237	2023/6/1
	ABC SUPPLY CO INC	5.625	450	447	53,909	2021/4/15
	ABENGOA YIELD PLC	7.0	200	181	21,792	2019/11/15
	ACCESS MIDSTREAM PARTNER	4.875	500	471	56,787	2023/5/15
	ACCURIDE CORP	9.5	150	151	18,285	2018/8/1
	ACTIVISION BLIZZARD	5.625	350	367	44,247	2021/9/15
	ACTIVISION BLIZZARD	6.125	200	214	25,839	2023/9/15
	ADVANCED MICRO DEVICES	6.75	125	89	10,760	2019/3/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	7.0	125	79	9,594	2024/7/1
	AES CORPORATION	7.375	610	646	77,850	2021/7/1
	AGUILA 3 SA	7.875	650	657	79,140	2018/1/31
	AIR CANADA	6.75	200	211	25,404	2019/10/1
	AIRCASTLE LTD	6.25	250	269	32,393	2019/12/1
	AIRCASTLE LTD	5.125	150	152	18,397	2021/3/15
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA	8.375	250	264	31,793	2019/11/1
	ALERIS INTL INC	7.625	251	247	29,767	2018/2/15
	ALERIS INTL INC	7.875	126	124	14,942	2020/11/1
	ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	10.75	250	138	16,705	2019/10/15
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	5.375	650	637	76,694	2022/8/1
	ALLY FINANCIAL	8.0	1,045	1,205	145,156	2020/3/15
	ALLY FINANCIAL INC	7.5	759	876	105,548	2020/9/15
	ALLY FINANCIAL INC	8.0	350	412	49,672	2031/11/1
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	9.625	700	383	46,143	2018/10/15
	ALTICE FINCO SA	7.625	200	185	22,334	2025/2/15
	ALTICE SA	7.75	700	647	77,980	2022/5/15
	AMC ENTERTAINMENT INC	5.75	275	273	32,911	2025/6/15
	AMERICAN ACHIEVEMENT COR	10.875	75	73	8,871	2016/4/15
	AMERICAN AIRLINES GROUP	4.625	275	271	32,696	2020/3/1
	AMERICAN AXLE & MFG INC	6.25	250	253	30,513	2021/3/15
	AMERICAN GILSONITE CO	11.5	275	235	28,309	2017/9/1
	AMERICAN GREETINGS	7.375	625	655	78,918	2021/12/1
	AMERISTAR CASINOS INC	7.5	375	397	47,915	2021/4/15
	AMSURG CORP	5.625	150	154	18,601	2020/11/30
	AMSURG CORP	5.625	225	226	27,327	2022/7/15
	ANIXTER INC	5.125	175	175	21,175	2021/10/1
	ANTERO RESOURCES CORP	5.375	225	201	24,254	2021/11/1
	ANTERO RESOURCES CORP	5.625	275	253	30,461	2023/6/1
	APPROACH RESOURCES INC	7.0	300	184	22,213	2021/6/15
	APX GROUP INC	6.375	425	409	49,315	2019/12/1
	ARAMARK CORP	5.75	350	362	43,693	2020/3/15
	ARCELORMITTAL	6.25	600	555	66,912	2021/3/1
	ARCELORMITTAL	7.75	625	546	65,843	2039/10/15
	ARGOS MERGER SUB INC	7.125	550	563	67,875	2023/3/15
	ARTESYN ESCROW INC	9.75	400	402	48,400	2020/10/15

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)					
	ASSTEAD CAPITAL INC	6.5	575	603	72,691	2022/7/15
	ASSTEAD CAPITAL INC	5.625	250	250	30,100	2024/10/1
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.0	450	451	54,383	2021/6/15
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.125	625	627	75,532	2023/11/1
	AURICO GOLD INC	7.75	150	133	16,050	2020/4/1
	AUS FINANCE PTY LTD	6.875	225	154	18,556	2019/11/1
	BANK OF AMERICA CORP	6.25	650	647	77,966	2049/9/29
	BANK OF AMERICA CORP	8.0	250	262	31,548	2049/12/29
	BANKRATE INC	6.125	875	861	103,769	2018/8/15
	BARCLAYS BANK PLC	7.75	200	216	26,006	2023/4/10
	BARCLAYS PLC	8.25	400	420	50,675	2049/12/29
	BEACON ROOFING SUPPLY IN	6.375	200	202	24,335	2023/10/1
	BERRY PLASTICS ESCROW	6.0	25	25	3,040	2022/10/15
	BLOCK COMMUNICATIONS INC	7.25	375	373	44,924	2020/2/1
	BLUE RACER MID LLC/FINAN	6.125	75	72	8,736	2022/11/15
	BOISE CASCADE LLC/FIN	6.375	125	130	15,670	2020/11/1
	BONANZA CREEK ENERGY INC	5.75	100	66	8,006	2023/2/1
	BRIGHTSTAR CORP	9.5	150	151	18,195	2016/12/1
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.5	225	224	27,022	2020/12/15
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.375	125	119	14,410	2025/5/15
	BUILDING MATERIALS CORP	6.75	425	454	54,780	2021/5/1
	BUILDING MATERIALS CORP	5.375	575	569	68,537	2024/11/15
	BUILDING MATERIALS HOLDI	9.0	400	426	51,290	2018/9/15
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	5.875	625	473	57,001	2022/9/15
	CALERES INC	6.25	125	126	15,200	2023/8/15
	CALFRAC HOLDINGS LP	7.5	250	160	19,282	2020/12/1
	CALPINE CORP	6.0	175	184	22,176	2022/1/15
	CALPINE CORP	5.375	475	447	53,901	2023/1/15
	CALPINE CORP	5.75	675	637	76,800	2025/1/15
	CARDTRONICS INC	5.125	275	266	32,033	2022/8/1
	CARMIKE CINEMAS INC	6.0	200	206	24,862	2023/6/15
	CARRIZO OIL & GAS INC	6.25	125	111	13,469	2023/4/15
	CARROLS RESTAURANT GROUP	8.0	25	26	3,190	2022/5/1
	CASCADES INC	5.5	225	217	26,175	2022/7/15
	CASTLE (AM) & CO	12.75	150	126	15,215	2016/12/15
	CBS OUT AMER CAP LLC/COR	5.25	125	126	15,181	2022/2/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	250	250	30,171	2021/3/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	400	385	46,354	2022/9/30
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.125	250	234	28,256	2023/2/15
	CDW LLC/CDW FINANCE	6.0	500	524	63,134	2022/8/15
	CEB INC	5.625	200	200	24,140	2023/6/15
	CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	5.375	375	382	46,053	2024/6/1
	CEMEX FINANCE LLC	6.0	200	188	22,695	2024/4/1
	CENTURY INTERMEDIATE HLD	9.75	175	180	21,781	2019/2/15
	CENTURYLINK INC	5.8	975	858	103,303	2022/3/15
	CENTURYLINK INC	6.75	125	112	13,488	2023/12/1
	CENTURYLINK INC	7.6	425	342	41,191	2039/9/15

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)	CEQUEL COM ESCRW 1/CAP C	6.375	575	540	65,076	2020/9/15
		CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	175	151	18,225	2021/12/15
		CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	125	108	13,018	2021/12/15
		CHAPARRAL ENERGY INC	9.875	350	115	13,906	2020/10/1
		CHEMOURS CO	7.0	325	222	26,804	2025/5/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.625	50	38	4,627	2020/8/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.125	200	142	17,096	2021/2/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.375	250	176	21,295	2021/6/15
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.75	800	548	65,979	2023/3/15
		CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	7.25	981	971	116,931	2019/11/15
		CHRYSLER GP/CG CO-ISSUER	8.25	600	640	77,116	2021/6/15
		CHS/COMMUNITY HEALTH	6.875	425	447	53,920	2022/2/1
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	8.0	650	679	81,781	2019/11/15
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	7.125	500	528	63,586	2020/7/15
		CINEMARK USA INC	5.125	350	349	42,034	2022/12/15
		CIT GROUP INC	5.0	750	773	93,121	2017/5/15
		CIT GROUP INC	4.25	500	510	61,404	2017/8/15
		CIT GROUP INC	3.875	175	175	21,175	2019/2/19
		CIT GROUP INC	5.0	175	177	21,326	2022/8/15
		CITGO PETROLEUM CORP	6.25	275	266	32,116	2022/8/15
		CITIGROUP INC	5.95	650	640	77,086	2049/12/29
		CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	150	149	18,037	2022/11/15
		CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	600	611	73,594	2022/11/15
		CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	6.375	50	28	3,461	2024/3/15
		CNG HOLDINGS INC	9.375	650	347	41,869	2020/5/15
		CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	3.375	50	48	5,845	2019/7/15
		CNO FINANCIAL GROUP INC	5.25	250	257	31,001	2025/5/30
		COEUR D'ALENE MINES CORP	7.875	125	78	9,406	2021/2/1
		COGENT COMMUNICATIONS GR	5.375	150	147	17,743	2022/3/1
		COMMERCIAL METALS CO	4.875	100	89	10,775	2023/5/15
		COMMSCOPE INC	5.0	275	270	32,571	2021/6/15
		COMMSCOPE INC	5.5	275	265	31,914	2024/6/15
		COMMSCOPE TECH FINANCE L	6.0	300	293	35,352	2025/6/15
		COMMUNICATIONS SALES & L	8.25	125	109	13,131	2023/10/15
		COMMUNITY CHOICE FINANCI	10.75	350	118	14,222	2019/5/1
		COMPRESSCO PARTNERS/FINA	7.25	125	103	12,416	2022/8/15
		CONCHO RESOURCES INC	6.5	525	532	64,158	2022/1/15
		CONCHO RESOURCES INC	5.5	600	581	70,000	2022/10/1
		CONSOLIDATED COMMUNICATI	6.5	400	362	43,584	2022/10/1
		CONSOLIDATED ENERGY FIN	6.75	400	384	46,233	2019/10/15
	CONSTELLATION BRANDS INC	6.0	450	497	59,868	2022/5/1	
	COTT BEVERAGES INC	6.75	300	312	37,665	2020/1/1	
	COTT BEVERAGES INC	5.375	375	364	43,908	2022/7/1	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	6.25	200	191	23,050	2049/12/29	
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.0	125	114	13,770	2020/12/15	
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.125	125	111	13,469	2022/3/1	
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.25	100	88	10,655	2023/4/1	

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)					
	CTP TRANS PROD LLC/ FINA	8.25	100	106	12,852	2019/12/15
	CVR REF LLC/COFF FIN INC	6.5	275	268	32,282	2022/11/1
	DANA HOLDING CORP	6.0	500	507	61,103	2023/9/15
	DENBURY RESOURCES INC	5.5	550	341	41,056	2022/5/1
	DENBURY RESOURCES INC	4.625	250	144	17,382	2023/7/15
	DIGICEL LIMITED	6.0	525	485	58,469	2021/4/15
	DISH DBS CORP	4.25	350	343	41,402	2018/4/1
	DISH DBS CORP	7.875	1,250	1,328	159,906	2019/9/1
	DISH DBS CORP	5.125	350	331	39,927	2020/5/1
	DISH DBS CORP	5.875	175	159	19,173	2022/7/15
	DRIVETIME AUTO GP & ACCE	8.0	175	158	19,068	2021/6/1
	DUPONT FABROS TECH LP	5.875	175	180	21,754	2021/9/15
	DUPONT FABROS TECH LP	5.625	125	125	15,087	2023/6/15
	DYNEGY INC	6.75	275	280	33,772	2019/11/1
	DYNEGY INC	7.375	300	303	36,481	2022/11/1
	DYNEGY INC	7.625	490	497	59,880	2024/11/1
	ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	8.125	25	24	2,904	2023/9/15
	ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	5.375	225	222	26,836	2023/1/15
	ENDO FINANCE LLC	5.75	325	329	39,716	2022/1/15
	ENERGY TRANSFER EQUITY	5.875	525	490	59,101	2024/1/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	11.0	500	280	33,712	2020/3/15
	ENERSYS	5.0	100	97	11,739	2023/4/30
	ENTEGRIS INC	6.0	75	77	9,271	2022/4/1
	ENVISION HEALTHCARE CORP	5.125	225	227	27,428	2022/7/1
	EP ENER/EVEREST ACQ FIN	6.375	400	312	37,564	2023/6/15
	EQUINIX INC	5.375	350	354	42,719	2022/1/1
	EQUINIX INC	5.375	1,025	1,027	123,718	2023/4/1
	ESH HOSPITALITY INC	5.25	125	123	14,899	2025/5/1
	EXAMWORKS GROUP INC	5.625	150	152	18,398	2023/4/15
	FELCOR LODGING LP	6.0	125	127	15,313	2025/6/1
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	175	166	20,016	2022/1/15
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	250	233	28,143	2023/6/15
	FERRELLGAS PARTNERS LP	8.625	341	341	41,159	2020/6/15
	FGI OPERATING CO LLC/FIN	7.875	125	96	11,663	2020/5/1
	FIRST CASH FINANCIAL SER	6.75	75	76	9,164	2021/4/1
	FIRST DATA CORPORATION	6.75	438	460	55,503	2020/11/1
	FIRST QUANTUM MINERALS L	7.25	150	108	13,093	2019/10/15
	FLY LEASING LTD	6.75	400	413	49,725	2020/12/15
	FRESENIUS MED CARE II	5.625	325	351	42,260	2019/7/31
	FRESENIUS MED CARE II	5.875	350	379	45,721	2022/1/31
	FRONTIER COMMUNICATIONS	8.125	625	653	78,730	2018/10/1
	FRONTIER COMMUNICATIONS	10.5	600	590	71,066	2022/9/15
	FRONTIER COMMUNICATIONS	11.0	425	410	49,379	2025/9/15
	FTI CONSULTING INC	6.0	200	211	25,494	2022/11/15
	GANNETT CO INC	5.125	200	208	25,103	2019/10/15
	GANNETT CO INC	4.875	100	99	11,949	2021/9/15
	GANNETT CO INC	6.375	125	131	15,877	2023/10/15

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)					
	GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	225	212	25,532	2021/11/15
	GENCORP INC	7.125	250	262	31,605	2021/3/15
	GENON ESCROW CORP	9.875	925	876	105,523	2020/10/15
	GEO GROUP INC/THE	5.875	125	130	15,727	2022/1/15
	GESTAMP FUND LUX SA	5.625	200	202	24,320	2020/5/31
	GIBRALTAR STEEL CORP OF	6.25	100	102	12,280	2021/2/1
	GLOBAL BRASS AND COPPER	9.5	650	706	85,009	2019/6/1
	GLP CAPITAL LP / FIN II	4.875	325	336	40,499	2020/11/1
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.7	125	126	15,181	2049/12/29
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.375	75	74	8,917	2049/12/31
	GRAFTECH INTERNATIONAL	6.375	175	123	14,854	2020/11/15
	GREAT LAKES DREDGE&DOCK	7.375	250	252	30,401	2019/2/1
	GREIF INC	7.75	250	279	33,674	2019/8/1
	GREYSTAR REAL ESTATE PAR	8.25	300	315	37,926	2022/12/1
	GRIFFON CORPORATION	5.25	125	120	14,504	2022/3/1
	GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	5.0	275	275	33,192	2022/6/1
	GULFPORT ENERGY CORP	7.75	275	273	32,944	2020/11/1
	H&E EQUIPMENT SERVICES	7.0	150	148	17,924	2022/9/1
	HALYARD HEALTH INC	6.25	200	206	24,907	2022/10/15
	HARDWOODS ACQUISITION IN	7.5	275	260	31,371	2021/8/1
	HARLAND CLARKE HLDINGS	6.875	125	114	13,770	2020/3/1
	HARLAND CLARKE HOLDINGS	9.75	150	153	18,534	2018/8/1
	HCA HOLDINGS INC	6.25	225	242	29,223	2021/2/15
	HCA INC	3.75	525	529	63,763	2019/3/15
	HCA INC	7.5	900	1,030	124,072	2022/2/15
	HCA INC	5.875	720	761	91,672	2023/5/1
	HCA INC	5.375	500	504	60,764	2025/2/1
	HD SUPPLY INC	5.25	375	382	45,996	2021/12/15
	HEALTHSOUTH CORP	5.75	275	278	33,523	2024/11/1
	HEALTHSOUTH CORP	5.75	300	303	36,571	2024/11/1
	HEALTHSOUTH CORP	5.75	150	149	17,992	2025/9/15
	HECLA MINING CO	6.875	325	264	31,890	2021/5/1
	HEXION US FINANCE CORP	6.625	400	356	42,862	2020/4/15
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	7.625	350	353	42,540	2021/4/15
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	5.0	300	260	31,334	2024/12/1
	HILL-ROM HOLDINGS INC	5.75	175	178	21,438	2023/9/1
	HOLOGIC INC	5.25	225	231	27,868	2022/7/15
	HRG GROUP INC	7.875	50	51	6,245	2019/7/15
	HUGHES SATELLITE SYSTEMS	7.625	500	542	65,265	2021/6/15
	HUNTSMAN INTERNATIONAL L	5.125	225	199	23,974	2022/11/15
	IAC/INTERACTIVECORP	4.75	525	482	58,074	2022/12/15
	IAMGOLD CORP	6.75	350	254	30,656	2020/10/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	4.875	300	303	36,594	2019/3/15
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	6.0	225	234	28,275	2020/8/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	5.875	825	842	101,440	2022/2/1
	ICON HEALTH & FITNESS	11.875	425	418	50,402	2016/10/15
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	4.57	300	276	33,320	2065/12/21

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)					
	IMS HEALTH INC	6.0	250	256	30,890	2020/11/1
	INFOR US INC	6.5	625	587	70,735	2022/5/15
	INTELSAT JACKSON HLDG	5.5	675	572	68,876	2023/8/1
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.25	575	679	81,864	2020/12/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	5.875	500	540	65,128	2022/8/15
	INTREPID AVIATION GRP HL	6.875	525	475	57,205	2019/2/15
	INVENTIV HEALTH INC	9.0	250	259	31,285	2018/1/15
	IRON MOUNTAIN INC	6.0	625	625	75,250	2020/10/1
	J. B. POINDEXTER & CO	9.0	225	244	29,392	2022/4/1
	JACK COOPER HOLDINGS COR	10.25	125	115	13,921	2020/6/1
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.75	200	204	24,561	2020/10/28
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.25	400	389	46,835	2024/4/3
	JMC STEEL GROUP	8.25	275	196	23,673	2018/3/15
	JPMORGAN CHASE & CO	6.75	275	290	34,972	2049/1/29
	JPMORGAN CHASE & CO	5.0	525	514	61,961	2049/12/29
	KB HOME	9.1	600	666	80,186	2017/9/15
	KB HOME	4.75	75	73	8,871	2019/5/15
	KB HOME	8.0	50	54	6,531	2020/3/15
	KB HOME	7.0	175	177	21,386	2021/12/15
	KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	7.625	100	105	12,732	2021/8/15
	KENNEDY-WILSON INC	5.875	425	418	50,402	2024/4/1
	KINDER MORGAN INC/DELAWA	7.42	1,720	1,815	218,579	2037/2/15
	KINDRED ESCROW CORP II	8.0	125	135	16,366	2020/1/15
	KINDRED ESCROW CORP II	8.75	125	138	16,724	2023/1/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	6.375	200	203	24,531	2022/4/15
	KISSNER MILLING CO LTD	7.25	225	232	28,038	2019/6/1
	KLX INC	5.875	350	347	41,823	2022/12/1
	LADDER CAP FIN LLC/CORP	7.375	250	255	30,702	2017/10/1
	LAREDO PETROLEUM INC	7.375	800	788	94,875	2022/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	6.25	125	115	13,846	2023/3/15
	LBG CAPITAL NO.1 PLC	8.0	140	159	19,155	2049/12/29
	LENNAR CORP	6.95	275	299	36,089	2018/6/1
	LENNAR CORP	4.75	250	246	29,648	2022/11/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.375	500	491	59,221	2022/8/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.625	350	346	41,665	2023/2/1
	LIFEPOINT HOSPITALS INC	5.5	798	815	98,240	2021/12/1
	LIMITED BRANDS INC	8.5	600	709	85,423	2019/6/15
	LIMITED BRANDS INC	7.0	225	257	30,984	2020/5/1
	LIMITED BRANDS INC	5.625	275	292	35,262	2022/2/15
	LIN TELEVISION CORP	6.375	75	78	9,492	2021/1/15
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	6.5	550	167	20,197	2019/5/15
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	6.25	400	112	13,484	2019/11/1
	LIVE NATION ENTERTAINMEN	5.375	75	74	8,984	2022/6/15
	LLOYDS BANKING	7.5	222	230	27,717	2049/6/27
	LYNX I CORP	5.375	180	183	22,105	2021/4/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	4.875	200	196	23,688	2020/4/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.75	350	342	41,244	2022/8/1

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)					
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.625	175	164	19,779	2023/10/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.5	200	184	22,258	2025/4/15
	MANITOWOC COMPANY INC	5.875	150	160	19,301	2022/10/15
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	5.5	500	491	59,146	2023/2/15
	MATADOR RESOURCES CO	6.875	75	72	8,713	2023/4/15
	MATTAMY GROUP CORP	6.5	250	243	29,347	2020/11/15
	MEG ENERGY CORP	6.5	325	275	33,162	2021/3/15
	MEG ENERGY CORP	6.375	750	603	72,691	2023/1/30
	MERCER INTL INC	7.0	150	153	18,466	2019/12/1
	MERCER INTL INC	7.75	150	154	18,646	2022/12/1
	MERITAGE HOMES CORP	4.5	75	76	9,233	2018/3/1
	MERITAGE HOMES CORP	7.0	150	162	19,595	2022/4/1
	MERITAGE HOMES CORP	6.0	150	152	18,330	2025/6/1
	MERITOR INC	6.25	125	121	14,598	2024/2/15
	MGM RESORTS INTL	10.0	200	215	25,946	2016/11/1
	MGM RESORTS INTL	6.75	575	605	72,864	2020/10/1
	MGM RESORTS INTL	6.625	375	395	47,633	2021/12/15
	MGM RESORTS INTL	7.75	275	300	36,214	2022/3/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.875	175	174	21,043	2022/2/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.25	150	140	16,931	2024/1/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.5	525	493	59,417	2025/2/1
	MIDCONTINENT COMM & FIN	6.875	200	201	24,227	2023/8/15
	MILLAR WESTERN FOREST	8.5	75	59	7,156	2021/4/1
	MPG HOLDCO I INC	7.375	225	234	28,173	2022/10/15
	MPL 2 ACQUISITION CANCO	9.875	625	654	78,824	2018/8/15
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.875	600	633	76,213	2021/5/1
	MRT MID PART/MRT MID FIN	7.25	300	280	33,772	2021/2/15
	MSCI INC	5.75	425	432	52,065	2025/8/15
	NAI ENTERTAINMENT HLDING	5.0	687	699	84,162	2018/8/1
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	7.875	475	495	59,689	2021/7/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	6.0	375	382	46,107	2022/4/15
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	9.625	200	206	24,832	2019/5/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	7.875	200	185	22,304	2020/10/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	500	407	49,063	2022/6/1
	NAVIENT CORP	5.875	800	662	79,704	2024/10/25
	NBTY INC	9.0	575	589	70,960	2018/10/1
	NCL CORP LTD	5.25	225	232	28,038	2019/11/15
	NCR CORP	5.875	100	99	11,994	2021/12/15
	NCR CORP	6.375	450	453	54,654	2023/12/15
	NETFLIX INC	5.5	100	102	12,341	2022/2/15
	NEXSTAR BROADCASTING INC	6.125	150	150	18,105	2022/2/15
	NIELSEN CO LUX SARL/THE	5.5	300	303	36,526	2021/10/1
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.0	1,275	1,251	150,631	2022/4/15
	NORBORD INC	6.25	150	149	18,037	2023/4/15
	NORTEK INC	8.5	500	536	64,564	2021/4/15
	NRG ENERGY INC	7.875	500	512	61,705	2021/5/15
	NRG ENERGY INC	6.625	600	564	67,905	2023/3/15

銘柄		当期				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)					
	NRG ENERGY INC	6.25	375	343	41,312	2024/5/1
	NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD	7.75	680	751	90,531	2025/12/15
	NUMERICABLE GROUP SA	4.875	400	392	47,196	2019/5/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.0	600	580	69,892	2022/5/15
	NWH ESCROW CORP	7.5	300	276	33,320	2021/8/1
	OMNICARE INC	4.75	125	136	16,404	2022/12/1
	ORBITAL ATK INC	5.25	150	153	18,421	2021/10/1
	OUTERWALL INC	5.875	150	142	17,157	2021/6/15
	OWENS-BROCKWAY	5.875	250	253	30,570	2023/8/15
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	8.875	275	272	32,840	2017/4/15
	PARAMOUNT RESOURCES LTD	6.875	250	221	26,713	2023/6/30
	PARKER DRILLING CO	7.5	450	375	45,240	2020/8/1
	PARKER DRILLING CO	6.75	150	120	14,448	2022/7/15
	PBF LOGISTICS LP/FINANCE	6.875	175	160	19,279	2023/5/15
	PENN NATIONAL GAMING INC	5.875	225	229	27,631	2021/11/1
	PENSKE AUTO GROUP INC	5.75	350	356	42,877	2022/10/1
	PERSTORP HOLDING AB	8.75	200	206	24,802	2017/5/15
	PETROLEUM GEO-SERVICES	7.375	200	163	19,685	2018/12/15
	PIONEER ENERGY SERVICES	6.125	125	71	8,653	2022/3/15
	PNK FINANCE CORP	6.375	400	427	51,471	2021/8/1
	POLYONE CORP	5.25	125	121	14,636	2023/3/15
	POST HOLDINGS INC	6.75	125	125	15,125	2021/12/1
	POST HOLDINGS INC	7.375	100	102	12,371	2022/2/15
	POST HOLDINGS INC	7.75	325	336	40,499	2024/3/15
	POST HOLDINGS INC	8.0	175	181	21,860	2025/7/15
	PRECISION DRILLING CORP	5.25	150	122	14,718	2024/11/15
	PRODUCTION RES GROUP	8.875	500	405	48,762	2019/5/1
	PROSPECT HLDG LLC/FINANC	10.25	225	139	16,795	2018/10/1
	PSPC ESCROW CORP	6.5	75	65	7,935	2022/2/1
	QUEBECOR MEDIA INC	5.75	250	249	29,987	2023/1/15
	QVC INC	5.125	50	51	6,159	2022/7/2
	RADIAN GROUP INC	5.25	275	273	32,944	2020/6/15
	RADIO SYSTEMS CORP	8.375	975	1,023	123,259	2019/11/1
	RAIN CII CARBON LLC/CII	8.0	295	260	31,344	2018/12/1
	RANGE RESOURCES CORP	5.0	175	160	19,279	2023/3/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	100	100	12,040	2022/3/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	50	48	5,892	2023/6/15
	REGENCY ENERGY PART/FIN	5.875	175	182	22,000	2022/3/1
	RESOLUTE FOREST PRODUCTS	5.875	650	504	60,749	2023/5/15
	REXEL SA	5.25	300	305	36,752	2020/6/15
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS	6.875	315	329	39,656	2021/2/15
	RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	5.0	125	125	15,162	2023/4/15
	ROSE ROCK MIDSTREAM/FIN	5.625	425	380	45,797	2022/7/15
	ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	7.64	1,100	1,174	141,379	2049/3/29
	RR DONNELLEY & SONS CO	6.5	125	119	14,353	2023/11/15
	RSI HOME PRODUCTS INC	6.5	775	790	95,176	2023/3/15
	RYLAND GROUP	6.625	425	467	56,287	2020/5/1

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)					
	RYLAND GROUP	5.375	150	153	18,421	2022/10/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	800	750	90,300	2021/2/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	6.25	300	285	34,314	2022/3/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	50	45	5,478	2023/4/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.75	500	456	54,932	2024/5/15
	SABRA HEALTH/CAPTL CORP	5.5	50	52	6,336	2021/2/1
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	6.875	450	469	56,550	2019/11/15
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.75	311	327	39,457	2022/6/1
	SANCHEZ ENERGY CORP	6.125	450	303	36,571	2023/1/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	8.75	500	130	15,652	2020/1/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	8.75	50	32	3,867	2020/6/1
	SANDRIDGE ENERGY INC	8.125	450	102	12,393	2022/10/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	7.5	175	39	4,793	2023/2/15
	SANJEL CORP	7.5	400	188	22,635	2019/6/19
	SANMINA CORP	4.375	75	75	9,120	2019/6/1
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5.625	325	339	40,841	2019/10/1
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4.875	525	520	62,704	2022/7/15
	SCHAEFFLER FINANCE BV	4.75	200	198	23,899	2021/5/15
	SCHAEFFLER HLDG FIN BV	6.25	750	799	96,282	2019/11/15
	SEALED AIR CORP	5.125	200	201	24,200	2024/12/1
	SEMINOLE HARD ROCK ENT I	5.875	175	174	21,017	2021/5/15
	SERVICE CORP INTL	8.0	875	1,030	124,049	2021/11/15
	SERVICE CORP INTL	5.375	200	210	25,344	2022/1/15
	SERVICE CORP INTL	5.375	100	105	12,672	2024/5/15
	SESI LLC	6.375	300	301	36,300	2019/5/1
	SESI LLC	7.125	300	300	36,145	2021/12/15
	SEVENTY SEVEN ENE	6.5	625	271	32,733	2022/7/15
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	5.875	150	154	18,601	2023/4/1
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	6.125	150	154	18,610	2025/4/1
	SHEARERS FOODS	9.0	100	107	12,912	2019/11/1
	SILGAN HOLDINGS INC	5.0	325	334	40,303	2020/4/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.625	160	150	18,060	2024/8/1
	SIRIUS XM RADIO INC	5.875	225	232	27,970	2020/10/1
	SIRIUS XM RADIO INC	6.0	675	690	83,098	2024/7/15
	SLM CORP	6.0	100	102	12,310	2017/1/25
	SLM CORP	5.5	200	192	23,116	2019/1/15
	SLM CORP	8.0	500	495	59,598	2020/3/25
	SLM CORP	6.125	400	338	40,695	2024/3/25
	SM ENERGY CO	6.5	175	164	19,805	2023/1/1
	SMITHFIELD FOODS INC	6.625	350	371	44,721	2022/8/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	7.0	775	833	100,308	2022/7/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	5.0	125	121	14,673	2023/5/15
	SOUTHERN STAR CENT CORP	5.125	225	217	26,141	2022/7/15
	SPCM SA	6.0	200	202	24,350	2022/1/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.625	75	80	9,684	2022/11/15
	SPECTRUM BRANDS INC	5.75	175	181	21,873	2025/7/15
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	6.75	375	389	46,899	2020/12/15

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 (含む投資法人債券)					
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	5.25	125	128	15,426	2022/3/15
	SPIRIT CAPITAL CORP	6.875	325	242	29,249	2028/11/15
	SPIRIT CAPITAL CORP	8.75	750	624	75,174	2032/3/15
	SPIRIT COMMUNICATIONS	6.0	350	280	33,712	2022/11/15
	SPIRIT CORP	7.875	150	127	15,396	2023/9/15
	SPIRIT CORP	7.125	550	451	54,300	2024/6/15
	SPIRIT NEXTEL CORP	8.375	1,075	1,079	129,965	2017/8/15
	SPIRIT NEXTEL CORP	7.0	450	458	55,195	2020/3/1
	SPIRIT NEXTEL CORP	7.0	75	66	8,036	2020/8/15
	SS&C TECH HOLDINGS INC	5.875	150	153	18,534	2023/7/15
	STANDARD PACIFIC CORP	8.375	850	962	115,900	2018/5/15
	STANDARD PACIFIC CORP	6.25	100	107	12,912	2021/12/15
	STEEL DYNAMICS INC	6.375	275	275	33,110	2022/8/15
	SUBURBAN PROPANE PARTNRS	5.5	250	236	28,519	2024/6/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	7.5	650	637	76,694	2021/7/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	5.5	75	66	7,991	2022/8/15
	SUN MERGER SUB INC	5.25	200	203	24,501	2018/8/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	100	87	10,535	2020/2/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	125	109	13,168	2020/2/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	100	87	10,535	2020/2/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	5.5	450	455	54,890	2020/8/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	6.375	625	623	75,061	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.464	200	204	24,651	2019/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.542	500	511	61,554	2020/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.25	100	100	12,085	2021/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.125	150	148	17,879	2022/1/15
	T-MOBILE USA INC	6.731	125	126	15,275	2022/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.0	450	441	53,096	2023/3/1
	T-MOBILE USA INC	6.625	100	100	12,040	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.836	75	75	9,120	2023/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.375	450	439	52,960	2025/3/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	4.125	300	276	33,230	2019/11/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	350	348	41,929	2021/2/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.375	131	127	15,299	2022/8/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.75	250	242	29,234	2024/3/15
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	5.625	200	195	23,538	2024/3/1
	TEMPEL STEEL COMPANY	12.0	100	91	11,016	2016/8/15
	TENASKA ALABAMA PART	7.0	212	222	26,809	2021/6/30
	TENET HEALTHCARE CORP	4.75	200	204	24,621	2020/6/1
	TENET HEALTHCARE CORP	3.8372	225	225	27,090	2020/6/15
	TENET HEALTHCARE CORP	6.0	350	374	45,089	2020/10/1
	TENET HEALTHCARE CORP	4.5	350	349	42,087	2021/4/1
	TERRAFORM GLOBAL OPERATI	9.75	275	246	29,633	2022/8/15
	TERRAFORM POWER OPERATIN	5.875	375	345	41,565	2023/2/1
	TERRAFORM POWER OPERATIN	6.125	75	66	8,059	2025/6/15
	TERVITA CORP	8.0	275	209	25,163	2018/11/15
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.125	175	176	21,228	2021/10/15

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 (含む投資法人債券)	THOMPSON CREEK METALS CO	9.75	200	185	22,274	2017/12/1
		THOMPSON CREEK METALS CO	7.375	275	152	18,376	2018/6/1
		TITAN INTERNATIONAL INC	6.875	150	129	15,621	2020/10/1
		TMS INTERNATIONAL CORP	7.625	75	70	8,443	2021/10/15
		TMX FIN LLC/TITLEMAX FIN	8.5	175	139	16,750	2018/9/15
		TOLL BROS FINANCE CORP	8.91	225	253	30,476	2017/10/15
		TOPAZ MARINE SA	8.625	200	179	21,551	2018/11/1
		TOPS HOLDING/MARKETS II	8.0	200	200	24,080	2022/6/15
		TPC GROUP INC	8.75	300	259	31,243	2020/12/15
		TRAC INTERMODAL LLC/CORP	11.0	150	163	19,640	2019/8/15
		TRANSFIELD SERVICES LTD	8.375	125	129	15,557	2020/5/15
		TRI POINTE HOLDINGS INC	4.375	225	223	26,886	2019/6/15
		TRI POINTE HOLDINGS INC	5.875	225	223	26,886	2024/6/15
		TRIBUNE MEDIA CO	5.875	150	148	17,879	2022/7/15
		TRINIDAD DRILLING LTD	7.875	250	238	28,670	2019/1/15
		TRIUMPH GROUP INC	5.25	175	166	20,016	2022/6/1
		TULLOW OIL PLC	6.25	600	435	52,374	2022/4/15
		UNITED CONTINENTAL HLDGS	6.0	500	526	63,360	2020/12/1
		UNITED REFINING	10.5	358	372	44,827	2018/2/28
		UNITED RENTALS NORTH AM	7.375	225	238	28,715	2020/5/15
		UNITYMEDIA HESSEN / NRW	5.5	475	486	58,548	2023/1/15
		UNITYMEDIA KABELBW GMBH	6.125	200	203	24,501	2025/1/15
		UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	7.625	225	215	25,925	2020/8/15
		UNIVISION COMMUNICATIONS	6.75	420	441	53,096	2022/9/15
		US AIRWAYS 2012-2C PTT	5.45	50	50	6,038	2018/6/3
		US STEEL CORP	6.875	125	100	12,040	2021/4/1
		VALEANT PHARMACEUTICALS	6.75	500	520	62,608	2021/8/15
		VECTOR GROUP LTD	7.75	275	292	35,262	2021/2/15
		VERSO PAPER HLDGS LLC/IN	11.75	75	19	2,302	2019/1/15
		VIASAT INC	6.875	275	290	34,931	2020/6/15
		VIKING CRUISES LTD	8.5	350	384	46,248	2022/10/15
		VIKING CRUISES LTD	6.25	75	74	9,007	2025/5/15
		VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	6.375	200	206	24,832	2023/4/15
		VPI ESCROW CORP	6.375	100	103	12,431	2020/10/15
		VPII ESCROW CORP	6.75	250	261	31,473	2018/8/15
		VPII ESCROW CORP	7.5	250	266	32,056	2021/7/15
		VRX ESCROW CORP	5.375	325	329	39,619	2020/3/15
		VRX ESCROW CORP	5.875	650	650	78,260	2023/5/15
		VRX ESCROW CORP	6.125	375	373	44,924	2025/4/15
		VTR FINANCE BV	6.875	200	185	22,278	2024/1/15
	WELLCARE HEALTH PLANS IN	5.75	450	470	56,618	2020/11/15	
	WELLS FARGO & COMPANY	5.9	150	152	18,359	2049/12/29	
	WESCO DISTRIBUTION INC	5.375	150	145	17,473	2021/12/15	
	WEST CORP	5.375	950	889	107,088	2022/7/15	
	WESTERN REFINING/WNRL FI	7.5	100	100	12,040	2023/2/15	
	WILLIAM LYON HOMES INC	5.75	75	76	9,188	2019/4/15	
	WILLIAM LYON HOMES INC	7.0	100	104	12,551	2022/8/15	

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 (含む投資法人債券)					
	WINDSTREAM CORP	7.75	375	298	35,894	2021/10/1
	WINDSTREAM CORP	7.5	250	190	22,988	2022/6/1
	WINDSTREAM CORP	6.375	250	179	21,634	2023/8/1
	WMG HOLDINGS CORP	13.75	300	320	38,603	2019/10/1
	WOODSIDE HOMES CO LLC/FI	6.75	500	467	56,287	2021/12/15
	WR GRACE & CO-CONN	5.125	225	224	27,022	2021/10/1
	XPO LOGISTICS INC	7.875	200	198	23,929	2019/9/1
	XPO LOGISTICS INC	6.5	450	400	48,220	2022/6/15
	ZIGGO BOND FINANCE BV	5.875	200	189	22,815	2025/1/15
合	計				19,420,891	

* 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

(2015年9月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 19,420,891	% 90.8
コール・ローン等、その他	1,977,724	9.2
投資信託財産総額	21,398,615	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 (21,053,346千円) の投資信託財産総額 (21,398,615千円) に対する比率は98.4%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=120.40円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年9月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,735,035,855
コール・ローン等	1,401,054,969
公社債(評価額)	19,420,891,055
未収入金	540,714,719
未収利息	352,271,283
前払費用	20,103,829
(B) 負債	781,452,000
未払金	445,452,000
未払解約金	336,000,000
(C) 純資産総額(A-B)	20,953,583,855
元本	3,188,059,257
次期繰越損益金	17,765,524,598
(D) 受益権総口数	3,188,059,257口
1万口当たり基準価額(C/D)	65,725円

(注) 期首元本額2,924百万円、期中追加設定元本額693百万円、期中一部解約元本額429百万円、計算口数当たり純資産額65,725円。

(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Aコース 390百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース 763百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンCコース 16百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンDコース 312百万円
- ・ハイブリッド・インカムオープン 256百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンAコース (野村SMA向け) 335百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース (野村SMA向け) 596百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Aコース (野村SMA・EW向け) 144百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Bコース (野村SMA・EW向け) 373百万円

○損益の状況 (2015年3月31日～2015年9月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	651,000,850
受取利息	649,842,000
その他収益金	1,158,850
(B) 有価証券売買損益	△ 1,081,083,517
売買益	221,219,898
売買損	△ 1,302,303,415
(C) 保管費用等	△ 5,696,612
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 435,779,279
(E) 前期繰越損益金	16,625,143,344
(F) 追加信託差損益金	4,074,871,035
(G) 解約差損益金	△ 2,498,710,502
(H) 計(D+E+F+G)	17,765,524,598
次期繰越損益金(H)	17,765,524,598

*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。