

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84期(決算日2015年11月30日) 第85期(決算日2016年1月28日) 第86期(決算日2016年3月28日)

作成対象期間(2015年9月29日～2016年3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関し、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関し、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 (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 総額
		税分	込配	み金	期中騰落	期中騰落				
	円	円	円	騰落	騰落	率	率	率	率	百万円
72期(2013年11月28日)	10,591		95		227.36	2.6	—	96.2	—	140
73期(2014年1月28日)	10,600		95		229.94	1.1	—	93.2	—	140
74期(2014年3月28日)	10,699		95		234.83	2.1	—	92.8	—	141
75期(2014年5月28日)	10,729		95		238.49	1.6	—	93.2	—	145
76期(2014年7月28日)	10,666		95		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
84期(2015年11月30日)	9,394		95	△0.7	232.47	△0.3	—	97.1	—	110
85期(2016年1月28日)	8,951		95	△3.7	223.12	△4.0	—	92.0	—	100
86期(2016年3月28日)	9,184		95	3.7	233.40	4.6	—	94.7	—	105

* 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	騰 落 率	騰 落 率			
第84期	(期 首) 2015年9月28日	円 9,557	% —	233.23	% —	% —	% 91.6	% —
	9月末	9,439	△1.2	230.11	△1.3	—	92.7	—
	10月末	9,682	1.3	237.23	1.7	—	94.4	—
	(期 末) 2015年11月30日	9,489	△0.7	232.47	△0.3	—	97.1	—
第85期	(期 首) 2015年11月30日	9,394	—	232.47	—	—	97.1	—
	12月末	9,197	△2.1	227.26	△2.2	—	90.2	—
	(期 末) 2016年1月28日	9,046	△3.7	223.12	△4.0	—	92.0	—
第86期	(期 首) 2016年1月28日	8,951	—	223.12	—	—	92.0	—
	1月末	8,969	0.2	223.71	0.3	—	93.5	—
	2月末	9,004	0.6	225.02	0.9	—	93.2	—
	(期 末) 2016年3月28日	9,279	3.7	233.40	4.6	—	94.7	—

* 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 (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 総額	
		税分	込配	み金	期中騰落率	期中騰落率					
	円									百万円	
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
84期(2015年11月30日)	9,288			75	1.3	301.49	1.8	—	95.5	—	2,047
85期(2016年1月28日)	8,581			75	△6.8	280.07	△7.1	—	92.8	—	1,794
86期(2016年3月28日)	8,450			75	△0.7	280.51	0.2	—	95.6	—	1,761

* 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) パンクオブアメリカ・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 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第84期	(期 首) 2015年9月28日	円 9,239	% —	— 296.30	% —	% —	% 91.9	% —
	9月末	9,093	△1.6	291.27	△1.7	—	93.4	—
	10月末	9,403	1.8	302.76	2.2	—	94.3	—
	(期 末) 2015年11月30日	9,363	1.3	301.49	1.8	—	95.5	—
第85期	(期 首) 2015年11月30日	9,288	—	301.49	—	—	95.5	—
	12月末	8,941	△3.7	289.75	△3.9	—	91.3	—
	(期 末) 2016年1月28日	8,656	△6.8	280.07	△7.1	—	92.8	—
第86期	(期 首) 2016年1月28日	8,581	—	280.07	—	—	92.8	—
	1月末	8,753	2.0	286.05	2.1	—	92.6	—
	2月末	8,275	△3.6	270.62	△3.4	—	93.8	—
	(期 末) 2016年3月28日	8,525	△0.7	280.51	0.2	—	95.6	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

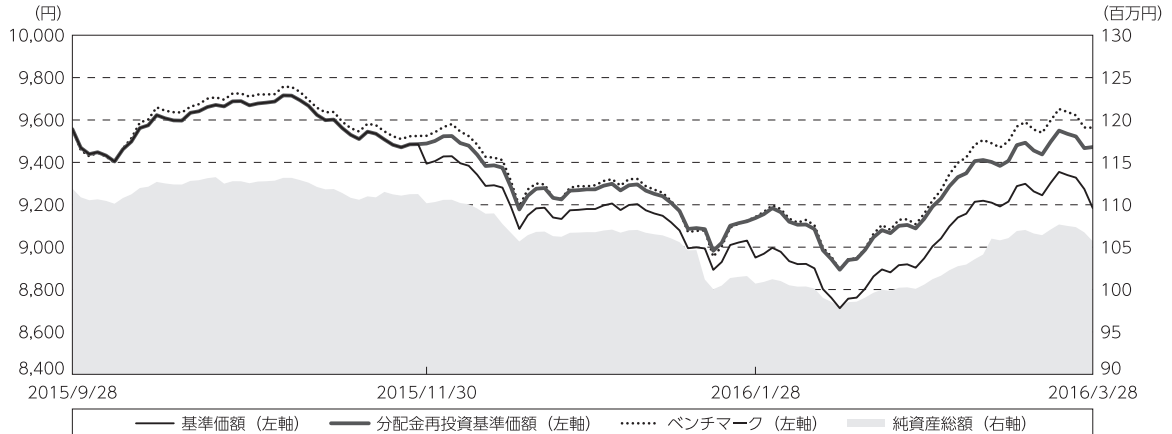
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<Cコース>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第84期首：9,557円

第86期末：9,184円 (既払分配金 (税込み) : 285円)

騰落率：△ 0.9% (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9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 (2015年9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9,557円から当作成期末には9,184円となりました。

- ・ 中国人民銀行 (中央銀行) などが金融緩和姿勢を強めたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・ 原油価格が大幅に下落したことや、FOMC (米連邦公開市場委員会) において政策金利の引き上げが決定されたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・ 中国株の急落および人民元安を背景とした同国の景気減速懸念の高まりや、原油を中心に商品価格が下落したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと

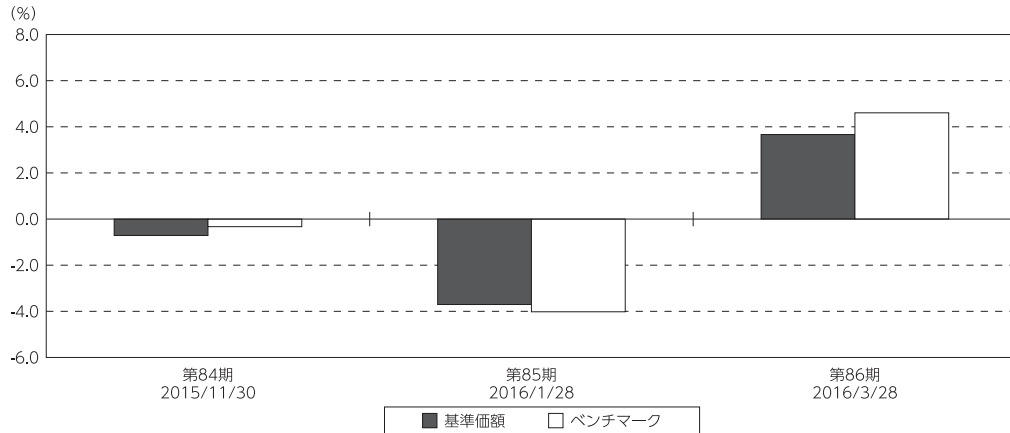
<Cコース>

○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-0.9%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+0.1%を1.0ポイント下回りました。主な差異の要因は、CCC格以下の銘柄のオーバーウェイト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84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
当期分配金	95	95	95
(対基準価額比率)	1.001%	1.050%	1.024%
当期の収益	74	76	88
当期の収益以外	20	18	6
翌期繰越分配対象額	3,670	3,652	3,646

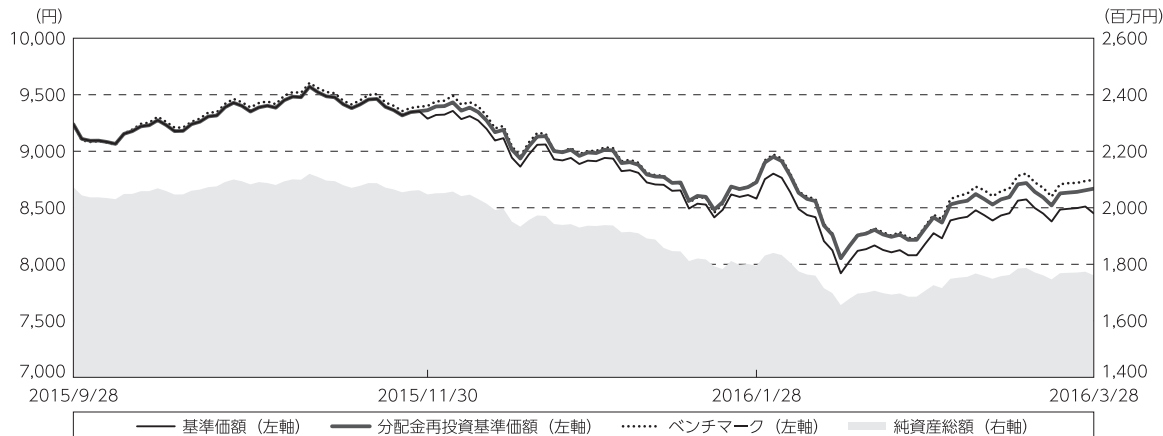
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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



(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9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（円換算ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2015年9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9,239円から当作成期末には8,450円となりました。

- ・ 中国人民銀行（中央銀行）などが金融緩和姿勢を強めたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・ 原油価格が大幅に下落したことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の引き上げが決定されたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・ 中国株の急落および人民元安を背景とした同国の景気減速懸念の高まりや、原油を中心に商品価格が下落したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・ 円／ドルの為替相場推移

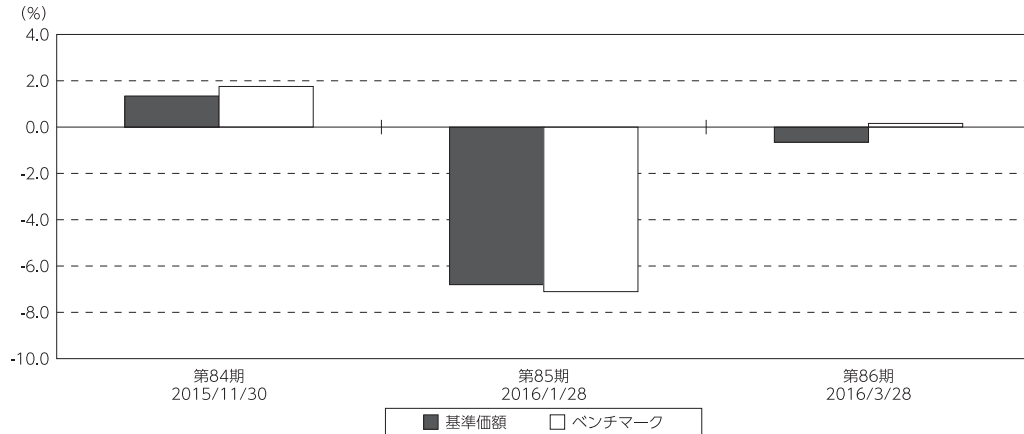
<Dコース>

○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-6.2%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-5.3%を0.9ポイント下回りました。主な差異の要因は、CCC格以下の銘柄のオーバーウェイト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84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
当期分配金	75	75	75
(対基準価額比率)	0.801%	0.866%	0.880%
当期の収益	75	75	69
当期の収益以外	—	—	5
翌期繰越分配対象額	2,277	2,278	2,272

(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）や中国人民銀行（中央銀行）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、2016年1月の米国雇用統計が市場予想を下回る結果となったことや、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2.5%、33.2%、54.0%、6.9%、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は昨年12月に利上げを実施しましたが、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、原油市場は不透明な市場環境が続いており、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、よろしく願いいたします。

<Cコース>

○1万口当たりの費用明細

(2015年9月29日～2016年3月28日)

項 目	第84期～第86期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 78	% 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)	(51)	(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)	(25)	(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)	(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	3	0.032	(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)	(0.031)	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	81	0.875	
作成期間の平均基準価額は、9,280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9月29日～2016年3月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第84期～第86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 1,579	千円 9,600	千口 1,729	千円 11,000

*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9月29日～2016年3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84期～第86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 292	百万円 2	% 0.7	百万円 290	百万円 7	% 2.4

<ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド>

区 分	第84期～第86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 1,414	百万円 808	% 57.1	百万円 1,166	百万円 167	% 14.3

平均保有割合 0.5%

※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3月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第83期末	第86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 16,822	千口 16,673	千円 103,647

*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

(2016年3月28日現在)

項 目	第86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	103,647	96.8
コール・ローン等、その他	3,476	3.2
投資信託財産総額	107,123	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86期末における外貨建て純資産（20,236,791千円）の投資信託財産総額（20,641,728千円）に対する比率は98.0%です。

*外貨建て資産は、第86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=113.44円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第84期末	第85期末	第86期末
	2015年11月30日現在	2016年1月28日現在	2016年3月28日現在
	円	円	円
(A) 資産	219,944,721	199,512,852	208,574,710
コール・ローン等	1,168,449	973,841	1,074,391
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	110,892,393	98,873,809	103,647,597
未収入金	107,883,877	99,665,201	103,852,722
未収利息	2	1	—
(B) 負債	109,769,158	98,813,881	102,873,666
未払金	108,327,000	97,453,120	101,495,080
未払収益分配金	1,114,215	1,068,707	1,093,437
未払信託報酬	327,551	291,700	284,811
その他未払費用	392	354	338
(C) 純資産総額(A-B)	110,175,563	100,698,971	105,701,044
元本	117,285,858	112,495,521	115,098,632
次期繰越損益金	△ 7,110,295	△ 11,796,550	△ 9,397,588
(D) 受益権総口数	117,285,858口	112,495,521口	115,098,632口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,394円	8,951円	9,184円

(注) 第84期首元本額117百万円、第84～第86期中追加設定元本額3百万円、第84～第86期中一部解約元本額5百万円、第86期末計算口数当たり純資産額9,184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50,992,547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84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
	円	円	円
(A) 配当等収益	117	79	21
受取利息	117	79	21
(B) 有価証券売買損益	△ 468,222	△ 3,611,760	3,978,959
売買益	2,160,432	5,231,545	5,967,452
売買損	△ 2,628,654	△ 8,843,305	△ 1,988,493
(C) 信託報酬等	△ 327,943	△ 292,054	△ 285,149
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△ 796,048	△ 3,903,735	3,693,831
(E) 前期繰越損益金	△ 6,448,252	△ 8,002,282	△12,965,498
(F) 追加信託差損益金	1,248,220	1,178,174	967,516
(配当等相当額)	(30,757,671)	(29,523,680)	(30,489,146)
(売買損益相当額)	(△29,509,451)	(△28,345,506)	(△29,521,630)
(G) 計(D+E+F)	△ 5,996,080	△10,727,843	△ 8,304,151
(H) 収益分配金	△ 1,114,215	△ 1,068,707	△ 1,093,437
次期繰越損益金 (G+H)	△ 7,110,295	△11,796,550	△ 9,397,588
追加信託差損益金	1,248,220	1,178,174	967,516
(配当等相当額)	(30,758,152)	(29,530,118)	(30,489,146)
(売買損益相当額)	(△29,509,932)	(△28,351,944)	(△29,521,630)
分配準備積立金	12,285,891	11,558,482	11,476,764
繰越損益金	△20,644,406	△24,533,206	△21,841,868

* 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9月29日～2016年3月28日) は以下の通りです。

項 目	第84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	870,924円	864,915円	1,019,939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	30,758,152円	29,530,118円	30,489,146円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	12,529,182円	11,762,274円	11,550,262円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	44,158,258円	42,157,307円	43,059,347円
f. 分配対象収益 (1万円当たり)	3,765円	3,747円	3,741円
g. 分配金	1,114,215円	1,068,707円	1,093,437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84期	第85期	第86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

該当事項はございません。

<Dコース>

○1万口当たりの費用明細

(2015年9月29日～2016年3月28日)

項 目	第84期～第86期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	76	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 ）	(49)	(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 ）	(24)	(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 ）	(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	3	0.032	(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)	(0.031)	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	79	0.875	
作成期間の平均基準価額は、8,958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9月29日～2016年3月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第84期～第86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	千円	千口	千円
	—	—	32,257	205,600

*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9月29日～2016年3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84期～第86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 1,414	百万円 808	% 57.1	百万円 1,166	百万円 167	% 14.3

平均保有割合 9.3%

※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3月28日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第83期末	第86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 312,712	千口 280,455	千円 1,743,420

*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

(2016年3月28日現在)

項 目	第86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	1,743,420	97.8
コール・ローン等、その他	38,321	2.2
投資信託財産総額	1,781,741	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86期末における外貨建て純資産（20,236,791千円）の投資信託財産総額（20,641,728千円）に対する比率は98.0%です。

*外貨建て資産は、第86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=113.44円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第84期末	第85期末	第86期末
	2015年11月30日現在	2016年1月28日現在	2016年3月28日現在
	円	円	円
(A) 資産	2,070,758,138	1,824,742,220	1,781,741,601
コール・ローン等	19,028,754	17,660,334	17,520,928
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド(評価額)	2,026,829,347	1,777,081,853	1,743,420,673
未収入金	24,900,000	30,000,000	20,800,000
未収利息	37	33	—
(B) 負債	23,440,945	30,063,133	20,681,598
未払収益分配金	16,532,623	15,686,248	15,630,901
未払解約金	838,530	9,091,990	195,293
未払信託報酬	6,062,091	5,278,191	4,849,246
その他未払費用	7,701	6,704	6,158
(C) 純資産総額(A-B)	2,047,317,193	1,794,679,087	1,761,060,003
元本	2,204,349,856	2,091,499,856	2,084,120,245
次期繰越損益金	△ 157,032,663	△ 296,820,769	△ 323,060,242
(D) 受益権総口数	2,204,349,856口	2,091,499,856口	2,084,120,245口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,288円	8,581円	8,450円

(注) 第84期首元本額2,243百万円、第84～第86期中追加設定元本額6百万円、第84～第86期中一部解約元本額166百万円、第86期末計算口数当たり純資産額8,450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50,992,547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84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
	円	円	円
(A) 配当等収益	2,362	2,054	503
受取利息	2,362	2,054	503
(B) 有価証券売買損益	33,310,038	△126,847,679	△ 6,711,080
売買益	33,843,029	5,790,754	371,842
売買損	△ 532,991	△132,638,433	△ 7,082,922
(C) 信託報酬等	△ 6,069,792	△ 5,284,895	△ 4,855,404
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	27,242,608	△132,130,520	△ 11,565,981
(E) 前期繰越損益金	△148,099,621	△130,261,881	△276,633,435
(F) 追加信託差損益金	△ 19,643,027	△ 18,742,120	△ 19,229,925
(配当等相当額)	(262,867,649)	(249,582,442)	(249,089,130)
(売買損益相当額)	(△282,510,676)	(△268,324,562)	(△268,319,055)
(G) 計(D+E+F)	△140,500,040	△281,134,521	△307,429,341
(H) 収益分配金	△ 16,532,623	△ 15,686,248	△ 15,630,901
次期繰越損益金(G+H)	△157,032,663	△296,820,769	△323,060,242
追加信託差損益金	△ 19,643,027	△ 18,742,120	△ 19,229,925
(配当等相当額)	(262,876,438)	(249,591,073)	(249,105,102)
(売買損益相当額)	(△282,519,465)	(△268,333,193)	(△268,335,027)
分配準備積立金	239,264,523	226,921,875	224,510,440
繰越損益金	△376,654,159	△505,000,524	△528,340,757

* 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9月29日～2016年3月28日)は以下の通りです。

項 目	第84期	第85期	第86期
	2015年9月29日～ 2015年11月30日	2015年12月1日～ 2016年1月28日	2016年1月29日～ 2016年3月28日
a. 配当等収益(経費控除後)	17,953,217円	15,756,617円	14,398,810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	262,876,438円	249,591,073円	249,105,102円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	237,843,929円	226,851,506円	225,742,531円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	518,673,584円	492,199,196円	489,246,443円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,352円	2,353円	2,347円
g. 分配金	16,532,623円	15,686,248円	15,630,901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84期	第85期	第86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

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42期（決算日2016年3月28日）

作成対象期間（2015年9月29日～2016年3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					
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	
42期(2016年3月28日)	62,164	△5.4	546.55	△5.3	—	96.6	—	20,049	

*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

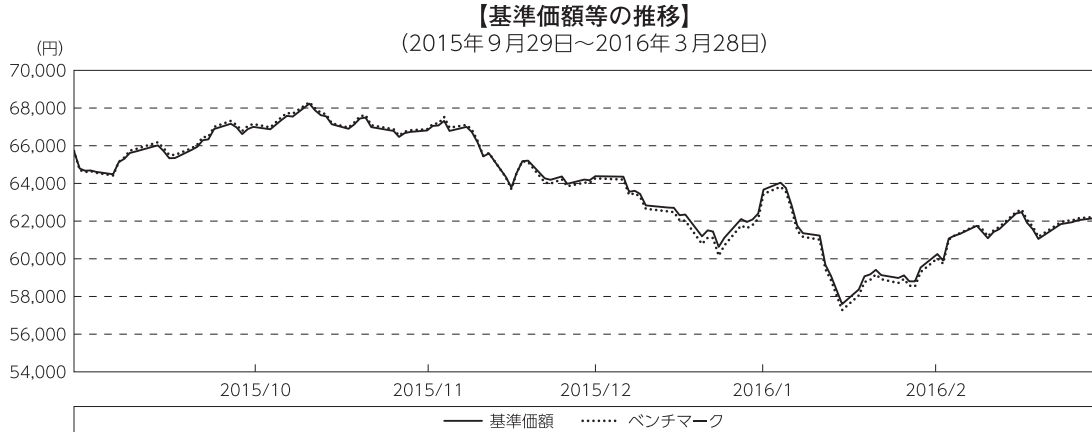
年月日	基準価額		ベンチマーク		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債 組入比率	券 率	債 先物比率
	円	%	騰落率	騰落率				
(期首) 2015年9月28日	65,725	—	577.30	—	—	92.7	—	
9月末	64,684	△1.6	567.50	△1.7	—	94.1	—	
10月末	67,002	1.9	589.89	2.2	—	94.8	—	
11月末	66,810	1.7	587.43	1.8	—	96.5	—	
12月末	64,386	△2.0	564.54	△2.2	—	91.9	—	
2016年1月末	63,673	△3.1	557.33	△3.5	—	93.5	—	
2月末	60,251	△8.3	527.27	△8.7	—	94.6	—	
(期末) 2016年3月28日	62,164	△5.4	546.55	△5.3	—	96.6	—	

*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65,725円から当作成期末には62,164円となりました。

- ・ 中国人民銀行（中央銀行）などが金融緩和姿勢を強めたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が上昇したこと
- ・ 原油価格が大幅に下落したことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の引き上げが決定されたことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・ 中国株の急落および人民元安を背景とした同国の景気減速懸念の高まりや、原油を中心に商品価格が下落したことなどから、ハイ・イールド・ボンドの価格が下落したこと
- ・ 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

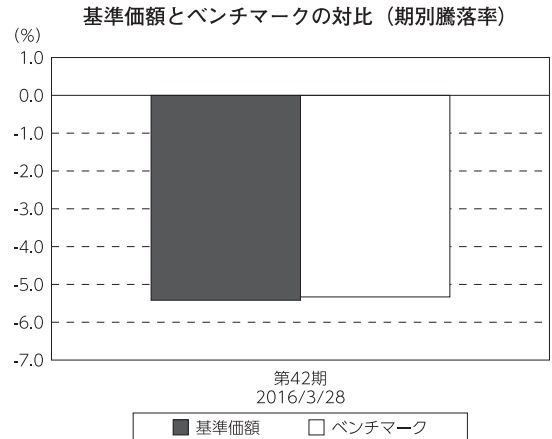
主要投資対象である米国ハイ・イールド・ボンドを高位に組入れました。

・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2.5%、33.2%、54.0%、6.9%、0.0%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-5.4%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（円換算ベース））の-5.3%を0.1ポイント下回りました。主な差異の要因は、CCC格以下の銘柄のオーバーウェイト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、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）は昨年12月に利上げを実施しましたが、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、原油市場は不透明な市場環境が続いており、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。

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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年9月29日～2016年3月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 20	% 0.032	(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 ）	(20)	(0.031)	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	20	0.032	
期中の平均基準価額は、64,467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9月29日～2016年3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 37,470	千米ドル 19,429 (3,952)

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月29日～2016年3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	$\frac{D}{C}$
		百万円	%		百万円	%
為替直物取引	1,414	808	57.1	1,166	167	14.3

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3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	177,925	170,648	19,358,381	96.6	94.1	66.2	27.3	3.1
合 計	177,925	170,648	19,358,381	96.6	94.1	66.2	27.3	3.1

*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	
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	759	86,143	2022/1/15
	A SCHULMAN INC	6.875	200	198	22,461	2023/6/1
	ABC SUPPLY CO INC	5.625	450	465	52,834	2021/4/15
	ABC SUPPLY CO INC	5.75	150	155	17,654	2023/12/15
	ACADIA HEALTHCARE CO INC	6.5	100	104	11,882	2024/3/1
	ACCESS MIDSTREAM PARTNER	4.875	500	434	49,298	2023/5/15
	ACCURIDE CORP	9.5	150	137	15,569	2018/8/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	6.75	125	100	11,344	2019/3/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	7.0	125	83	9,429	2024/7/1
	AES CORPORATION	7.375	610	680	77,177	2021/7/1
	AIRCASTLE LTD	6.25	250	272	30,868	2019/12/1
	AIRCASTLE LTD	5.125	150	155	17,687	2021/3/15
	AIRCASTLE LTD	5.0	100	100	11,390	2023/4/1
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA	8.375	250	264	29,990	2019/11/1
	ALERIS INTL INC	7.875	126	108	12,290	2020/11/1
	ALERIS INTL INC	9.5	125	127	14,410	2021/4/1
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	5.375	650	614	69,680	2022/8/1
	ALLY FINANCIAL	8.0	1,045	1,165	132,177	2020/3/15
	ALLY FINANCIAL INC	3.25	500	490	55,585	2018/11/5
	ALLY FINANCIAL INC	7.5	759	840	95,356	2020/9/15
	ALLY FINANCIAL INC	5.75	200	196	22,290	2025/11/20
	ALLY FINANCIAL INC	8.0	350	399	45,361	2031/11/1
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	9.625	550	145	16,533	2018/10/15
	ALTICE FINCO SA	7.625	200	191	21,766	2025/2/15
	ALTICE SA	7.75	700	682	77,422	2022/5/15
	AMC ENTERTAINMENT INC	5.75	500	513	58,244	2025/6/15
	AMC NETWORKS INC	5.0	575	573	65,064	2024/4/1
	AMERICAN AIRLINES GROUP	4.625	275	267	30,377	2020/3/1
	AMERICAN AXLE & MFG INC	6.25	250	257	29,175	2021/3/15
	AMERICAN GILSONITE CO	11.5	275	123	14,038	2017/9/1
	AMERICAN GREETINGS	7.375	625	639	72,583	2021/12/1
	AMERISTAR CASINOS INC	7.5	375	390	44,347	2021/4/15
	AMSURG CORP	5.625	150	155	17,643	2020/11/30
	AMSURG CORP	5.625	225	231	26,257	2022/7/15
	ANADARKO PETROLEUM CORP	5.55	25	25	2,875	2026/3/15
	ANADARKO PETROLEUM CORP	6.6	25	25	2,907	2046/3/15
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.125	400	343	38,909	2021/4/15
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.125	200	165	18,774	2022/9/27
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	4.875	400	332	37,662	2025/5/14
	ANIXTER INC	5.125	175	176	20,000	2021/10/1
	ANTERO RESOURCES CORP	5.375	225	210	23,928	2021/11/1
	ANTERO RESOURCES CORP	5.625	500	466	52,891	2023/6/1
	ANTERO RESOURCES FINANCE	5.125	400	368	41,745	2022/12/1
	APX GROUP INC	6.375	925	920	104,407	2019/12/1
	ARAMARK CORP	5.75	350	361	41,020	2020/3/15

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	
		%	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)	ARAMARK SERVICES INC	5.125	150	157	17,824	2024/1/15
	ARCELORMITTAL	6.5	600	588	66,702	2021/3/1
	ARCELORMITTAL	8.0	625	545	61,860	2039/10/15
	ARGOS MERGER SUB INC	7.125	475	495	56,234	2023/3/15
	ARTESYN ESCROW INC	9.75	400	340	38,569	2020/10/15
	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	6.0	125	126	14,392	2024/12/15
	ASHTREAD CAPITAL INC	6.5	575	612	69,467	2022/7/15
	ASHTREAD CAPITAL INC	5.625	250	258	29,370	2024/10/1
	AURICO GOLD INC	7.75	150	139	15,867	2020/4/1
	AUS FINANCE PTY LTD	6.875	225	175	19,908	2019/11/1
	BALL CORP	4.375	200	207	23,567	2020/12/15
	BANK OF AMERICA CORP	6.25	650	638	72,445	2049/9/29
	BANK OF AMERICA CORP	8.0	375	366	41,529	2049/12/29
	BANK OF AMERICA CORP	6.3	100	102	11,641	2049/12/29
	BANKRATE INC	6.125	875	877	99,508	2018/8/15
	BARCLAYS BANK PLC	7.75	200	212	24,110	2023/4/10
	BARCLAYS PLC	8.25	400	402	45,678	2049/12/29
	BEACON ROOFING SUPPLY IN	6.375	200	214	24,304	2023/10/1
	BERRY PLASTICS CORP	6.0	375	394	44,773	2022/10/15
	BLOCK COMMUNICATIONS INC	7.25	375	360	40,944	2020/2/1
	BLUE CUBE SPINCO INC	10.0	75	85	9,702	2025/10/15
	BOISE CASCADE LLC/FIN	6.375	125	124	14,144	2020/11/1
	BOYD GAMING CORP	6.875	175	184	20,943	2023/5/15
	BOYD GAMING CORP	6.375	325	331	37,635	2026/4/1
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.5	225	214	24,375	2020/12/15
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.375	125	108	12,265	2025/5/15
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7.625	500	520	58,988	2021/6/1
	BUILDING MATERIALS CORP	5.375	575	589	66,858	2024/11/15
	BUILDING MATERIALS HOLDI	9.0	400	417	47,304	2018/9/15
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	8.625	500	527	59,839	2017/9/15
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	5.875	625	533	60,529	2022/9/15
	CALATLANTIC GROUP INC	6.25	100	107	12,194	2021/12/15
	CALPINE CORP	6.0	175	183	20,844	2022/1/15
	CALPINE CORP	5.375	475	460	52,267	2023/1/15
	CALPINE CORP	5.75	375	362	41,077	2025/1/15
	CARDTRONICS INC	5.125	275	275	31,196	2022/8/1
	CARMIKE CINEMAS INC	6.0	200	212	24,049	2023/6/15
	CARRIZO OIL & GAS INC	6.25	450	399	45,305	2023/4/15
	CASCADES INC	5.5	225	215	24,471	2022/7/15
	CBS OUT AMER CAP LLC/COR	5.25	125	128	14,552	2022/2/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	250	258	29,281	2021/3/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	650	670	76,040	2022/9/30
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.125	250	252	28,608	2023/2/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.875	775	802	90,993	2024/4/1
	CCOH SAFARI LLC	5.75	1,600	1,622	183,999	2026/2/15
	CDW LLC/CDW FINANCE	6.0	500	528	59,910	2022/8/15
	CEB INC	5.625	200	205	23,255	2023/6/15

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)					
	CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	5.375	375	390	44,241	2024/6/1
	CEMEX FINANCE LLC	6.0	200	187	21,317	2024/4/1
	CENTENE ESCROW CORP	5.625	300	316	35,878	2021/2/15
	CENTENE ESCROW CORP	6.125	300	314	35,648	2024/2/15
	CENTRAL GARDEN & PET CO	6.125	150	155	17,611	2023/11/15
	CENTURY INTERMEDIATE HLD	9.75	175	178	20,224	2019/2/15
	CENTURYLINK INC	5.8	975	932	105,765	2022/3/15
	CENTURYLINK INC	6.75	125	121	13,807	2023/12/1
	CENTURYLINK INC	7.5	125	125	14,215	2024/4/1
	CENTURYLINK INC	7.6	425	346	39,292	2039/9/15
	CEQUEL COM ESCRW 1/CAP C	6.375	575	567	64,425	2020/9/15
	CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	175	161	18,263	2021/12/15
	CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	125	113	12,903	2021/12/15
	CHEMOURS CO	7.0	325	259	29,402	2025/5/15
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.625	50	20	2,353	2020/8/15
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.125	200	79	8,961	2021/2/15
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.375	250	91	10,351	2021/6/15
	CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	7.25	939	906	102,791	2019/11/15
	CHS/COMMUNITY HEALTH	6.875	875	780	88,589	2022/2/1
	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	7.125	500	472	53,600	2020/7/15
	CHURCHILL DOWNS INC	5.375	200	205	23,311	2021/12/15
	CINEMARK USA INC	5.125	550	564	64,029	2022/12/15
	CIT GROUP INC	5.0	750	766	86,909	2017/5/15
	CIT GROUP INC	4.25	500	507	57,616	2017/8/15
	CIT GROUP INC	5.5	175	180	20,497	2019/2/15
	CIT GROUP INC	3.875	175	174	19,752	2019/2/19
	CITGO PETROLEUM CORP	6.25	275	268	30,494	2022/8/15
	CITIGROUP INC	5.95	650	626	71,063	2049/12/29
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	150	144	16,399	2022/11/15
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	600	605	68,659	2022/11/15
	CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	6.375	50	15	1,787	2024/3/15
	CNG HOLDINGS INC	9.375	650	269	30,600	2020/5/15
	CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	3.375	50	48	5,516	2019/7/15
	CNO FINANCIAL GROUP INC	5.25	250	253	28,785	2025/5/30
	COEUR D'ALENE MINES CORP	7.875	125	101	11,485	2021/2/1
	COGENT COMMUNICATIONS GR	5.375	150	148	16,845	2022/3/1
	COMMERCIAL METALS CO	4.875	100	87	9,869	2023/5/15
	COMMSCOPE INC	5.0	275	276	31,312	2021/6/15
	COMMSCOPE INC	5.5	275	278	31,624	2024/6/15
	COMMSCOPE TECH FINANCE L	6.0	300	306	34,755	2025/6/15
	COMMUNICATIONS SALES & L	8.25	125	116	13,267	2023/10/15
	COMPRESSCO PARTNERS/FINA	7.25	125	82	9,358	2022/8/15
	CONCHO RESOURCES INC	6.5	525	530	60,151	2022/1/15
	CONCHO RESOURCES INC	5.5	235	230	26,191	2022/10/1
	CONSOLIDATED COMMUNICATI	6.5	400	349	39,590	2022/10/1
	CONSOLIDATED ENERGY FIN	6.75	400	370	41,972	2019/10/15
	CONSTELLATION BRANDS INC	6.0	450	508	57,684	2022/5/1

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 (含む投資法人債類)					
	CONSTELLATION BRANDS INC	4.75	200	207	23,538	2025/12/1
	CONTINENTAL RESOURCES	7.125	175	168	19,057	2021/4/1
	CONTINENTAL RESOURCES	5.0	625	543	61,683	2022/9/15
	CONTINENTAL RESOURCES	4.5	150	126	14,378	2023/4/15
	COTT BEVERAGES INC	6.75	300	315	35,818	2020/1/1
	CREDIT SUISSE GROUP AG	6.25	200	185	21,089	2049/12/29
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.0	125	97	11,060	2020/12/15
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.125	125	92	10,528	2022/3/1
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.25	100	73	8,337	2023/4/1
	CTP TRANS PROD LLC/ FINA	8.25	100	99	11,258	2019/12/15
	CVR REF LLC/COFF FIN INC	6.5	275	246	27,920	2022/11/1
	CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	6.375	75	78	8,848	2022/11/15
	DANA HOLDING CORP	6.0	500	497	56,436	2023/9/15
	DENBURY RESOURCES INC	5.5	550	261	29,636	2022/5/1
	DENBURY RESOURCES INC	4.625	250	110	12,552	2023/7/15
	DIGICEL LIMITED	6.0	525	469	53,312	2021/4/15
	DISH DBS CORP	4.25	350	356	40,398	2018/4/1
	DISH DBS CORP	7.875	1,250	1,364	154,783	2019/9/1
	DISH DBS CORP	5.125	350	349	39,604	2020/5/1
	DISH DBS CORP	5.875	175	165	18,762	2022/7/15
	DRIVETIME AUTO GP & ACCE	8.0	175	153	17,370	2021/6/1
	DUPONT FABROS TECH LP	5.875	175	183	20,794	2021/9/15
	DUPONT FABROS TECH LP	5.625	125	129	14,711	2023/6/15
	DYNEGY INC	6.75	275	274	31,137	2019/11/1
	DYNEGY INC	7.375	300	276	31,394	2022/11/1
	DYNEGY INC	7.625	490	442	50,166	2024/11/1
	ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	5.875	225	214	24,311	2023/1/15
	ENDO FINANCE LLC	5.75	325	311	35,301	2022/1/15
	ENERGY TRANSFER EQUITY	5.875	790	679	77,071	2024/1/15
	ENERSYS	5.0	100	96	10,918	2023/4/30
	ENVISION HEALTHCARE CORP	5.125	225	228	25,906	2022/7/1
	EP ENER/EVEREST ACQ FIN	6.375	400	190	21,553	2023/6/15
	EQUINIX INC	5.375	350	365	41,490	2022/1/1
	EQUINIX INC	5.375	1,025	1,063	120,636	2023/4/1
	EQUINIX INC	5.875	475	499	56,712	2026/1/15
	ESH HOSPITALITY INC	5.25	550	533	60,468	2025/5/1
	EXAMWORKS GROUP INC	5.625	150	153	17,420	2023/4/15
	FELCOR LODGING LP	6.0	375	390	44,241	2025/6/1
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	175	154	17,569	2022/1/15
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	250	220	24,956	2023/6/15
	FERRELLGAS PARTNERS LP	8.625	341	322	36,555	2020/6/15
	FGI OPERATING CO LLC/FIN	7.875	125	74	8,437	2020/5/1
	FIRST CASH FINANCIAL SER	6.75	75	72	8,252	2021/4/1
	FIRST DATA CORPORATION	6.75	438	462	52,419	2020/11/1
	FIRST DATA CORPORATION	5.0	375	375	42,593	2024/1/15
	FLY LEASING LTD	6.75	400	394	44,752	2020/12/15
	FMG RESOURCES AUG 2006	9.75	100	98	11,202	2022/3/1

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)	FREESCALE SEMICONDUCTOR	5.0	275	286	32,443	2021/5/15
	FRESENIUS MED CARE II	5.625	325	355	40,278	2019/7/31
	FRESENIUS MED CARE II	5.875	350	383	43,475	2022/1/31
	FRONTIER COMMUNICATIONS	10.5	1,000	1,010	114,645	2022/9/15
	FRONTIER COMMUNICATIONS	11.0	625	624	70,811	2025/9/15
	FTI CONSULTING INC	6.0	200	209	23,737	2022/11/15
	GANNETT CO INC	4.875	100	104	11,826	2021/9/15
	GANNETT CO INC	6.375	125	135	15,332	2023/10/15
	GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	225	174	19,781	2021/11/15
	GENCORP INC	7.125	250	261	29,707	2021/3/15
	GENON ESCROW CORP	9.875	925	619	70,304	2020/10/15
	GEO GROUP INC/THE	5.875	125	127	14,516	2022/1/15
	GESTAMP FUND LUX SA	5.625	200	203	23,107	2020/5/31
	GIBRALTAR STEEL CORP OF	6.25	100	102	11,627	2021/2/1
	GLOBAL BRASS AND COPPER	9.5	650	689	78,160	2019/6/1
	GLP CAPITAL LP / FIN II	4.875	325	335	38,112	2020/11/1
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.7	125	120	13,665	2049/12/29
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.375	75	71	8,162	2049/12/31
	GOODYEAR TIRE & RUBBER	5.125	300	310	35,223	2023/11/15
	GRAFTECH INTERNATIONAL	6.375	175	102	11,613	2020/11/15
	GREIF INC	7.75	250	278	31,585	2019/8/1
	GREYSTAR REAL ESTATE PAR	8.25	300	313	35,563	2022/12/1
	GRIFFON CORPORATION	5.25	125	123	14,038	2022/3/1
	GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	5.0	275	272	30,884	2022/6/1
	GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	5.25	150	148	16,845	2023/12/15
	GULFPORT ENERGY CORP	7.75	275	277	31,507	2020/11/1
	HALYARD HEALTH INC	6.25	200	200	22,730	2022/10/15
	HARLAND CLARKE HLDINGS	6.875	125	112	12,762	2020/3/1
	HARLAND CLARKE HOLDINGS	9.75	150	148	16,845	2018/8/1
	HCA HOLDINGS INC	6.25	225	243	27,565	2021/2/15
	HCA INC	3.75	525	535	60,747	2019/3/15
	HCA INC	7.5	900	1,021	115,878	2022/2/15
	HCA INC	5.875	720	754	85,556	2023/5/1
	HCA INC	5.375	500	504	57,216	2025/2/1
	HCA INC	5.875	450	462	52,451	2026/2/15
	HCA INC	5.25	450	456	51,781	2026/6/15
	HD SUPPLY INC	5.25	375	393	44,667	2021/12/15
	HEALTHSOUTH CORP	5.75	575	586	66,505	2024/11/1
	HECLA MINING CO	6.875	325	261	29,678	2021/5/1
	HEXION US FINANCE CORP	6.625	400	327	37,094	2020/4/15
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	7.625	350	327	37,123	2021/4/15
	HILL-ROM HOLDINGS INC	5.75	175	180	20,447	2023/9/1
	HOLOGIC INC	5.25	225	232	26,417	2022/7/15
	HRG GROUP INC	7.875	50	52	5,976	2019/7/15
	HUGHES SATELLITE SYSTEMS	7.625	500	551	62,604	2021/6/15
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	5.0	375	394	44,720	2025/11/15
	HUNTSMAN INTERNATIONAL L	5.125	225	219	24,885	2022/11/15

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	
	%	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)	IAMGOLD CORP	6.75	350	267	30,373	2020/10/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	4.875	300	286	32,517	2019/3/15
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	6.0	225	219	24,931	2020/8/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	5.875	825	777	88,206	2022/2/1
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	4.24	300	243	27,651	2065/12/21
	INFOR US INC	6.5	625	568	64,519	2022/5/15
	INTELSAT JACKSON HLDG	5.5	675	408	46,328	2023/8/1
	INTELSAT JACKSON HLDG	8.0	25	25	2,889	2024/2/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.25	575	676	76,757	2020/12/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	5.875	500	551	62,533	2022/8/15
	INTREPID AVIATION GRP HL	6.875	525	427	48,538	2019/2/15
	INVENTIV HEALTH INC	9.0	250	260	29,494	2018/1/15
	IRON MOUNTAIN INC	6.0	625	660	74,905	2020/10/1
	J. B. POINDEXTER & CO	9.0	225	235	26,672	2022/4/1
	JACK COOPER HOLDINGS COR	10.25	125	92	10,493	2020/6/1
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.75	200	196	22,321	2020/10/28
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.25	400	365	41,420	2024/4/3
	JMC STEEL GROUP	8.25	275	250	28,466	2018/3/15
	JPMORGAN CHASE & CO	6.75	275	299	34,026	2049/1/29
	JPMORGAN CHASE & CO	5.0	525	501	56,864	2049/12/29
	KB HOME	9.1	600	646	73,338	2017/9/15
	KB HOME	4.75	75	75	8,508	2019/5/15
	KB HOME	8.0	50	52	6,006	2020/3/15
	KB HOME	7.0	175	175	19,876	2021/12/15
	KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	7.625	100	96	10,946	2021/8/15
	KENNEDY-WILSON INC	5.875	425	414	47,006	2024/4/1
	KINDER MORGAN INC/DELAWA	7.42	1,720	1,689	191,634	2037/2/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	8.0	125	125	14,180	2020/1/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	6.375	200	176	20,050	2022/4/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	8.75	125	119	13,595	2023/1/15
	KISSNER MILLING CO LTD	7.25	225	211	24,024	2019/6/1
	L BRANDS INC	6.875	500	541	61,399	2035/11/1
	LADDER CAP FIN LLC/CORP	7.375	250	248	28,218	2017/10/1
	LAREDO PETROLEUM INC	7.375	400	346	39,250	2022/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	6.25	125	107	12,194	2023/3/15
	LENNAR CORP	6.95	275	297	33,769	2018/6/1
	LENNAR CORP	4.75	250	247	28,076	2022/11/15
	LENNAR CORP	4.875	375	372	42,274	2023/12/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.375	675	694	78,773	2022/8/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.625	350	360	40,875	2023/2/1
	LEVEL 3 FINANCING INC	5.375	375	379	43,071	2024/1/15
	LIFEPOINT HOSPITALS INC	5.5	798	833	94,598	2021/12/1
	LIMITED BRANDS INC	8.5	600	703	79,805	2019/6/15
	LIMITED BRANDS INC	7.0	225	258	29,352	2020/5/1
	LIMITED BRANDS INC	5.625	275	298	33,887	2022/2/15
	LIN TELEVISION CORP	6.375	75	78	8,901	2021/1/15
	LIVE NATION ENTERTAINMEN	5.375	75	77	8,741	2022/6/15

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)					
	LLOYDS BANKING	7.5	222	220	25,057	2049/6/27
	LYNX I CORP	5.375	180	188	21,363	2021/4/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.75	350	325	36,890	2022/8/1
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.625	175	159	18,065	2023/10/15
	MALLINCKRODT FIN/SB	5.5	200	179	20,305	2025/4/15
	MATADOR RESOURCES CO	6.875	75	72	8,199	2023/4/15
	MATTAMY GROUP CORP	6.5	250	226	25,736	2020/11/15
	MDC PARTNERS INC	6.5	175	175	19,852	2024/5/1
	MEDIACOM LLC/CAPTL CORP	7.25	350	362	41,143	2022/2/15
	MEDNAX INC	5.25	200	209	23,737	2023/12/1
	MEG ENERGY CORP	6.5	325	193	21,936	2021/3/15
	MEG ENERGY CORP	6.375	750	444	50,409	2023/1/30
	MERCER INTL INC	7.0	150	150	17,101	2019/12/1
	MERCER INTL INC	7.75	150	150	17,101	2022/12/1
	MERITAGE HOMES CORP	7.0	225	237	26,927	2022/4/1
	MERITAGE HOMES CORP	6.0	150	151	17,143	2025/6/1
	MERITOR INC	6.25	125	111	12,620	2024/2/15
	MGM RESORTS INTL	10.0	200	209	23,747	2016/11/1
	MGM RESORTS INTL	6.75	575	621	70,446	2020/10/1
	MGM RESORTS INTL	6.625	375	402	45,677	2021/12/15
	MGM RESORTS INTL	7.75	275	306	34,822	2022/3/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.875	175	161	18,263	2022/2/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.25	450	382	43,390	2024/1/15
	MICRON TECHNOLOGY INC	5.5	525	443	50,324	2025/2/1
	MICROSEMI CORP	9.125	225	246	27,948	2023/4/15
	MIDCONTINENT COMM & FIN	6.875	200	207	23,538	2023/8/15
	MILLAR WESTERN FOREST	8.5	75	28	3,275	2021/4/1
	MOLINA HEALTHCARE INC	5.375	550	565	64,107	2022/11/15
	MPG HOLDCO I INC	7.375	225	221	25,077	2022/10/15
	MPL 2 ACQUISITION CANCO	9.875	625	650	73,736	2018/8/15
	MPLX LP 144A	5.5	500	483	54,848	2023/2/15
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.375	225	236	26,864	2024/3/1
	MRT MID PART/MRT MID FIN	7.25	300	267	30,288	2021/2/15
	MURPHY OIL CORP	3.7	200	161	18,375	2022/12/1
	NAI ENTERTAINMENT HLDING	5.0	687	699	79,394	2018/8/1
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	7.875	475	496	56,308	2021/7/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	6.0	375	392	44,507	2022/4/15
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	9.625	200	205	23,340	2019/5/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	500	426	48,353	2022/6/1
	NAVIENT CORP	5.875	800	684	77,592	2024/10/25
	NBTY INC	9.0	575	587	66,695	2018/10/1
	NCL CORP LTD	5.25	225	231	26,225	2019/11/15
	NCR CORP	5.875	100	102	11,670	2021/12/15
	NCR CORP	6.375	450	464	52,707	2023/12/15
	NEPTUNE FINCO CORP	10.125	400	429	48,665	2023/1/15
	NEPTUNE FINCO CORP	10.875	400	433	49,119	2025/10/15
	NETFLIX INC	5.5	100	104	11,803	2022/2/15

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)					
	NEXSTAR BROADCASTING INC	6.125	150	149	16,930	2022/2/15
	NIELSEN CO LUX SARL/THE	5.5	300	313	35,605	2021/10/1
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.0	1,275	1,286	145,901	2022/4/15
	NORBORD INC	6.25	150	147	16,760	2023/4/15
	NORTEK INC	8.5	500	523	59,414	2021/4/15
	NOVELIS INC	8.75	155	155	17,671	2020/12/15
	NRG ENERGY INC	8.25	250	254	28,856	2020/9/1
	NRG ENERGY INC	7.875	500	502	57,003	2021/5/15
	NRG ENERGY INC	6.625	600	557	63,256	2023/3/15
	NRG ENERGY INC	6.25	375	342	38,897	2024/5/1
	NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD	7.75	650	689	78,241	2025/12/15
	NUMERICABLE GROUP SA	4.875	400	398	45,149	2019/5/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.0	1,300	1,274	144,522	2022/5/15
	NWH ESCROW CORP	7.5	300	196	22,290	2021/8/1
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	3.75	200	202	22,971	2018/6/1
	OASIS PETROLEUM INC	6.875	500	377	42,823	2022/3/15
	OUTERWALL INC	5.875	150	114	13,017	2021/6/15
	OWENS-BROCKWAY	5.875	250	259	29,458	2023/8/15
	OWENS-BROCKWAY	6.375	400	415	47,162	2025/8/15
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	8.875	275	266	30,221	2017/4/15
	PBF LOGISTICS LP/FINANCE	6.875	350	325	36,924	2023/5/15
	PENN NATIONAL GAMING INC	5.875	225	223	25,396	2021/11/1
	PENSKE AUTO GROUP INC	5.75	350	357	40,597	2022/10/1
	PERSTORP HOLDING AB	8.75	200	200	22,688	2017/5/15
	PETROLEUM GEO-SERVICES	7.375	200	140	15,881	2018/12/15
	PINNACLE FOODS INC	5.875	100	104	11,797	2024/1/15
	PIONEER ENERGY SERVICES	6.125	125	54	6,132	2022/3/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.5	859	691	78,443	2020/11/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.75	725	572	64,972	2022/2/1
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.875	1,400	1,099	124,670	2023/2/15
	PNK FINANCE CORP	6.375	400	426	48,431	2021/8/1
	POLYONE CORP	5.25	125	125	14,286	2023/3/15
	POST HOLDINGS INC	6.75	125	132	14,995	2021/12/1
	POST HOLDINGS INC	7.375	100	105	11,953	2022/2/15
	POST HOLDINGS INC	7.75	325	359	40,831	2024/3/15
	POST HOLDINGS INC	8.0	175	194	22,085	2025/7/15
	PRECISION DRILLING CORP	5.25	150	105	11,996	2024/11/15
	PRODUCTION RES GROUP	8.875	500	346	39,278	2019/5/1
	PSPC ESCROW CORP	6.5	75	64	7,343	2022/2/1
	QORVO INC	6.75	275	288	32,677	2023/12/1
	QORVO INC	7.0	200	212	24,049	2025/12/1
	QUEBECOR MEDIA INC	5.75	250	260	29,494	2023/1/15
	QVC INC	5.125	50	51	5,866	2022/7/2
	RADIAN GROUP INC	5.25	275	268	30,416	2020/6/15
	RADIAN GROUP INC	7.0	200	206	23,368	2021/3/15
	RADIO SYSTEMS CORP	8.375	975	1,006	114,198	2019/11/1
	RANGE RESOURCES CORP	5.0	175	151	17,171	2023/3/15

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)	REALOGY GROUP/CO-ISSUER	5.25	300	309	35,138	2021/12/1
		REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	100	103	11,769	2022/3/15
		REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	50	51	5,806	2023/6/15
		RESOLUTE FOREST PRODUCTS	5.875	650	446	50,693	2023/5/15
		REXEL SA	5.25	300	306	34,712	2020/6/15
		REYNOLDS GROUP HOLDINGS	6.875	315	325	36,894	2021/2/15
		REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	5.75	650	663	75,210	2020/10/15
		RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	5.0	125	128	14,534	2023/4/15
		RICE ENERGY INC	6.25	125	110	12,549	2022/5/1
		ROSE ROCK MIDSTREAM/FIN	5.625	425	286	32,543	2022/7/15
		ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	7.64	1,100	1,072	121,664	2049/3/29
		RR DONNELLEY & SONS CO	6.5	125	106	12,123	2023/11/15
		RSI HOME PRODUCTS INC	6.5	775	808	91,762	2023/3/15
		RYLAND GROUP	6.625	425	464	52,671	2020/5/1
		SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	800	774	87,802	2021/2/1
		SABINE PASS LIQUEFACTION	6.25	300	294	33,351	2022/3/15
		SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	50	47	5,416	2023/4/15
		SABRA HEALTH/CAPTL CORP	5.5	150	150	17,058	2021/2/1
		SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.75	311	327	37,132	2022/6/1
		SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.625	200	213	24,162	2025/12/1
		SANCHEZ ENERGY CORP	6.125	250	151	17,173	2023/1/15
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5.625	325	339	38,480	2019/10/1
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4.875	525	540	61,268	2022/7/15
		SCHAEFFLER FINANCE BV	4.75	200	206	23,425	2021/5/15
		SCHAEFFLER HLDG FIN BV	6.25	750	786	89,227	2019/11/15
		SCOTTS MIRACLE-GRO CO	6.0	325	344	39,080	2023/10/15
		SEALED AIR CORP	5.125	200	208	23,652	2024/12/1
		SEALED AIR CORP	5.5	500	522	59,236	2025/9/15
		SEMINOLE HARD ROCK ENT I	5.875	175	176	20,050	2021/5/15
		SENSATA TECH UK FIN CO	6.25	375	399	45,305	2026/2/15
		SERVICE CORP INTL	8.0	875	1,034	117,374	2021/11/15
		SERVICE CORP INTL	5.375	200	209	23,708	2022/1/15
		SERVICE CORP INTL	5.375	100	105	11,967	2024/5/15
		SESI LLC	6.375	300	240	27,310	2019/5/1
		SESI LLC	7.125	300	219	24,928	2021/12/15
		SEVEN GENERATIONS ENERGY	6.75	100	95	10,833	2023/5/1
		SHEA HOMES LP/FNDG CP	5.875	150	149	16,930	2023/4/1
		SHEA HOMES LP/FNDG CP	6.125	150	149	16,930	2025/4/1
		SILGAN HOLDINGS INC	5.0	325	329	37,421	2020/4/1
		SINCLAIR TELEVISION GROU	5.625	160	162	18,422	2024/8/1
		SINCLAIR TELEVISION GROU	5.875	150	153	17,398	2026/3/15
		SIRIUS XM RADIO INC	5.875	225	235	26,704	2020/10/1
		SIRIUS XM RADIO INC	6.0	675	708	80,400	2024/7/15
		SLM CORP	6.0	100	101	11,514	2017/1/25
		SLM CORP	5.5	200	198	22,461	2019/1/15
		SLM CORP	8.0	500	497	56,436	2020/3/25
		SLM CORP	6.125	400	346	39,250	2024/3/25

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)					
	SM ENERGY CO	6.5	175	127	14,442	2023/1/1
	SONIC AUTOMOTIVE INC	7.0	775	819	92,971	2022/7/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	5.0	125	121	13,790	2023/5/15
	SOUTHERN STAR CENT CORP	5.125	225	207	23,482	2022/7/15
	SPCM SA	6.0	200	203	23,028	2022/1/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.625	75	80	9,124	2022/11/15
	SPECTRUM BRANDS INC	5.75	175	186	21,192	2025/7/15
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	6.75	375	389	44,161	2020/12/15
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	5.25	125	129	14,711	2022/3/15
	SPRINT CAPITAL CORP	6.875	325	240	27,282	2028/11/15
	SPRINT CAPITAL CORP	8.75	750	590	67,000	2032/3/15
	SPRINT COMMUNICATIONS	6.0	350	256	29,083	2022/11/15
	SPRINT CORP	7.875	150	114	12,966	2023/9/15
	SPRINT CORP	7.125	550	410	46,560	2024/6/15
	SPRINT NEXTEL CORP	8.375	1,075	1,061	120,423	2017/8/15
	SPRINT NEXTEL CORP	7.0	450	452	51,303	2020/3/1
	SPRINT NEXTEL CORP	7.0	75	59	6,700	2020/8/15
	SS&C TECH HOLDINGS INC	5.875	150	154	17,569	2023/7/15
	STANDARD INDUSTRIES INC	5.125	150	154	17,505	2021/2/15
	STANDARD INDUSTRIES INC	5.5	75	78	8,848	2023/2/15
	STANDARD PACIFIC CORP	8.375	850	949	107,753	2018/5/15
	STEEL DYNAMICS INC	6.375	275	284	32,287	2022/8/15
	SUBURBAN PROPANE PARTNRS	5.5	250	240	27,225	2024/6/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	7.5	650	518	58,804	2021/7/1
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	5.5	75	53	6,040	2022/8/15
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	100	70	7,997	2020/2/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	125	88	9,996	2020/2/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	100	70	7,997	2020/2/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	5.5	450	452	51,367	2020/8/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	6.375	625	635	72,140	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.464	200	205	23,289	2019/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.542	500	520	59,059	2020/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.25	100	103	11,783	2021/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.125	150	156	17,739	2022/1/15
	T-MOBILE USA INC	6.731	125	129	14,739	2022/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.0	450	465	52,834	2023/3/1
	T-MOBILE USA INC	6.625	100	105	11,982	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.836	75	79	9,014	2023/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.375	450	463	52,579	2025/3/1
	T-MOBILE USA INC	6.5	525	545	61,838	2026/1/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	4.125	300	279	31,649	2019/11/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	350	346	39,306	2021/2/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.375	131	125	14,266	2022/8/1
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.75	250	245	27,881	2024/3/15
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	5.625	200	189	21,440	2024/3/1
	TEAMHEALTH INC	7.25	100	107	12,223	2023/12/15
	TECK RESOURCES LIMITED	4.75	50	34	3,942	2022/1/15

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	
		%	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	198	201	22,869	2021/6/30
	TENET HEALTHCARE CORP	4.13385	225	225	25,587	2020/6/15
	TENET HEALTHCARE CORP	6.0	850	903	102,450	2020/10/1
	TERRAFORM GLOBAL OPERATI	9.75	275	190	21,603	2022/8/15
	TERRAFORM POWER OPERATIN	6.125	75	55	6,338	2025/6/15
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.125	175	175	19,951	2021/10/15
	THOMPSON CREEK METALS CO	7.375	275	70	7,954	2018/6/1
	TIME INC	5.75	275	242	27,452	2022/4/15
	TITAN INTERNATIONAL INC	6.875	100	80	9,131	2020/10/1
	TMS INTERNATIONAL CORP	7.625	75	46	5,296	2021/10/15
	TMX FIN LLC/TITLEMAX FIN	8.5	175	140	15,980	2018/9/15
	TOLL BROS FINANCE CORP	8.91	225	247	28,108	2017/10/15
	TOLL BROS FINANCE CORP	4.875	100	99	11,315	2025/11/15
	TOPAZ MARINE SA	8.625	200	179	20,413	2018/11/1
	TPC GROUP INC	8.75	300	214	24,332	2020/12/15
	TRAC INTERMODAL LLC/CORP	11.0	150	161	18,334	2019/8/15
	TRANSFIELD SERVICES LTD	8.375	125	128	14,605	2020/5/15
	TREEHOUSE FOODS INC	6.0	300	315	35,818	2024/2/15
	TRI POINTE HOLDINGS INC	4.375	225	225	25,524	2019/6/15
	TRI POINTE HOLDINGS INC	5.875	225	224	25,460	2024/6/15
	TRIBUNE MEDIA CO	5.875	150	147	16,718	2022/7/15
	TRINIDAD DRILLING LTD	7.875	250	195	22,120	2019/1/15
	TRIUMPH GROUP INC	5.25	175	157	17,866	2022/6/1
	TULLOW OIL PLC	6.25	600	434	49,261	2022/4/15
	UNITYMEDIA HESSEN / NRW	5.5	675	701	79,539	2023/1/15
	UNITYMEDIA KABELBW GMBH	6.125	200	208	23,652	2025/1/15
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	7.625	225	208	23,609	2020/8/15
	UNIVISION COMMUNICATIONS	6.75	920	971	110,235	2022/9/15
	US AIRWAYS 2012-2C PTT	5.45	50	50	5,672	2018/6/3
	VALEANT PHARMACEUTICALS	6.75	425	343	38,991	2021/8/15
	VECTOR GROUP LTD	7.75	275	289	32,833	2021/2/15
	VIASAT INC	6.875	275	286	32,498	2020/6/15
	VIDEOTRON LTD	5.375	75	77	8,827	2024/6/15
	VIKING CRUISES LTD	8.5	350	330	37,520	2022/10/15
	VIKING CRUISES LTD	6.25	75	63	7,189	2025/5/15
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	6.375	400	416	47,191	2023/4/15
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	5.75	500	507	57,570	2025/1/15
	VPII ESCROW CORP	6.75	250	227	25,807	2018/8/15
	VPII ESCROW CORP	7.5	250	207	23,538	2021/7/15
	VRX ESCROW CORP	5.375	325	264	30,047	2020/3/15
	VRX ESCROW CORP	5.875	525	411	46,677	2023/5/15
	VRX ESCROW CORP	6.125	900	692	78,552	2025/4/15
	VTR FINANCE BV	6.875	200	196	22,271	2024/1/15
	WEATHERFORD BERMUDA	5.125	225	194	22,104	2020/9/15
	WELLCARE HEALTH PLANS IN	5.75	450	467	53,026	2020/11/15
	WELLS FARGO & COMPANY	5.9	150	151	17,226	2049/12/29
	WESCO DISTRIBUTION INC	5.375	150	151	17,143	2021/12/15

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	
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)					
	WEST CORP	5.375	950	862	97,799	2022/7/15
	WESTERN REFINING/WNRL FI	7.5	100	90	10,266	2023/2/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	5.75	75	72	8,167	2019/4/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	7.0	100	96	10,918	2022/8/15
	WILLIAMS COMPANIES INC	4.55	500	391	44,383	2024/6/24
	WINDSTREAM CORP	7.75	375	311	35,308	2021/10/1
	WINDSTREAM CORP	7.5	250	192	21,837	2022/6/1
	WINDSTREAM CORP	6.375	250	182	20,702	2023/8/1
	WMG HOLDINGS CORP	13.75	200	212	24,134	2019/10/1
	WOODSIDE HOMES CO LLC/FI	6.75	500	450	51,048	2021/12/15
	WPX ENERGY INC	6.0	50	37	4,239	2022/1/15
	WR GRACE & CO-CONN	5.125	225	234	26,608	2021/10/1
	XPO LOGISTICS INC	7.875	200	208	23,595	2019/9/1
	XPO LOGISTICS INC	6.5	450	436	49,484	2022/6/15
	ZIGGO BOND FINANCE BV	5.875	200	197	22,376	2025/1/15
	iStar Inc	6.5	150	150	17,016	2021/7/1
合	計				19,358,381	

*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3月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	19,358,381	93.8
コール・ローン等、その他	1,283,347	6.2
投資信託財産総額	20,641,728	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（20,236,791千円）の投資信託財産総額（20,641,728千円）に対する比率は98.0%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=113.44円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月28日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	21,026,499,542	
コール・ローン等	607,586,035	
公社債(評価額)	19,358,381,604	
未収入金	714,611,848	
未収利息	325,822,124	
前払費用	20,097,931	
(B) 負債	976,524,920	
未払金	578,424,920	
未払解約金	398,100,000	
(C) 純資産総額(A-B)	20,049,974,622	
元本	3,225,331,881	
次期繰越損益金	16,824,642,741	
(D) 受益権総口数	3,225,331,881口	
1万口当たり基準価額(C/D)	62,164円	

(注) 期首元本額3,188百万円、期中追加設定元本額475百万円、期中一部解約元本額438百万円、計算口数当たり純資産額62,164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 396百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース 714百万円
- ・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 280百万円
- ・ハイブリッド・インカムオープン 234百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンAコース(野村SMA向け) 405百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープンBコース(野村SMA向け) 473百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Aコース(野村SMA・EW向け) 239百万円
- ・ハイ・イールド ボンド オープン Bコース(野村SMA・EW向け) 463百万円

○損益の状況 (2015年9月29日～2016年3月28日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	644,089,083	
受取利息	642,178,032	
その他収益金	1,911,051	
(B) 有価証券売買損益	△ 1,756,512,942	
売買益	389,655,977	
売買損	△ 2,146,168,919	
(C) 保管費用等	△ 6,485,374	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,118,909,233	
(E) 前期繰越損益金	17,765,524,598	
(F) 追加信託差損益金	2,573,107,120	
(G) 解約差損益金	△ 2,395,079,744	
(H) 計(D+E+F+G)	16,824,642,741	
次期繰越損益金(H)	16,824,642,741	

*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。