

野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型

運用報告書(全体版)

第14期(決算日2017年3月15日)

作成対象期間(2016年9月16日～2017年3月15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。

| | | |
|--------|--|--|
| 商品分類 | 追加型投信/海外/債券 | |
| 信託期間 | 2010年4月23日から2020年3月16日(当初、2015年3月16日)までです。 | |
| 運用方針 | 主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界のハイ・イールド債券を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。 | |
| 主な投資対象 | 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
| | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス | 世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とします。 |
| | 野村マネー マザーファンド | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。 |
| | 野村マネー マザーファンド | 株式への投資は行いません。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、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/>

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 (分配落) | 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------|--------------|--------------|-------|----------------|----------------|--------------------|--------------|
| | | 税 込 分 配 金 | 騰 落 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 10期(2015年3月16日) | 13,244 | 10 | △1.1 | 0.0 | — | 99.1 | 2,109 |
| 11期(2015年9月15日) | 13,080 | 10 | △1.2 | 0.0 | — | 99.0 | 1,726 |
| 12期(2016年3月15日) | 12,961 | 10 | △0.8 | 0.0 | — | 99.1 | 1,302 |
| 13期(2016年9月15日) | 13,737 | 10 | 6.1 | 0.0 | — | 99.0 | 1,701 |
| 14期(2017年3月15日) | 13,991 | 10 | 1.9 | 0.0 | — | 99.0 | 1,536 |

* 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、「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。

* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|------------|--------|-------|-----|----------------|----------------|--------------------|
| | | 騰 落 率 | 率 | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % | % | % |
| 2016年9月15日 | 13,737 | — | 0.0 | — | 99.0 | |
| 9月末 | 13,814 | 0.6 | 0.0 | — | 98.1 | |
| 10月末 | 13,832 | 0.7 | 0.0 | — | 98.4 | |
| 11月末 | 13,622 | △0.8 | 0.0 | — | 99.0 | |
| 12月末 | 13,847 | 0.8 | 0.0 | — | 98.8 | |
| 2017年1月末 | 13,976 | 1.7 | 0.0 | — | 99.1 | |
| 2月末 | 14,125 | 2.8 | 0.0 | — | 98.3 | |
| (期 末) | | | | | | |
| 2017年3月15日 | 14,001 | 1.9 | 0.0 | — | 99.0 | |

* 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、「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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：13,737円

期末：13,991円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：1.9%（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。作定期首（2016年9月15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）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

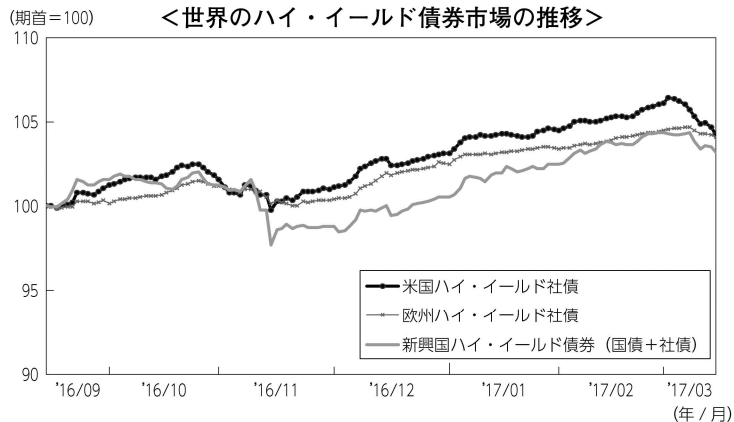
基準価額は、期首13,737円から期末には13,991円となりました。

- ・実質的に投資している世界のハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利子収入）
- ・実質的に投資している世界のハイ・イールド債券からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

○投資環境

<世界のハイ・イールド債券市場>

世界のハイ・イールド債券市場の騰落は以下ようになりました。



(注) 各市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、各市場指数は、米ドル建て指数を用いています。
 米国ハイ・イールド社債：BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス、欧州ハイ・イールド社債：BofA・メリルリンチ・ユーロ・ハイ・イールド・コンストレインド・インデックス、新興国ハイ・イールド債券：JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル (BB格以下) とJPモルガン・コーポレート・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・ブロード (BB格以下) を半分ずつ合成し日当たりバランスしたと仮定し算出。

<米国ハイ・イールド債券市場>

OPEC (石油輸出国機構) の原油減産合意を受けて原油価格が上昇したことや、良好な米経済指標が発表されたこと、トランプ米大統領が規制緩和などにより米国経済の成長を加速させるとの期待が高まったことなどから堅調に推移し、当作成期間で値上がりとなりました。

<欧州ハイ・イールド債券市場>

米大統領選挙を控え、政治経済に対する先行き不透明感が高まったことなどから軟調に推移する局面もありましたが、ECB (欧州中央銀行) が資産購入プログラムの延長を発表したことや、ドラギECB総裁が追加金融緩和の可能性を示唆したことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

＜新興国ハイ・イールド債券市場＞

米国のトランプ政権が掲げる保護主義的な通商政策が新興国経済に悪影響を与えるとの懸念が高まったことや、米国の利上げペースの加速が意識されたことなどから軟調に推移する場面もありましたが、OPECが原油減産に合意し、加盟各国も合意を遵守する姿勢を示したことを背景として原油価格が上昇したことや、中国で良好な経済指標が発表されたことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

●BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・コンストレインド・インデックス（BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index）は、バンクオブアメリカ・メリルリンチが算出する、米国のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表わす代表的な指数です。
 BofA・メリルリンチ・ユーロ・ハイ・イールド・コンストレインド・インデックス（BofA Merrill Lynch EURO High Yield Constrained Index）は、バンクオブアメリカ・メリルリンチが算出する、欧州のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表わす代表的な指数です。
 ●JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（JP Morgan Emerging Market Bond Index Global）は、J. P. Morgan Securities LLCが公表しているエマージング・マーケット国債を対象としたインデックスです。JPモルガン・コーポレート・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・ブロード（JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index Broad）は、J. P. Morgan Securities LLCが公表しているエマージング・マーケット社債を対象としたインデックスです。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型]

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス〕受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス〕受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス]

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド〕のポートフォリオにおける信用格付け別比率については、期末現在で、AA格0.3%、A格2.3%、BBB格11.4%、BB格29.1%、B格33.5%、CCC格以下および無格付13.3%となりました。

*格付はS&P社あるいはムーディーズ社のいずれかの格付機関の低い方の格付によります。格付がない場合は副投資顧問会社が同等の信用度を有すると判断した格付によります。

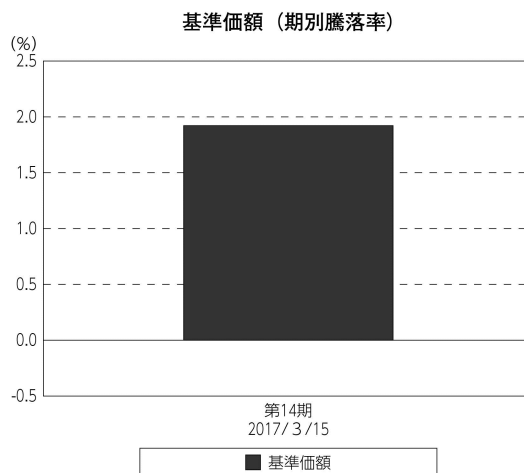
[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配については、分配原資の範囲内で、基準価額水準等を勘案して、分配を行いました。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す。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第14期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2016年9月16日～ 2017年3月15日 |
| 当期分配金 | 10 |
| (対基準価額比率) | 0.071% |
| 当期の収益 | 10 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 9,300 |

(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。

◎今後の運用方針

[野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス] 受益証券および[野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス] 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス]

世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル建て資産を原則として対円で為替ヘッジを行います。

債券への投資にあたっては、引き続き、高水準のインカムゲイン（利子収入）の確保とキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指し、地域別配分、信用格付別配分、債券種別配分に考慮したポートフォリオの構築を行っていきます。地域間の市場環境や利回り水準などに鑑み、相対的に利回り水準が高く、中長期的な観点から、潜在的に高いリターンが見込まれる地域への投資を高位とする戦略を継続する方針です。また、ファンダメンタルズ（基礎的条件）が概ね良好と判断する社債への投資比率を、相対的に高位とする戦略を継続する方針です。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行う場合があります。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図る運用を行う方針です。

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。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2016年9月16日～2017年3月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 58 | % 0.418 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (20) | (0.147) | 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 ） | (36) | (0.257) | 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) | (0.013) | 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 | 0 | 0.001 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.001) | 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 |
| 合 計 | 58 | 0.419 | |
| 期中の平均基準価額は、13,869円です。 | | | |

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

○売買及び取引の状況

(2016年9月16日～2017年3月15日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---|--------|---------------|--------|---------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドー グローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス | 64,940 | 千円 419,549 | 86,780 | 千円 555,151 |

* 金額は受け渡し代金。

* 金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年9月16日～2017年3月15日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型>

該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

| 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 18,264 | 百万円 1,164 | % 6.4 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

平均保有割合 0.0%

※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證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2017年3月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|---|--------------|--------------|-----------------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドー グローバル・ハイ・イールド・ボンドー日本円クラス | 口 259,842 | 口 238,002 | 千円 1,521,308 | % 99.0 |
| 合 計 | 259,842 | 238,002 | 1,521,308 | 99.0 |

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|-----------|-----------|-------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 野村マネー マザーファンド | 千口 984 | 千口 984 | 千円 1,005 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年3月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 1,521,308 | % 98.4 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,005 | 0.1 |
| コール・ローン等、その他 | 24,468 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 1,546,781 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年3月15日現在）

○損益の状況（2016年9月16日～2017年3月15日）

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,546,781,000 |
| コール・ローン等 | 24,466,799 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 1,521,308,784 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,005,417 |
| (B) 負債 | 10,485,908 |
| 未払金 | 2,008,208 |
| 未払収益分配金 | 1,098,087 |
| 未払解約金 | 259,449 |
| 未払信託報酬 | 7,101,979 |
| 未払利息 | 33 |
| その他未払費用 | 18,152 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,536,295,092 |
| 元本 | 1,098,087,366 |
| 次期繰越損益金 | 438,207,726 |
| (D) 受益権総口数 | 1,098,087,366口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,991円 |

(注) 期首元本額は1,238,465,223円、期中追加設定元本額は422,772,743円、期中一部解約元本額は563,150,600円、1口当たり純資産額は1.3991円です。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 51,492,038 |
| 受取配当金 | 51,501,312 |
| 支払利息 | △ 9,274 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 20,266,835 |
| 売買益 | 5,820,618 |
| 売買損 | △ 26,087,453 |
| (C) 信託報酬等 | △ 7,120,131 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 24,105,072 |
| (E) 前期繰越損益金 | 77,432,562 |
| (F) 追加信託差損益金 | 337,768,179 |
| (配当等相当額) | (765,715,622) |
| (売買損益相当額) | (△427,947,443) |
| (G) 計(D+E+F) | 439,305,813 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,098,087 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 438,207,726 |
| 追加信託差損益金 | 337,768,179 |
| (配当等相当額) | (765,715,757) |
| (売買損益相当額) | (△427,947,578) |
| 分配準備積立金 | 255,607,066 |
| 繰越損益金 | △155,167,519 |

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

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2016年9月16日～2017年3月15日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2016年9月16日～ 2017年3月15日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 44,373,947円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 765,715,757円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 212,331,206円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,022,420,910円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 9,310円 |
| g. 分配金 | 1,098,087円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|-----------------|-----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 10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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年3月15日現在）

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体（19,131,712千口）の内容です。

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）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 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 1,119,000 (1,119,000) | 1,119,416 (1,119,416) | 5.7 (5.7) | — (—) | — (—) | — (—) | 5.7 (5.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 2,070,000 (2,070,000) | 2,070,684 (2,070,684) | 10.6 (10.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 10.6 (10.6) |
| 金融債券 | 3,490,000 (3,490,000) | 3,491,998 (3,491,998) | 17.9 (17.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 17.9 (17.9) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 4,145,000 (4,145,000) | 4,148,946 (4,148,946) | 21.2 (21.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 21.2 (21.2) |
| 合 計 | 10,824,000 (10,824,000) | 10,831,046 (10,831,046) | 55.5 (55.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 55.5 (55.5) |

*（ ）内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 北海道 公募（5年）平成23年度第14回 | 0.35 | 200,000 | 200,019 | 2017/3/23 |
| 神奈川県 公募第145回 | 1.8 | 100,000 | 100,025 | 2017/3/20 |
| 広島県 公募平成18年度第4回 | 1.79 | 200,000 | 200,128 | 2017/3/27 |
| 共同発行市場地方債 公募第48回 | 1.7 | 607,000 | 607,225 | 2017/3/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第49回 | 1.8 | 10,000 | 10,017 | 2017/4/25 |
| 川崎市 公募（5年）第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,000 | 2017/3/17 |
| 小 計 | | 1,119,000 | 1,119,416 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第21回 | 0.46 | 200,000 | 200,012 | 2017/3/17 |
| 地方公共団体金融機構債券（5年）第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,044 | 2017/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券（2年）第2回 | 0.1 | 270,000 | 270,018 | 2017/3/28 |
| 日本政策金融公庫社債 第24回財投機関債 | 0.368 | 280,000 | 280,172 | 2017/5/10 |
| 国際協力銀行債券 第27回財投機関債 | 1.77 | 100,000 | 100,010 | 2017/3/17 |
| 都市再生債券 財投機関債第14回 | 1.9 | 100,000 | 100,011 | 2017/3/17 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第2回 | 1.8 | 280,000 | 280,034 | 2017/3/17 |
| 東日本高速道路 第18回 | 0.387 | 130,000 | 130,281 | 2017/9/20 |
| 中日本高速道路社債 第15回 | 0.931 | 530,000 | 530,044 | 2017/3/17 |
| 中日本高速道路社債 第53回 | 0.222 | 80,000 | 80,053 | 2017/6/20 |
| 小 計 | | 2,070,000 | 2,070,684 | |
| 金融債券 | | | | |
| 商工債券 利付第743回い号 | 0.4 | 300,000 | 300,157 | 2017/4/27 |
| 商工債券 利付第745回い号 | 0.35 | 200,000 | 200,205 | 2017/6/27 |
| 商工債券 利付第751回い号 | 0.25 | 20,000 | 20,041 | 2017/12/27 |
| 農林債券 利付第742回い号 | 0.45 | 690,000 | 690,102 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第268回 | 0.4 | 500,000 | 500,071 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第269回 | 0.4 | 80,000 | 80,037 | 2017/4/27 |
| しんきん中金債券 利付第270回 | 0.35 | 100,000 | 100,070 | 2017/5/26 |
| しんきん中金債券 利付第271回 | 0.35 | 300,000 | 300,312 | 2017/6/27 |
| 商工債券 利付（3年）第171回 | 0.2 | 200,000 | 200,059 | 2017/4/27 |
| 商工債券 利付（3年）第173回 | 0.2 | 500,000 | 500,311 | 2017/6/27 |
| 商工債券 利付（3年）第174回 | 0.15 | 200,000 | 200,130 | 2017/7/27 |
| 商工債券 利付（3年）第179回 | 0.14 | 400,000 | 400,498 | 2017/12/27 |
| 小 計 | | 3,490,000 | 3,491,998 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | |
| 中部電力 第411回 | 3.125 | 100,000 | 100,342 | 2017/4/25 |
| 中国電力 第371回 | 0.575 | 100,000 | 100,151 | 2017/6/23 |
| 東北電力 第463回 | 0.72 | 45,000 | 45,083 | 2017/6/23 |
| みずほコーポレート銀行 第7回特定社債間限定同順位特約付 | 2.08 | 200,000 | 201,517 | 2017/7/27 |
| みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付 | 0.46 | 300,000 | 300,150 | 2017/4/21 |
| みずほコーポレート銀行 第30回特定社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 200,000 | 200,270 | 2017/7/25 |
| ホンダファイナンス 第18回社債間限定同順位特約付 | 0.479 | 100,000 | 100,007 | 2017/3/17 |
| ホンダファイナンス 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.372 | 200,000 | 200,208 | 2017/6/20 |
| トヨタファイナンス 第49回社債間限定同等特約付 | 0.415 | 100,000 | 100,113 | 2017/6/20 |
| 日立キャピタル 第43回社債間限定同順位特約付 | 0.57 | 100,000 | 100,150 | 2017/6/20 |
| 三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.487 | 300,000 | 300,294 | 2017/5/29 |
| 三菱地所 第79回担保提供制限等財務上特約無 | 1.79 | 600,000 | 600,089 | 2017/3/17 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|---|-------|------------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 西日本鉄道 第38回社債間限定同順位特約付 | | 2.0 | 100,000 | 100,173 | 2017/4/17 |
| 日本電信電話 第52回 | | 1.77 | 1,300,000 | 1,300,143 | 2017/3/17 |
| 大阪瓦斯 第7回社債間限定同順位特約付 | | 3.4 | 200,000 | 200,099 | 2017/3/20 |
| ポヨラ・バンク・ピーエルシー 第3回円貨社債(2014) | | 0.303 | 200,000 | 200,149 | 2017/6/16 |
| 小 計 | | | 4,145,000 | 4,148,946 | |
| 合 計 | | | 10,824,000 | 10,831,046 | |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

| 区 分 | 当 期 末 | |
|-------------|-----------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 1,099,991 | % 5.6 |

*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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。

Nomura Multi Managers Fund — Global High Yield Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

2016年6月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 形態 | ケイマン諸島籍円建て外国投資信託 | | | | | | | | | | | | | | |
|----------|--|--------|--------|----|--------|------|--------|--------|--------|------|----------------------------|----------|--|----------|---|
| 投資目的 | <ul style="list-style-type: none"> ◆世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。 ◆投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、ハイ・イールド債券の運用を行う運用会社を原則として複数選定します。 ◆「ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド」には、為替取引手法の異なる3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があります。 | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資態度 | <ul style="list-style-type: none"> ●ハイ・イールド債券を、発行体の登録国や所在地、発行通貨等から、「米国」、「欧州」、「新興国その他」の各地域に属する債券に分類します。 ●各地域の債券への投資比率は、原則として、下表の通りとします。 <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>地域名</th> <th>米国</th> <th>欧州</th> <th>新興国その他</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>投資比率</td> <td>25-50%</td> <td>25-50%</td> <td>25-50%</td> </tr> </tbody> </table> <p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●米ドル建て以外の外貨建資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買い替取引を行います。 ●株式への投資は優先証券のうち株券または新株引受権証書の性質を有するものまたは転換社債を転換および新株予約権を行使したものならびに社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合はファンドの純資産総額の30%以内とします。 ●格付をもたない債券(国債・地方債等は除く)への投資割合は、取得時において、原則としてファンドの純資産総額の10%以内とします。 ●CCC+格(S&P社)以下またはCaa 1格(Moody's社)以下の格付の債券(ディストレス債およびデフォルト債を含みます。)への投資割合は、取得時において、原則としてファンドの純資産総額の30%以内とします。 ●外貨建資産については、クラスごとに以下のとおり為替取引を行います。 <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tbody> <tr> <td>円クラス</td> <td>外貨建資産を原則として対円建て為替ヘッジを行います。</td> </tr> <tr> <td>資源国通貨クラス</td> <td>外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。</td> </tr> <tr> <td>アジア通貨クラス</td> <td>外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。</td> </tr> </tbody> </table> <ul style="list-style-type: none"> ●投資顧問会社が、ハイ・イールド債券の運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、ハイ・イールド債券の運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行います。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 | 地域名 | 米国 | 欧州 | 新興国その他 | 投資比率 | 25-50% | 25-50% | 25-50% | 円クラス | 外貨建資産を原則として対円建て為替ヘッジを行います。 | 資源国通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。 | アジア通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。 |
| 地域名 | 米国 | 欧州 | 新興国その他 | | | | | | | | | | | | |
| 投資比率 | 25-50% | 25-50% | 25-50% | | | | | | | | | | | | |
| 円クラス | 外貨建資産を原則として対円建て為替ヘッジを行います。 | | | | | | | | | | | | | | |
| 資源国通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。 | | | | | | | | | | | | | | |
| アジア通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。 | | | | | | | | | | | | | | |
| 受託会社 | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資顧問会社 | 野村アセットマネジメント株式会社 | | | | | | | | | | | | | | |
| 管理事務代行会社 | ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー | | | | | | | | | | | | | | |
| 保管銀行 | ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー | | | | | | | | | | | | | | |

※作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

※掲載している組入資産の明細および計算書等は、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドの年次報告書から抜粋・邦訳したものです。

「投資顧問会社」は、米国1940年投資顧問法規則第206条(4)項2号(「カストディ・ルール」)に基づき、保管銀行から受益者または受益者のために投資顧問会社が任命した「独立した代理人」に対し、米国法で定められている四半期口座明細書およびその他の必要な通知を送付させることが求められています。

投資顧問会社はArthur F. Bell, Jr. & Associates, L.L.C. (「アーサー・ベル社」)を、「独立した代理人」に任命しました。

投資家が同意する場合または独立の第三者が投資家にとって最善の利益になると判断する場合を除き、アーサー・ベル社の「独立した代理人」としての地位は失われず、また、報酬を含めアーサー・ベル社に不利益な契約変更は行われません。」

純資産計算書
2016年6月30日現在
(金額は米ドル表示)

| | | |
|---------------------------|--|---------------|
| 資産 | | |
| 投資有価証券時価 | | 1,113,836,684 |
| (取得原価: 1,188,277,191米ドル) | | |
| 現金預金等 | | 137,127,257 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差益 | | 20,840,320 |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差益 | | 1,106,921 |
| デリバティブに係る委託証拠金 | | 1,618,048 |
| 受益証券発行未収金 | | 55,365 |
| ブローカーからの受取金 | | 8,038,648 |
| 未収収益 | | 19,757,928 |
| 現金及び現金等価物に係る金利 | | 640 |
| | | |
| 資産合計 | | 1,302,381,811 |
| 負債 | | |
| 銀行借越金 | | 832,140 |
| 先物契約に係る評価差損 | | 770,524 |
| 受益証券買戻支払金 | | 5,380,434 |
| ブローカーへの未払金 | | 22,322,315 |
| 未払費用 | | 2,996,660 |
| | | |
| 負債合計 | | 32,302,073 |
| 純資産総額 | | 1,270,079,738 |

受益証券一口当たり情報:

| | 期末1口当たり純資産価格 | 発行済受益証券数 | 純資産総額 |
|-------------|--------------|------------|----------------|
| アジア通貨クラス(円) | 4,243 | 3,651,129 | 15,490,451,241 |
| 資源国通貨クラス(円) | 2,534 | 38,887,606 | 98,536,423,706 |
| 日本円クラス(円) | 6,410 | 2,560,249 | 16,410,367,505 |

運用計算書
2016年6月30日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

| | |
|------------------------------|---------------|
| 収益 | |
| 銀行口座利息 | 151,559 |
| 債券利息 | 83,738,500 |
| 金利スワップ契約に係る受取利息 | 12,576 |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る利息 | 1,280,737 |
| 受取配当金等 | 477,903 |
| 雑収益 | 1,128 |
| | <hr/> |
| 収益合計 | 85,662,403 |
| | <hr/> |
| 費用 | |
| 投資顧問及び共同投資顧問報酬 | 10,404,991 |
| 事務管理代行報酬 | 1,156,189 |
| 保管費用 | 389,998 |
| 源泉徴収税 | 17,842 |
| 金利スワップ契約に係る支払利息 | 6,315 |
| 当座借越利息 | 20,270 |
| 取引銀行報酬 | 120,424 |
| 銀行手数料 | 138,180 |
| 受託報酬 | 272,300 |
| 法務報酬 | 4,003 |
| 海外登記手数料 | 344 |
| 立替費用 | 135,993 |
| 専門家報酬 | 98,403 |
| 印刷、出版手数料 | 5,578 |
| その他税 | 10,134 |
| 雑費用 | 3,156 |
| | <hr/> |
| 費用合計 | 12,784,120 |
| | <hr/> |
| 純投資損益 | 72,878,283 |
| | <hr/> |
| 投資有価証券売買に係る損益 | (92,324,589) |
| 先物契約に係る損益 | (2,035,832) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | (38,748,801) |
| 金利スワップ契約に係る損益 | 27,520 |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益 | 1,396,166 |
| | <hr/> |
| 当期実現純損益 | (131,685,536) |
| | <hr/> |
| 投資有価証券評価損益の増減 | 30,369,997 |
| 先物契約に係る評価損益の増減 | (713,875) |
| 金利スワップ契約に係る評価損益の増減 | (23,790) |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価損益の増減 | (2,282,506) |
| 外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減 | 23,684,606 |
| | <hr/> |
| 当期評価差損益 | 51,034,432 |
| | <hr/> |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (7,772,821) |
| | <hr/> |

純資産変動計算書
2016年6月30日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

| | |
|-----------------|---------------|
| 期首純資産総額 | 1,813,825,168 |
| 純投資損益 | 72,878,283 |
| 当期実現純損益 | (131,685,536) |
| 当期評価差損益 | 51,034,432 |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (7,772,821) |
| 受益証券の発行手取金 | 86,098,071 |
| 受益証券の買戻支払金 | (278,833,463) |
| | (192,735,392) |
| 受益者への支払分配金 | (343,237,217) |
| 期末純資産総額 | 1,270,079,738 |

発行済受益証券数の変動表
2016年6月30日に終了する計測期間
(未監査)

| | | |
|----------|--|-------------|
| アジア通貨クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 4,170,357 |
| 発行受益証券数 | | 188,563 |
| 買戻受益証券数 | | (707,791) |
| | | 3,651,129 |
| | | 3,651,129 |
| 資源国通貨クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 44,068,056 |
| 発行受益証券数 | | 2,980,754 |
| 買戻受益証券数 | | (8,161,204) |
| | | 38,887,606 |
| | | 38,887,606 |
| 日本円クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 3,195,471 |
| 発行受益証券数 | | 112,681 |
| 買戻受益証券数 | | (747,903) |
| | | 2,560,249 |
| | | 2,560,249 |

統計情報
2016年6月30日現在
(未監査)

| | 2016 | 2015 | 2014 |
|--------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 期末純資産総額(米ドル) | 1,270,079,738 | 1,813,825,168 | 3,314,872,828 |
| アジア通貨クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 15,490,451,241 | 23,885,398,525 | 28,226,704,671 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 4,243 | 5,727 | 5,668 |
| 資源国通貨クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 98,536,423,706 | 175,273,674,196 | 270,734,606,977 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 2,534 | 3,977 | 4,851 |
| 日本円クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 16,410,367,505 | 22,581,095,774 | 37,133,733,843 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 6,410 | 7,067 | 7,827 |

組入資産明細
2016年6月30日現在
(金額は米ドル表示)

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| アンゴラ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 230,000 | REP OF ANGOLA 9.5% 12/11/25 REGS | 230,000 | 227,746 | 0.02 |
| | | | <u>230,000</u> | <u>227,746</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：アンゴラ | <u>230,000</u> | <u>227,746</u> | <u>0.02</u> |
| アルゼンチン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,459,000 | REP OF ARGENTINA 7.5% 22/04/26 REGS | 3,596,911 | 3,740,908 | 0.29 |
| USD | 2,125,000 | REP OF ARGENTINA FRN 31/12/33 dis | 3,469,562 | 3,305,567 | 0.26 |
| USD | 1,745,000 | REP OF ARGENTINA 6.875% 22/04/21 RE | 1,745,000 | 1,849,700 | 0.15 |
| USD | 452,000 | REP OF ARGENTINA 7.625% 22/04/46 RE | 432,826 | 488,160 | 0.04 |
| USD | 225,000 | REP OF ARGENTINA 7% 17/04/17 X | 201,193 | 234,000 | 0.02 |
| USD | 80,000 | REP OF ARGENTINA FRN 31/12/33 | 123,660 | 122,370 | 0.01 |
| | | | <u>9,569,152</u> | <u>9,740,705</u> | <u>0.77</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 320,000 | REP OF ARGENTINA 2.5% 31/12/38 par | 207,437 | 214,401 | 0.01 |
| EUR | 295,000 | REP ARGENTINA STUP 2.26% 31/12/38 | 196,475 | 201,016 | 0.02 |
| USD | 150,000 | PROV BUENO AIR 9.125% 16/3/24 REGS | 148,112 | 163,875 | 0.01 |
| USD | 150,000 | PROVINCE OF SALTA 9.125% 7/7/24 REG | 150,000 | 151,125 | 0.01 |
| USD | 95,000 | YPF SOCIEDAD 8.75% 04/04/24 REGS | 94,173 | 102,195 | 0.01 |
| USD | 136,000 | AEROPUERTOS ARG 10.75% 1/12/20 REGS | 88,679 | 93,391 | 0.01 |
| | | | <u>884,876</u> | <u>926,003</u> | <u>0.07</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,430,000 | YPF SOCIEDAD 8.5% 23/03/21 REGS | 1,508,360 | 1,529,670 | 0.13 |
| USD | 640,000 | YPF SOCIEDAD 8.5% 28/07/25 REGS | 619,116 | 679,200 | 0.06 |
| USD | 300,000 | CABLEVISION SA 6.5% 15/06/21 REGS | 300,000 | 306,000 | 0.02 |
| USD | 50,000 | BANCO HIPOTECA 9.75% 30/11/20 REGs | 53,263 | 54,608 | 0.00 |
| USD | 50,000 | BANCO HIPOTECA 9.75% 30/11/20 REGS | 50,000 | 54,238 | 0.00 |
| USD | 25,000 | IRSA PROPIEADADES 8.75% 23/3/23 REGS | 24,681 | 26,313 | 0.00 |
| | | | <u>2,555,420</u> | <u>2,650,029</u> | <u>0.21</u> |
| | | 合計：アルゼンチン | <u>13,009,448</u> | <u>13,316,737</u> | <u>1.05</u> |
| オーストラリア | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 275,000 | TRANSFIELD SVC 8.375% 15/05/20 144A | 275,000 | 293,563 | 0.02 |
| USD | 2,175,000 | MIDWEST VANADIUM 11.5% 15/02/18 144 | 2,215,939 | 152,250 | 0.01 |
| USD | 83,000 | NUFARM AUST LTD 6.375% 15/10/19 144 | 83,000 | 83,830 | 0.01 |
| USD | 20,775 | MIRABELA NICKEL 0% 15/04/18 | 0 | 0 | 0.00 |
| | | | <u>2,573,939</u> | <u>529,643</u> | <u>0.04</u> |
| | | 合計：オーストラリア | <u>2,573,939</u> | <u>529,643</u> | <u>0.04</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| オーストリア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | OMV AG FRN 29/12/49 | 1,058,989 | 1,167,700 | 0.09 |
| | | | 1,058,989 | 1,167,700 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 990,000 | SAPPI PAP HLD 3.375% 01/04/22 REGS | 1,053,537 | 1,107,198 | 0.09 |
| USD | 600,000 | JBS INVEST 7.25% 03/04/24 REGS | 629,700 | 617,700 | 0.05 |
| USD | 500,000 | JBS INVEST 7.75% 28/10/20 REGS | 547,500 | 520,750 | 0.04 |
| USD | 400,000 | JBS INVEST 7.75% 28/10/20 144A | 400,000 | 422,000 | 0.03 |
| USD | 400,000 | JBS INVEST 7.25% 03/04/24 144A | 400,000 | 411,880 | 0.03 |
| | | | 3,030,737 | 3,079,528 | 0.24 |
| | | 合計：オーストリア | 4,089,726 | 4,247,228 | 0.33 |
| アゼルバイジャン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF AZERBAIJAN 4.75% 18/03/24 RE | 193,500 | 202,800 | 0.02 |
| | | | 193,500 | 202,800 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 760,000 | STATE OIL CO 6.95% 18/03/30 | 748,250 | 794,200 | 0.06 |
| USD | 250,000 | INTL BK AZERBAIJAN 5.625% 11/06/19 | 250,000 | 245,790 | 0.02 |
| USD | 250,000 | STATE OIL CO 4.75% 13/03/23 EMTN | 242,200 | 239,191 | 0.02 |
| | | | 1,240,450 | 1,279,181 | 0.10 |
| | | 合計：アゼルバイジャン | 1,433,950 | 1,481,981 | 0.12 |
| パハマ | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 360,000 | INTERCORP PERU 5.875% 12/02/25 REGS | 357,988 | 360,317 | 0.03 |
| | | | 357,988 | 360,317 | 0.03 |
| | | 合計：パハマ | 357,988 | 360,317 | 0.03 |
| バングラデシュ | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 370,000 | BANGLALINK DIG 8.625% 6/05/19 REGS | 380,398 | 393,998 | 0.03 |
| | | | 380,398 | 393,998 | 0.03 |
| | | 合計：バングラデシュ | 380,398 | 393,998 | 0.03 |
| バルバドス | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,030,000 | COLUMBUS INTL 7.375% 30/03/21 REGS | 1,099,761 | 1,086,650 | 0.09 |
| | | | 1,099,761 | 1,086,650 | 0.09 |
| | | 合計：バルバドス | 1,099,761 | 1,086,650 | 0.09 |
| ベラルーシ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 567,000 | REP OF BELARUS 8.95% 26/01/18 REGS | 542,341 | 587,979 | 0.05 |
| | | | 542,341 | 587,979 | 0.05 |
| | | 合計：ベラルーシ | 542,341 | 587,979 | 0.05 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| ベルギー | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,150,000 | KBC GROEP FRN 29/03/49 | 1,593,440 | 1,206,485 | 0.10 |
| | | | 1,593,440 | 1,206,485 | 0.10 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 480,000 | ONTEX GROUP NV 4.75% 15/11/21 REGS | 602,832 | 567,914 | 0.04 |
| | | | 602,832 | 567,914 | 0.04 |
| | | 合計：ベルギー | 2,196,272 | 1,774,399 | 0.14 |
| バミューダ諸島 | | | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| — | 4,292 | TRAVELPORT WORLDWIDE LTD | 100,501 | 54,208 | 0.00 |
| | | | 100,501 | 54,208 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,925,000 | DIGICEL GROUP 8.25% 30/09/20 REGS | 2,757,051 | 2,456,999 | 0.20 |
| USD | 1,300,000 | CHINA RES GAS GP 4.5% 05/04/22 | 1,393,453 | 1,418,898 | 0.11 |
| USD | 1,600,000 | DIGICEL LTD 6.75% 01/03/23 144A | 1,603,000 | 1,360,000 | 0.11 |
| USD | 1,425,000 | DIGICEL LTD 6% 15/04/21 144A | 1,425,000 | 1,221,510 | 0.10 |
| USD | 1,000,000 | BANCO BRADESCO 5.9% 16/01/21 REGS | 1,030,982 | 1,035,000 | 0.08 |
| USD | 1,385,000 | DIGICEL GP LTD 7.125% 01/04/22 144A | 1,385,000 | 1,017,975 | 0.08 |
| USD | 925,000 | AIRCATTLE LTD 6.25% 01/12/19 | 925,000 | 1,001,313 | 0.08 |
| USD | 1,225,000 | DIGICEL GP LTD 7.125% 01/04/22 REGS | 1,181,385 | 900,375 | 0.07 |
| USD | 800,000 | DIGICEL LTD 7% 15/02/20 144A | 800,000 | 740,000 | 0.06 |
| USD | 650,000 | DIGICEL LTD 6% 15/04/21 REGS | 628,796 | 557,180 | 0.04 |
| USD | 500,000 | CHINA OIL & GAS 5.25% 25/04/18 REGS | 515,000 | 503,750 | 0.04 |
| USD | 350,000 | NCL CORP 5.25% 15/11/19 144A | 350,000 | 353,500 | 0.03 |
| USD | 325,000 | AIRCATTLE LTD 5.125% 15/03/21 | 325,000 | 338,000 | 0.03 |
| USD | 205,000 | GCX LTD 7% 01/08/19 REGS | 211,307 | 200,486 | 0.02 |
| USD | 187,000 | AIRCATTLE LTD 5% 01/04/23 | 187,000 | 190,029 | 0.01 |
| USD | 250,000 | VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14 | 250,375 | 188,750 | 0.01 |
| USD | 120,000 | AIRCATTLE LTD 5.5% 15/02/22 | 124,038 | 124,800 | 0.01 |
| USD | 23,000 | WEATHERFORD INTL 4.5% 15/04/22 | 19,175 | 19,608 | 0.00 |
| USD | 14,000 | WEATHERFORD BERMUDA 7.75% 15/06/21 | 14,000 | 13,611 | 0.00 |
| USD | 13,000 | WEATHERFORD BERMUDA 8.25% 15/06/23 | 13,000 | 12,297 | 0.00 |
| | | | 15,138,562 | 13,654,081 | 1.08 |
| | | 合計：バミューダ諸島 | 15,239,063 | 13,708,289 | 1.08 |
| ボリビア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 250,000 | BOLIVIA GVT 5.95% 22/08/23 REGS | 266,975 | 290,250 | 0.02 |
| | | | 266,975 | 290,250 | 0.02 |
| | | 合計：ボリビア | 266,975 | 290,250 | 0.02 |
| ブラジル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,605,000 | FED REP OF BRAZIL 6% 07/04/26 | 3,634,359 | 3,893,400 | 0.30 |
| USD | 1,578,000 | FED REP OF BRAZIL 4.25% 07/01/25 * | 1,536,495 | 1,549,643 | 0.12 |
| USD | 1,700,000 | REP OF BRAZIL 5% 27/01/45 | 1,429,801 | 1,513,000 | 0.12 |
| USD | 1,217,000 | FED REP OF BRAZIL 4.875% 22/01/21 | 1,270,340 | 1,277,850 | 0.10 |
| BRL | 1,132 | NOTA TESOUREO NAEL 6% 15/08/16 NTNE | 888,943 | 1,030,512 | 0.08 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| USD | 399,000 | FED REP OF BRAZIL 2.625% 05/01/23 | 369,528 | 362,691 | 0.03 |
| USD | 295,000 | FED REP OF BRAZIL 8.25% 20/01/34 | 377,983 | 357,688 | 0.03 |
| BRL | 368 | NOTA TESOUREO NACL 6% 15/08/22 NTNB | 252,060 | 330,668 | 0.03 |
| USD | 250,000 | REP OF BRAZIL 7.125% 20/01/37 | 257,980 | 280,000 | 0.02 |
| USD | 100,000 | FED REP OF BRAZIL 5.625% 07/01/41 | 87,670 | 96,250 | 0.01 |
| USD | 10,000 | FED REP OF BRAZIL 8.875% 15/04/24 | 12,250 | 12,600 | 0.00 |
| | | | 10,117,409 | 10,704,302 | 0.84 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 200,000 | GLOBO COMM PART STUP 08/06/25 REGS | 185,000 | 193,000 | 0.02 |
| | | | 185,000 | 193,000 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BRASKEM SA 7% 07/05/20 REGS | 1,036,436 | 1,064,999 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | BANCO NAC DE DES 5.75% 26/9/23 144A | 1,060,000 | 1,024,500 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | ITAU UNIBANCO HDG 5.5% 6/08/22 REGS | 1,000,000 | 1,012,500 | 0.08 |
| USD | 900,000 | CAIXA ECONOMICA 3.5% 07/11/22 REGS | 780,750 | 805,500 | 0.06 |
| USD | 600,000 | BANCO NAC DE 5.5% 12/07/20 REGS | 614,040 | 612,000 | 0.05 |
| USD | 365,000 | BANCO DO BRAZIL 6% 22/01/20 REGS | 375,014 | 385,258 | 0.03 |
| USD | 1,000,000 | SAMARCO MINERA 5.75% 24/10/23 REGS | 617,625 | 385,000 | 0.03 |
| USD | 266,000 | BANCO NAC DE 6.5% 10/06/19 REGS | 295,402 | 280,630 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BANCO NAC DE 5.75% 26/09/23 REGS | 209,500 | 202,298 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BRF SA 4.75% 22/05/24 REGS | 194,500 | 200,104 | 0.02 |
| USD | 200,000 | VOTORANTIM CIMENTOS 7.25% 5/4/41 RE | 207,100 | 183,500 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | BNDES 3.625% 21/01/19 REGS | 109,645 | 110,054 | 0.01 |
| | | | 6,500,012 | 6,266,343 | 0.49 |
| | | 合計：ブラジル | 16,802,421 | 17,163,645 | 1.35 |
| 英領ヴァージン諸島 | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 245,000 | STAR ENERGY GEO 6.125% 27/3/20 REGS | 246,772 | 246,838 | 0.02 |
| | | | 246,772 | 246,838 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,600,000 | SINOPEC 2013 4.375% 17/10/23 144A | 1,710,240 | 1,727,174 | 0.13 |
| USD | 1,200,000 | SINOPEC GRP OVERS 3.9% 17/05/22 144 | 1,228,800 | 1,269,800 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | STATE GRID 4.125% 07/05/24 REGS | 1,069,170 | 1,107,260 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | SINOCHEM OVS 4.5% 12/11/20 | 1,066,840 | 1,063,913 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | CNOOC 3% 09/05/23 | 965,500 | 993,317 | 0.08 |
| USD | 800,000 | CNOOC FINANCE 2011 4.25% 26/1/21 RE | 838,400 | 845,268 | 0.07 |
| USD | 800,000 | CHARMING LIGHT 3.75% 3/09/19 EMTN | 809,299 | 829,288 | 0.07 |
| USD | 700,000 | CNPC GENERAL CAP 3.4% 16/04/23 REGS | 699,069 | 718,165 | 0.06 |
| USD | 620,000 | FRANSHION DEV 6.75% 15/04/21 REGS | 690,101 | 709,185 | 0.06 |
| USD | 500,000 | HUARONG FINANCE 5.5% 16/01/25 EMTN | 523,807 | 549,140 | 0.04 |
| USD | 500,000 | CHINA CINDA FIN 4% 14/05/19 REGS | 511,675 | 522,940 | 0.04 |
| USD | 500,000 | CHINA CINDA FIN 4.25% 23/04/25 REG | 478,180 | 506,356 | 0.04 |
| USD | 500,000 | GTL TRADE FIN 5.893% 29/04/24 144A | 474,814 | 441,150 | 0.03 |
| USD | 450,000 | FAVOR SEA LTD 11.75% 04/02/19 REGS | 388,375 | 339,750 | 0.03 |
| USD | 200,000 | SINOCHEM OVS 6.3% 12/11/40 | 256,729 | 264,353 | 0.02 |
| USD | 220,000 | FPC TREASURY 4.5% 16/04/23 REGS | 209,273 | 222,226 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PCCW-HKT CAP N05 3.75% 08/03/23 REG | 201,018 | 213,005 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SINOPEC GRP OVER 3.5% 03/05/26 REGS | 198,332 | 204,535 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SINOPEC GP OVS 4.1% 28/04/45 REGS | 195,480 | 200,606 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SINOPEC GRP OVERS 4.875% 17/5/42 RE | 109,080 | 112,256 | 0.01 |
| | | | 12,624,182 | 12,839,687 | 1.01 |
| | | 合計：英領ヴァージン諸島 | 12,870,954 | 13,086,525 | 1.03 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| ブルガリア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 305,000 | REP OF BULGARIA 3.125% 26/03/35 MTN | 306,887 | 318,963 | 0.02 |
| EUR | 210,000 | REP OF BULGARIA 3% 21/03/28 12YR | 235,672 | 236,782 | 0.02 |
| | | | 542,559 | 555,745 | 0.04 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | BULGARIAN TELECOM 6.625% 15/11/18 R | 1,387,087 | 1,128,274 | 0.09 |
| | | | 1,387,087 | 1,128,274 | 0.09 |
| | | 合計：ブルガリア | 1,929,646 | 1,684,019 | 0.13 |
| カメルーン | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF CAMEROON 9.5% 19/11/25 REGS | 197,000 | 202,272 | 0.02 |
| | | | 197,000 | 202,272 | 0.02 |
| | | 合計：カメルーン | 197,000 | 202,272 | 0.02 |
| カナダ | | | | | |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 1,850,591 | CATALYST PAPER CRP PIK 13% 30/10/17 | 2,443,446 | 1,369,437 | 0.11 |
| USD | 206,118 | CATALYST PAPER PIK 13% 30/10/17 144 | 164,894 | 155,619 | 0.01 |
| USD | 439,762 | ALBERTA /ALGOMA PIK 14% 13/02/20 | 365,544 | 44 | 0.00 |
| | | | 2,973,884 | 1,525,100 | 0.12 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,175,000 | MPL 2 ACQUISITION 9.875% 15/8/18 14 * | 2,183,413 | 2,245,687 | 0.19 |
| USD | 1,815,000 | VRX ESCROW 5.875% 15/05/23 144A | 1,681,291 | 1,465,612 | 0.12 |
| USD | 2,025,000 | THOMPSON CREEK MET 7.375% 01/06/18 | 2,027,008 | 1,422,562 | 0.11 |
| EUR | 1,600,000 | VRX ESCROW 4.5% 15/05/23 REGS | 1,604,653 | 1,342,812 | 0.11 |
| USD | 1,438,000 | VRX ESCROW 6.125% 15/4/25 144A | 1,297,067 | 1,161,184 | 0.09 |
| USD | 1,280,000 | VRX ESCROW 5.375% 15/3/20 144A | 1,281,625 | 1,091,199 | 0.09 |
| USD | 1,315,000 | GARDA WORLD SEC 7.25% 15/11/21 144A | 1,327,122 | 1,061,862 | 0.08 |
| USD | 2,175,000 | MILLAR WESTERN 8.5% 01/04/21 | 2,175,000 | 1,000,500 | 0.08 |
| USD | 1,065,000 | TRINIDAD DRIL 7.875% 15/01/19 144A | 1,056,970 | 947,550 | 0.07 |
| EUR | 720,000 | COTT FINANCE 5.5% 01/07/24 REGS | 811,224 | 816,359 | 0.06 |
| USD | 825,000 | MATTAMY GROUP 6.5% 15/11/20 144A | 822,976 | 792,000 | 0.06 |
| USD | 650,000 | 1011778 BC/NEWRED 4.625% 15/01/22 1 | 650,210 | 656,500 | 0.05 |
| USD | 605,000 | CONCORDIA HEALTH 9.5% 21/10/22 144A | 592,400 | 561,138 | 0.04 |
| USD | 525,000 | KISSNER MILLING CO 7.25% 01/06/19 1 | 530,063 | 525,000 | 0.04 |
| USD | 550,000 | CONCORDIA HLTH COR 7% 15/04/23 144A | 550,000 | 466,125 | 0.04 |
| USD | 491,000 | VPI ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A | 458,063 | 433,308 | 0.03 |
| USD | 465,000 | BROOKFIELD RESID 6.125% 15/5/25 144 | 465,000 | 424,313 | 0.03 |
| USD | 425,000 | CASCADES INC 5.75% 15/07/23 144A | 425,000 | 409,063 | 0.03 |
| USD | 375,000 | OPEN TEXT CORP 5.875% 01/06/26 144A | 375,000 | 375,938 | 0.03 |
| USD | 377,000 | BOMBARDIER INC 6.125% 15/01/23 144A | 335,053 | 321,393 | 0.03 |
| USD | 400,000 | PARAMOUNT RES 6.875% 30/06/23 144A | 398,132 | 314,000 | 0.02 |
| USD | 300,000 | AIR CANADA 7.75% 15/04/21 144A | 308,250 | 311,250 | 0.02 |
| USD | 405,000 | MEG ENERGY CORP 6.375% 30/1/23 144A | 392,500 | 299,700 | 0.02 |
| USD | 268,000 | NOVELIS INC 8.75% 15/12/20 | 260,912 | 279,390 | 0.02 |
| USD | 268,000 | RELiance INT. 6.5% 01/04/23 144A | 268,000 | 278,720 | 0.02 |
| USD | 335,000 | MEG ENERGY CORP 7% 31/03/24 144A | 320,631 | 251,250 | 0.02 |
| USD | 236,000 | CENOVUS ENERGY 5.7% 15/10/19 | 232,076 | 250,870 | 0.02 |
| USD | 350,000 | TECK RESOURCES LTD 6.125% 01/10/35 | 217,946 | 248,938 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| USD | 245,000 | QUEBECOR MEDIA 5.75% 15/01/23 | 251,738 | 248,675 | 0.02 |
| USD | 250,000 | MDC PARTNERS INC 6.5% 01/05/24 144A | 250,000 | 248,125 | 0.02 |
| USD | 267,000 | CONCORDIA HEALTH 7% 15/04/23 REGS | 240,788 | 226,283 | 0.02 |
| USD | 225,000 | GIBSON ENERGY INC 6.75% 15/07/21 14 | 243,000 | 223,875 | 0.02 |
| USD | 250,000 | IAMGOLD CORP 6.75% 01/10/20 144A | 250,000 | 223,125 | 0.02 |
| USD | 270,000 | PRECISION DRILLING 5.25% 15/11/24 | 270,000 | 216,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BKW 6% 01/04/22 144A | 200,111 | 206,938 | 0.02 |
| USD | 200,000 | AURICO GOLD 7.75% 01/04/20 144A | 193,048 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | FIRST QUANTUM MIN 7.25% 15/10/19 14 | 160,500 | 171,000 | 0.01 |
| EUR | 200,000 | VALEANT PHARMA 4.5% 15/05/23 144a | 180,294 | 167,852 | 0.01 |
| USD | 200,000 | TEMBEC INDS 9% 15/12/19 144A | 202,211 | 155,000 | 0.01 |
| USD | 150,000 | TECK RESOURCES LTD 4.75% 15/01/22 | 107,000 | 126,000 | 0.01 |
| USD | 171,000 | ULTRA PETROLEUM 6.125% 1/10/24 144A | 171,000 | 117,135 | 0.01 |
| USD | 115,000 | VPI ESCROW CORP 6.75% 15/8/18 144a | 110,082 | 110,975 | 0.01 |
| USD | 100,000 | NORBORD INC 6.25% 15/04/23 144A | 100,000 | 102,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | LUNDIN MINING 7.5% 1/11/20 144A | 91,230 | 102,000 | 0.01 |
| USD | 95,000 | AUTOMATION TOOLING 6.5% 15/6/23 144 | 95,375 | 96,663 | 0.01 |
| USD | 95,000 | CASCADES INC 5.5% 15/07/22 144A | 95,000 | 92,150 | 0.01 |
| USD | 86,000 | VIDEOTRON 5.375% 15/6/24 144A | 86,366 | 87,290 | 0.01 |
| USD | 80,000 | MASONITE INTL C 5.625% 15/3/23 144A | 80,000 | 83,000 | 0.01 |
| USD | 95,000 | BOMBARDIER INC 7.5% 15/03/25 144A | 78,988 | 82,650 | 0.01 |
| USD | 80,000 | VIDEOTRON LTEE 5% 15/07/22 | 80,520 | 81,600 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GFL ENVIRONMENTAL 9.875% 01/2/21 14 | 77,438 | 80,625 | 0.01 |
| USD | 75,000 | TECK RESOURCES 8.5% 01/06/24 144A | 76,631 | 77,484 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NOVELIS INC 8.375% 15/12/17 | 73,500 | 76,688 | 0.01 |
| USD | 1,150,000 | PETROBAKKEN ENER 8.625% 1/02/20 144 | 1,144,250 | 76,245 | 0.01 |
| USD | 75,000 | PRECISION DRILL 6.5% 15/12/21 | 62,906 | 66,750 | 0.01 |
| USD | 64,000 | AUTOMATION TOOLING 6.5% 15/6/23 REG | 64,000 | 65,120 | 0.01 |
| USD | 70,000 | TECK RESOURCES LTD 4.5% 15/01/21 | 60,123 | 60,900 | 0.00 |
| USD | 60,000 | NOVA CHEMICALS CORP 5% 01/05/25 144 | 60,000 | 59,400 | 0.00 |
| USD | 53,000 | CENOVUS ENERGY 6.75% 15/11/39 | 47,942 | 55,834 | 0.00 |
| USD | 56,000 | BOMBARDIER INC 5.5% 15/09/18 144A | 56,000 | 55,300 | 0.00 |
| USD | 54,000 | NEW GOLD INC 6.25% 15/11/22 144A | 47,885 | 52,650 | 0.00 |
| USD | 75,000 | TECK RESOURCES LTD 6% 15/08/40 | 52,125 | 52,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | TECK RESOURCES 8% 01/06/21 144A | 50,000 | 51,500 | 0.00 |
| USD | 35,000 | 1011778 BC/NEWRED 4.625% 15/1/22 R | 35,000 | 35,350 | 0.00 |
| USD | 50,000 | TASEKO MINES LTD 7.75% 15/04/19 | 50,811 | 31,500 | 0.00 |
| USD | 30,000 | OPEN TEXT 5.875% 01/06/26 REGS | 30,000 | 30,075 | 0.00 |
| USD | 28,000 | ULTRA PETROLEUM 5.75% 15/12/18 144A | 28,000 | 18,830 | 0.00 |
| USD | 21,000 | MEG ENERGY CORP 6.5% 15/03/21 144A | 20,580 | 16,275 | 0.00 |
| USD | 10,000 | TECK RESOURCES 8.5% 01/06/24 REGS | 10,000 | 10,331 | 0.00 |
| USD | 10,000 | TECK RESOURCES 8% 01/06/21 REGS | 10,000 | 10,300 | 0.00 |
| USD | 10,000 | ENCANA CORP 6.5% 01/02/38 | 7,400 | 9,933 | 0.00 |
| USD | 8,000 | CENOVUS ENERGY 4.45% 15/09/42 | 5,911 | 6,194 | 0.00 |
| USD | 500,000 | SANJEL CORP 7.5% 19/06/19 | 453,500 | 5,000 | 0.00 |
| USD | 4,000 | ENCANA CORP 3.9% 15/11/21 | 3,310 | 3,879 | 0.00 |
| | | | <u>29,112,148</u> | <u>24,128,022</u> | <u>1.90</u> |
| | | 合計：カナダ | <u>32,086,032</u> | <u>25,653,122</u> | <u>2.02</u> |
| | | ケイマン諸島 | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| GBP | 415,000 | SMFG PREF CAP FRN 29/07/49 REGS | 978,916 | 843,596 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | BANCO BRASIL CAY FRN 29/12/49 REGS | 1,000,000 | 776,810 | 0.06 |
| USD | 600,000 | GEMS MEA SUKUK LTD FRN 31/12/49 | 632,786 | 688,164 | 0.05 |
| USD | 400,000 | MAF GLOBAL SECS FRN 29/10/49 | 424,880 | 415,700 | 0.03 |
| USD | 180,000 | BBVA BANCOMER FRN 17/05/22 | 185,713 | 179,550 | 0.01 |
| | | | <u>3,222,295</u> | <u>2,903,820</u> | <u>0.23</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------------------|----------------------------|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| その他債券 | | | | | |
| GBP | 600,000 | MIZZEN BONDCO 7% 01/05/21 REGS | 983,428 | 748,082 | 0.06 |
| USD | 295,000 | IVORY COAST 6.375% 03/03/28 REGS | 256,650 | 287,932 | 0.02 |
| USD | 250,000 | LIMA METRO LINE 2 5.875% 5/7/34 REG | 250,000 | 259,843 | 0.02 |
| | | | 1,490,078 | 1,295,857 | 0.10 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 775,000 | TRANSOCEAN INC STUP 3.8% 15/10/22 | 544,438 | 542,015 | 0.04 |
| USD | 398,000 | TRANSOCEAN INC STUP 6.375% 15/12/21 | 293,514 | 334,197 | 0.03 |
| | | | 837,952 | 876,212 | 0.07 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,950,000 | PETROBRAS INTL FIN 5.375% 27/01/21 | 2,488,277 | 2,702,052 | 0.20 |
| USD | 2,685,000 | VALE OVERSEAS LTD 5.875% 10/06/21 | 2,670,920 | 2,685,000 | 0.20 |
| EUR | 1,960,000 | VIRIDIAN GP 7.5% 01/03/20 REGS | 2,250,080 | 2,253,358 | 0.18 |
| USD | 2,105,000 | PETROBRAS INTL FIN 5.75% 20/01/20 | 1,754,040 | 2,026,063 | 0.16 |
| USD | 1,550,000 | VOTO VOTORANTIM 6.75% 5/4/21 | 1,543,449 | 1,604,250 | 0.13 |
| USD | 1,200,000 | CHINA OVERSEAS FIN 5.5% 10/11/20 RE * | 1,290,120 | 1,339,193 | 0.11 |
| USD | 1,300,000 | BAIDU INC 2.75% 09/06/19 * | 1,295,124 | 1,317,757 | 0.10 |
| EUR | 1,200,000 | UPCB FINANCE IV 4% 15/01/27 REGS | 1,294,560 | 1,288,900 | 0.10 |
| USD | 1,317,000 | VALE OVERSEAS 6.875% 21/11/36 | 1,073,724 | 1,198,470 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | IPIC GMTN LTD 5.5% 01/03/22 REGS * | 1,050,353 | 1,146,400 | 0.09 |
| USD | 1,100,000 | TENCENT HDGS LTD 3.375% 02/05/19 RE * | 1,120,131 | 1,140,359 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | HUTCH WHAMPOA 4.625% 13/01/22 REGS | 1,117,400 | 1,115,442 | 0.09 |
| USD | 1,360,000 | PETROBRAS INTL FIN 6.875% 20/01/40 | 1,288,423 | 1,085,266 | 0.09 |
| USD | 900,000 | SWIRE PACIFIC 4.5% 09/10/23 EMTN | 991,791 | 1,012,563 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | UPCB FINANCE IV 5.375% 15/1/25 144A | 1,004,500 | 990,000 | 0.08 |
| USD | 700,000 | HUTCH WHAMPOA 3.625% 31/10/24 REGS | 716,677 | 740,483 | 0.06 |
| USD | 800,000 | BANCO DO BRASIL 3.875% 10/10/22 | 635,744 | 728,000 | 0.06 |
| USD | 700,000 | ALIBABA GP HDGS 2.5% 28/11/19 | 694,673 | 708,183 | 0.06 |
| USD | 600,000 | GRUPOSURA FINANCE 5.7% 18/5/21 REGS | 596,124 | 642,600 | 0.05 |
| USD | 621,000 | CHINA HONGQIAO 6.875% 03/05/18 | 623,474 | 636,488 | 0.05 |
| USD | 600,000 | SABLE INTL FIN 6.875% 01/08/22 144A | 591,864 | 602,592 | 0.05 |
| USD | 600,000 | WYNN MACAU 5.25% 15/10/21 144A | 604,500 | 577,500 | 0.05 |
| USD | 500,000 | SHIMAO PPTY HLDG 8.125% 22/01/21 Re | 534,875 | 555,500 | 0.04 |
| USD | 500,000 | CHINA SCE PROP 10% 02/07/20 | 505,681 | 552,632 | 0.04 |
| USD | 500,000 | COUNTRY GARDEN 7.25% 04/04/21 REGS | 476,875 | 533,445 | 0.04 |
| USD | 480,000 | CENTRAL CHINA REAL ES 8.75% 23/1/21 | 468,955 | 501,167 | 0.04 |
| USD | 450,000 | MARFRIG OVERS 9.5% 04/05/20 REGS | 469,347 | 462,816 | 0.04 |
| USD | 400,000 | COUNTRY GARDEN 7.5% 10/01/23 REGS | 408,920 | 429,688 | 0.03 |
| USD | 400,000 | LONGFOR PROPERTIES 6.75% 29/01/23 | 406,333 | 429,266 | 0.03 |
| USD | 400,000 | CENTRAL CHINA REAL EST 6.5% 04/6/18 | 388,000 | 405,390 | 0.03 |
| USD | 350,000 | EZDAN SUKUK CO LTD 4.375% 18/05/21 | 339,395 | 347,375 | 0.03 |
| USD | 265,000 | ENN ENERGY HOLDING 6% 13/05/21 REGS | 308,186 | 300,554 | 0.02 |
| USD | 328,000 | VALE OVERSEAS 6.875% 10/11/39 | 272,796 | 296,840 | 0.02 |
| USD | 290,000 | VALE OVERSEAS LTD 4.625% 15/09/20 | 260,638 | 281,663 | 0.02 |
| USD | 275,000 | COMCEL TRUST 6.875% 06/02/24 REGS | 281,579 | 266,420 | 0.02 |
| USD | 500,000 | ODEBRECHT FIN LTD 7.5% 31/12/49 RE | 508,028 | 242,500 | 0.02 |
| USD | 210,000 | TRANSPRT DE GAS 5.7% 20/03/22 REGS | 224,175 | 218,925 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CIFI HLDGS GRP 7.75% 05/06/20 | 212,500 | 214,418 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MAF GLOBAL SECS 4.75% 07/05/24 REG | 199,670 | 211,136 | 0.02 |
| USD | 200,000 | LONGFOR PROPER 6.875% 18/10/19 EMTN | 211,500 | 209,492 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BAIDU INC 3.5% 28/11/22 | 197,860 | 204,545 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALIBABA GP HDGS 3.125% 28/11/21 | 202,412 | 204,531 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALPHA STAR HDG 4.97% 09/04/19 REGS | 185,900 | 188,574 | 0.01 |
| USD | 161,000 | VALE OVERSEAS 4.375% 11/01/22 | 115,012 | 150,535 | 0.01 |
| USD | 121,000 | VALE OVERSEAS 5.625% 15/09/19 | 112,529 | 124,025 | 0.01 |
| USD | 125,000 | BCP SINGAPORE VI 8% 15/04/21 144A | 125,000 | 107,188 | 0.01 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|
| USD | 225,000 | ODEBRECHT FINANCE 5.25% 27/06/29 RE | 223,313 | 89,550 | 0.01 |
| USD | 95,000 | PETROBRAS INTL FIN 6.75% 27/01/41 | 97,042 | 75,782 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NOBLE HDGS INTL 4.9% 01/08/20 | 41,375 | 42,125 | 0.00 |
| | | | 34,473,844 | 35,186,641 | 2.77 |
| 優先証券 | | | | | |
| — | 225 | XLIT GRP LTD PFD 3.52583% 29/10/49 | 191,851 | 178,383 | 0.01 |
| | | | 191,851 | 178,383 | 0.01 |
| | | 合計：ケイマン諸島 | 40,216,020 | 40,440,913 | 3.18 |
| 国債 | | | | | |
| チリ | | | | | |
| USD | 800,000 | REP OF CHILE 3.125% 21/01/26 | 796,200 | 833,000 | 0.07 |
| | | | 796,200 | 833,000 | 0.07 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,350,000 | EMPRESA ELECTRICA 4.875% 25/5/29 RE | 1,338,816 | 1,308,177 | 0.10 |
| | | | 1,338,816 | 1,308,177 | 0.10 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,580,000 | CODELCO INC 3% 17/07/22 REGS | 1,527,892 | 1,563,651 | 0.11 |
| USD | 1,120,000 | EMPRESA NACIONAL 5.25% 10/08/20 REG | 1,146,159 | 1,211,180 | 0.10 |
| USD | 1,100,000 | CODELCO INC 4.5% 16/09/25 REGS | 1,064,195 | 1,151,037 | 0.09 |
| USD | 700,000 | CENCOSUD SA 5.5% 20/01/21 REGS | 729,680 | 752,816 | 0.06 |
| USD | 600,000 | EMBOTELL ANDINA 5% 01/10/23 REGS | 648,600 | 657,527 | 0.05 |
| USD | 600,000 | E. CL SA 4.5% 29/01/25 REGS | 622,500 | 625,488 | 0.05 |
| USD | 600,000 | COLBUN SA 4.5% 10/07/24 REGS | 615,750 | 624,858 | 0.05 |
| USD | 310,000 | CODELCO INC 3.875% 03/11/21 REGS | 326,671 | 327,715 | 0.03 |
| USD | 200,000 | CODELCO INC 4.875% 04/11/44 REGS | 187,960 | 201,839 | 0.02 |
| USD | 100,000 | CODELCO INC 3.75% 04/11/20 REGS | 105,835 | 107,135 | 0.01 |
| USD | 90,000 | BANCO ESTADO CHILE 4.125% 7/10/20 | 95,594 | 96,476 | 0.01 |
| USD | 10,000 | EMPRESA NACIONAL 6.25% 08/07/19 REG | 11,225 | 10,981 | 0.00 |
| | | | 7,082,061 | 7,330,703 | 0.58 |
| | | 合計：チリ | 9,217,077 | 9,471,880 | 0.75 |
| 変動金利債 | | | | | |
| 中国 | | | | | |
| USD | 2,000,000 | CHINA CONSTRUCT BK FRN 13/05/25 | 2,011,370 | 2,023,588 | 0.16 |
| | | | 2,011,370 | 2,023,588 | 0.16 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BANK OF CHINA 5% 13/11/24 REGS | 1,032,155 | 1,064,579 | 0.08 |
| USD | 600,000 | BESTGAIN REAL 2.625% 13/03/18 REGS * | 569,756 | 600,084 | 0.05 |
| USD | 250,000 | CHINA RAILWAYS 3.85% 05/02/23 | 254,618 | 261,966 | 0.02 |
| USD | 200,000 | IND & COM BK 4.875% 21/09/25 REGS | 198,378 | 211,327 | 0.02 |
| | | | 2,054,907 | 2,137,956 | 0.17 |
| | | 合計：中国 | 4,066,277 | 4,161,544 | 0.33 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| コロンビア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 200,000 | COLOMBIA TELECOM FRN 29/12/49 REGS | 200,000 | 176,000 | 0.01 |
| | | | 200,000 | 176,000 | 0.01 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 4,400,000 | REP OF COLOMBIA 4% 26/02/24 | 4,497,979 | 4,595,139 | 0.36 |
| USD | 820,000 | REP OF COLOMBIA 6.125% 18/01/41 * | 933,934 | 949,678 | 0.07 |
| USD | 350,000 | REP OF COLOMBIA 5.625% 26/02/44 | 397,363 | 385,000 | 0.03 |
| USD | 250,000 | REP OF COLOMBIA 7.375% 18/09/37 * | 349,944 | 321,250 | 0.03 |
| USD | 291,000 | REP OF COLOMBIA 5% 15/06/45 | 288,142 | 299,730 | 0.02 |
| USD | 177,000 | REP OF COLOMBIA 11.75% 25/02/20 | 248,178 | 233,198 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF COLOMBIA 4.375% 12/07/21 | 208,000 | 214,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF COLOMBIA 4.5% 28/01/26 | 202,950 | 213,000 | 0.02 |
| USD | 126,000 | REP OF COLOMBIA 8.125% 21/05/24 | 153,971 | 162,225 | 0.01 |
| | | | 7,280,461 | 7,373,220 | 0.58 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BANCOCOLOMBIA SA 6.125% 26/07/20 * | 1,020,235 | 1,070,000 | 0.08 |
| USD | 685,000 | ECOPETROL SA 5.875% 18/09/23 | 690,120 | 704,694 | 0.06 |
| USD | 700,000 | ECOPETROL SA 7.375% 18/09/43 | 642,180 | 698,726 | 0.06 |
| USD | 400,000 | BANCO DE BOGOTA 6.25% 12/05/26 REGS | 396,180 | 407,000 | 0.03 |
| USD | 200,000 | BBVA COLOMBIA 4.875% 21/04/25 REGS | 199,828 | 198,000 | 0.02 |
| USD | 175,000 | ECOPETROL SA 5.875% 28/05/45 | 170,291 | 150,535 | 0.01 |
| USD | 130,000 | ECOPETROL SA 7.625% 23/07/19 | 158,135 | 149,500 | 0.01 |
| | | | 3,276,969 | 3,378,455 | 0.27 |
| | | 合計：コロンビア | 10,757,430 | 10,927,675 | 0.86 |
| コスタリカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 400,000 | REP OF COSTA RICA 7.158% 12/3/45 R | 400,000 | 399,000 | 0.04 |
| USD | 200,000 | REP OF COSTA RICA 4.25% 26/1/23 REG | 184,800 | 190,000 | 0.01 |
| USD | 200,000 | REP OF COSTA RICA 4.375% 30/4/25 RE | 177,500 | 186,000 | 0.01 |
| | | | 762,300 | 775,000 | 0.06 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | BANCO NAL COSTA 6.25% 1/11/23 REGS | 199,400 | 202,454 | 0.02 |
| | | | 199,400 | 202,454 | 0.02 |
| | | 合計：コスタリカ | 961,700 | 977,454 | 0.08 |
| クロアチア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 500,000 | REP OF CROATIA 6.375% 24/03/21 | 534,487 | 545,475 | 0.04 |
| USD | 210,000 | CROATIA GVT 6% 26/01/24 REGS | 218,925 | 229,818 | 0.02 |
| EUR | 200,000 | REP OF CROATIA 3% 11/03/25 | 215,992 | 211,204 | 0.02 |
| USD | 160,000 | REP OF CROATIA 6.625% 14/07/20 | 174,251 | 174,560 | 0.01 |
| | | | 1,143,655 | 1,161,057 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,300,000 | AGROKOR D. D. 9.125% 01/02/20 REGS | 2,017,906 | 1,534,530 | 0.12 |
| | | | 2,017,906 | 1,534,530 | 0.12 |
| | | 合計：クロアチア | 3,161,561 | 2,695,587 | 0.21 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|----------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------|------------------|-------------|
| キュラソー島 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 400,000 | TEVA PHARMA FIN 2.95% 18/12/22 | 385,344 | 407,879 | 0.03 |
| | | | <u>385,344</u> | <u>407,879</u> | <u>0.03</u> |
| | | 合計：キュラソー島 | <u>385,344</u> | <u>407,879</u> | <u>0.03</u> |
| キプロス | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | GLOBAL PORTS 6.872% 25/01/22 144A | 200,000 | 206,500 | 0.02 |
| | | | <u>200,000</u> | <u>206,500</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：キプロス | <u>200,000</u> | <u>206,500</u> | <u>0.02</u> |
| チェコ | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,535,000 | RPG BYTY SRO 6.75% 01/05/20 REGS | 2,048,718 | 1,756,369 | 0.14 |
| | | | <u>2,048,718</u> | <u>1,756,369</u> | <u>0.14</u> |
| | | 合計：チェコ | <u>2,048,718</u> | <u>1,756,369</u> | <u>0.14</u> |
| ドミニカ共和国 | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,720,000 | DOMINICAN REP 5.5% 27/01/25 REGS | 1,742,800 | 1,755,122 | 0.14 |
| USD | 570,000 | DOMINICAN REP 6.875% 29/01/26 REGS | 570,360 | 628,995 | 0.05 |
| USD | 425,000 | DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 REGS | 435,341 | 466,782 | 0.04 |
| USD | 430,000 | DOMINICAN REP 6.85% 27/01/45 REGS | 430,025 | 443,726 | 0.03 |
| USD | 140,000 | DOMINICAN REP 6.6% 28/01/24 REGS | 151,107 | 152,418 | 0.01 |
| | | | <u>3,329,633</u> | <u>3,447,043</u> | <u>0.27</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 807,000 | DOMINICAN REP 7.5% 06/05/21 | 890,195 | 895,770 | 0.07 |
| USD | 191,000 | DOMINICAN REP 5.875% 18/04/24 REGS | 194,260 | 199,595 | 0.02 |
| | | | <u>1,084,455</u> | <u>1,095,365</u> | <u>0.09</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 390,000 | AEROPUERTOS DOM 9.25% 13/11/19 REGS | 382,157 | 415,155 | 0.03 |
| | | | <u>382,157</u> | <u>415,155</u> | <u>0.03</u> |
| | | 合計：ドミニカ共和国 | <u>4,796,245</u> | <u>4,957,563</u> | <u>0.39</u> |
| エクアドル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 5,964,000 | REP OF ECUADOR 10.5% 24/03/20 REGS | 5,594,898 | 5,916,526 | 0.47 |
| USD | 1,060,000 | REP OF ECUADOR 7.95% 20/06/24 REGS | 1,054,153 | 926,928 | 0.07 |
| | | | <u>6,649,051</u> | <u>6,843,454</u> | <u>0.54</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,140,000 | EP PETROECUADOR FRN 24/09/19 REGS | 755,515 | 733,200 | 0.06 |
| | | | <u>755,515</u> | <u>733,200</u> | <u>0.06</u> |
| | | 合計：エクアドル | <u>7,404,566</u> | <u>7,576,654</u> | <u>0.60</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| エジプト | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 750,000 | ARAB REP EGYPT 5.875% 11/06/25 REGS | 743,740 | 652,500 | 0.05 |
| | | | 743,740 | 652,500 | 0.05 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 850,000 | AFRICAN EXP-IMP 4% 24/05/21 EMTN | 841,347 | 851,063 | 0.07 |
| | | | 841,347 | 851,063 | 0.07 |
| | | 合計：エジプト | 1,585,087 | 1,503,563 | 0.12 |
| エルサルバドル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,066,000 | REP EL SALVADOR 6.375% 18/01/27 REG | 993,212 | 936,843 | 0.08 |
| USD | 200,000 | REP EL SALVADOR 7.375% 01/12/19 REG | 199,920 | 200,500 | 0.02 |
| USD | 185,000 | REP EL SALVADOR 8.25% 10/04/32 REGS | 208,075 | 178,063 | 0.01 |
| USD | 169,000 | REP EL SALVADOR 5.875% 30/01/25 REG | 167,429 | 150,410 | 0.01 |
| USD | 162,000 | REP EL SALVADOR 7.65% 15/6/35 REGS | 161,644 | 144,180 | 0.01 |
| | | | 1,730,280 | 1,609,996 | 0.13 |
| | | 合計：エルサルバドル | 1,730,280 | 1,609,996 | 0.13 |
| エチオピア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF ETHIOPIA 6.625% 11/12/24 R | 179,000 | 186,520 | 0.01 |
| | | | 179,000 | 186,520 | 0.01 |
| | | 合計：エチオピア | 179,000 | 186,520 | 0.01 |
| フランス | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | SOCIETE GENERALE FRN 19/12/49 | 2,170,091 | 1,999,295 | 0.17 |
| EUR | 1,095,000 | SOLVAY FINANCE FRN 29/06/49 | 1,164,483 | 1,266,907 | 0.10 |
| EUR | 860,000 | ORANGE SA FRN 29/10/49 EMTN * | 1,097,528 | 995,028 | 0.08 |
| USD | 875,000 | CREDIT AGRICOLE FRN 29/12/49 144A | 892,719 | 869,019 | 0.07 |
| EUR | 570,000 | DRY MIX SOLUTIONS FRN 15/06/21 REGS | 771,324 | 626,642 | 0.05 |
| USD | 630,000 | SOCIETE GENERALE FRN 29/11/49 EMTN | 682,427 | 625,766 | 0.05 |
| USD | 550,000 | SOCIETE GENERALE FRN 29/04/49 144A | 382,250 | 554,582 | 0.04 |
| USD | 560,000 | CREDIT AGRICOLE FRN 29/01/49 REGS | 560,000 | 538,334 | 0.04 |
| EUR | 415,000 | CREDIT AGRICOLE FRN 23/12/49 | 589,346 | 436,043 | 0.03 |
| USD | 395,000 | AXA SA FRN 31/12/49 144A | 406,356 | 409,892 | 0.03 |
| | | | 8,716,524 | 8,321,508 | 0.66 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 900,000 | PICARD GROUPE FRN 01/08/19 REGS | 953,307 | 940,760 | 0.07 |
| EUR | 540,000 | DRY MIX SOLUTIONS FRN 15/03/23 REGS | 593,673 | 601,795 | 0.05 |
| EUR | 100,000 | FAURECIA 3.625% 15/06/23 | 110,960 | 112,394 | 0.01 |
| | | | 1,657,940 | 1,654,949 | 0.13 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| EUR | 800,000 | CASINO GUICHARD 2.798% 5/08/26 EMTN | 874,694 | 910,528 | 0.07 |
| | | | 874,694 | 910,528 | 0.07 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,915,000 | CROWN EURO HOLD 3.375% 15/5/25 REGS | 3,118,583 | 3,237,397 | 0.26 |
| USD | 3,018,000 | NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A | 2,967,232 | 2,945,568 | 0.23 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| EUR | 3,100,000 | AREVA 4.875% 23/09/24 EMTN | 3,875,141 | 2,820,174 | 0.22 |
| EUR | 2,000,000 | CERBA EUROPEAN LAB 7% 1/02/20 RegS | 2,726,805 | 2,302,124 | 0.18 |
| EUR | 1,895,000 | SYNLAB BONDCO 6.25% 01/07/22 REGs | 2,114,711 | 2,222,339 | 0.17 |
| USD | 2,015,000 | NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 144 | 2,024,155 | 1,974,700 | 0.16 |
| EUR | 1,700,000 | NUMERICABLE GRP 5.625% 15/05/24 REG | 2,191,037 | 1,910,961 | 0.15 |
| EUR | 1,350,000 | BUT SAS 7.375% 15/09/19 REGS | 1,712,431 | 1,553,183 | 0.12 |
| EUR | 1,330,000 | LION SENECA 7.875% 15/04/19 REGS | 1,840,586 | 1,315,801 | 0.10 |
| USD | 1,240,000 | REXEL SA 5.25% 15/06/20 144A | 1,239,764 | 1,283,400 | 0.10 |
| EUR | 1,070,000 | HOMEVI 6.875% 15/08/21 REGS | 1,355,195 | 1,263,429 | 0.10 |
| EUR | 1,000,000 | TEREOS FIN GP 4.125% 16/06/23 | 1,132,027 | 1,105,651 | 0.09 |
| EUR | 1,243,000 | CMA CGM SA 7.75% 15/01/21 REGS | 1,372,633 | 1,048,028 | 0.08 |
| EUR | 870,000 | THOM EUROPE SAS 7.375% 15/07/19 REG | 1,177,315 | 1,009,644 | 0.08 |
| EUR | 820,000 | NOVALIS SAS 3% 30/04/22 RegS | 879,696 | 903,101 | 0.07 |
| EUR | 800,000 | REXEL SA 3.25% 15/06/22 | 884,487 | 893,727 | 0.07 |
| EUR | 785,000 | SGD GROUP 5.625% 15/04/19 REGS | 932,873 | 890,495 | 0.07 |
| EUR | 655,000 | THREEAB OPTIQUE 5.625% 15/04/19 REG | 782,830 | 719,070 | 0.06 |
| EUR | 525,000 | HORIZON HDG I 7.25% 01/08/23 REGS | 596,950 | 604,162 | 0.05 |
| EUR | 525,000 | KERNEOS CORP SAS 5.75% 1/3/21 REGS | 631,232 | 601,098 | 0.05 |
| EUR | 560,000 | HOLDIKKS SAS 6.75% 15/07/21 REGS | 764,344 | 596,358 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | MEDI PARTENAIRES 7% 15/05/20 RegS | 580,977 | 578,032 | 0.05 |
| EUR | 480,000 | NUMERICABLE GRP 5.625% 15/05/24 144 | 663,264 | 536,695 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | AREVA SA 3.5% 22/03/21 EMTN | 475,695 | 460,758 | 0.04 |
| USD | 500,000 | NOVASEP HLDG 8% 15/12/16 REGS | 488,750 | 450,000 | 0.04 |
| EUR | 390,000 | BISOHO SAS 5.875% 01/05/23 REGs | 443,703 | 444,348 | 0.03 |
| EUR | 500,000 | AREVA SA 3.125% 20/03/23 EMTN | 442,541 | 434,830 | 0.03 |
| EUR | 320,000 | OBERTHUR TECH 9.25% 30/04/20 REGS | 433,860 | 376,610 | 0.03 |
| EUR | 280,000 | PAPREC HOLDING 5.25% 01/04/22 REGS | 299,152 | 313,582 | 0.02 |
| EUR | 250,000 | EUROPCAR GROUPE 5.75% 15/06/22 REGS | 276,109 | 287,766 | 0.02 |
| USD | 311,000 | NOVASEP HLDG 8% 15/12/16 144A | 536,000 | 279,900 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 REG | 200,000 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NUMERICABLE GRP 6.25% 15/05/24 144A | 205,190 | 189,464 | 0.01 |
| EUR | 120,000 | FAURECIA 3.125% 15/06/22 | 129,612 | 133,726 | 0.01 |
| | | | <u>39,494,880</u> | <u>35,882,121</u> | <u>2.82</u> |
| | | 合計：フランス | <u>50,744,038</u> | <u>46,769,106</u> | <u>3.68</u> |
| | | ガボン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 240,000 | GABONESE REP 6.95% 16/06/25 REGS | 240,000 | 210,048 | 0.02 |
| | | | <u>240,000</u> | <u>210,048</u> | <u>0.02</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 341,000 | GABONESE REP 6.375% 12/12/24 REGS | 342,728 | 293,703 | 0.02 |
| | | | <u>342,728</u> | <u>293,703</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：ガボン | <u>582,728</u> | <u>503,751</u> | <u>0.04</u> |
| | | グルジア | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 150,000 | REP OF GEORGIA 6.875% 12/04/21 REGS | 174,000 | 165,018 | 0.01 |
| | | | <u>174,000</u> | <u>165,018</u> | <u>0.01</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 650,000 | JSC GEORGIAN RAIL 7.75% 11/07/22 RE | 701,038 | 716,625 | 0.06 |
| | | | <u>701,038</u> | <u>716,625</u> | <u>0.06</u> |
| | | 合計：グルジア | <u>875,038</u> | <u>881,643</u> | <u>0.07</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| ドイツ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | HT1 FUNDING/COMMERZBK FRN 29/07/49 * | 1,228,351 | 1,666,983 | 0.13 |
| EUR | 500,000 | RWE AG FRN 21/04/75 EMTN | 490,633 | 474,031 | 0.04 |
| | | | <u>1,718,984</u> | <u>2,141,014</u> | <u>0.17</u> |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 5,150,000 | BUNDESSCHATZ 0% 16/12/16 | 5,868,198 | 5,740,942 | 0.45 |
| | | | <u>5,868,198</u> | <u>5,740,942</u> | <u>0.45</u> |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 1,110,000 | SAFARI HDG VERVAL 8.25% 15/02/21 RE | 1,485,931 | 1,288,537 | 0.10 |
| EUR | 530,000 | UNITYMEDIA HESS 5.125% 21/1/23 REGS | 575,629 | 498,684 | 0.04 |
| EUR | 290,000 | UNITYMEDIA HESSEN 5.75% 15/01/23 RE | 307,885 | 275,445 | 0.02 |
| EUR | 245,000 | UNITYMEDIA HES 5.625% 15/04/23 RegS | 288,636 | 229,857 | 0.02 |
| | | | <u>2,658,081</u> | <u>2,292,523</u> | <u>0.18</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,400,000 | HEIDELBERGCEMENT 8.5% 31/10/19 * | 3,175,783 | 3,308,123 | 0.25 |
| EUR | 1,920,000 | RAPID HOLDING 6.625% 15/11/20 REGS | 2,076,882 | 2,207,052 | 0.16 |
| EUR | 2,090,000 | WITTUR INTL HLDG 8.5% 15/2/23 REGS | 2,353,045 | 2,106,602 | 0.17 |
| EUR | 1,360,000 | HEIDELBERGCEMENT 7.5% 03/04/20 | 1,713,781 | 1,855,705 | 0.15 |
| EUR | 1,500,000 | UNITYMEDIA HESSEN 6.25% 15/01/29 RE | 1,889,058 | 1,846,646 | 0.15 |
| EUR | 1,500,000 | TECHEM GMBH 6.125% 01/10/19 RegS | 1,986,365 | 1,734,196 | 0.14 |
| EUR | 1,460,000 | UNITYMEDIA HESSEN 4% 15/01/25 REGS | 1,711,524 | 1,632,057 | 0.13 |
| EUR | 1,500,000 | UNITYMEDIA HESSEN 3.5% 15/1/27 REGS | 1,586,346 | 1,604,873 | 0.13 |
| EUR | 1,200,000 | TRIONISTA HOLDCO 5% 30/04/20 REGS | 1,534,794 | 1,365,601 | 0.11 |
| EUR | 1,070,000 | HP PELZER HLDG 7.5% 15/07/21 REGS | 1,447,174 | 1,249,953 | 0.10 |
| EUR | 1,000,000 | FALCON GERMANY HLD 9% 15/07/20 RegS | 1,316,392 | 1,174,917 | 0.09 |
| EUR | 1,000,000 | UNITYMEDIA KABEL 3.75% 15/1/27 REGS | 1,017,326 | 1,017,114 | 0.08 |
| EUR | 820,000 | KIRK BEAUTY ONE 8.75% 15/07/23 REGS | 917,498 | 966,203 | 0.08 |
| EUR | 700,000 | PFLEIDEDER AG 7.875% 1/08/19 REGS | 948,822 | 805,471 | 0.06 |
| EUR | 420,000 | TRIONISTA TOPC 6.875% 30/04/21 REGS | 549,948 | 490,216 | 0.04 |
| USD | 450,000 | HAPAG LLOYD AG 9.75% 15/10/17 144A | 405,429 | 448,875 | 0.04 |
| EUR | 340,000 | COMMERZBANK AG 6.375% 22/03/19 EMTN | 519,931 | 420,263 | 0.03 |
| USD | 400,000 | UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14 | 400,000 | 409,960 | 0.03 |
| EUR | 285,000 | TECHEM ENERGY 7.875% 01/10/20 REGS | 416,396 | 332,646 | 0.03 |
| USD | 260,000 | UNITYMEDIA HESSEN 5.5% 15/01/23 144 | 263,137 | 261,300 | 0.02 |
| EUR | 160,000 | PROGROUP AG 5.125% 01/05/22 REGS | 171,328 | 186,749 | 0.01 |
| | | | <u>26,400,959</u> | <u>25,424,522</u> | <u>2.00</u> |
| | | 合計：ドイツ | <u>36,646,222</u> | <u>35,599,001</u> | <u>2.80</u> |
| ガーナ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 600,000 | REP GHANA 7.875% 07/08/23 REGS | 594,750 | 524,052 | 0.04 |
| | | | <u>594,750</u> | <u>524,052</u> | <u>0.04</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 205,000 | REP OF GHANA 10.75% 14/10/30 REGS | 205,000 | 218,366 | 0.02 |
| | | | <u>205,000</u> | <u>218,366</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：ガーナ | <u>799,750</u> | <u>742,418</u> | <u>0.06</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| グアテマラ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF GUATEMALA 4.875% 13/2/28 REG | 197,452 | 208,000 | 0.02 |
| | | | 197,452 | 208,000 | 0.02 |
| | | 合計：グアテマラ | 197,452 | 208,000 | 0.02 |
| 香港 | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,330,000 | SUN HUNG KAI FRN 25/02/24 | 1,359,260 | 1,360,641 | 0.11 |
| USD | 500,000 | BANK OF EAST ASIA FRN 04/05/22 1 | 520,650 | 518,198 | 0.04 |
| USD | 500,000 | BANK OF EAST ASIA FRN 20/11/24 REGS | 498,400 | 506,595 | 0.04 |
| | | | 2,378,310 | 2,385,434 | 0.19 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 900,000 | CITIC PACIFIC 6.8% 17/01/23 REGS | 1,070,840 | 1,086,731 | 0.08 |
| USD | 900,000 | YUEXIU PROPERTY CO 4.5% 24/01/23 | 875,583 | 897,750 | 0.07 |
| USD | 70,000 | ICBC ASIA LTD 5.125% 30/11/20 | 76,199 | 76,862 | 0.01 |
| | | | 2,022,622 | 2,061,343 | 0.16 |
| | | 合計：香港 | 4,400,932 | 4,446,777 | 0.35 |
| ハンガリー | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,196,000 | REP OF HUNGARY 7.625% 29/03/41 * | 1,396,627 | 1,734,200 | 0.13 |
| USD | 828,000 | HUNGARY GVT 5.375% 21/02/23 | 886,814 | 916,622 | 0.06 |
| USD | 630,000 | REP OF HUNGARY 6.25% 29/01/20 | 696,037 | 698,640 | 0.06 |
| USD | 474,000 | REP OF HUNGARY 6.375% 29/03/21 | 539,475 | 539,588 | 0.04 |
| USD | 444,000 | REP OF HUNGARY 5.75% 22/11/23 | 478,006 | 506,351 | 0.04 |
| USD | 410,000 | REP OF HUNGARY 5.375% 25/03/24 | 431,331 | 457,970 | 0.04 |
| USD | 200,000 | REP OF HUNGARY 4% 25/03/19 | 208,440 | 207,500 | 0.02 |
| | | | 4,636,730 | 5,060,871 | 0.39 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 800,000 | MAGYAR EXPORT IMP 5.5% 12/02/18 REG | 810,400 | 838,200 | 0.07 |
| | | | 810,400 | 838,200 | 0.07 |
| | | 合計：ハンガリー | 5,447,130 | 5,899,071 | 0.46 |
| インド | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,500,000 | ICICI BANK LTD FRN 30/04/22 REGS | 1,437,708 | 1,518,687 | 0.12 |
| | | | 1,437,708 | 1,518,687 | 0.12 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,300,000 | RELIANCE IND 8.25% 15/01/27 REGS * | 2,584,750 | 2,939,744 | 0.22 |
| USD | 900,000 | NTPC 5.625% 14/07/21 EMTN | 1,009,080 | 1,020,862 | 0.08 |
| USD | 780,000 | PERTAMINA PT 6% 03/05/42 REGS | 767,698 | 791,544 | 0.06 |
| USD | 500,000 | STATE BK INDIA LDN 4.125% 1/8/17 RE | 495,700 | 512,629 | 0.04 |
| USD | 350,000 | ONGC VIDESH LTD 4.625% 15/7/24 REGS | 369,436 | 373,720 | 0.03 |
| USD | 355,000 | BHARTI AIRTEL LTD 4.375% 10/6/25 RE | 352,529 | 370,780 | 0.03 |
| USD | 200,000 | PERTAMINA PT 4.3% 20/05/23 REGS | 200,180 | 203,325 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BHARAT PETRO 4% 08/05/25 MTN | 198,210 | 202,905 | 0.02 |
| USD | 90,000 | EXPORT IMPORT BK 4% 14/01/23 REGS | 90,506 | 94,487 | 0.01 |
| | | | 6,068,089 | 6,509,996 | 0.51 |
| | | 合計：インド | 7,505,797 | 8,028,683 | 0.63 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|
| インドネシア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,600,000 | REP OF INDONESIA 4.75% 08/01/26 REG | 3,852,959 | 3,919,936 | 0.30 |
| USD | 2,000,000 | REP OF INDONES 5.25% 17/01/42 REGS | 2,087,500 | 2,126,020 | 0.17 |
| USD | 1,304,000 | REP OF INDONESIA 11.625% 4/3/19 | 1,664,621 | 1,610,066 | 0.13 |
| USD | 712,000 | REP OF INDONESIA 5.125% 15/1/45 REG | 739,596 | 759,198 | 0.06 |
| USD | 510,000 | REP OF INDONES 8.5% 12/10/35 | 694,947 | 727,771 | 0.06 |
| USD | 367,000 | REP OF INDONESIA 7.75% 17/1/38 | 451,015 | 498,025 | 0.04 |
| USD | 300,000 | REP INDONESIA 5.875% 13/03/20 | 334,000 | 333,625 | 0.03 |
| USD | 240,000 | REP OF INDONES 6.625% 17/02/37 REGS | 258,480 | 297,686 | 0.02 |
| USD | 260,000 | REP OF INDONES 4.875% 05/05/21 REGS | 283,027 | 281,822 | 0.02 |
| EUR | 223,000 | REP OF INDONESIA 3.75% 14/06/28 RE | 249,533 | 252,089 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF INDONESIA 5.95% 08/01/46 REG | 200,500 | 235,666 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF INDONESIA 4.125% 15/1/25 REG | 200,500 | 208,318 | 0.02 |
| | | | 11,016,678 | 11,250,222 | 0.89 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 600,000 | PERTAMINA 6.5% 27/05/41 | 590,280 | 636,061 | 0.04 |
| USD | 560,000 | PERUSAHAAN LISTRIK 5.5% 22/11/21 | 604,111 | 609,291 | 0.04 |
| USD | 500,000 | PRATAMA AGUNG 6.25% 24/02/20 REGS | 500,000 | 510,470 | 0.04 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN PEN 6.125% 15/03/19 REGS | 219,660 | 219,232 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN NEGA 5.125% 16/5/24 REG | 190,480 | 211,518 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN PEN 4.55% 29/03/26 REGS | 200,000 | 209,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN PEN 4.325% 28/05/25 REGS | 200,000 | 207,268 | 0.02 |
| | | | 2,504,531 | 2,602,840 | 0.20 |
| | | 合計：インドネシア | 13,521,209 | 13,853,062 | 1.09 |
| イラク | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 250,000 | IRAQ REPUBLIC 5.8% 15/01/28 | 190,625 | 190,325 | 0.01 |
| | | | 190,625 | 190,325 | 0.01 |
| | | 合計：イラク | 190,625 | 190,325 | 0.01 |
| アイルランド | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,030,000 | GOVERNOR & CO FRN 11/06/24 EMTN | 1,396,595 | 1,110,820 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | ARDAGH PKG FIN FRN 15/12/19 144A | 1,000,000 | 1,000,000 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | GOVERNOR & CO FRN 29/12/49 | 673,041 | 616,778 | 0.05 |
| EUR | 560,000 | ALLIED IRISH BK FRN 26/11/25 EMTN | 598,737 | 578,828 | 0.05 |
| | | | 3,668,373 | 3,306,426 | 0.26 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 335,000 | ARDAGH PKG FIN 7% 15/11/20 144A | 59,118 | 57,935 | 0.00 |
| | | | 59,118 | 57,935 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | SMURFIT KAPPA 3.25% 01/06/21 REGS | 1,887,461 | 1,765,777 | 0.14 |
| EUR | 1,000,000 | GOVERNOR & CO 10% 19/12/22 EMTN | 1,353,147 | 1,395,612 | 0.11 |
| USD | 912,000 | VEB FINANCE 6.902% 09/07/20 | 951,567 | 988,562 | 0.08 |
| USD | 910,000 | VEB FINANCE PLC 5.942% 21/11/23 REG | 846,530 | 955,045 | 0.08 |
| EUR | 825,000 | EIRCOM FINANCE 4.5% 31/05/22 REGS | 928,780 | 905,378 | 0.07 |
| USD | 717,000 | VEB FINANCE PLC 6.8% 22/11/25 REGS * | 763,359 | 787,051 | 0.06 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| EUR | 675,000 | ARDAGH PKG FIN 6.75% 15/05/24 REGS | 768,555 | 761,585 | 0.06 |
| USD | 655,000 | AERCAP IRELAND 4.5% 15/05/21 | 641,900 | 670,229 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | ARDAGH PKG FIN 4.25% 15/01/22 REGS | 617,845 | 568,128 | 0.04 |
| USD | 500,000 | ROSNEFT 4.199% 06/03/22 REGS | 499,375 | 497,240 | 0.04 |
| USD | 420,000 | ALLEGION PLC 5.875% 15/09/23 | 424,324 | 445,200 | 0.04 |
| USD | 400,000 | ARDAGH PKG FIN 7.25% 15/05/24 144A | 403,500 | 409,000 | 0.03 |
| USD | 380,000 | GRIFOLS WORLDWIDE 5.25% 01/04/22 | 381,108 | 386,806 | 0.03 |
| USD | 361,000 | VEB FINANCE PLC 6.025% 05/07/22 REG | 326,833 | 381,346 | 0.03 |
| EUR | 310,000 | ARDAGH PKG FIN 4.125% 15/05/23 REGS | 352,966 | 349,334 | 0.03 |
| USD | 245,000 | VIMPELCOM 7.748% 2/2/21 | 262,446 | 270,994 | 0.02 |
| USD | 234,000 | SCF CAPITAL 5.375% 16/06/23 REGS | 234,000 | 235,053 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALFA BANK OJSC 7.5% 26/09/19 REGS | 209,441 | 218,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CREDIT BK MOSCOW 7.7% 01/02/18 REGS | 204,032 | 208,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BORETS FIN 7.625% 26/09/18 REGS | 179,500 | 186,000 | 0.01 |
| USD | 150,000 | AERCAP IRELAND 3.75% 15/05/19 | 150,000 | 151,125 | 0.01 |
| | | | <u>12,386,669</u> | <u>12,535,465</u> | <u>0.99</u> |
| | | 合計：アイルランド | <u>16,114,160</u> | <u>15,899,826</u> | <u>1.25</u> |
| マン島 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 70,000 | ANGLOGOLD HLDGS 5.125% 01/08/22 | 66,465 | 71,470 | 0.01 |
| | | | <u>66,465</u> | <u>71,470</u> | <u>0.01</u> |
| | | 合計：マン島 | <u>66,465</u> | <u>71,470</u> | <u>0.01</u> |
| イスラエル | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | DELEK&AVNER YAM 5.412% 30/12/25 14 | 1,022,700 | 1,036,230 | 0.08 |
| USD | 850,000 | B COMM 7.375% 15/02/21 144A | 850,000 | 908,225 | 0.07 |
| | | | <u>1,872,700</u> | <u>1,944,455</u> | <u>0.15</u> |
| | | 合計：イスラエル | <u>1,872,700</u> | <u>1,944,455</u> | <u>0.15</u> |
| イタリア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 2,100,000 | INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/06/49 | 2,667,757 | 2,521,296 | 0.20 |
| EUR | 1,050,000 | INTESA SANPAOLO FRN 29/10/49 PERP | 1,347,385 | 1,318,914 | 0.10 |
| GBP | 900,000 | ENEL SPA FRN 10/09/75 | 1,381,989 | 1,292,550 | 0.10 |
| USD | 1,430,000 | UNICREDIT SPA FRN 31/12/50 | 1,430,000 | 1,151,150 | 0.09 |
| EUR | 1,200,000 | UNICREDIT SPA FRN 29/09/49 | 1,575,239 | 1,068,470 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | ASSICURAZIONI GEN FRN 10/07/42 EMTN | 756,180 | 847,032 | 0.07 |
| GBP | 500,000 | ASSICURAZ GENERALI FRN 29/12/49 | 578,235 | 644,493 | 0.05 |
| GBP | 500,000 | ASSICURAZIONI GENERALI FRN 29/06/49 | 547,675 | 628,977 | 0.05 |
| EUR | 350,000 | ENEL SPA FRN 15/01/75 | 474,140 | 409,256 | 0.03 |
| EUR | 220,000 | INTESA SANPAOLO FRN 29/12/49 EMTN | 239,404 | 224,988 | 0.02 |
| GBP | 150,000 | ENEL SPA FRN 15/09/76 | 258,787 | 207,047 | 0.02 |
| | | | <u>11,256,791</u> | <u>10,314,173</u> | <u>0.81</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| GBP | 2,300,000 | TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23 EMT | 3,770,042 | 3,463,786 | 0.27 |
| EUR | 1,550,000 | UNICREDIT SPA 6.95% 31/10/22 REGS | 2,113,708 | 1,934,876 | 0.15 |
| GBP | 1,000,000 | TELECOM ITALIA 6.375% 24/06/19 EMTN | 1,694,119 | 1,481,507 | 0.12 |
| EUR | 1,000,000 | FINMECCANICA FIN 5.25% 21/01/22 | 1,271,123 | 1,276,666 | 0.10 |
| EUR | 1,060,000 | ONORATO ARMATORI 7.75% 15/02/23 REG | 1,152,871 | 1,128,219 | 0.09 |
| EUR | 1,200,000 | CMC RAVENNA 7.5% 01/08/21 REGS | 1,632,240 | 1,107,154 | 0.09 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| EUR | 900,000 | ZOBELE HOLDING 7.875% 01/02/18 REGS | 1,198,349 | 1,012,946 | 0.08 |
| EUR | 730,000 | TELECOM ITALIA SPA 3.625% 25/5/26 E | 824,097 | 837,284 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | SNAI SPA 12% 15/12/18 REGS | 679,850 | 564,137 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | GAMENET SPA 7.25% 01/08/18 REGS | 509,366 | 561,358 | 0.04 |
| EUR | 400,000 | LKQ ITALIA BONDCO 3.875% 01/04/24 R | 455,960 | 455,756 | 0.04 |
| EUR | 400,000 | SNAI SPA 7.625% 15/06/18 REGS | 443,866 | 449,086 | 0.04 |
| EUR | 350,000 | MARCOLIN SPA 8.5% 15/11/19 REGS | 473,340 | 393,161 | 0.03 |
| EUR | 100,000 | BANCA POPOLARE 4.25% 30/01/19 EMTN | 140,113 | 118,895 | 0.01 |
| EUR | 125,000 | MANUTENCOOP 8.5% 01/08/20 REGS | 163,827 | 114,217 | 0.01 |
| | | 合計：イタリア | 16,522,871 | 14,899,048 | 1.18 |
| | | | 27,779,662 | 25,213,221 | 1.99 |
| コートジボワール | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 800,000 | IVORY COAST 5.375% 23/07/24 REGS | 731,510 | 752,080 | 0.06 |
| | | | 731,510 | 752,080 | 0.06 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 2,193,000 | IVORY COAST FRN 31/12/32 REGS | 2,038,498 | 2,025,239 | 0.16 |
| | | 合計：コートジボワール | 2,038,498 | 2,025,239 | 0.16 |
| | | | 2,770,008 | 2,777,319 | 0.22 |
| ジャマイカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | JAMAICA GVT 7.875% 28/07/45 | 195,480 | 213,500 | 0.01 |
| | | | 195,480 | 213,500 | 0.01 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | JAMAICA GVT 6.75% 28/04/28 | 199,920 | 210,000 | 0.02 |
| | | 合計：ジャマイカ | 199,920 | 210,000 | 0.02 |
| | | | 395,400 | 423,500 | 0.03 |
| 日本 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | SOFTBANK GP CORP 4.75% 30/07/25 | 1,629,491 | 1,793,539 | 0.14 |
| EUR | 270,000 | SOFTBANK GP CORP 4.625% 15/4/20 REG | 352,512 | 325,643 | 0.03 |
| | | 合計：日本 | 1,982,003 | 2,119,182 | 0.17 |
| | | | 1,982,003 | 2,119,182 | 0.17 |
| ジャージー | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 800,000 | MERCURY BONDCO FRN 30/05/21 REGS | 809,846 | 875,941 | 0.07 |
| | | | 809,846 | 875,941 | 0.07 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 2,000,000 | MERCURY BONDCO PIK 9% 30/05/21 REGS | 2,172,163 | 2,197,189 | 0.17 |
| | | | 2,172,163 | 2,197,189 | 0.17 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 3,500,000 | MAIN CAPITAL FDG 5.5% 29/06/49 * | 3,057,176 | 3,952,850 | 0.32 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|
| EUR | 1,930,000 | LINCOLN FIN 6.875% 15/04/21 REGS | 2,118,367 | 2,295,566 | 0.18 |
| GBP | 795,000 | AA BOND CO LTD 5.5% 31/07/22 REGS | 1,181,730 | 1,017,317 | 0.08 |
| EUR | 500,000 | MAIN CAPITAL FD 5.75% 29/12/49 | 445,196 | 564,815 | 0.04 |
| GBP | 400,000 | GALAXY FINCO 7.875% 15/11/21 REGS | 603,291 | 527,710 | 0.04 |
| GBP | 350,000 | GALAXY BIDCO 6.375% 15/11/20 REGS | 566,720 | 461,747 | 0.04 |
| GBP | 165,000 | CPUK FIN LTD 7% 28/08/20 REGS | 258,152 | 227,676 | 0.02 |
| GBP | 130,000 | TVL FINANCE PLC 8.5% 15/05/23 REGS | 190,359 | 169,231 | 0.01 |
| | | 合計：ジャージー | 8,420,991 | 9,216,912 | 0.73 |
| | | | 11,403,000 | 12,290,042 | 0.97 |
| カザフスタン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,000,000 | REP OF KAZAKHSTAN 3.875% 14/10/24 R | 942,200 | 1,006,080 | 0.08 |
| USD | 570,000 | REP KAZAKHSTAN 6.5% 21/07/45 REGS | 614,603 | 662,420 | 0.05 |
| USD | 560,000 | REP KAZAKHSTAN 5.125% 21/07/25 REGS | 566,890 | 613,267 | 0.05 |
| USD | 400,000 | REP OF KAZAKHSTAN 4.875% 14/10/44 R | 358,700 | 391,092 | 0.03 |
| | | | 2,482,393 | 2,672,859 | 0.21 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BTA BANK 5.5% 21/12/22 REGS | 700,200 | 669,000 | 0.05 |
| | | | 700,200 | 669,000 | 0.05 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,124,000 | KAZMUNAIGAZ FIN 7% 05/05/20 REGS | 2,236,908 | 2,312,059 | 0.19 |
| EUR | 900,000 | KAZKOMMERTSBANK 6.875% 13/2/17 EMTN | 1,010,451 | 960,423 | 0.08 |
| USD | 695,000 | DEVEL BK KAZA 4.125% 10/12/22 REGS * | 654,051 | 677,764 | 0.05 |
| USD | 600,000 | HALYK SAVING KAZAK 7.25% 28/1/21 RE | 605,000 | 631,800 | 0.05 |
| USD | 292,000 | KAZMUNAIGAZ FIN 9.125% 02/7/18 | 344,798 | 324,178 | 0.03 |
| USD | 200,000 | KAZMUNAYGAZ FIN 5.75% 30/04/43 REGS | 175,317 | 185,000 | 0.01 |
| USD | 200,000 | KAZAGRO NTL MGMT 4.625% 24/05/23 RE | 169,500 | 182,520 | 0.01 |
| | | | 5,196,025 | 5,273,744 | 0.42 |
| | | 合計：カザフスタン | 8,378,618 | 8,615,603 | 0.68 |
| ケニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 590,000 | REP OF KENYA 6.875% 24/06/24 REGS | 574,260 | 548,989 | 0.05 |
| USD | 300,000 | REP OF KENYA 5.875% 24/06/19 REGS | 300,000 | 298,854 | 0.02 |
| | | | 874,260 | 847,843 | 0.07 |
| | | 合計：ケニア | 874,260 | 847,843 | 0.07 |
| レバノン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,195,000 | REP OF LEBANON 6.1% 04/10/22 EMTN | 2,257,309 | 2,142,100 | 0.18 |
| USD | 655,000 | REP OF LEBANON 6.375% 9/03/20 GMTN | 673,033 | 663,842 | 0.05 |
| USD | 304,000 | REP OF LEBANON 6.6% 27/11/26 GMTN | 303,666 | 293,704 | 0.02 |
| USD | 145,000 | REP OF LEBANON 5.15% 12/11/18 EMTN | 145,406 | 144,690 | 0.01 |
| USD | 127,000 | REP OF LEBANON 8.25% 12/04/21 REGS | 142,611 | 136,065 | 0.01 |
| USD | 131,000 | LEBANESE REPUBLIC 5.45% 28/11/19 GM | 130,345 | 128,996 | 0.01 |
| | | | 3,652,370 | 3,509,397 | 0.28 |
| | | 合計：レバノン | 3,652,370 | 3,509,397 | 0.28 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| リトアニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 505,000 | REP OF LITHUANIA 7.375% 11/02/20 RE * | 610,900 | 595,900 | 0.05 |
| USD | 225,000 | REP OF LITHUANIA 6.125% 09/3/21 * | 248,732 | 262,080 | 0.02 |
| | | | 859,632 | 857,980 | 0.07 |
| | | 合計：リトアニア | 859,632 | 857,980 | 0.07 |
| ルクセンブルグ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,020,000 | WIND ACQUIS FIN FRN 15/07/20 REGS | 1,386,793 | 1,105,056 | 0.09 |
| EUR | 700,000 | EUROFINS SCIENTIFIC FRN 31/12/49 | 750,960 | 764,497 | 0.06 |
| EUR | 500,000 | GRAND CITY PROP FRN 29/12/49 | 515,964 | 539,126 | 0.04 |
| EUR | 390,000 | WIND ACQUIS FIN FRN 15/07/20 REGs | 410,163 | 426,605 | 0.03 |
| USD | 200,000 | SBERBANK RUSSIA FRN 26/02/24 REGS | 178,083 | 197,300 | 0.02 |
| | | | 3,241,963 | 3,032,584 | 0.24 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 2,000,000 | GEO TRAVEL FIN 10.375% 01/05/19 REG | 2,107,308 | 1,540,488 | 0.12 |
| EUR | 500,000 | SCHMOLZBICKENBACH 9.875% 15/5/19 RE | 447,668 | 362,676 | 0.03 |
| | | | 2,554,976 | 1,903,164 | 0.15 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 2,540,000 | PLAY TOPCO PIK 8.5% 28/02/20 REGS | 3,372,079 | 2,862,992 | 0.22 |
| USD | 1,325,000 | CONVATEC FINAN PIK 9% 15/01/19 144A | 1,311,957 | 1,295,187 | 0.10 |
| EUR | 1,000,000 | DAKAR FINANCE PIK 9% 15/11/20 REGS | 1,109,137 | 1,079,364 | 0.08 |
| EUR | 734,434 | ARDAGH FIN PIK 8.375% 15/06/19 REGS | 837,054 | 829,868 | 0.07 |
| USD | 612,552 | ARDAGH FIN PIK 8.625% 15/06/19 144A | 511,841 | 618,678 | 0.05 |
| USD | 101,000 | CAPSUGEL SA PIK 7% 15/05/19 144A | 102,010 | 101,253 | 0.01 |
| | | | 7,244,078 | 6,787,342 | 0.53 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 1,000,000 | ARCELORMITTAL STUP 25/02/22 | 1,016,880 | 1,052,500 | 0.08 |
| USD | 610,000 | ARCELORMITTAL 5.5% 01/03/21 | 514,825 | 626,775 | 0.05 |
| USD | 500,000 | ARCELORMITTAL 7% 15/10/39 | 516,656 | 485,000 | 0.04 |
| USD | 120,000 | ARCELORMITTAL STUP 01/06/19 | 130,200 | 141,300 | 0.01 |
| | | | 2,178,561 | 2,305,575 | 0.18 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,700,000 | TELENET FIN VI 4.875% 15/7/27 REGS | 2,890,428 | 3,046,339 | 0.25 |
| EUR | 1,740,000 | FIAT FIN&TRADE 6.75% 14/10/19 GMTN | 2,299,234 | 2,173,635 | 0.17 |
| EUR | 1,700,000 | FIAT FINANCE 7.375% 09/07/18 EMTN | 2,254,482 | 2,070,433 | 0.16 |
| EUR | 1,800,000 | GCL HLDG 9.375% 15/04/18 REGS | 2,237,096 | 2,033,495 | 0.16 |
| EUR | 1,650,000 | FIAT INDUSTRIAL FIN 6.25% 9/3/18 EM | 2,034,473 | 1,975,919 | 0.16 |
| EUR | 1,765,000 | TRINSEO OP/IN 6.375% 01/05/22 REGS | 1,909,861 | 1,973,256 | 0.16 |
| EUR | 1,675,000 | GAZPROM OAO 3.389% 20/3/20 EMTN | 1,900,061 | 1,925,251 | 0.15 |
| GBP | 1,310,000 | GAZPROM OAO 5.338% 25/09/20 | 1,807,421 | 1,850,958 | 0.15 |
| USD | 1,750,000 | ALBEA BEAUTY HDGS 8.375% 1/11/19 14 | 1,750,000 | 1,837,500 | 0.14 |
| USD | 1,820,000 | ALTICE FINANCING 7.5% 15/05/26 144A | 1,823,750 | 1,776,775 | 0.14 |
| EUR | 1,485,000 | JH HOLDING FIN 8.25% 01/12/22 REGS | 1,590,107 | 1,758,024 | 0.14 |
| USD | 1,500,000 | SBERBANK 5.717% 16/06/21 | 1,497,426 | 1,617,240 | 0.13 |
| EUR | 1,400,000 | GARFUNKELUX HOLDCO 7.5% 1/8/22 REGS | 1,585,979 | 1,523,559 | 0.12 |
| GBP | 1,000,000 | CABOT FIN LUX 10.375% 01/10/19 REGS * | 1,611,800 | 1,420,241 | 0.11 |
| EUR | 1,300,000 | MATTERHORN TEL 3.875% 01/05/22 REGS | 1,378,612 | 1,390,485 | 0.11 |
| EUR | 1,150,000 | FIAT FIN&TRADE 4.75% 22/03/21 EMTN | 1,355,752 | 1,373,641 | 0.11 |
| EUR | 1,000,000 | FMC FINANCE VIII 6.5% 15/09/18 REGS | 1,266,389 | 1,252,218 | 0.10 |
| EUR | 1,100,000 | CERBERUS NIGHT 8.25% 01/02/20 REGs | 1,246,961 | 1,245,993 | 0.10 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| USD | 1,200,000 | GAZPROM 4.95% 19/07/22 REGS | 1,183,080 | 1,243,680 | 0.10 |
| EUR | 1,540,000 | ALDESA FIN 7.25% 01/04/21 REGS | 2,123,660 | 1,222,271 | 0.10 |
| USD | 1,200,000 | ALTICE SA 7.75% 15/05/22 144A | 1,118,500 | 1,212,144 | 0.10 |
| EUR | 1,000,000 | LSF9 BALTA ISSUE 7.75% 15/09/22 REG | 1,168,517 | 1,170,737 | 0.09 |
| EUR | 1,000,000 | GESTAMP FUND LUX 3.5% 15/05/23 REGS | 1,147,881 | 1,131,776 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | RSHB CAPITAL 7.75% 29/05/18 RegS | 1,068,950 | 1,077,928 | 0.08 |
| USD | 1,100,000 | WIND ACQUIS FIN 7.375% 23/04/21 144 | 1,100,000 | 1,049,620 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | VTB CAPITAL 6% 12/04/17 REGS | 1,014,900 | 1,027,144 | 0.08 |
| EUR | 830,000 | ALTICE FINANCING 5.25% 15/02/23 REG | 951,193 | 933,663 | 0.07 |
| USD | 980,000 | MHP SA 8.25% 02/04/20 REGS | 844,018 | 926,100 | 0.07 |
| EUR | 835,000 | WIND ACQ FIN 4% 15/07/20 144A | 1,120,128 | 914,263 | 0.07 |
| USD | 850,000 | VTB CAPITAL 6.95% 17/10/22 REGS | 773,228 | 888,420 | 0.07 |
| EUR | 765,000 | CIRSA FUNDING LUX 5.875% 15/5/23 RE | 824,706 | 855,051 | 0.07 |
| USD | 825,000 | MINERVA LUX SA 7.75% 31/01/23 REGS | 872,473 | 845,625 | 0.07 |
| USD | 665,000 | GAZ CAP SA 8.625% 28/04/34 REGS | 759,952 | 840,294 | 0.07 |
| USD | 820,000 | TMK OAO/TMK CAP 6.75% 03/04/20 REGS | 765,467 | 835,793 | 0.07 |
| USD | 850,000 | WIND ACQUIS FIN 4.75% 15/07/20 144A | 850,000 | 828,750 | 0.07 |
| USD | 800,000 | TELECOM ITALIA CAP 7.2% 18/07/36 | 729,035 | 801,000 | 0.06 |
| USD | 805,000 | MILLICOM INTL 6% 15/03/25 REGS | 771,460 | 782,863 | 0.06 |
| USD | 800,000 | CONSOLIDATED NRG 6.75% 15/10/19 144 | 792,000 | 752,000 | 0.06 |
| EUR | 600,000 | ALTICE SA 7.25% 15/05/22 REGS | 825,375 | 674,530 | 0.05 |
| USD | 670,000 | PUMA INTL FIN 6.75% 01/02/21 REGS | 678,935 | 665,859 | 0.05 |
| USD | 655,000 | COSAN LUX 7% 20/01/27 REGS | 642,968 | 650,612 | 0.05 |
| EUR | 630,000 | MATTHORN TEL 4.875% 01/05/23 REGS | 669,375 | 650,411 | 0.05 |
| USD | 600,000 | ALTICE US FIN II 7.75% 15/7/25 144 | 594,825 | 623,940 | 0.05 |
| USD | 600,000 | KLABIN FIN 5.25% 16/07/24 REGS | 587,104 | 594,636 | 0.05 |
| USD | 600,000 | ALTICE SA 7.625% 15/02/23 144A | 600,750 | 585,750 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | CONVATEC HEALTH 10.875% 15/12/18 RE | 672,308 | 570,918 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | CNH INDUSTRIAL 2.75% 18/03/19 GMTN | 553,479 | 569,695 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | GEO DEBT FINANCE 7.5% 01/08/18 | 503,385 | 533,735 | 0.04 |
| USD | 450,000 | ALROSA FINANCE 7.75% 03/11/20 REGS | 472,388 | 512,568 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | MONITCHEM HLDCO 6.875% 15/6/22 REGS | 502,656 | 486,347 | 0.04 |
| USD | 515,000 | TOPAZ MARINE 8.625% 01/11/18 REGS | 475,298 | 485,161 | 0.04 |
| USD | 500,000 | TUPY OVERSEAS 6.625% 17/07/24 REGS | 509,000 | 473,475 | 0.04 |
| USD | 475,000 | INEOS GROUP HDGS 5.875% 15/02/19 14 | 471,798 | 472,625 | 0.04 |
| EUR | 400,000 | ALBEA BEAUTY HDGS 8.75% 1/11/19 REG | 521,134 | 469,784 | 0.04 |
| USD | 460,000 | ALTICE FINANCE 6.625% 15/02/23 REGS | 458,350 | 452,148 | 0.04 |
| USD | 455,000 | ALTICE FIN SA 7.5% 15/05/26 REGS | 453,863 | 444,194 | 0.03 |
| EUR | 400,000 | ZINC CAPITAL 8.875% 15/05/18 REGs | 447,389 | 441,990 | 0.03 |
| USD | 450,000 | INTELSAT JACK 8% 15/02/24 144A | 457,875 | 441,000 | 0.03 |
| EUR | 400,000 | WIND ACQ FIN 4% 15/07/20 REGS | 440,622 | 437,970 | 0.03 |
| USD | 400,000 | TRINSEO OP/FIN 6.75% 01/05/22 144A | 394,875 | 399,000 | 0.03 |
| USD | 375,000 | MILLICOM INTL 6.625% 15/10/21 REGS | 376,648 | 385,013 | 0.03 |
| GBP | 265,000 | CABOT FIN LUX 8.375% 01/08/20 REGS | 484,703 | 362,487 | 0.03 |
| USD | 300,000 | SBERBANK 6.125% 07/02/22 REGS | 307,500 | 332,250 | 0.03 |
| USD | 320,000 | SBERBANK OF RUSSIA 5.25% 23/5/23 RE | 268,400 | 316,960 | 0.02 |
| USD | 440,000 | INTELSAT JACK 7.25% 15/10/20 GDT | 442,250 | 316,800 | 0.02 |
| USD | 300,000 | EVRAZ GROUP 6.5% 22/04/20 REGS | 267,656 | 304,500 | 0.02 |
| EUR | 255,000 | AURIS LUXEMBOURG II 8% 15/1/23 REGS | 319,712 | 303,669 | 0.02 |
| EUR | 195,000 | TELECOM ITALIA FIN 7.75% 24/1/33 EM | 294,384 | 288,484 | 0.02 |
| USD | 380,000 | ANDRADE GUTIER INT 4% 30/04/18 REGS | 279,300 | 273,600 | 0.02 |
| USD | 265,000 | WIND ACQUIS FIN 6.5% 30/04/20 144A | 265,000 | 271,625 | 0.02 |
| USD | 260,000 | SBERBANK 5.125% 29/10/22 REGS | 261,274 | 263,884 | 0.02 |
| USD | 246,000 | GAZPROM 4.95% 06/02/28 REGS | 224,783 | 241,233 | 0.02 |
| USD | 229,000 | ALTICE FINANCING 6.5% 15/01/22 144A | 229,000 | 230,145 | 0.02 |
| EUR | 200,000 | INEOS GROUP HDGS 6.5% 15/08/18 REGS | 264,556 | 225,099 | 0.02 |
| USD | 292,000 | INTEL JACKSON 7.25% 01/04/19 | 232,060 | 216,080 | 0.02 |
| EUR | 180,000 | DUFREY FINANCE 4.5% 01/08/23 REGS | 196,884 | 208,592 | 0.02 |
| USD | 200,000 | INEOS GROUP HDGS 6.125% 15/08/18 14 | 205,000 | 201,875 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| USD | 200,000 | ALTICE FIN SA 6.625% 15/02/23 144A | 200,000 | 196,374 | 0.02 |
| EUR | 175,000 | BMBG BOND FIN 3% 15/06/21 REGS | 196,358 | 192,637 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TELECOM ITALIA CAP 6% 30/09/34 | 165,000 | 191,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALTICE FINCO 7.625% 15/02/25 144A | 190,500 | 183,000 | 0.01 |
| EUR | 175,000 | GALAPAGOS HGD 5.375% 15/06/21 REGS | 180,111 | 180,868 | 0.01 |
| EUR | 200,000 | GALAPAGOS HGD 7% 15/06/22 REGS | 266,077 | 172,632 | 0.01 |
| EUR | 165,000 | ALTICE SA 6.25% 15/02/25 REGS | 166,696 | 168,768 | 0.01 |
| USD | 150,000 | ROSNEFT FINANCE 7.875% 13/03/18 REG | 162,360 | 161,655 | 0.01 |
| EUR | 135,000 | TELENET FIN V 6.25% 15/08/22 REGS | 180,576 | 160,195 | 0.01 |
| EUR | 130,000 | FIAT FINANCE 4.75% 15/07/22 GMTN | 170,750 | 155,264 | 0.01 |
| USD | 162,000 | MALLINCKRODT FIN 5.75% 1/8/22 144A | 163,911 | 153,900 | 0.01 |
| USD | 125,000 | DANA FIN LUX SARL 6.5% 01/06/26 144 | 125,000 | 121,563 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | ALTICE FIN 6.5% 15/01/22 REGs | 119,928 | 116,718 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | ARCELORMITTAL 3.125% 14/01/22 EMTN | 104,571 | 108,747 | 0.01 |
| USD | 110,000 | MALLINCKRODT FIN 4.875 15/04/20 REG | 110,000 | 105,600 | 0.01 |
| USD | 400,000 | INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23 | 368,469 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 150,000 | INTELSAT LUX 6.75% 01/06/18 | 117,000 | 98,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | MALLINCKRODT FIN 5.625% 15/10/23 14 | 86,625 | 93,500 | 0.01 |
| EUR | 65,000 | HEIDELBERGCEMENT 2.25% 30/03/23 EMT | 72,974 | 73,703 | 0.01 |
| USD | 80,000 | MALLINCKRODT FINSB 5.5 15/4/25 REGS | 80,000 | 71,370 | 0.01 |
| USD | 54,000 | INTELSAT JACK 8% 15/02/24 REGS | 54,000 | 52,920 | 0.00 |
| USD | 50,000 | MALLINCKRODT INTL 5.75% 01/08/22 RE | 47,125 | 47,500 | 0.00 |
| USD | 64,000 | INTELSAT JACK 5.5% 01/08/23 | 50,779 | 40,640 | 0.00 |
| USD | 148,000 | INTELSAT LUX 7.75% 01/06/21 | 97,375 | 35,520 | 0.00 |
| USD | 30,000 | BEVERAGE PACKAGING 6% 15/6/17 144A | 29,963 | 30,105 | 0.00 |
| USD | 25,000 | MALLINCKRODT FIN 5.5% 15/04/25 144A | 25,000 | 22,250 | 0.00 |
| EUR | 1,154,000 | IIB LUX 9% 06/07/11 | 1,350,997 | 1,283 | 0.00 |
| | | | 74,153,987 | 70,997,690 | 5.59 |
| | | 合計：ルクセンブルグ | 89,373,565 | 85,026,355 | 6.69 |
| | | マレーシア | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 2,000,000 | MALAYAN BANKING FRN 20/09/22 EMTN * | 2,023,288 | 2,024,138 | 0.15 |
| USD | 200,000 | MALAYAN BANKING FRN 29/10/26 | 200,000 | 205,697 | 0.02 |
| | | | 2,223,288 | 2,229,835 | 0.17 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 800,000 | PETRONAS CAP 3.5% 18/03/25 REGS | 821,070 | 841,127 | 0.07 |
| USD | 140,000 | WAKALA GLOBAL 4.646% 6/07/21 REGS | 156,926 | 155,526 | 0.01 |
| USD | 100,000 | PETRONAS CAP 7.875% 22/05/22 REGS | 132,734 | 128,976 | 0.01 |
| | | | 1,110,730 | 1,125,629 | 0.09 |
| | | 合計：マレーシア | 3,334,018 | 3,355,464 | 0.26 |
| | | マーシャル諸島 | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 425,000 | NAVIOS MARITIME 8.125% 15/11/21 144 | 421,694 | 333,625 | 0.03 |
| USD | 250,000 | OCF SA 6.875% 25/04/44 REGS | 247,640 | 263,438 | 0.02 |
| USD | 64,000 | NAVIOS SA LOGIST 7.25% 01/05/22 144 | 64,000 | 45,120 | 0.00 |
| | | | 733,334 | 642,183 | 0.05 |
| 優先証券 | | | | | |
| — | 37,317 | SEASPAN CORP PFD 6.375% 30/04/19 | 933,502 | 934,305 | 0.07 |
| | | | 933,502 | 934,305 | 0.07 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|----------------------------|---------------------------------------|------------|------------|---------|
| ワラント | | | | | |
| — | 3,496 | GENERS MARITIME INC WTS17 | 1,823,524 | 4 | 0.00 |
| | | | 1,823,524 | 4 | 0.00 |
| | | 合計：マーシャル諸島 | 3,490,360 | 1,576,492 | 0.12 |
| | | | | | |
| | | モーリシャス | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 280,000 | MTN MAURITIUS 4.755% 11/11/24 REGS | 280,959 | 272,191 | 0.02 |
| | | | 280,959 | 272,191 | 0.02 |
| | | 合計：モーリシャス | 280,959 | 272,191 | 0.02 |
| | | | | | |
| | | メキシコ | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 20,000 | PETROLEOS MEXICANOS FRN 18/07/18 | 19,390 | 19,954 | 0.00 |
| | | | 19,390 | 19,954 | 0.00 |
| | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,110,000 | UTD MEXICAN STATE 6.05% 11/01/40 * | 3,846,253 | 3,887,500 | 0.32 |
| USD | 2,000,000 | UNITED MEXICAN STATE 3.6% 30/01/25 | 2,040,013 | 2,085,000 | 0.16 |
| USD | 1,000,000 | UTD MEXICAN STATE 3.625% 15/3/22 | 1,028,000 | 1,051,500 | 0.08 |
| USD | 892,000 | UNITED MEXICAN STATE 4.6% 23/01/46 | 870,708 | 933,398 | 0.07 |
| USD | 800,000 | UTD MEXICAN STATE 4.75% 8/3/44 MTN * | 822,086 | 856,000 | 0.07 |
| EUR | 631,000 | UNITED MEXICAN STATE 4% 15/03/2115 | 631,652 | 653,372 | 0.05 |
| USD | 425,000 | UNITED MEXICAN STATE 5.55% 21/01/45 * | 476,956 | 505,750 | 0.04 |
| USD | 342,000 | UTD MEXICAN STATES 5.75% 12/10/10 | 360,145 | 375,345 | 0.03 |
| MXN | 24,714 | MEXICAN FIXED RATE 10% 05/12/24 | 181,674 | 170,439 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | UNITED MEXICAN STATE 3% 6/3/45 GMTN | 94,011 | 104,435 | 0.01 |
| | | | 10,351,498 | 10,622,739 | 0.84 |
| | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | MEXICO GENERADORA 5.5% 06/12/32 REG | 178,898 | 181,951 | 0.01 |
| | | | 178,898 | 181,951 | 0.01 |
| | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 5,502,000 | PETROLEOS MEX 6.875% 04/08/26 REGS | 6,008,011 | 6,130,988 | 0.49 |
| USD | 3,410,000 | PETROLEOS MEX 6.375% 04/02/21 REGS | 3,597,486 | 3,699,849 | 0.29 |
| USD | 1,500,000 | PEMEX 5.5% 21/01/21 * | 1,627,003 | 1,582,500 | 0.12 |
| USD | 1,245,000 | GRUPO TELEVISA 6.625% 15/01/40 | 1,545,716 | 1,428,514 | 0.11 |
| USD | 1,100,000 | CEMEX SAB DE CV 7.25% 15/01/21 REGS | 1,178,700 | 1,160,720 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | BBVA BANCOMER 6.75% 30/09/22 REGS | 1,103,500 | 1,119,900 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | AMERICA MOVIL SAB 5% 30/03/20 | 1,109,120 | 1,102,744 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | CREDITO REAL SA 7.5% 13/03/19 REGS | 1,085,000 | 1,031,640 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | CEMEX SAB DE CV 5.875% 25/03/19 REG | 1,037,500 | 1,020,000 | 0.08 |
| USD | 821,000 | CEMEX SAB DE CV 7.75% 16/04/26 REGS | 842,291 | 861,311 | 0.07 |
| USD | 800,000 | BANCO INBURSA 4.125% 06/06/24 REGS | 798,122 | 803,792 | 0.06 |
| USD | 887,000 | PETROLEOS MEX 5.5% 27/06/44 | 795,674 | 800,518 | 0.06 |
| USD | 710,000 | ELEMENTIA SA 5.5% 15/01/25 REGS | 716,374 | 709,198 | 0.06 |
| USD | 605,000 | COM FED DE ELEC 5.75% 14/02/42 REGS | 600,247 | 620,881 | 0.05 |
| USD | 600,000 | TRUST F/1401 6.95% 30/01/44 REGS | 606,246 | 619,500 | 0.05 |
| USD | 575,000 | SIGMA ALIMENTOS 4.125% 02/05/26 REG | 573,833 | 580,031 | 0.05 |
| USD | 600,000 | CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 REGS | 578,500 | 570,684 | 0.04 |
| USD | 535,000 | TRUST F/1401 5.25% 15/12/24 REGS | 532,593 | 549,803 | 0.04 |
| USD | 500,000 | MEXICHEM SAB DE 4.875% 19/09/22 REG | 495,130 | 528,750 | 0.04 |
| USD | 579,000 | PEMEX 5.625% 23/01/46 | 550,111 | 528,338 | 0.04 |
| EUR | 390,000 | CEMEX SAB CV 4.75% 11/01/22 REGS | 495,311 | 433,524 | 0.03 |
| USD | 400,000 | CEMEX SAB DE CV 7.75% 16/04/26 144A | 401,472 | 419,640 | 0.03 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| EUR | 360,000 | CEMEX SAB DE CV 4.375% 5/03/23 REGS | 348,118 | 388,531 | 0.03 |
| USD | 400,000 | CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 144A | 400,000 | 380,412 | 0.03 |
| USD | 360,000 | PETROLEOS MEX 6.5% 02/06/41 | 411,037 | 362,700 | 0.03 |
| USD | 300,000 | AMERICA MOVIL SAB 6.125% 30/03/40 | 360,090 | 361,868 | 0.03 |
| USD | 325,000 | CEMEX SAB DE CV 6.5% 10/12/19 REGS | 324,298 | 345,439 | 0.03 |
| USD | 298,000 | PETROLEOS MEXICANOS 6% 05/03/20 | 340,143 | 320,052 | 0.03 |
| USD | 255,000 | PETROLEOS MEXICANOS 8% 03/05/19 | 294,143 | 284,963 | 0.02 |
| USD | 240,000 | TENEDORA NEMAK 5.5% 28/02/23 REGS | 245,530 | 248,400 | 0.02 |
| USD | 205,000 | BBVA BANCOMER 7.25% 22/04/20 REGS | 228,063 | 226,013 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GRUMA SAB DE CV 4.875% 01/12/24 REG | 204,169 | 216,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | COM FED DE ELEC 4.875% 15/1/24 REGS | 205,677 | 209,666 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MEXICHEM SAB DE 6.75% 19/09/42 REGS | 221,820 | 201,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CEMEX SAB DE CV 6.125% 5/05/25 144A | 199,960 | 194,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GRUPO TELEvisa SAB 5% 13/05/45 | 184,920 | 188,846 | 0.01 |
| USD | 200,000 | MEXICHEM SAB DE 5.875% 17/09/44 REG | 188,500 | 183,058 | 0.01 |
| USD | 178,000 | PETROLEOS MEX 4.875% 24/01/22 | 182,393 | 181,560 | 0.01 |
| USD | 125,000 | PETROLEOS MEX/PEMEX 6.625% 15/06/38 | 136,688 | 126,875 | 0.01 |
| USD | 85,000 | AMERICA MOVIL SAB 6.375% 01/03/35 | 102,850 | 105,090 | 0.01 |
| USD | 600,000 | EMPRESAS ICA SOC 8.875% 29/05/24 RE | 429,000 | 90,000 | 0.01 |
| | | | <u>31,285,339</u> | <u>30,917,798</u> | <u>2.44</u> |
| | | 合計：メキシコ | <u>41,835,125</u> | <u>41,742,442</u> | <u>3.29</u> |
| | | モンゴル | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | MONGOLIA GVT 10.875% 06/04/21 REGS | 200,000 | 209,933 | 0.02 |
| | | | <u>200,000</u> | <u>209,933</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：モンゴル | <u>200,000</u> | <u>209,933</u> | <u>0.02</u> |
| | | モロッコ | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 230,000 | KINGDOM OF MOROCCO 3.5% 19/06/24 | 307,015 | 268,375 | 0.02 |
| USD | 235,000 | KINGDOM OF MOROCCO 4.25% 11/12/22 R | 224,595 | 246,186 | 0.02 |
| USD | 205,000 | KINGDOM OF MOROCCO 5.5% 11/12/42 RE | 215,250 | 220,406 | 0.02 |
| | | | <u>746,860</u> | <u>734,967</u> | <u>0.06</u> |
| | | 普通社債(固定金利債) | | | |
| USD | 385,000 | OFFICE CHERIFIEN 4.5% 22/10/25 REGS | 348,425 | 376,068 | 0.02 |
| USD | 300,000 | OFFICE CHERIFIEN 5.625% 25/04/24 RE | 310,770 | 317,940 | 0.03 |
| | | | <u>659,195</u> | <u>694,008</u> | <u>0.05</u> |
| | | 合計：モロッコ | <u>1,406,055</u> | <u>1,428,975</u> | <u>0.11</u> |
| | | オランダ | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| GBP | 1,900,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 29/09/49 | 3,316,068 | 2,609,678 | 0.20 |
| EUR | 1,470,000 | KONINKLIJKE KPN FRN 14/03/49 | 1,906,650 | 1,738,347 | 0.14 |
| EUR | 1,400,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 29/09/49 | 1,855,561 | 1,731,317 | 0.14 |
| EUR | 800,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 31/03/49 | 1,054,167 | 909,965 | 0.07 |
| GBP | 500,000 | KONINKLIJKE KPN FRN 14/03/73 | 752,645 | 694,976 | 0.05 |
| EUR | 640,000 | DELTA LLOYD FRN 29/06/49 EMTN | 869,608 | 532,027 | 0.04 |
| EUR | 480,000 | RABOBANK NEDERLAND FRN 22/01/49 | 560,098 | 508,224 | 0.04 |
| USD | 700,000 | FBN FIN FRN 23/07/21 REGS | 661,663 | 483,000 | 0.04 |
| EUR | 322,000 | HYDRA DUTCH HDG FRN 15/04/19 REGS | 444,972 | 356,317 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ROYAL CAPITAL BV FRN 29/05/49 | 201,000 | 207,445 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|-----------|---------|
| USD | 170,000 | PETROBRAS GL FIN FRN 15/01/19 | 169,661 | 153,595 | 0.01 |
| | | | 11,792,093 | 9,924,891 | 0.78 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 1,638,000 | HYDRA DUTCH 8% 15/04/19 REGS | 1,489,734 | 1,527,137 | 0.12 |
| EUR | 500,000 | GOODYEAR DUNLOP 3.75% 15/12/23 REGS | 588,348 | 574,853 | 0.05 |
| | | | 2,078,082 | 2,101,990 | 0.17 |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 1,112,000 | SCHAEFFLER PIK 6.75% 15/11/22 144A | 1,231,540 | 1,223,200 | 0.10 |
| USD | 934,000 | JLL/DELTA DUTCH PIK 9.5% 1/5/20 144 | 937,643 | 928,163 | 0.07 |
| USD | 750,000 | SCHAEFFLER PIK 6.25% 15/11/19 144A | 760,125 | 780,000 | 0.06 |
| | | | 2,929,308 | 2,931,363 | 0.23 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 3,735,000 | PETROBRAS GBL FIN 4.75% 14/01/25 | 3,120,243 | 3,327,851 | 0.26 |
| EUR | 2,200,000 | SCHAEFFLER FIN 3.25% 15/05/25 REGS | 2,358,700 | 2,501,816 | 0.20 |
| EUR | 2,000,000 | NYRSTAR NETHER HD 8.5% 15/09/19 REG | 2,273,704 | 2,237,651 | 0.18 |
| USD | 2,497,000 | PETROBRAS GBL FIN 6.25% 17/03/24 | 2,496,913 | 2,216,088 | 0.17 |
| EUR | 1,800,000 | CABLE COMM SYST 7.5% 01/11/20 REGS | 2,489,471 | 2,100,964 | 0.17 |
| EUR | 1,500,000 | HEIDELBERGCEMENT 9.5% 15/12/18 EMTN | 2,073,056 | 2,018,488 | 0.16 |
| EUR | 1,160,000 | UPC HOLDING BV 6.75% 15/03/23 REGS | 1,593,660 | 1,381,330 | 0.11 |
| EUR | 1,170,000 | SM MTH AUTO GRP 4.125% 15/07/21 REG | 1,457,515 | 1,311,289 | 0.10 |
| EUR | 1,050,000 | OI EUROPEAN GRP 4.875% 31/3/21 REGS | 1,360,380 | 1,287,166 | 0.10 |
| CHF | 1,150,000 | UPC HOLDING BV 6.75% 15/03/23 REGS | 1,216,930 | 1,257,683 | 0.10 |
| USD | 1,100,000 | LUKOIL INTL FIN 6.125% 9/11/20 * | 1,193,408 | 1,199,062 | 0.09 |
| USD | 1,150,000 | PETROBRAS GBL FIN 8.375% 23/05/21 | 1,138,523 | 1,184,040 | 0.09 |
| USD | 1,140,000 | GTH FINANCE BV 6.25% 26/04/20 REGS | 1,163,364 | 1,181,359 | 0.09 |
| USD | 880,000 | MAJAPAHIT HLDG 7.875% 29/06/37 | 922,739 | 1,106,600 | 0.09 |
| EUR | 1,000,000 | ZIGGO SEC 3.75% 15/1/25 REGS | 1,116,570 | 1,083,810 | 0.09 |
| USD | 1,180,000 | ZHAIKMUNAI INT 7.125% 13/11/19 REGS | 1,061,951 | 1,035,686 | 0.08 |
| EUR | 910,000 | DARLING GLOB 4.75% 30/05/22 REGS | 997,724 | 1,024,201 | 0.08 |
| EUR | 1,120,000 | CONSTELLIUM NV 7% 15/01/23 REGS | 1,386,336 | 1,002,841 | 0.08 |
| USD | 885,000 | VIMPELCOM 7.5043% 01/03/22 REGS | 894,160 | 964,650 | 0.08 |
| EUR | 1,050,000 | PETROBRAS GBL FIN 4.25% 02/10/23 | 971,844 | 938,413 | 0.07 |
| USD | 910,000 | KAZAKHSTAN TEMIR 6.95% 10/7/42 REGS | 901,483 | 930,657 | 0.07 |
| USD | 900,000 | MARFRIG HLDG EUR 8% 08/06/23 REGS | 888,210 | 919,350 | 0.07 |
| USD | 1,040,000 | NOSTRUM OIL&GAS 6.375% 14/02/19 REG | 956,595 | 911,477 | 0.07 |
| USD | 860,000 | VTR FIN 6.875% 15/01/24 REGS | 836,334 | 862,124 | 0.07 |
| USD | 750,000 | VIMPELCOM HDGS 5.2% 13/02/19 REGS | 721,875 | 771,375 | 0.06 |
| USD | 745,000 | PETROBRAS GBL FIN 4.875% 17/03/20 | 560,775 | 698,438 | 0.05 |
| USD | 724,000 | PETROBRAS GL FIN 3% 15/01/19 | 631,892 | 667,890 | 0.05 |
| USD | 660,000 | PETROBRAS GBL FIN 8.75% 23/05/26 | 649,268 | 662,970 | 0.05 |
| EUR | 550,000 | UNITED GP BV 7.875% 15/11/20 REGS | 735,060 | 641,949 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | LGE HOLDCO VI 7.125% 15/05/24 REGS | 595,272 | 615,810 | 0.05 |
| USD | 600,000 | NXP BV/NXP FD 4.125% 01/06/21 144A | 600,000 | 612,000 | 0.05 |
| USD | 600,000 | VTR FIN 6.875% 15/01/24 144A | 600,000 | 601,500 | 0.05 |
| EUR | 480,000 | TMF GROUP HLDGS 9.875% 01/12/19 REG | 577,714 | 569,317 | 0.04 |
| USD | 525,000 | SCHAEFFLER FIN 4.25% 15/05/21 144A | 521,078 | 532,770 | 0.04 |
| EUR | 440,000 | GRUPO ANTOLIN DUT 5.125% 30/6/22 RE | 496,892 | 509,891 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | PETROBRAS GBL FIN 3.75% 14/01/21 | 483,429 | 487,129 | 0.04 |
| EUR | 455,000 | ZIGGO BOND FIN 4.625% 15/01/25 REGS | 483,518 | 481,754 | 0.04 |
| USD | 430,000 | GTH FINANCE BV 7.25% 26/04/23 REGS | 431,720 | 447,200 | 0.04 |
| GBP | 400,000 | PETROBRAS INTL 6.25% 14/12/26 ENT | 526,678 | 430,129 | 0.03 |
| USD | 430,000 | EMBRAER NETHERLANDS 5.05% 15/06/25 | 394,963 | 424,367 | 0.03 |
| USD | 400,000 | MYRIAD INTL HDGS 5.5% 21/07/25 REGS | 399,924 | 416,000 | 0.03 |
| USD | 400,000 | MARFRIG HLDG EUR 6.875% 24/6/19 14 | 403,500 | 401,000 | 0.03 |
| USD | 385,000 | MARFRIG HLDG EUR 6.875% 24/6/19 RE | 366,223 | 383,075 | 0.03 |
| USD | 270,000 | MAJAPAHIT HLDS 7.75% 20/01/20 REGS | 321,063 | 308,610 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| EUR | 250,000 | INTERXION HDGS 6% 15/07/20 REGS | 289,660 | 290,205 | 0.02 |
| USD | 200,000 | KAZMUNAIGAZ FIN 6.375% 09/4/21 | 212,400 | 218,540 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BHARTI AIRTEL ITL 5.125% 11/3/23 RE | 211,160 | 216,125 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GTH FINANCE BV 6.25% 26/04/20 144A | 200,000 | 207,256 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NXP BV/FDG 4.125% 01/06/21 REGS | 200,000 | 204,000 | 0.02 |
| USD | 270,000 | PETROBRAS GBL FIN 6.85% 05/06/2115 | 208,236 | 203,715 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NXP BV/NXP FD 4.625% 15/06/22 REGS | 200,000 | 203,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | FIAT CHRYSLER AUTO 4.5% 15/04/20 | 200,000 | 202,250 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ZIGGO BONG FIN 5.875% 15/01/25 144A | 200,000 | 193,000 | 0.02 |
| USD | 140,000 | MONTELL FIN 8.1% 15/03/27 144A | 183,750 | 186,274 | 0.01 |
| USD | 175,000 | JLL/DELTA DUTCH NEW 7.5% 1/02/22 14 | 177,824 | 179,813 | 0.01 |
| USD | 200,000 | PETROBRAS GL FIN 4.375% 20/05/23 | 148,248 | 162,000 | 0.01 |
| USD | 101,000 | MAJAPAHIT HLDG 8% 07/08/19 | 115,645 | 115,393 | 0.01 |
| USD | 75,000 | MYLAN NV 2.5% 07/06/19 144A | 74,916 | 75,975 | 0.01 |
| | | | <u>47,992,496</u> | <u>47,305,316</u> | <u>3.72</u> |
| | | 合計：オランダ | <u>64,791,979</u> | <u>62,263,560</u> | <u>4.90</u> |
| | | ナイジェリア | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 210,000 | ACCESS BANK FRN 24/06/21 REGS | <u>212,512</u> | <u>166,217</u> | <u>0.01</u> |
| | | | <u>212,512</u> | <u>166,217</u> | <u>0.01</u> |
| | | 合計：ナイジェリア | <u>212,512</u> | <u>166,217</u> | <u>0.01</u> |
| | | ノルウェー | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 900,000 | LOCK LOWER HLDG 9.5% 15/08/22 REGS | 1,204,740 | 978,431 | 0.07 |
| EUR | 860,000 | SILK BIDCO 7.5% 01/02/22 REGS | 971,578 | 974,503 | 0.08 |
| EUR | 300,000 | LOCK AS 7% 15/08/21 REGS | 378,513 | 340,363 | 0.03 |
| | | | <u>2,554,831</u> | <u>2,293,297</u> | <u>0.18</u> |
| | | 合計：ノルウェー | <u>2,554,831</u> | <u>2,293,297</u> | <u>0.18</u> |
| | | パキスタン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 900,000 | ISLAMIC REP PAKIST 8.25% 15/4/24 R | 938,688 | 946,561 | 0.07 |
| USD | 320,000 | ISLAMIC REP PAKIST 6.75% 3/12/19 RE | 320,000 | 334,737 | 0.03 |
| USD | 278,000 | ISLAM REP PAKISTAN 6.875% 1/6/17 RE | 274,670 | 284,253 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ISLAMIC REP PAKIST 8.25% 30/9/25 RE | 200,000 | 211,314 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ISLAMIC REP PAKIST 7.25% 15/4/19 R | 210,960 | 210,400 | 0.02 |
| | | | <u>1,944,318</u> | <u>1,987,265</u> | <u>0.16</u> |
| | | 合計：パキスタン | <u>1,944,318</u> | <u>1,987,265</u> | <u>0.16</u> |
| | | パナマ | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,000,000 | REP PANAMA 3.75% 16/03/25 | 2,031,000 | 2,099,999 | 0.17 |
| USD | 1,500,000 | REP OF PANAMA 5.2% 30/01/20 | 1,632,000 | 1,653,750 | 0.13 |
| USD | 200,000 | REP OF PANAMA 3.875% 17/03/28 | 202,780 | 210,000 | 0.02 |
| USD | 125,000 | REP OF PANAMA 9.375% 01/04/29 | 183,688 | 189,688 | 0.01 |
| USD | 25,000 | REP OF PANAMA 8.875% 30/09/27 | 37,489 | 36,563 | 0.00 |
| | | | <u>4,086,957</u> | <u>4,190,000</u> | <u>0.33</u> |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| その他債券 | | | | | |
| USD | 280,000 | REP OF PANAMA 4.3% 29/04/53 | 266,500 | 283,500 | 0.02 |
| USD | 270,000 | ENA NORTE TRUST 4.95% 25/04/23 REGS | 226,654 | 230,620 | 0.02 |
| USD | 92,000 | REP OF PANAMA 6.7% 26/01/36 | 118,266 | 121,440 | 0.01 |
| | | | 611,420 | 635,560 | 0.05 |
| | | 合計：パナマ | 4,698,377 | 4,825,560 | 0.38 |
| 国債 | | | | | |
| パラグアイ | | | | | |
| USD | 800,000 | REP OF PARAGUAY 4.625% 25/01/23 REG | 816,940 | 832,000 | 0.07 |
| | | | 816,940 | 832,000 | 0.07 |
| | | 合計：パラグアイ | 816,940 | 832,000 | 0.07 |
| 変動金利債 | | | | | |
| ペルー | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BANCO INTL PERU FRN 23/04/70 REGS | 1,028,500 | 1,098,540 | 0.09 |
| | | | 1,028,500 | 1,098,540 | 0.09 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,650,000 | REP OF PERU 7.35% 21/07/25 * | 3,520,429 | 3,590,750 | 0.27 |
| USD | 195,000 | REP OF PERU 8.75% 21/11/33 | 293,733 | 305,175 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF PERU 4.125% 25/08/27 | 211,390 | 218,500 | 0.02 |
| USD | 105,000 | REP OF PERU 5.625% 18/11/50 | 123,763 | 129,675 | 0.01 |
| PEN | 290 | REP OF PERU 6.95% 12/08/31 | 97,514 | 94,123 | 0.01 |
| | | | 4,246,829 | 4,338,223 | 0.33 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BANCO CRED PERU 5.375% 16/09/20 REG | 967,500 | 1,110,000 | 0.09 |
| USD | 500,000 | UNION AND CEMENT 5.875% 30/10/21 RE | 500,000 | 509,945 | 0.04 |
| USD | 100,000 | CEMENTOS PACASMAYO 4.5% 8/2/23 REGS | 95,490 | 98,250 | 0.01 |
| | | | 1,562,990 | 1,718,195 | 0.14 |
| | | 合計：ペルー | 6,838,319 | 7,154,958 | 0.56 |
| 国債 | | | | | |
| フィリピン | | | | | |
| USD | 2,000,000 | REP OF PHILIPPINES 4% 15/01/21 | 2,192,000 | 2,187,905 | 0.17 |
| USD | 1,600,000 | REP OF PHILIPPINES 4.2% 21/01/24 | 1,778,000 | 1,830,274 | 0.14 |
| USD | 1,000,000 | REP OF PHILIPPINES 3.95% 20/01/40 | 1,034,500 | 1,151,747 | 0.09 |
| USD | 370,000 | REP OF PHILIPPINES 5.5% 30/03/26 | 453,250 | 469,375 | 0.04 |
| USD | 251,000 | REP OF PHILIPPINES 6.375% 23/10/34 | 345,163 | 365,016 | 0.03 |
| USD | 177,000 | REP OF PHILIPPINES 7.75% 14/01/31 | 250,363 | 274,708 | 0.02 |
| USD | 100,000 | REP OF PHILIPPINES 10.625% 16/03/25 | 161,734 | 164,602 | 0.01 |
| USD | 80,000 | REP OF PHILIPPINES 9.5% 02/02/30 | 133,346 | 136,843 | 0.01 |
| | | | 6,348,356 | 6,580,470 | 0.51 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 550,000 | NATIONAL POWER 9.625% 15/05/28 * | 687,713 | 863,500 | 0.07 |
| USD | 200,000 | DEV BK PHILIPPINES 5.5% 25/03/21 | 226,750 | 227,328 | 0.02 |
| USD | 100,000 | POWER SECTOR 7.39% 02/12/24 REGS | 132,026 | 135,374 | 0.01 |
| | | | 1,046,489 | 1,226,202 | 0.10 |
| | | 合計：フィリピン | 7,394,845 | 7,806,672 | 0.61 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| ポーランド | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,700,000 | REP OF POLAND 5% 23/03/22 | 1,907,049 | 1,911,990 | 0.15 |
| USD | 735,000 | REP OF POLAND 3.25% 06/04/26 | 742,812 | 749,285 | 0.06 |
| USD | 200,000 | REP OF POLAND 4% 22/01/24 | 214,500 | 216,000 | 0.02 |
| USD | 77,000 | REP OF POLAND 3% 17/03/23 * | 75,243 | 78,317 | 0.01 |
| | | | 2,939,604 | 2,955,592 | 0.24 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 500,000 | PLAY FINANCE 2 5.25% 01/02/19 REGS | 697,566 | 569,740 | 0.04 |
| | | | 697,566 | 569,740 | 0.04 |
| | | 合計：ポーランド | 3,637,170 | 3,525,332 | 0.28 |
| プエルトリコ | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,650,000 | PUERTO RICO EMPLOYT RET 6.2% 1/7/39 | 868,313 | 618,750 | 0.05 |
| USD | 630,000 | PUERTO RICO EMPLO RET 6.55% 1/07/58 | 313,425 | 236,250 | 0.02 |
| | | | 1,181,738 | 855,000 | 0.07 |
| | | 合計：プエルトリコ | 1,181,738 | 855,000 | 0.07 |
| カタール | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 250,000 | STATE OF QATAR 2.375% 02/06/21 REGS | 247,310 | 252,700 | 0.02 |
| | | | 247,310 | 252,700 | 0.02 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,250,000 | RAS LAFFAN LNG 6.332% 30/09/27 REGS | 1,355,181 | 1,412,500 | 0.11 |
| | | | 1,355,181 | 1,412,500 | 0.11 |
| | | 合計：カタール | 1,602,491 | 1,665,200 | 0.13 |
| 韓国 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | SHINHAN BK 3.875% 24/03/26 REGS | 993,610 | 1,035,337 | 0.08 |
| USD | 500,000 | KOREA GAS CORP 3.5% 21/07/25 REGS | 536,750 | 544,519 | 0.04 |
| | | | 1,530,360 | 1,579,856 | 0.12 |
| | | 合計：韓国 | 1,530,360 | 1,579,856 | 0.12 |
| ルーマニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,010,000 | ROMANIA GVT 6.75% 07/02/22 REGS | 1,083,296 | 1,195,739 | 0.09 |
| EUR | 520,000 | ROMANIA 3.625% 24/04/24 EMTN | 692,014 | 641,038 | 0.05 |
| USD | 558,000 | ROMANIA GVT 4.375% 22/08/23 REGS | 572,814 | 597,060 | 0.05 |
| EUR | 180,000 | ROMANIA 3.875% 29/10/35 REGS | 204,988 | 210,092 | 0.02 |
| USD | 176,000 | ROMANIA GVT 4.875% 22/01/24 REGS | 189,728 | 194,151 | 0.02 |
| EUR | 50,000 | ROMANIA 2.75% 29/10/25 REGS | 56,610 | 57,247 | 0.00 |
| | | | 2,799,450 | 2,895,327 | 0.23 |
| | | 合計：ルーマニア | 2,799,450 | 2,895,327 | 0.23 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| ロシア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,800,000 | RUSSIAN FED 4.875% 16/09/23 REGS | 2,884,580 | 3,061,016 | 0.25 |
| USD | 1,245,000 | RUSSIAN FED 12.75% 24/06/28 REGS * | 2,221,313 | 2,179,636 | 0.17 |
| USD | 2,000,000 | RUSSIAN FED 3.5% 16/01/19 REGS | 1,972,500 | 2,067,860 | 0.16 |
| USD | 800,000 | RUSSIAN FED 5.625% 04/04/42 | 868,510 | 904,704 | 0.07 |
| USD | 400,000 | RUSSIAN FED 5.875% 16/09/43 REGS | 391,725 | 468,232 | 0.04 |
| | | | 8,338,628 | 8,681,448 | 0.69 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 375,640 | RUSSIAN FED FRN 31/03/30 REGS | 256,051 | 259,094 | 0.02 |
| | | | 256,051 | 259,094 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,825,000 | GAZPROM OAO 3.6% 26/02/21 EMTN | 2,860,279 | 3,249,270 | 0.25 |
| USD | 1,220,000 | GAZPROM 4.375% 19/09/22 REGS | 1,074,027 | 1,204,750 | 0.08 |
| USD | 900,000 | GAZPROMBK OJSC 7.25% 03/05/19 EMTN | 905,625 | 955,539 | 0.08 |
| USD | 600,000 | CREDIT BK MOSCOW 8.7% 13/11/18 REGS | 576,354 | 618,288 | 0.05 |
| USD | 600,000 | OJSC NOVO 4.5% 15/06/23 REGS | 600,000 | 592,500 | 0.05 |
| USD | 400,000 | GAZPROM OAO 7.288% 16/08/37 REGS | 404,205 | 463,664 | 0.04 |
| USD | 400,000 | MMC NORILSK 6.625% 14/10/22 REGS | 400,000 | 443,000 | 0.03 |
| USD | 290,000 | MMC NORILSK 6.625% 14/10/22 144A | 290,000 | 321,175 | 0.03 |
| USD | 230,000 | VEB FINANCE 5.45% 22/11/17 REGS | 236,929 | 237,120 | 0.02 |
| EUR | 200,000 | SBERBANK RUSSIA 3.3524% 15/11/19 RE | 192,080 | 233,296 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SEVERSTAL OAO 5.9% 17/10/22 REGS | 200,800 | 212,000 | 0.02 |
| | | | 7,740,299 | 8,530,602 | 0.67 |
| | | 合計：ロシア | 16,334,978 | 17,471,144 | 1.38 |
| セネガル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 100,000 | REP OF SENEGAL 8.75% 13/05/21 | 113,264 | 109,260 | 0.01 |
| | | | 113,264 | 109,260 | 0.01 |
| | | 合計：セネガル | 113,264 | 109,260 | 0.01 |
| セルビア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF SERBIA 5.875% 03/12/18 REGS | 209,830 | 212,000 | 0.01 |
| USD | 200,000 | REP OF SERBIA 4.875% 25/02/20 REGS | 206,000 | 206,232 | 0.02 |
| | | | 415,830 | 418,232 | 0.03 |
| | | 合計：セルビア | 415,830 | 418,232 | 0.03 |
| シンガポール | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,100,000 | ABJA INVESTMENT 5.95% 31/07/24 | 1,100,000 | 1,038,158 | 0.08 |
| USD | 200,000 | STATS CHIPPAC LTD 8.5% 24/11/20 REG | 200,000 | 207,000 | 0.02 |
| | | | 1,300,000 | 1,245,158 | 0.10 |
| | | 合計：シンガポール | 1,300,000 | 1,245,158 | 0.10 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| スロベニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 715,000 | REP OF SLOVENIA 5.85% 10/05/23 REGS | 816,695 | 830,436 | 0.06 |
| USD | 205,000 | REP OF SLOVENIA 5.5% 26/10/22 REGS | 204,552 | 232,737 | 0.02 |
| | | | 1,021,247 | 1,063,173 | 0.08 |
| | | 合計：スロベニア | 1,021,247 | 1,063,173 | 0.08 |
| 南アフリカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,410,000 | REP OF STH AFRICA 5.875% 30/05/22 | 1,553,695 | 1,569,330 | 0.12 |
| USD | 850,000 | REP OF STH AFRICA 5.875% 16/09/25 * | 901,213 | 946,475 | 0.07 |
| USD | 600,000 | REP OF SOUTH AFRICA 4.875% 14/04/26 | 591,786 | 622,500 | 0.05 |
| USD | 300,000 | REP OF STH AFRICA 6.875% 27/05/19 | 355,188 | 334,110 | 0.03 |
| USD | 315,000 | REP OF SOUTH AFRICA 5.375% 24/7/44 | 318,465 | 329,629 | 0.03 |
| USD | 220,000 | REP OF STH AFRICA 5.5% 09/03/20 | 244,979 | 237,600 | 0.02 |
| ZAR | 2,960,000 | REP OF STH AFRICA 8.75% 31/1/44 204 | 182,119 | 182,744 | 0.01 |
| ZAR | 1,310,000 | REP OF STH AFRICA 8.5% 31/1/37 2037 | 78,256 | 80,163 | 0.01 |
| | | | 4,225,701 | 4,302,551 | 0.34 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 654,000 | ESKOM HLDG 5.75% 26/01/21 REGS | 577,646 | 648,441 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ESKOM HLDG 6.75% 06/08/23 REGS | 370,380 | 396,052 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ESKOM HLDG 7.125% 11/02/25 REGS | 186,650 | 198,230 | 0.02 |
| | | | 1,134,676 | 1,242,723 | 0.10 |
| | | 合計：南アフリカ | 5,360,377 | 5,545,274 | 0.44 |
| スペイン | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,000,000 | BANCO BILBAO VIZCAYA FRN 29/05/49 | 1,103,878 | 1,000,680 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | BANCO SANTANDER FRN 11/09/49 | 787,320 | 566,509 | 0.04 |
| EUR | 400,000 | BBVA FRN 29/12/49 REGS | 571,789 | 382,360 | 0.03 |
| EUR | 200,000 | BANCO BILBAO VIZCAYA FRN 29/12/49 | 226,720 | 190,084 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | BANCO SANTANDER FRN 12/03/49 | 139,439 | 94,628 | 0.01 |
| | | | 2,829,146 | 2,234,261 | 0.17 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 200,000 | BANCO BILBAO VIZ FRN 29/12/49 | 227,980 | 219,399 | 0.02 |
| | | | 227,980 | 219,399 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 480,000 | ALMIRALL SA 4.625% 01/04/21 REGS | 668,113 | 554,951 | 0.04 |
| EUR | 335,000 | NH HOTELES SA 6.875% 15/11/19 144A | 469,836 | 402,581 | 0.03 |
| EUR | 300,000 | OBRASCON HUARTE 4.75% 15/03/22 | 412,050 | 223,432 | 0.02 |
| EUR | 100,000 | CAMPOFRIO FOOD 3.375% 15/03/22 REGS | 116,251 | 112,020 | 0.01 |
| | | | 1,666,250 | 1,292,984 | 0.10 |
| | | 合計：スペイン | 4,723,376 | 3,746,644 | 0.29 |
| スリランカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 980,000 | REP OF SRI LANKA 5.875% 25/7/22 REG | 954,272 | 949,960 | 0.07 |
| USD | 650,000 | REP OF SRI LANKA 6.85% 3/11/25 REGS | 604,900 | 635,005 | 0.05 |
| USD | 250,000 | REP OF SRI LANKA 6% 14/01/19 REGS | 254,430 | 255,545 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| | | | 1,813,602 | 1,840,510 | 0.14 |
| | | 合計：スリランカ | 1,813,602 | 1,840,510 | 0.14 |
| | | スウェーデン | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,360,000 | SVENSKA HANDEL FRN 29/12/49 | 1,360,000 | 1,285,540 | 0.10 |
| USD | 1,000,000 | SWEDBANK AB FRN 29/12/49 | 1,000,000 | 977,500 | 0.08 |
| | | | 2,360,000 | 2,263,040 | 0.18 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 2,390,000 | VERISURE HDG 6% 01/11/22 REGS | 2,680,345 | 2,828,083 | 0.22 |
| EUR | 1,741,000 | TVN FINANCE 7.375% 15/12/20 REGS | 1,830,038 | 1,634,009 | 0.13 |
| | | | 4,510,383 | 4,462,092 | 0.35 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 1,800,000 | CORRAL PETROL PIK 11.75% 15/5/21 RE | 2,014,292 | 1,887,230 | 0.15 |
| | | | 2,014,292 | 1,887,230 | 0.15 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,930,000 | PERSTORP HDGS AB 9% 15/05/17 REGS | 2,412,981 | 2,135,820 | 0.17 |
| USD | 825,000 | PERSTORP HDGS AB 8.75% 15/05/17 144 | 825,000 | 825,000 | 0.06 |
| EUR | 340,000 | VOLVO CAR AB 3.25% 18/05/21 | 386,818 | 388,338 | 0.03 |
| | | | 3,624,799 | 3,349,158 | 0.26 |
| | | 合計：スウェーデン | 12,509,474 | 11,961,520 | 0.94 |
| | | スイス | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,660,000 | CREDIT SUISSE GR FRN 29/12/49 144A | 1,578,647 | 1,567,073 | 0.13 |
| USD | 525,000 | UBS GROUP AG FRN 29/12/49 | 511,594 | 513,188 | 0.04 |
| USD | 400,000 | UBS GROUP AG FRN 29/12/49 | 400,000 | 377,748 | 0.03 |
| USD | 200,000 | CREDIT SUISSE GR FRN 29/12/49 REGS | 201,000 | 188,000 | 0.01 |
| | | | 2,691,241 | 2,646,009 | 0.21 |
| | | 合計：スイス | 2,691,241 | 2,646,009 | 0.21 |
| | | タイ | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| THB | 15,110,000 | BANK OF THAILAND 1.49% 23/02/18 | 428,836 | 428,891 | 0.03 |
| | | | 428,836 | 428,891 | 0.03 |
| | | 合計：タイ | 428,836 | 428,891 | 0.03 |
| | | チュニジア | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 260,000 | BANQ CENT TUNIS 5.75% 30/01/25 REGS | 247,111 | 234,650 | 0.02 |
| | | | 247,111 | 234,650 | 0.02 |
| | | 合計：チュニジア | 247,111 | 234,650 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| トルコ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,200,000 | REP OF TURKEY 8% 14/02/34 * | 4,274,797 | 4,308,288 | 0.33 |
| USD | 2,500,000 | REP OF TURKEY 5.125% 25/03/22 * | 2,661,743 | 2,673,090 | 0.21 |
| USD | 1,600,000 | REP OF TURKEY 3.25% 23/03/23 | 1,508,800 | 1,550,080 | 0.12 |
| USD | 750,000 | REP OF TURKEY 4.875% 16/04/43 * | 706,559 | 733,125 | 0.06 |
| USD | 584,000 | REP OF TURKEY 5.625% 30/03/21 | 630,004 | 636,560 | 0.05 |
| USD | 505,000 | REP OF TURKEY 6.25% 26/09/22 | 561,509 | 571,281 | 0.04 |
| USD | 400,000 | REP OF TURKEY 6% 14/01/41 | 436,960 | 447,394 | 0.04 |
| USD | 290,000 | REP OF TURKEY 7.375% 05/02/25 | 347,463 | 357,933 | 0.03 |
| TRY | 1,045,000 | TURKEY GOVT 7.1% 08/03/23 | 314,711 | 327,320 | 0.03 |
| USD | 230,000 | REP OF TURKEY 5.75% 22/03/24 | 246,301 | 256,475 | 0.02 |
| USD | 210,000 | REP OF TURKEY 6.75% 30/05/40 | 250,341 | 256,010 | 0.02 |
| USD | 180,000 | REP OF TURKEY 7.5% 07/11/19 | 216,212 | 205,576 | 0.02 |
| USD | 200,000 | REP OF TURKEY 4.25% 14/04/26 | 195,250 | 203,069 | 0.02 |
| USD | 160,000 | REP OF TURKEY 6.75% 03/04/18 | 184,129 | 172,080 | 0.01 |
| USD | 150,000 | REP OF TURKEY 7% 05/06/20 | 173,567 | 170,126 | 0.01 |
| USD | 140,000 | REP OF TURKEY 7% 11/03/19 | 166,527 | 154,921 | 0.01 |
| USD | 70,000 | REP OF TURKEY 7.25% 05/03/38 | 84,700 | 89,348 | 0.01 |
| USD | 51,000 | REP OF TURKEY 6.875% 17/03/36 * | 62,297 | 62,072 | 0.00 |
| | | | 13,021,870 | 13,174,748 | 1.03 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,000,000 | TURKIYE HALK BK 4.875% 19/7/17 REGS | 1,989,060 | 2,037,872 | 0.16 |
| USD | 1,000,000 | EXPORT CRED TURK 5.875% 24/04/19 RE | 989,270 | 1,060,052 | 0.08 |
| USD | 700,000 | ANADOLU EFES 3.375% 01/11/22 REGS | 614,250 | 631,750 | 0.05 |
| USD | 600,000 | TURKIYE GAR 5.25% 13/09/22 REGS | 605,640 | 621,900 | 0.05 |
| USD | 600,000 | AKBANK TAS 5% 24/10/22 REGS | 595,392 | 614,270 | 0.05 |
| USD | 500,000 | TURKIYE IS BANK 5.375% 6/10/21 REGS | 497,700 | 515,581 | 0.04 |
| USD | 200,000 | TURK TELEKOM 4.875% 19/06/24 REGS | 192,400 | 199,510 | 0.02 |
| | | | 5,483,712 | 5,680,935 | 0.45 |
| | | 合計：トルコ | 18,505,582 | 18,855,683 | 1.48 |
| ウクライナ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 151,000 | UKRAINE GVT FRN 31/05/40 GDP | 71,363 | 48,916 | 0.00 |
| | | | 71,363 | 48,916 | 0.00 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 930,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/19 REGS | 888,037 | 916,235 | 0.07 |
| USD | 688,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/20 REGS | 622,190 | 672,658 | 0.05 |
| USD | 355,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/22 REGS | 334,715 | 343,196 | 0.03 |
| USD | 255,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/23 REGS | 239,063 | 245,489 | 0.02 |
| USD | 255,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/24 REGS | 237,788 | 244,099 | 0.02 |
| USD | 255,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/25 REGS | 237,788 | 242,939 | 0.02 |
| | | | 2,559,581 | 2,664,616 | 0.21 |
| | | 合計：ウクライナ | 2,630,944 | 2,713,532 | 0.21 |
| アラブ首長国連邦 | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 300,000 | NATL BK ABU DHABI FRN 29/12/49 REGS | 300,000 | 302,625 | 0.02 |
| | | | 300,000 | 302,625 | 0.02 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 400,000 | ABU DHABI GVT 2.125% 03/05/21 144A | 397,950 | 404,580 | 0.03 |
| USD | 200,000 | OMAN GVT INTL 3.625% 15/06/21 REGS | 199,774 | 201,100 | 0.02 |
| | | | 597,724 | 605,680 | 0.05 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 990,000 | DP WORLD 6.85% 02/07/37 REGS * | 874,015 | 1,084,426 | 0.08 |
| USD | 800,000 | ABU DHABI NTL NRG 4.375% 22/6/26 RE | 792,016 | 850,000 | 0.07 |
| USD | 500,000 | ABU DHABI NTL NRG 3.625% 22/6/21 RE | 498,300 | 523,850 | 0.04 |
| USD | 200,000 | ABU DHABI NTL NRG 3.625% 12/1/23 | 197,750 | 206,500 | 0.02 |
| | | | <u>2,362,081</u> | <u>2,664,776</u> | <u>0.21</u> |
| | | 合計：アラブ首長国連邦 | <u>3,259,805</u> | <u>3,573,081</u> | <u>0.28</u> |
| イギリス | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 2,500,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 15/06/49 | 2,432,798 | 2,459,416 | 0.20 |
| GBP | 1,000,000 | LLOYDS BANK FRN 29/01/49 EMTn * | 1,840,599 | 2,210,342 | 0.18 |
| USD | 1,125,000 | RBS FRN 29/03/49 U | 1,138,046 | 1,066,511 | 0.08 |
| USD | 1,075,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 29/12/49 | 1,106,406 | 1,053,285 | 0.08 |
| USD | 950,000 | BARCLAYS BANK PLC FRN 10/04/23 | 973,000 | 973,750 | 0.08 |
| GBP | 660,000 | AVIVA PLC FRN 29/09/49 * | 926,253 | 895,556 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | RBS FRN 30/09/49 | 414,927 | 543,789 | 0.04 |
| EUR | 450,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 15/12/49 | 667,407 | 466,011 | 0.04 |
| GBP | 345,000 | NATIONWIDE BUILD SOC FRN 11/03/49 | 599,351 | 433,958 | 0.03 |
| USD | 400,000 | RBS FRN 29/12/49 | 400,000 | 372,875 | 0.03 |
| USD | 400,000 | RBS FRN 29/12/49 | 400,000 | 365,500 | 0.03 |
| GBP | 250,000 | SANTANDER UK GP FRN 24/06/49 | 386,551 | 312,145 | 0.02 |
| GBP | 225,000 | LLOYDS BANK FRN 31/12/49 | 389,456 | 284,721 | 0.02 |
| | | | <u>11,674,794</u> | <u>11,437,859</u> | <u>0.90</u> |
| その他債券 | | | | | |
| GBP | 2,000,000 | MELTON REN NRG UK 6.75% 01/2/20 REG | 2,433,945 | 2,148,535 | 0.17 |
| GBP | 1,100,000 | GARFUNKELUX HOLDCO 11% 1/11/23 RE | 1,681,021 | 1,332,738 | 0.10 |
| USD | 480,000 | BIZ FINANCE 9.75% 22/01/25 REGS | 473,650 | 457,200 | 0.04 |
| USD | 265,000 | LYNX/VIRGIN MED 5.375% 15/4/21 144 | 245,357 | 242,674 | 0.02 |
| | | | <u>4,833,973</u> | <u>4,181,147</u> | <u>0.33</u> |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 500,000 | R&R ICE CREAM PIK 9.25% 10/5/18 REG | 658,234 | 555,800 | 0.04 |
| | | | <u>658,234</u> | <u>555,800</u> | <u>0.04</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| GBP | 3,520,000 | GHD BONDCO PLC 7% 15/04/20 REGS | 5,207,230 | 4,505,531 | 0.35 |
| GBP | 1,979,000 | ENTREPRISE INNS 6.375% 26/09/31 * | 2,352,095 | 2,523,411 | 0.20 |
| EUR | 2,175,000 | INTL GAME 4.75% 15/02/23 REGS | 2,397,295 | 2,502,351 | 0.20 |
| GBP | 1,850,000 | VIRGIN MEDIA SEC 6.25% 28/3/29 REGS | 3,144,473 | 2,440,661 | 0.19 |
| GBP | 1,440,000 | ARQVA BROAD FIN 9.5% 31/03/20 REGS * | 2,181,889 | 2,066,393 | 0.16 |
| USD | 1,800,000 | ANGLO AMERICAN 9.375% 08/04/19 REGS | 1,773,000 | 2,056,464 | 0.16 |
| GBP | 1,500,000 | ARROW GLOBAL FIN 7.875% 1/03/20 REG | 2,378,399 | 2,050,599 | 0.16 |
| EUR | 1,400,000 | INTL GAME 4.125% 15/02/20 REGS | 1,653,157 | 1,622,381 | 0.13 |
| GBP | 1,075,000 | ENTERTAINMENT ONE 6.875% 15/12/22 R | 1,607,251 | 1,453,533 | 0.11 |
| GBP | 1,650,000 | BIBBY OFFSHORE 7.5% 15/06/21 REGS | 2,485,208 | 1,446,065 | 0.11 |
| GBP | 1,540,000 | JOHNSTON PRESS BD 8.625% 1/06/19 RE | 2,547,530 | 1,378,644 | 0.11 |
| GBP | 1,000,000 | KEYSTONE FINANCING 9.5% 15/10/19 RE | 1,614,619 | 1,369,530 | 0.11 |
| GBP | 750,000 | INVESTEC BANK 9.625% 17/02/22 EMTN | 1,202,118 | 1,186,403 | 0.09 |
| EUR | 1,000,000 | TESCO CORP TREAS 1.25% 13/11/17 EMT | 1,153,099 | 1,117,529 | 0.09 |
| GBP | 800,000 | RL FIN BONDS NO3 6.125% 13/11/28 | 1,233,360 | 1,101,377 | 0.09 |
| EUR | 1,000,000 | RBS 5.5% 29/11/49 | 698,156 | 1,022,672 | 0.08 |
| EUR | 1,000,000 | BOING GP FINAN 6.625% 15/07/19 REGS | 1,367,207 | 1,019,337 | 0.08 |
| USD | 900,000 | FRESNILLO PLC 5.5% 13/11/23 REGS | 902,594 | 971,748 | 0.08 |
| EUR | 830,000 | THOMAS COOK FIN 7.75% 15/06/20 REGS | 1,063,803 | 903,776 | 0.07 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------|----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|
| EUR | 850,000 | TA MANUFACTURING 3.625% 15/4/23 REG | 933,810 | 891,239 | 0.07 |
| GBP | 750,000 | BOPARAN FIANCE 5.5% 15/07/21 REGS | 988,299 | 888,563 | 0.07 |
| EUR | 760,000 | MERLIN ENTERT 2.75% 15/03/22 REGS | 812,364 | 819,472 | 0.06 |
| GBP | 595,000 | DEBENHAMS PLC 5.25% 15/07/21 | 984,293 | 764,112 | 0.06 |
| GBP | 500,000 | OLD MUTUAL PLC 8% 03/06/21 EMTN | 975,226 | 721,334 | 0.06 |
| GBP | 500,000 | MARLIN IMDT HDGS 10.5% 01/08/20 Reg | 758,961 | 703,591 | 0.06 |
| GBP | 480,000 | INFINIS PLC 7% 15/02/19 RegS | 791,022 | 649,407 | 0.05 |
| USD | 600,000 | SOUTHERN GAS CO 6.875% 24/03/26 RE | 594,672 | 646,500 | 0.05 |
| USD | 700,000 | INMARSAT FIN 4.875% 15/05/22 144A | 694,337 | 638,750 | 0.05 |
| GBP | 460,000 | COGNITA FIN PLC 7.75% 15/08/21 REGS | 717,968 | 627,934 | 0.05 |
| EUR | 600,000 | ANGLO AMERICAN CAP 1.5% 01/04/20 EM | 535,482 | 604,937 | 0.05 |
| EUR | 550,000 | INEOS FIN 4% 01/05/23 REGS | 611,736 | 586,350 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | ANGLO AMERICAN 2.75% 07/06/19 EMTN | 462,061 | 544,851 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | TESCO PLC 5.125% 10/04/47 EMTN | 517,710 | 531,573 | 0.04 |
| GBP | 380,000 | IDH FINANCE PLC 6% 01/12/18 REGS | 585,903 | 496,209 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | INTL PERSONAL FIN 5.75% 07/04/21 EM | 531,846 | 491,883 | 0.04 |
| USD | 406,000 | GAZ CAPITAL 9.25% 23/04/19 REGS | 442,865 | 468,430 | 0.04 |
| USD | 446,000 | ROYAL BK SCOTLAND 6.1% 10/06/23 | 453,676 | 457,918 | 0.04 |
| EUR | 400,000 | INOVYN FINANCE PLC 6.25% 15/5/21 RE | 456,200 | 451,310 | 0.04 |
| USD | 400,000 | ANGLO AMERICAN 4.875% 14/05/25 144A | 331,000 | 381,000 | 0.03 |
| USD | 400,000 | ANGLO AMERICAN 4.125% 27/09/22 144A | 337,500 | 372,000 | 0.03 |
| USD | 450,000 | TULLOW OIL 6.25% 15/04/22 144A | 448,661 | 365,625 | 0.03 |
| GBP | 265,000 | STONEGATE PUB 5.75% 15/04/19 REGS | 445,221 | 354,246 | 0.03 |
| GBP | 275,000 | GARFUNKELUX HOLDCO 8.5% 01/11/22 RE | 420,255 | 350,177 | 0.03 |
| EUR | 260,000 | INTERROUTE FINCO 7.375% 15/10/20 REG | 290,472 | 306,126 | 0.02 |
| EUR | 255,000 | SYNLAB UNSEC BD 8.25% 01/07/23 REGS | 293,973 | 287,710 | 0.02 |
| USD | 255,000 | INTL GAME 6.25% 15/02/22 144A | 251,850 | 259,144 | 0.02 |
| GBP | 200,000 | NEW LOOK SEC ISS 6.5% 01/07/22 REGS | 310,280 | 247,351 | 0.02 |
| GBP | 180,000 | MOTO FINANCE 6.375% 01/09/20 REGS | 275,893 | 247,162 | 0.02 |
| GBP | 175,000 | VUE INTL BIDCO 7.875% 15/07/20 RegS | 288,230 | 242,351 | 0.02 |
| EUR | 185,000 | AVIS BUDGET FIN 6% 01/03/21 REGS | 243,330 | 211,301 | 0.02 |
| EUR | 200,000 | ANGLO AMERICAN 3.5% 28/03/22 EMTN | 199,011 | 208,952 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ANGLO AMERICAN 4.125% 15/04/21 144A | 168,500 | 189,000 | 0.01 |
| GBP | 120,000 | BAKKAVOR FINANCE 8.75% 15/06/20 REG | 188,410 | 170,914 | 0.01 |
| EUR | 140,000 | WORLDPAY FINANCE 3.75% 15/11/22 REG | 164,630 | 158,542 | 0.01 |
| USD | 105,000 | ANGLO AMERICAN 9.375% 08/04/19 144A | 113,663 | 119,960 | 0.01 |
| USD | 100,000 | STANDARD BANK 8.125% 02/12/19 GMTN | 109,772 | 111,251 | 0.01 |
| USD | 108,000 | SENSATA TECHNO 5.625% 01/11/24 REGS | 113,670 | 111,240 | 0.01 |
| USD | 125,000 | ENSCO PLC 5.75% 01/10/44 | 73,750 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 60,000 | ROYAL BK SCOTLAND 6% 19/12/23 | 65,086 | 61,355 | 0.00 |
| USD | 25,000 | ENSCO PLC 5.2% 15/03/25 | 17,750 | 17,375 | 0.00 |
| USD | 20,000 | ENSCO PLC 4.7% 15/03/21 | 16,775 | 16,618 | 0.00 |
| USD | 10,000 | ENSCO PLC 4.5% 01/10/24 | 7,125 | 6,700 | 0.00 |
| | | | 54,985,721 | 49,593,868 | 3.91 |
| | | 合計：イギリス | 72,152,722 | 65,768,674 | 5.18 |
| | | アメリカ | | | |
| バンクローン | | | | | |
| USD | 102,642 | GLOBAL AVIATION FRN 13/08/17 2ND TL | 585,198 | 10 | 0.00 |
| | | | 585,198 | 10 | 0.00 |
| 転換社債 | | | | | |
| USD | 216,000 | M/I HOMES INC CV 3% 01/03/18 | 237,343 | 213,322 | 0.01 |
| USD | 80,000 | MGIC INVESMENT CORP CV 2% 01/04/20 | 98,275 | 88,160 | 0.01 |
| USD | 200,000 | COBALT INTL CV 2.625% 01/12/19 | 219,152 | 75,942 | 0.01 |
| | | | 554,770 | 377,424 | 0.03 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------|----------------------------|---------------------------------------|------------|------------|---------|
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 4,300,000 | DEUTSCHE POSTBANK FRN 17/06/49 | 4,565,703 | 4,768,121 | 0.38 |
| USD | 2,140,000 | ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144 * | 1,532,487 | 1,679,899 | 0.13 |
| USD | 1,275,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X | 1,275,000 | 1,296,599 | 0.10 |
| USD | 1,275,000 | CITIGROUP INC FRN 29/05/49 | 1,275,000 | 1,198,526 | 0.09 |
| USD | 975,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 U | 975,000 | 1,008,306 | 0.08 |
| USD | 825,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z | 825,000 | 876,884 | 0.07 |
| USD | 575,000 | JPMORGAN CHASE CO FRN 29/12/49 V | 575,000 | 550,678 | 0.04 |
| USD | 475,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49 | 475,000 | 524,015 | 0.04 |
| USD | 375,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 Q | 375,000 | 364,530 | 0.03 |
| USD | 700,000 | AGFC CAP TRUST FRN 15/01/67 144A | 414,750 | 351,750 | 0.03 |
| USD | 300,000 | WELLS FARGO & CO FRN 29/12/49 S | 300,000 | 309,069 | 0.02 |
| USD | 300,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 Q | 300,000 | 293,592 | 0.02 |
| USD | 275,000 | GOLDMAN SACHS FRN 31/12/49 M | 275,875 | 271,953 | 0.02 |
| USD | 210,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T | 210,000 | 216,300 | 0.02 |
| USD | 200,000 | WELLS FARGO & CO FRN 31/12/49 U | 200,000 | 213,344 | 0.02 |
| USD | 202,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K * | 203,461 | 200,738 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49 L | 198,125 | 199,276 | 0.02 |
| USD | 175,000 | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD | 175,000 | 184,844 | 0.01 |
| USD | 145,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 R | 145,000 | 147,900 | 0.01 |
| USD | 123,000 | AES CORP FRN 01/06/19 | 122,693 | 122,693 | 0.01 |
| USD | 64,000 | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 AA | 64,558 | 64,760 | 0.01 |
| USD | 50,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/10/49 | 50,000 | 51,469 | 0.00 |
| | | | 14,532,652 | 14,895,246 | 1.17 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,033,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/21 REGS | 950,877 | 1,004,799 | 0.08 |
| | | | 950,877 | 1,004,799 | 0.08 |
| 普通株式 | | | | | |
| — | 75,909 | ASG RESTRICTED COMMON STOCK | 5,122,799 | 1,707,952 | 0.14 |
| — | 279,010 | IPAYMENT COMMON SHARES | 378,009 | 1,255,544 | 0.11 |
| — | 19,500 | UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK | 309,719 | 604,499 | 0.05 |
| — | 1,272 | HOLDCO MEMBERSHIP INTERESTS | 0 | 302,207 | 0.02 |
| — | 7,000 | GEOKINETICS HOLDINGS | 1,307,093 | 175,000 | 0.01 |
| — | 31,000 | DENBURY RESOURCES INC | 193,688 | 111,910 | 0.01 |
| — | 21,782 | NII HOLDINGS INC | 638,302 | 65,128 | 0.01 |
| — | 31,430 | HERCULES OFFSHORE INC | 1,825,802 | 44,316 | 0.00 |
| — | 2,000 | DYNEGY INC | 78,843 | 34,220 | 0.00 |
| — | 15,777 | BEECHCRAFT BEECH HOLDING/BONY | 0 | 13,805 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK E | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK I | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK D | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK C | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK H | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK A | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK G | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK J | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK F | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK B | 0 | 13,185 | 0.00 |
| — | 9,727 | BLUESTEM GROUP INC | 178,196 | 12,159 | 0.00 |
| — | 2,704 | AFFINION GROUP HLDGS INC - CL C COM | 1,059,108 | 1,690 | 0.00 |
| — | 2,846 | AFFINION GROUP HLDGS INC - CL D COM | 766,375 | 1,636 | 0.00 |
| — | 22,715 | DIRECTBUY HDGS INC RESTR CO (BONY) | 386,155 | 0 | 0.00 |
| — | 2,374 | AQUILEX UNIT B DUMMY | 355,555 | 0 | 0.00 |
| — | 1,513 | AQUILEX UNIT A DUMMY | 997,500 | 0 | 0.00 |
| | | | 13,597,144 | 4,461,916 | 0.35 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| その他債券 | | | | | |
| USD | 420,000 | CHOCTAW RESORT 7.25% 15/11/19 144A | 306,902 | 396,900 | 0.04 |
| USD | 350,000 | US AIRWAYS 6.75% 2012-2B 03/12/22 | 296,671 | 316,697 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CONTL AIRLINES 12-2 5.5% 29/04/22 B | 211,927 | 220,405 | 0.02 |
| USD | 523,000 | CONTINENTAL AIR 9.558% 01/9/19 RJ04 | 164,494 | 177,113 | 0.01 |
| USD | 438,000 | CONTL AIRLINES 9.318% 01/11/19 144A | 167,203 | 175,856 | 0.01 |
| USD | 84,000 | CHUKCHANSI ECO DEV 9.75% 30/5/20 RE | 71,719 | 49,265 | 0.00 |
| USD | 13,200,000 | NEWPAGE CORP 11.375% 31/12/14 DUMMY | 0 | 0 | 0.00 |
| | | | 1,218,916 | 1,336,236 | 0.11 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 978,865 | NEW ENTREPRISE 13% PIK 15/03/18 | 672,158 | 1,010,677 | 0.08 |
| USD | 869,268 | INVENTIV HEALTH PIK 11% 15/08/18 14 | 707,345 | 893,173 | 0.07 |
| USD | 3,106,870 | DIRECTBUY HDGS PIK 12% 31/10/19 144 | 1,398,540 | 745,649 | 0.06 |
| USD | 745,000 | INFOR SOFT PIK 7.125% 01/05/21 144A | 747,614 | 659,325 | 0.05 |
| USD | 911,819 | LIBERTY TIRE REC PIK 11% 31/3/21 14 | 1,046,747 | 597,241 | 0.05 |
| USD | 548,469 | SORENSON COMM PIK 31/10/20 144A | 423,408 | 490,194 | 0.04 |
| USD | 313,500 | WAVE HOLDCO PIK 8.25% 15/07/19 144A | 300,000 | 316,635 | 0.02 |
| USD | 321,590 | SORENSON COMM PIK 31/10/21 144A | 242,865 | 301,692 | 0.02 |
| USD | 247,207 | AAF HLG/FIN PIK 12.75% 01/07/19 144 | 225,000 | 242,263 | 0.02 |
| USD | 250,000 | HUB HOLDINGS PIK 8.125% 15/17/19 14 | 226,875 | 240,000 | 0.02 |
| USD | 150,000 | ANCESTRY PIK 10.375% 15/10/18 144A | 150,750 | 151,875 | 0.01 |
| USD | 291,900 | CHINOS INT HL PIK 8.5% 1/05/19 144 | 242,294 | 97,787 | 0.01 |
| USD | 277 | ENERGY FUT HDG PIK 11.25% 01/11/17 | 112 | 180 | 0.00 |
| | | | 6,383,708 | 5,746,691 | 0.45 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 1,363,000 | REYNOLDS GRP ISS STUP 8.25% 15/2/21 | 1,401,724 | 1,420,682 | 0.12 |
| USD | 1,078,000 | INVENTIV HEALTH 10% 15/08/18 | 1,024,100 | 1,067,220 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | MURPHY OIL CORP 3.7% 01/12/22 | 794,969 | 914,714 | 0.07 |
| USD | 670,000 | INVENTIV HEALTH 10% 15/08/18 | 670,000 | 668,325 | 0.05 |
| USD | 650,000 | SABINE PASS LIQ 5.625% 15/04/23 | 642,000 | 653,250 | 0.05 |
| USD | 640,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 6% 01/02/25 144A | 642,149 | 550,400 | 0.04 |
| USD | 500,000 | LENNAR CORP 4.75% 15/11/22 | 500,523 | 495,750 | 0.04 |
| USD | 175,000 | ENDO FIN LLC/FIN 5.375% 15/01/23 1 | 175,000 | 151,813 | 0.01 |
| USD | 100,000 | RITE AID CORP 6.875% 15/12/28 | 95,625 | 115,500 | 0.01 |
| USD | 166,000 | GOODMAN NETWO 12.125% 1/07/18 | 163,133 | 84,245 | 0.01 |
| USD | 30,000 | PRINCE MINERAL 11.5% 15/12/19 144A | 25,918 | 26,100 | 0.00 |
| | | | 6,135,141 | 6,147,999 | 0.48 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 3,885,000 | SPRINT CORP 7.875% 15/09/23 | 3,454,691 | 3,185,699 | 0.26 |
| EUR | 2,450,000 | BALL CORP 4.375% 15/12/23 | 2,672,566 | 2,934,485 | 0.24 |
| USD | 2,100,000 | MEDIACOM BRDBND 6.375% 01/04/23 | 2,099,999 | 2,162,999 | 0.18 |
| USD | 2,340,000 | UNIFRAX 1 LLC/HO 7.5% 15/02/19 144A | 2,350,588 | 2,043,112 | 0.17 |
| EUR | 1,700,000 | ZF NA CAPITAL 2.75% 27/04/23 | 1,833,393 | 1,939,608 | 0.16 |
| USD | 1,900,000 | CNOOC FIN 2015 US 3.5% 05/05/25 | 1,848,851 | 1,924,785 | 0.16 |
| USD | 2,160,000 | CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI | 2,123,485 | 1,881,899 | 0.16 |
| USD | 1,645,000 | FRONTIER COMM 11% 15/09/25 | 1,640,929 | 1,696,817 | 0.14 |
| EUR | 1,815,000 | INFOR US INC 5.75% 15/05/22 WI | 1,923,174 | 1,691,517 | 0.14 |
| USD | 1,721,779 | IPAYMENT INC 9.5% 15/12/19 144A | 3,146,065 | 1,687,342 | 0.14 |
| USD | 1,625,000 | LADDER CAP FIN 7.375% 01/10/17 | 1,624,999 | 1,645,312 | 0.14 |
| EUR | 1,430,000 | HUNTSMAN INTL 5.125% 15/04/21 | 1,904,682 | 1,616,420 | 0.14 |
| EUR | 1,685,000 | GATES GLOBAL 5.75% 15/7/22 REGS | 2,268,921 | 1,561,970 | 0.13 |
| USD | 1,525,000 | DISH DBS CORP 5.125% 01/05/20 | 1,522,807 | 1,550,733 | 0.13 |
| USD | 1,440,000 | BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/23 | 1,487,262 | 1,533,599 | 0.13 |
| USD | 1,550,000 | ESH HOSPITALITY 5.25% 01/05/25 144A | 1,544,060 | 1,509,312 | 0.13 |
| EUR | 1,700,000 | CHEMOURS CO 6.125% 15/5/23 | 1,784,284 | 1,492,483 | 0.13 |
| USD | 1,575,000 | LTP MERGER 8.5% 15/06/23 144A | 1,570,322 | 1,488,374 | 0.13 |
| USD | 1,800,000 | SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 01/12/22 | 1,523,068 | 1,457,999 | 0.12 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| USD | 1,325,000 | CEMEX FINANCE 9.375% 12/10/22 144A | 1,324,999 | 1,457,499 | 0.12 |
| USD | 1,750,000 | WINDSTREAM CORP 6.375% 01/08/23 | 1,750,747 | 1,456,874 | 0.12 |
| USD | 1,365,000 | BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A | 1,364,999 | 1,388,887 | 0.12 |
| EUR | 1,435,000 | PSPC ESCROW CORP 6% 01/02/23 REGS | 1,467,420 | 1,347,898 | 0.12 |
| USD | 1,275,000 | LIN TELEVISION 6.375% 15/01/21 | 1,274,999 | 1,330,780 | 0.11 |
| USD | 1,370,000 | DYNEGY INC 7.375% 01/11/22 WI | 1,273,391 | 1,322,049 | 0.11 |
| USD | 1,380,000 | CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A | 1,347,427 | 1,310,999 | 0.11 |
| USD | 1,250,000 | WAVEDIVISION ESC 8.125% 1/09/20 144 | 1,293,813 | 1,299,999 | 0.11 |
| USD | 1,340,000 | BWAY HDGS CO 9.125% 15/08/21 144A | 1,331,477 | 1,283,049 | 0.11 |
| USD | 1,475,000 | NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24 | 1,461,355 | 1,261,124 | 0.11 |
| USD | 1,250,000 | EXOPACK HLDG 10% 01/06/18 144A | 1,249,999 | 1,249,999 | 0.11 |
| USD | 1,155,000 | T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/26 | 1,155,981 | 1,218,524 | 0.11 |
| EUR | 1,055,000 | BELDEN INC 5.5% 15/04/23 REGS | 1,347,236 | 1,175,669 | 0.10 |
| USD | 1,000,000 | SERVICE CORP 7.5% 01/04/27 | 946,249 | 1,159,999 | 0.09 |
| USD | 1,085,000 | FAGE DAIRY IND 9.875% 01/02/20 144A * | 1,009,652 | 1,129,072 | 0.09 |
| EUR | 1,030,000 | CEMEX FINANCE 4.625% 15/06/24 REGS | 1,168,100 | 1,121,773 | 0.09 |
| USD | 1,000,000 | NEPTUNE FINCO 10.125% 15/01/23 144A | 1,029,713 | 1,117,499 | 0.09 |
| USD | 1,178,000 | INFOR US INC 6.5% 15/05/22 WI | 1,185,125 | 1,116,154 | 0.09 |
| USD | 1,169,000 | COEUR D'ALENE MINES 7.875% 01/02/21 | 1,163,743 | 1,107,627 | 0.09 |
| USD | 1,400,000 | TEEKAY OFFSHORE 6% 30/07/19 | 1,399,999 | 1,098,999 | 0.09 |
| USD | 1,100,000 | SUNOCO LP/FIN 6.25% 15/04/21 144A | 1,099,999 | 1,097,249 | 0.09 |
| USD | 1,045,000 | LUCENT TECHNOLOGIES 6.45% 15/03/29 | 964,696 | 1,092,024 | 0.09 |
| USD | 1,115,000 | CHS COMMUNITY 8% 15/11/19 | 1,081,387 | 1,091,305 | 0.09 |
| USD | 1,035,000 | DISH DBS CORP 6.75% 01/06/21 | 1,098,936 | 1,072,518 | 0.08 |
| USD | 1,100,000 | PRISO ACQ CORP 9% 15/05/23 144A | 1,099,999 | 1,069,749 | 0.08 |
| USD | 1,025,000 | ASTHEAD CAPITAL INC 6.5% 15/7/22 14 | 1,024,999 | 1,058,312 | 0.08 |
| USD | 1,035,000 | BOISE CASCADE CO 6.375% 01/11/20 | 1,034,913 | 1,055,699 | 0.08 |
| USD | 1,100,000 | CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A | 1,122,143 | 1,053,249 | 0.08 |
| USD | 1,050,000 | HRG GROUP 7.75% 15/01/22 | 1,044,785 | 1,042,124 | 0.08 |
| USD | 1,025,000 | HARLAND CLARKE 9.75% 01/08/18 144A | 984,000 | 1,040,374 | 0.08 |
| USD | 989,000 | GRAY TELEVISION INC 7.5% 01/10/20 | 995,773 | 1,031,032 | 0.08 |
| USD | 1,025,000 | SUNOCO LP/FIN 5.5% 01/08/20 144A | 1,025,000 | 1,012,187 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | BLOCK COMMS INC 7.25% 01/02/20 144A | 1,000,000 | 1,009,999 | 0.08 |
| USD | 956,000 | TRAC INTERMODAL 11% 15/08/19 | 956,000 | 1,008,579 | 0.08 |
| USD | 1,025,000 | ENERGY TRANSFER EQ 5.875% 15/01/24 | 895,861 | 996,812 | 0.08 |
| USD | 1,175,000 | MIRCON TECH INC 5.25% 15/01/24 144A | 1,139,125 | 995,812 | 0.08 |
| USD | 940,000 | BOYD GAMING CORP 6.375% 1/4/26 1 | 948,012 | 982,299 | 0.08 |
| USD | 940,000 | ALERE INC 6.375% 01/07/23 144A | 943,166 | 982,299 | 0.08 |
| USD | 955,000 | CCO HLDGS LLC 5.125% 01/05/23 144A | 952,513 | 960,371 | 0.08 |
| USD | 900,000 | WESTERN DIGITAL 10.5% 01/04/24 144A | 911,827 | 958,499 | 0.08 |
| USD | 945,000 | CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y | 932,313 | 947,947 | 0.07 |
| USD | 922,000 | RYLAND GROUP 5.375% 01/10/22 | 922,825 | 933,524 | 0.07 |
| EUR | 810,000 | MPT OPER PARTNERS 4% 19/08/22 | 895,860 | 932,179 | 0.07 |
| USD | 1,162,000 | SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI | 1,088,966 | 923,092 | 0.07 |
| USD | 895,000 | RSI HOME PROD INC 6.5% 15/3/23 144A | 896,250 | 919,612 | 0.07 |
| USD | 875,000 | SINCLAIR TELE 6.375% 01/11/21 WI | 876,563 | 918,749 | 0.07 |
| USD | 884,000 | T-MOBILE USA INC 6% 01/03/23 | 884,000 | 914,939 | 0.07 |
| USD | 1,100,000 | HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A | 1,111,000 | 907,499 | 0.07 |
| USD | 790,000 | HCA INC 7.5% 15/02/22 * | 889,679 | 890,724 | 0.07 |
| USD | 925,000 | AMKOR TECHNO INC 6.375% 01/10/22 | 925,000 | 890,312 | 0.07 |
| USD | 1,000,000 | CONSOLIDATED COMM 6.5% 01/10/22 | 990,419 | 889,999 | 0.07 |
| USD | 800,000 | SOUTHERN COPPER 7.5% 27/07/35 * | 930,981 | 888,347 | 0.07 |
| USD | 900,000 | APX GROUP INC 6.375% 01/12/19 | 900,000 | 881,999 | 0.07 |
| EUR | 1,050,000 | RAIN CII CARBON 8.5% 15/01/21 REGS | 1,374,554 | 881,220 | 0.07 |
| USD | 827,000 | FRONTIER COMM 10.5% 15/09/22 | 833,463 | 869,275 | 0.07 |
| USD | 986,000 | ROSE ROCK MID 5.625% 15/07/22 | 967,253 | 867,679 | 0.07 |
| USD | 927,000 | WEST CORP 5.375% 15/07/22 144A | 921,388 | 862,109 | 0.07 |
| USD | 975,000 | ARTESYN ESC INC 9.75% 15/10/20 144A | 975,000 | 857,999 | 0.07 |
| USD | 925,000 | MRT MID PART/FIN 7.25% 15/02/21 | 931,215 | 855,624 | 0.07 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|-----------|---------|---------|
| USD | 845,000 | COMMSCOPE 5.5% 15/06/24 144A | 845,750 | 853,449 | 0.07 |
| USD | 996,000 | MICRON TECHNO 5.25% 01/08/23 144A | 999,563 | 849,089 | 0.07 |
| USD | 811,000 | COPANO ENERGY LLC 7.125% 01/04/21 * | 815,668 | 839,887 | 0.07 |
| USD | 830,000 | LEVEL 3 FINANCING 5.375% 15/01/24 | 830,000 | 832,074 | 0.07 |
| USD | 790,000 | CDW LLC/FIN 6% 15/08/22 | 794,144 | 823,574 | 0.06 |
| USD | 815,000 | UNITED RENTALS 5.875% 15/09/26 | 816,293 | 806,849 | 0.06 |
| USD | 754,000 | COTT BEVERAGES 6.75% 01/01/20 | 754,000 | 786,044 | 0.06 |
| USD | 860,000 | OASIS PETROLEUM 6.5% 01/11/21 | 680,163 | 784,749 | 0.06 |
| USD | 800,000 | CENTURYLINK INC 6.75% 01/12/23 W | 804,688 | 783,999 | 0.06 |
| USD | 745,000 | SOLERA LLC/FIN 10.5% 01/03/24 144A | 712,750 | 783,180 | 0.06 |
| USD | 725,000 | LIMITED BRANDS 5.625% 15/02/22 | 725,000 | 780,099 | 0.06 |
| USD | 800,000 | SOUTHERN STAR 5.125% 15/7/22 144A | 804,500 | 779,999 | 0.06 |
| USD | 775,000 | SLM CORP 5.5% 15/01/19 MTN | 766,297 | 771,606 | 0.06 |
| USD | 750,000 | COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A | 752,750 | 766,590 | 0.06 |
| USD | 875,000 | SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN | 866,968 | 765,625 | 0.06 |
| USD | 775,000 | SUNOCO LP/FIN 6.375% 01/04/23 144A | 775,000 | 765,313 | 0.06 |
| USD | 716,000 | POST HLDGS 6.75% 01/12/21 144A | 731,368 | 757,170 | 0.06 |
| USD | 765,000 | SIRIUS XM RADIO 5.375% 15/07/26 144 | 764,513 | 755,438 | 0.06 |
| USD | 747,000 | CITGO HOLDING 10.75% 15/02/20 144A | 717,759 | 752,603 | 0.06 |
| USD | 1,175,000 | CHESAPEAKE EN 5.375% 15/06/21 | 1,175,000 | 752,000 | 0.06 |
| EUR | 715,000 | XPO LOGISTICS INC 5.75% 15/06/21 RE | 766,714 | 746,768 | 0.06 |
| USD | 750,000 | ALLY FINANCIAL INC 3.5% 27/01/19 | 743,213 | 746,250 | 0.06 |
| USD | 730,000 | ZAYO GROUP LLC/CAP 6% 01/04/23 | 736,633 | 740,950 | 0.06 |
| USD | 670,000 | CEMEX FINANCE 9.375% 12/10/22 REGS | 768,563 | 737,000 | 0.06 |
| USD | 735,000 | DENBURY RESOURCES 9% 15/05/21 144A | 337,975 | 735,000 | 0.06 |
| USD | 770,000 | XPO LOGISTICS 6.5% 15/06/22 144A | 754,165 | 731,500 | 0.06 |
| USD | 940,000 | GRAFTECH INTL 6.375% 15/11/20 | 940,000 | 723,800 | 0.06 |
| USD | 1,000,000 | CITIZEN UTILITIES 7.45% 01/07/35 | 830,000 | 722,500 | 0.06 |
| USD | 725,000 | UNIVISION COMM 5.125% 15/02/25 144A | 732,219 | 716,844 | 0.06 |
| USD | 650,000 | POST HLDGS 7.75% 15/03/24 144A | 650,000 | 710,125 | 0.06 |
| USD | 2,075,000 | TEXAS COMPETITIVE 11.5% 01/10/20 14 | 1,862,765 | 705,500 | 0.06 |
| USD | 825,000 | SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22 | 827,375 | 705,375 | 0.06 |
| USD | 750,000 | TRIUMPH GROUP INC 4.875% 01/04/21 | 750,000 | 705,000 | 0.06 |
| USD | 725,000 | MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A | 717,000 | 692,375 | 0.05 |
| USD | 658,000 | T-MOBILE USA INC 6.731% 28/04/22 | 665,860 | 690,564 | 0.05 |
| USD | 685,000 | PLATFORM SPEC 10.375% 01/05/21 144A | 701,386 | 690,138 | 0.05 |
| USD | 670,000 | RCN TELE SER CAP 8.5% 15/08/20 144A | 679,500 | 686,750 | 0.05 |
| USD | 670,000 | REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/03/22 | 690,494 | 685,075 | 0.05 |
| USD | 675,000 | TRANSOCEAN INC 6% 15/03/18 | 662,598 | 683,438 | 0.05 |
| USD | 725,000 | JBS USA LLC 5.75% 15/06/25 144A | 722,143 | 681,500 | 0.05 |
| USD | 666,000 | EARTHLINK 8.875% 15/05/19 * | 635,763 | 679,320 | 0.05 |
| USD | 770,000 | ANNA MERGER SUB 7.75% 01/10/22 144A | 778,254 | 675,675 | 0.05 |
| USD | 946,000 | CALIFORNIA RES 8% 15/12/22 144A | 636,125 | 671,660 | 0.05 |
| USD | 690,000 | CONTINENTAL RESOURCES 5% 15/09/22 | 591,450 | 665,850 | 0.05 |
| USD | 565,000 | INTEL LEASE FIN CORP 8.25% 15/12/20 | 617,581 | 661,683 | 0.05 |
| USD | 632,000 | PEMEX MASTER 6.625% 15/06/35 * | 692,773 | 651,466 | 0.05 |
| USD | 2,150,000 | CONSTELL ENTS 11.125% 01/02/18 1ST | 2,119,535 | 645,000 | 0.05 |
| USD | 650,000 | PLAINS EXPLORATION 6.625% 01/05/21 | 413,063 | 643,500 | 0.05 |
| USD | 700,000 | WILLIAMS CO INC 4.55% 24/06/24 | 496,419 | 642,026 | 0.05 |
| USD | 650,000 | REALOGY GROUP 4.875% 01/06/23 144A | 645,249 | 641,875 | 0.05 |
| USD | 630,000 | TARGA RES PAR 6.875% 01/02/21 | 630,088 | 641,025 | 0.05 |
| USD | 715,000 | FERRELLGAS PART 6.75% 15/01/22 | 726,262 | 639,925 | 0.05 |
| USD | 652,000 | TENET HEALTHCARE 5% 01/03/19 | 654,950 | 630,810 | 0.05 |
| USD | 675,000 | ITALICS MERGER 7.125% 15/07/23 144A | 675,000 | 630,707 | 0.05 |
| USD | 604,000 | CIT GROUP INC 5.375% 15/05/20 | 629,269 | 630,425 | 0.05 |
| USD | 640,000 | TOWNSQUARE MEDIA 6.5% 01/04/23 144A | 624,100 | 628,800 | 0.05 |
| USD | 600,000 | DEAN FOODS 6.5% 15/03/23 144A | 603,750 | 620,250 | 0.05 |
| USD | 600,000 | WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/20 | 623,538 | 619,500 | 0.05 |
| USD | 590,000 | CARMIKE CINEMAS INC 6% 15/6/23 144A | 591,038 | 612,863 | 0.05 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 625,000 | GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22 | 621,250 | 612,500 | 0.05 |
| USD | 575,000 | SOUTHERNWESTERN ENR 7.5% 01/02/18 | 571,250 | 610,938 | 0.05 |
| USD | 600,000 | CINEMARK USA 5.125% 15/12/22 | 600,000 | 610,500 | 0.05 |
| USD | 595,000 | MIDCONTINENT COM 6.875% 15/08/23 14 | 595,688 | 609,875 | 0.05 |
| USD | 575,000 | SCOTTS MIRACLE 6% 15/10/23 144A | 575,000 | 605,188 | 0.05 |
| USD | 600,000 | HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24 | 605,891 | 602,400 | 0.05 |
| USD | 600,000 | SINOPEC 3.125% 24/04/23 REGS | 585,276 | 600,753 | 0.05 |
| USD | 668,000 | ALERIS INTL INC 7.875% 01/11/20 | 632,199 | 599,530 | 0.05 |
| EUR | 500,000 | BALL CORP 3.5% 15/12/20 | 530,700 | 597,485 | 0.05 |
| USD | 625,000 | AMERICAN AIRLINES 4.625% 1/3/20 144 | 625,000 | 596,875 | 0.05 |
| USD | 580,000 | HCA INC 5.375% 01/02/25 | 586,016 | 594,500 | 0.05 |
| USD | 665,000 | CSC HOLDINGS 5.25% 01/06/24 | 647,425 | 593,513 | 0.05 |
| USD | 610,000 | CEMEX FINANCE 6% 01/04/24 144A | 616,306 | 592,615 | 0.05 |
| EUR | 530,000 | HANESBRANDS FIN LUX 3.5% 15/6/24 RE | 593,687 | 592,094 | 0.05 |
| USD | 585,000 | FELCOR LODGING LP 6% 01/06/25 | 590,844 | 589,388 | 0.05 |
| USD | 550,000 | INTL LEASE FIN CORP 8.875% 01/09/17 | 651,063 | 586,438 | 0.05 |
| USD | 580,000 | CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 1 | 568,471 | 585,800 | 0.05 |
| USD | 600,000 | KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24 | 599,126 | 585,750 | 0.05 |
| USD | 570,000 | SINCLAIR TELE 5.875% 15/3/26 144 A | 574,756 | 581,400 | 0.05 |
| USD | 604,000 | ANTERO RESOURCE 5.125% 1/12/22 | 558,581 | 579,840 | 0.05 |
| USD | 575,000 | KB HOME 7% 15/12/21 | 578,443 | 577,875 | 0.05 |
| USD | 545,000 | MPH ACQUISITION 7.125% 01/06/24 144 | 547,788 | 572,250 | 0.05 |
| USD | 550,000 | RADIO SYSTEMS 8.375% 01/11/19 144A | 550,000 | 572,000 | 0.05 |
| USD | 630,000 | AK STEEL CORP 7.625% 01/10/21 | 528,898 | 571,725 | 0.05 |
| USD | 610,000 | LAREDO PETROLEUM 5.625% 15/01/22 | 571,920 | 570,350 | 0.04 |
| USD | 545,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.875% 1/4/24 144 | 544,970 | 565,438 | 0.04 |
| USD | 555,000 | GOODYEAR TIRE&RUBBER 5% 31/05/26 | 555,469 | 565,406 | 0.04 |
| USD | 561,000 | CROSSTEX ENERGY 7.125% 01/06/22 | 561,000 | 565,178 | 0.04 |
| USD | 615,000 | DRIVETIME AUTO GP 8% 01/06/21 144A | 615,000 | 564,263 | 0.04 |
| USD | 592,000 | ADVANCED MICRO 6.75% 01/03/19 | 579,574 | 562,400 | 0.04 |
| USD | 530,000 | ENERGY TRANSFER EQ 7.5% 15/10/20 | 516,587 | 561,800 | 0.04 |
| USD | 525,000 | NATHAN'S FAMOUS 10% 15/03/20 144A | 541,250 | 559,125 | 0.04 |
| USD | 600,000 | COMPASS MINERALS 4.875% 15/7/24 144 | 600,000 | 558,000 | 0.04 |
| USD | 928,000 | EP ENERGY/EVER 6.375% 15/06/23 | 662,861 | 556,800 | 0.04 |
| USD | 600,000 | JEFFERIES GROUP 7.375% 01/04/20 | 553,500 | 555,750 | 0.04 |
| USD | 600,000 | UNIVERSAL HOSPITAL 7.625% 15/08/20 | 603,730 | 551,625 | 0.04 |
| USD | 625,000 | FERRELLGAS LP 6.75% 15/06/23 144A | 625,000 | 548,438 | 0.04 |
| USD | 650,000 | ALTA MESA HDGS/FIN 9.625% 15/10/18 | 594,042 | 546,000 | 0.04 |
| USD | 542,000 | NEWFIELD EXPLOR CO 5.75% 30/01/22 | 481,763 | 544,710 | 0.04 |
| USD | 525,000 | LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21 | 541,940 | 544,688 | 0.04 |
| USD | 510,000 | RADIAN GROUP INC 7% 15/03/21 | 510,775 | 543,150 | 0.04 |
| USD | 535,000 | FIRST DATA CORP 7% 01/12/23 144A | 539,843 | 543,079 | 0.04 |
| USD | 470,000 | ALLY FINANCIAL 8% 01/11/31 * | 549,589 | 542,850 | 0.04 |
| USD | 500,000 | MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21 | 504,500 | 541,250 | 0.04 |
| USD | 575,000 | TIME INC 5.75% 15/04/22 144A | 489,843 | 540,500 | 0.04 |
| USD | 550,000 | SUBURBAN PROPANE 5.5% 01/06/24 | 550,000 | 540,375 | 0.04 |
| USD | 550,000 | PLAINS EXPLOR 6.75% 01/02/22 | 363,688 | 539,000 | 0.04 |
| USD | 525,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144 | 531,344 | 532,613 | 0.04 |
| USD | 550,000 | CALPINE CORP 5.5% 01/02/24 | 550,000 | 530,750 | 0.04 |
| USD | 530,000 | SABINE PASS LIQ 5.875% 30/6/26 144A | 530,000 | 529,338 | 0.04 |
| USD | 525,000 | GIBRALTAR STEEL 6.25% 01/02/21 | 525,000 | 527,625 | 0.04 |
| USD | 530,000 | KINDRED HEALTH 8.75% 15/01/23 | 541,250 | 525,972 | 0.04 |
| USD | 525,000 | ICON HEALTH FIT 11.875% 15/10/16 14 | 524,001 | 522,375 | 0.04 |
| USD | 675,000 | SANCHEZ ENERY CORP 6.125% 15/1/23 | 578,231 | 521,438 | 0.04 |
| USD | 505,000 | REYNOLDS GRP ISS 7% 15/07/24 144A | 505,000 | 519,898 | 0.04 |
| USD | 500,000 | AMERICAN GREETINGS 7.375% 01/12/21 | 500,000 | 518,750 | 0.04 |
| USD | 495,000 | DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144 | 495,000 | 515,389 | 0.04 |
| USD | 527,000 | ANTERO RESOURCE FIN 5.375% 01/11/21 | 499,604 | 515,143 | 0.04 |
| USD | 500,000 | DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26 144A | 500,000 | 513,750 | 0.04 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 500,000 | WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A | 500,000 | 513,750 | 0.04 |
| USD | 500,000 | CHENIERE CORP CHRIS 7% 30/6/24 144A | 500,000 | 512,500 | 0.04 |
| USD | 525,000 | CALPINE CORP 5.375% 15/01/23 | 520,261 | 511,875 | 0.04 |
| USD | 500,000 | LUCENT TECHNOLOGIES 6.5% 15/01/28 * | 367,500 | 511,250 | 0.04 |
| USD | 480,000 | SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A | 554,172 | 510,658 | 0.04 |
| USD | 540,000 | AK STEEL CORP 7.625% 15/05/20 | 497,029 | 507,600 | 0.04 |
| USD | 525,000 | REVLON CONSUMER 5.75% 15/02/21 | 525,000 | 506,625 | 0.04 |
| USD | 515,000 | LEVEL 3 FIN INC 5.25% 15/3/26 144A | 515,000 | 504,700 | 0.04 |
| USD | 475,000 | GANNETT CO 6.375% 15/10/23 | 478,038 | 504,688 | 0.04 |
| EUR | 500,000 | HUNTSMAN INTL 4.25% 01/04/25 | 539,946 | 502,721 | 0.04 |
| USD | 500,000 | ECO SERVICES 8.5% 01/11/22 144A | 500,000 | 500,000 | 0.04 |
| USD | 488,000 | TENET HEALTHCARE 8.125% 1/4/22 | 510,905 | 497,760 | 0.04 |
| USD | 500,000 | NRG ENERGY INC 7.25% 15/05/26 144A | 500,288 | 496,250 | 0.04 |
| USD | 500,000 | KINDRED HEALTH 8% 15/01/20 | 514,000 | 495,000 | 0.04 |
| USD | 601,000 | COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22 | 595,390 | 492,820 | 0.04 |
| USD | 475,000 | SALLY HDGS/CAP 5.75% 01/06/22 | 503,094 | 492,219 | 0.04 |
| USD | 475,000 | ABC SUPPLY 5.75% 15/12/23 144A | 475,000 | 491,625 | 0.04 |
| USD | 485,000 | ANTERO RESOURCE FIN 6% 01/12/20 | 484,095 | 490,257 | 0.04 |
| USD | 465,000 | POST HLDGS 7.375% 15/02/22 | 484,464 | 489,924 | 0.04 |
| USD | 525,000 | NEW ENTERPRISE 11% 01/09/18 * | 508,193 | 486,938 | 0.04 |
| USD | 450,000 | WILLIAMS COS 7.875% 01/09/21 | 377,188 | 483,750 | 0.04 |
| USD | 435,000 | HCA INC 6.50% 15/02/20 | 482,649 | 483,394 | 0.04 |
| USD | 482,000 | EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36 | 492,876 | 482,603 | 0.04 |
| USD | 499,000 | PATRIOT MERGER CORP 9% 15/07/21 144 | 496,707 | 479,040 | 0.04 |
| USD | 450,000 | SPECTRUM BRANDS ESC 6.625% 15/11/22 | 450,000 | 477,563 | 0.04 |
| USD | 465,000 | L BRANDS 6.875% 01/11/35 | 465,000 | 476,300 | 0.04 |
| USD | 450,000 | GENCORP INC 7.125% 15/03/21 | 450,000 | 474,840 | 0.04 |
| USD | 450,000 | LEAR CORP 5.375% 15/03/24 | 450,000 | 473,625 | 0.04 |
| USD | 700,000 | HEXION US FINANCE 9% 15/11/20 | 607,688 | 472,500 | 0.04 |
| USD | 475,000 | TRANSIDGM INC 6.375% 15/06/26 144A | 475,000 | 471,438 | 0.04 |
| USD | 455,000 | ZAYO GRP LLC/CAP 6.375% 15/5/25 | 453,227 | 466,375 | 0.04 |
| USD | 500,000 | DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24 | 491,250 | 465,000 | 0.04 |
| USD | 440,000 | T-MOBILE USA INC 6.836% 28/04/23 | 460,863 | 464,750 | 0.04 |
| EUR | 405,000 | IMS HEALTH INC 4.125% 01/04/23 REGS | 427,842 | 456,951 | 0.04 |
| USD | 445,000 | AMSURG CORP 5.625% 15/07/22 | 445,870 | 456,125 | 0.04 |
| USD | 500,000 | ACCURIDE CORP 9.5% 01/08/18 | 505,025 | 455,000 | 0.04 |
| USD | 450,000 | COMM SALES&LEAS 8.25% 15/10/23 | 450,985 | 454,500 | 0.04 |
| USD | 450,000 | CPG MERGER SUB 8% 01/10/21 144A | 474,750 | 450,000 | 0.04 |
| USD | 450,000 | ALLY FINANCIAL INC 3.25% 05/11/18 | 449,361 | 449,829 | 0.04 |
| USD | 450,000 | NBTY INC 7.625% 15/05/21 144A | 450,000 | 447,750 | 0.04 |
| USD | 375,000 | RITE AID CORP 7.7% 15/02/27 | 382,063 | 447,188 | 0.04 |
| USD | 628,000 | GENON ENERGY 9.875% 15/10/20 WI | 619,571 | 445,880 | 0.04 |
| USD | 525,000 | CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P | 508,883 | 444,938 | 0.04 |
| USD | 440,000 | NEXSTAR BROAD 6.125% 15/02/22 144A | 440,000 | 444,400 | 0.03 |
| USD | 430,000 | ALBERTSONS LLC 6.625% 15/06/24 144A | 430,000 | 442,900 | 0.03 |
| USD | 430,000 | GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A | 424,076 | 440,750 | 0.03 |
| USD | 445,000 | NATIONSTAR MORT/CAP 6.5% 01/08/18 | 445,779 | 439,215 | 0.03 |
| USD | 450,000 | CEB INC 5.625% 15/06/23 144A | 450,000 | 437,625 | 0.03 |
| USD | 425,000 | LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144 | 427,531 | 436,688 | 0.03 |
| USD | 460,000 | BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A | 458,076 | 434,700 | 0.03 |
| USD | 425,000 | SPEEDWAY MOTORSP 5.125% 01/02/23 | 425,000 | 432,438 | 0.03 |
| USD | 425,000 | AMERICAN CAP 6.5% 15/09/18 144A | 425,000 | 432,438 | 0.03 |
| USD | 445,000 | NRG ENERGY INC 6.25% 15/07/22 | 424,415 | 431,743 | 0.03 |
| USD | 507,000 | SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32 | 439,606 | 431,584 | 0.03 |
| USD | 425,000 | ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24 14 | 440,938 | 431,375 | 0.03 |
| USD | 415,000 | LIBERTY MEDIA 8.25% 01/02/30 | 433,881 | 430,563 | 0.03 |
| USD | 415,000 | TOLL BROS FINANCE 5.625% 15/01/24 | 416,760 | 430,563 | 0.03 |
| USD | 550,000 | TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A | 433,113 | 430,375 | 0.03 |
| USD | 425,000 | PLAINS EXPLORATION 6.5% 15/11/20 | 317,019 | 425,901 | 0.03 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 410,000 | TESORO LOGISTICS 6.375% 01/05/24 | 411,875 | 425,375 | 0.03 |
| USD | 450,000 | AK STEEL CORP 8.375% 01/04/22 | 417,750 | 424,688 | 0.03 |
| USD | 425,000 | MEMORIAL RES 5.875% 01/07/22 | 425,000 | 423,938 | 0.03 |
| USD | 400,000 | T-MOBILE USA 6.625% 01/04/23 | 409,620 | 423,752 | 0.03 |
| USD | 440,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 6.25% 15/04/23 | 391,156 | 423,500 | 0.03 |
| USD | 547,000 | UNIT CORP 6.625% 15/05/21 | 551,364 | 422,558 | 0.03 |
| USD | 460,000 | CRESTWOOD MID 6.125% 01/03/22 | 452,300 | 422,050 | 0.03 |
| USD | 420,000 | GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A | 420,000 | 421,050 | 0.03 |
| USD | 500,000 | RRI ENERGY INC 7.875% 15/06/17 | 485,938 | 418,750 | 0.03 |
| USD | 420,000 | A SCHULMAN INC 6.875% 01/06/23 144A | 420,195 | 417,900 | 0.03 |
| USD | 425,000 | AV HOMES 8.5% 01/07/19 | 425,000 | 417,563 | 0.03 |
| USD | 425,000 | TEMPUR SEALY INTL 5.5% 15/6/26 144A | 425,000 | 417,563 | 0.03 |
| USD | 400,000 | JBS USA LLC 8.25% 01/02/20 144A | 396,159 | 414,000 | 0.03 |
| USD | 400,000 | VIASAT INC 6.875% 15/06/20 | 410,463 | 413,000 | 0.03 |
| USD | 390,000 | PRIME SECSRVC 9.25% 15/05/23 144A | 390,573 | 412,425 | 0.03 |
| USD | 425,000 | PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI | 425,000 | 412,250 | 0.03 |
| USD | 425,000 | ANTERO RESOURCE 5.625% 1/6/23 | 421,875 | 412,250 | 0.03 |
| USD | 405,000 | REYNOLDS GRP ISS 5.125% 15/7/23 144 | 405,000 | 410,063 | 0.03 |
| USD | 425,000 | CENTURY COMM 6.875% 15/05/22 | 419,808 | 408,000 | 0.03 |
| USD | 450,000 | TERRAFORM GLOBAL 9.75% 15/08/22 144 | 444,389 | 407,250 | 0.03 |
| USD | 475,000 | DJO FINCO LTD 8.125% 15/06/21 144A | 475,000 | 406,125 | 0.03 |
| USD | 400,000 | ANIXTER INC 5.125% 01/10/21 | 400,000 | 406,000 | 0.03 |
| USD | 380,000 | HCA HLDG 6.25% 15/02/21 | 393,980 | 403,750 | 0.03 |
| USD | 425,000 | LAREDO PETROLEUM INC 6.25% 15/03/23 | 426,951 | 403,750 | 0.03 |
| USD | 461,000 | WPX ENERGY INC 5.25% 15/09/24 | 432,887 | 403,375 | 0.03 |
| USD | 400,000 | ASHTREAD CAPITAL 5.625% 1/10/24 144 | 400,000 | 402,000 | 0.03 |
| USD | 400,000 | RHP HOTEL /RHP FIN 5% 15/04/23 | 400,000 | 400,000 | 0.03 |
| USD | 425,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.5% 15/08/17 | 341,625 | 399,500 | 0.03 |
| USD | 450,000 | QUAD GRAPHICS 7% 01/05/22 | 445,565 | 397,125 | 0.03 |
| USD | 415,000 | COMMERCIAL METALS 4.875% 15/05/23 | 398,159 | 392,175 | 0.03 |
| USD | 400,000 | FREEPORT-MCMORAN 2.375% 15/03/18 | 314,294 | 392,080 | 0.03 |
| USD | 402,000 | JBS USA LLC 5.875% 15/07/24 144A | 402,000 | 389,438 | 0.03 |
| USD | 375,000 | HCA INC 5.25% 15/06/26 | 375,000 | 389,063 | 0.03 |
| USD | 400,000 | COVANTA HDGS CORP 5.875% 01/03/24 | 388,144 | 388,000 | 0.03 |
| USD | 380,000 | WEYERHAEUSER REAL 5.875% 15/6/24 | 372,970 | 386,175 | 0.03 |
| USD | 365,000 | SONIC AUTOMOTIVE 7% 15/07/22 | 393,744 | 384,163 | 0.03 |
| USD | 375,000 | CHURCHILL DOWNS 5.375% 15/12/21 144 | 378,750 | 382,969 | 0.03 |
| USD | 365,000 | HD SUPPLY INC 7.5% 15/07/20 | 375,406 | 382,301 | 0.03 |
| USD | 350,000 | MGM RESORTS INTL 6.75% 01/10/20 | 376,995 | 381,717 | 0.03 |
| USD | 452,000 | CHESAPEAKE ENERGY 8% 15/12/22 WI | 496,959 | 380,810 | 0.03 |
| USD | 385,000 | SPRINT NEXTEL CORP 11.5% 15/11/21 | 394,483 | 380,380 | 0.03 |
| USD | 445,000 | VIKING CRUISES 8.5% 15/10/22 144A | 467,763 | 379,363 | 0.03 |
| USD | 365,000 | ELDORADO RES INC 7% 01/08/23 WI | 364,933 | 378,688 | 0.03 |
| USD | 395,000 | HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21 | 379,842 | 378,213 | 0.03 |
| USD | 375,000 | MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 | 375,000 | 376,875 | 0.03 |
| USD | 390,000 | SIGNODE IND GRP 6.375% 01/05/22 144 | 388,855 | 372,938 | 0.03 |
| USD | 375,000 | SHEA HOMES LP 5.875% 01/04/23 144A | 375,263 | 371,250 | 0.03 |
| USD | 375,000 | HALYARD HEALTH 6.25% 15/10/22 | 375,000 | 365,625 | 0.03 |
| USD | 425,000 | OUTERWALL 5.875% 15/06/21 | 400,938 | 365,500 | 0.03 |
| USD | 383,000 | ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22 | 359,406 | 361,027 | 0.03 |
| USD | 380,000 | PENSKO AUTOMOTIVE GP 5.5% 15/05/26 | 380,000 | 359,100 | 0.03 |
| USD | 338,000 | CABLEVISION SYSTEMS 8.625% 15/09/17 | 358,085 | 357,435 | 0.03 |
| USD | 360,000 | TRIBUNE MEDIA 5.875% 15/07/22 | 360,000 | 357,300 | 0.03 |
| USD | 360,000 | ALLY FINANCIAL INC 4.125% 13/02/22 | 355,168 | 356,623 | 0.03 |
| USD | 350,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24 | 343,298 | 356,563 | 0.03 |
| USD | 350,000 | TARGA RESOURCES 5% 15/01/18 | 350,000 | 356,125 | 0.03 |
| USD | 400,000 | HILLMAN GROUP INC 6.375% 15/7/22 14 | 400,269 | 356,000 | 0.03 |
| USD | 340,000 | OWENS-BROCKWAY 6.375% 15/08/25 144A | 346,994 | 355,300 | 0.03 |
| USD | 360,000 | COMPASS INV/ONEX 7.75% 15/01/21 144 | 360,143 | 354,600 | 0.03 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|--------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 600,000 | CHAPARRAL ENERGY 9.875% 01/10/20 | 586,032 | 354,000 | 0.03 |
| USD | 350,000 | MERCER INTL 7% 01/12/19 | 350,000 | 353,500 | 0.03 |
| USD | 340,000 | NORTEK INC 8.5% 15/04/21 | 366,685 | 352,750 | 0.03 |
| USD | 350,000 | IRON MOUNTAIN 4.375% 01/06/21 144A | 350,000 | 352,625 | 0.03 |
| USD | 355,000 | FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 144A | 354,851 | 349,675 | 0.03 |
| USD | 350,000 | SABINE PASS LIQ 5.625% 1/03/25 | 346,938 | 348,688 | 0.03 |
| USD | 416,000 | HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI | 372,909 | 347,901 | 0.03 |
| USD | 350,000 | TARGA RESOURCES 4.125% 15/11/19 | 350,000 | 346,500 | 0.03 |
| USD | 325,000 | MPT OPER PARTNER 6.375% 01/03/24 | 325,000 | 346,125 | 0.03 |
| USD | 375,000 | TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22 | 375,000 | 345,000 | 0.03 |
| USD | 382,000 | WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21 | 249,125 | 343,800 | 0.03 |
| USD | 575,000 | CHAPARRAL ENERGY 7.625% 15/11/22 | 509,375 | 339,250 | 0.03 |
| USD | 325,000 | MATCH GRP 6.375% 01/06/24 144A | 325,000 | 338,000 | 0.03 |
| GBP | 245,000 | LYNX II CORP 7% 15/04/23 REGs | 383,817 | 337,451 | 0.03 |
| USD | 350,000 | ACCESS MIDST PART 4.875% 15/05/23 | 363,063 | 336,987 | 0.03 |
| USD | 375,000 | WINDSTREAM CORP 7.5% 01/06/22 WI | 362,438 | 336,563 | 0.03 |
| USD | 325,000 | SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21 | 325,000 | 333,938 | 0.03 |
| USD | 340,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20 | 351,867 | 333,200 | 0.03 |
| USD | 375,000 | WILLIAMS CIE 3.7% 15/01/23 | 302,563 | 331,875 | 0.03 |
| USD | 305,000 | ACTIVISION BLIZ 6.125% 15/09/23 144A | 330,347 | 331,688 | 0.03 |
| USD | 450,000 | WINDSTREAM HDGS 6.75% 01/04/28 | 432,000 | 330,750 | 0.03 |
| USD | 325,000 | PENN NTL GAMING 5.875% 01/11/21 | 325,000 | 330,688 | 0.03 |
| EUR | 297,000 | VWR FUNDING 4.625% 15/04/22 REGS | 324,342 | 327,834 | 0.03 |
| USD | 325,000 | RADIAN GROUP INC 5.25% 15/06/20 | 325,000 | 327,438 | 0.03 |
| USD | 355,000 | HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A | 345,600 | 326,600 | 0.03 |
| USD | 325,000 | COGENT COM 5.375% 01/03/22 144A | 325,000 | 325,813 | 0.03 |
| USD | 350,000 | RR DONNELLEY 6.5% 15/11/23 | 350,000 | 325,500 | 0.03 |
| USD | 310,000 | PEMEX PROJ FDG MAS 5.75% 01/03/18 | 324,317 | 324,155 | 0.03 |
| USD | 320,000 | MEDNAX INC 5.25% 01/12/23 144A | 320,675 | 323,200 | 0.03 |
| USD | 330,000 | TAYLOR MORRISON 5.625% 01/03/24 144A | 330,000 | 321,750 | 0.03 |
| USD | 310,000 | SINCLAIR TELEVISION 5.375% 1/04/21 | 309,913 | 319,300 | 0.03 |
| USD | 315,000 | STERIGENICS NORD 6.5% 15/05/23 144A | 318,124 | 318,938 | 0.03 |
| USD | 310,000 | WILLIAM LYON HOME 8.5% 15/11/20 | 318,561 | 318,525 | 0.03 |
| USD | 335,000 | GENESIS ENERGY 5.75% 15/02/21 | 336,047 | 316,575 | 0.02 |
| USD | 305,000 | PRESTIGE BRANDS 6.375% 01/03/24 144 | 305,731 | 316,438 | 0.02 |
| EUR | 270,000 | MPT OPER PARTNER 5.75% 01/10/20 EMT | 365,175 | 315,937 | 0.02 |
| USD | 290,000 | LENNAR CORP 12.25% 01/06/17 B | 369,750 | 315,520 | 0.02 |
| USD | 300,000 | BEACON ROOF 6.375% 01/10/23 | 300,000 | 314,250 | 0.02 |
| USD | 305,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.25% 30/09/22 | 305,012 | 313,006 | 0.02 |
| USD | 300,000 | BUILDING MATERIALS 9% 15/09/18 144A | 312,750 | 312,750 | 0.02 |
| USD | 335,000 | ENERGY TRANSFER EQ 5.5% 01/06/27 | 329,975 | 312,388 | 0.02 |
| USD | 300,000 | CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A | 300,000 | 312,000 | 0.02 |
| USD | 325,000 | ACCESS MIDST PART 4.875% 15/03/24 | 294,938 | 311,227 | 0.02 |
| USD | 420,000 | NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a | 394,800 | 310,800 | 0.02 |
| USD | 302,000 | CCO HDGS LLC 5.75% 15/02/26 144A | 301,668 | 310,492 | 0.02 |
| USD | 350,000 | DYNEGY INC 5.875% 01/06/23 | 349,205 | 308,000 | 0.02 |
| USD | 300,000 | REALOGY GROUP 5.25% 01/12/21 144A | 300,340 | 307,125 | 0.02 |
| USD | 300,000 | SINCLAIR TELE 5.625% 01/08/24 144A | 298,115 | 306,750 | 0.02 |
| USD | 315,000 | HCA INC 7.5% 15/11/95 | 290,397 | 305,550 | 0.02 |
| USD | 300,000 | KFC HOLD PIZZA 5.25% 01/06/26 144A | 300,000 | 305,250 | 0.02 |
| USD | 300,000 | KFC HOLD PIZZA 5% 01/06/24 144A | 300,000 | 305,250 | 0.02 |
| USD | 770,000 | COMMUNITY CHOICE 10.75% 1/05/19 WI | 781,173 | 304,150 | 0.02 |
| USD | 295,000 | NBCUNIVERSAL ENT 5.25% 20/09/49 144 | 295,000 | 304,018 | 0.02 |
| USD | 300,000 | PLAINS ALL AMER PIP 5.875% 15/08/16 | 302,190 | 301,436 | 0.02 |
| USD | 306,000 | ALERE INC 6.5% 15/06/20 | 309,630 | 301,410 | 0.02 |
| USD | 300,000 | FRONTIER COMM 8.75% 15/04/22 | 341,576 | 300,000 | 0.02 |
| USD | 300,000 | GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22 | 300,000 | 295,500 | 0.02 |
| USD | 286,000 | CONTINENTAL RES 7.125% 01/04/21 | 272,623 | 295,295 | 0.02 |
| USD | 350,000 | TITAN INTL INC 6.875% 01/10/20 | 350,000 | 294,438 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|---------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 320,000 | PAPERWORKS 9.5% 15/08/19 144A | 325,231 | 294,400 | 0.02 |
| USD | 285,000 | MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A | 286,500 | 291,413 | 0.02 |
| USD | 320,000 | NGL ENERGY/FIN 5.125% 15/07/19 | 320,000 | 289,600 | 0.02 |
| USD | 286,000 | GEO GROUP INC 6% 15/04/26 | 286,000 | 288,860 | 0.02 |
| USD | 275,000 | HRG GROUP 7.875% 15/07/19 | 287,375 | 288,063 | 0.02 |
| USD | 275,000 | SALLY HDGS/CAP 5.625% 01/12/25 | 275,000 | 287,375 | 0.02 |
| USD | 300,000 | ARUBA INV 8.75% 15/02/23 144A | 300,000 | 287,250 | 0.02 |
| USD | 274,000 | SMITHFIELD FOODS 6.625% 15/08/22 | 300,030 | 286,930 | 0.02 |
| USD | 325,000 | RJS POWER HDG 5.125% 15/07/19 144A | 325,000 | 286,000 | 0.02 |
| USD | 275,000 | CENTRAL GARDEN PET 6.125% 15/11/23 | 275,216 | 286,000 | 0.02 |
| USD | 300,000 | SELECT MEDICAL 6.375% 01/06/21 | 302,813 | 285,750 | 0.02 |
| USD | 275,000 | CBS OUT AMER 5.625% 15/02/24 WI | 286,313 | 283,250 | 0.02 |
| USD | 270,000 | OWENS-BROCKWAY 5.875% 15/08/23 144A | 270,897 | 282,994 | 0.02 |
| USD | 275,000 | HILCORP ENERGY 7.625% 15/04/21 144A * | 277,432 | 282,563 | 0.02 |
| USD | 275,000 | CABLEVISION SYSTEMS 8% 15/04/20 | 282,704 | 282,013 | 0.02 |
| USD | 275,000 | TREEHOUSE FOODS INC 4.875% 15/3/22 | 266,063 | 280,500 | 0.02 |
| USD | 275,000 | SERVICE CORP INTL 4.5% 15/11/20 | 283,896 | 279,813 | 0.02 |
| USD | 270,000 | H&E EQUIPMENTS SVCS 7% 01/09/22 WI | 277,471 | 279,450 | 0.02 |
| USD | 270,000 | BERRY PLASTICS CORP 6% 15/10/22 | 271,944 | 279,113 | 0.02 |
| USD | 352,000 | FREEMPORT-MCMORAN 5.45% 15/03/43 | 248,613 | 278,960 | 0.02 |
| USD | 265,000 | STEEL DYNAMICS INC 6.375% 15/08/22 | 275,024 | 278,250 | 0.02 |
| USD | 272,000 | SS&C TECH HOLD 5.875% 15/07/23 | 272,000 | 278,120 | 0.02 |
| USD | 275,000 | CEQUEL COM HLD 6.375% 15/09/20 144A | 276,000 | 278,094 | 0.02 |
| USD | 261,000 | FAMILY TREE ESC 5.75% 01/03/23 144A | 262,468 | 277,313 | 0.02 |
| USD | 275,000 | WEYERHAEUSER REAL 4.375% 15/6/19 | 271,959 | 276,375 | 0.02 |
| USD | 285,000 | QUICKEN LOANS INC 5.75% 1/5/25 144A | 279,872 | 275,025 | 0.02 |
| USD | 260,000 | DIAMONDBACK EN 7.625% 01/10/21 | 268,440 | 274,625 | 0.02 |
| USD | 275,000 | STANDARDAERO AVIAT 10% 15/07/23 144 | 271,288 | 274,313 | 0.02 |
| USD | 280,000 | CALPINE CORP 5.75% 15/01/25 | 280,000 | 272,300 | 0.02 |
| USD | 250,000 | BUILDERS FIRSTS 10.75% 15/8/23 144A | 232,375 | 271,875 | 0.02 |
| USD | 260,000 | BUILDERS FIRSTS 7.625% 01/06/21 144 | 273,684 | 271,700 | 0.02 |
| USD | 265,000 | ENTEGRIS INC 6% 01/04/22 144A | 268,799 | 271,294 | 0.02 |
| USD | 259,000 | T-MOBILE USA INC 6.375% 01/03/25 | 260,057 | 270,655 | 0.02 |
| USD | 265,000 | MATADOR RES 6.875% 15/04/23 | 268,045 | 270,300 | 0.02 |
| USD | 325,000 | NATIONSTAR MORT 6.5% 01/06/22 | 312,844 | 269,750 | 0.02 |
| USD | 270,000 | RICE ENERGY 6.25% 01/05/22 | 239,631 | 267,975 | 0.02 |
| USD | 300,000 | RR DONNELLEY 6% 01/04/24 | 300,000 | 266,814 | 0.02 |
| USD | 275,000 | IRON MOUNTAIN US 5.375% 01/06/26 14 | 275,000 | 266,750 | 0.02 |
| USD | 258,000 | TESORO LOGISTICS 5.875% 1/10/20 | 258,000 | 263,805 | 0.02 |
| USD | 245,000 | KB HOME 8% 15/03/20 | 243,844 | 262,150 | 0.02 |
| USD | 250,000 | LEVEL 3 FIN INC 6.125% 15/1/21 | 263,750 | 260,498 | 0.02 |
| USD | 283,000 | WPX ENERGY INC 6% 15/01/22 | 245,583 | 260,360 | 0.02 |
| USD | 264,000 | SUMMIT MAT LLC 6.125% 15/07/23 | 263,901 | 260,204 | 0.02 |
| USD | 240,000 | INTL LEASE FINANCE 5.875% 15/08/22 | 240,000 | 259,800 | 0.02 |
| USD | 302,000 | SPRINT CORP 7.25% 15/09/21 | 289,640 | 258,210 | 0.02 |
| USD | 245,000 | SPRINT NEXTEL 7% 01/03/20 144A | 245,000 | 256,513 | 0.02 |
| USD | 245,000 | SUN PRODUCTS 7.75% 15/03/21 144A | 212,505 | 253,881 | 0.02 |
| USD | 250,000 | CBS OUT AMER 5.25% 15/02/22 WI | 250,000 | 253,750 | 0.02 |
| USD | 275,000 | CRESTWOOD MID 6.25% 01/04/23 144A | 275,000 | 253,000 | 0.02 |
| USD | 250,000 | BANKRATE INC 6.125% 15/08/18 144A | 248,125 | 251,395 | 0.02 |
| USD | 239,000 | JAC HOLDING 11.5% 01/10/19 144A | 239,000 | 250,950 | 0.02 |
| USD | 240,000 | NETFLIX INC 5.75% 01/03/24 | 243,575 | 250,200 | 0.02 |
| USD | 250,000 | SHEA HOMES LP 6.125% 01/04/25 144A | 250,000 | 248,750 | 0.02 |
| USD | 228,000 | CHARTER COMM 4.908% 23/07/25 144A | 228,000 | 248,620 | 0.02 |
| USD | 250,000 | GROUP 1 AUTO 5.25% 15/12/23 144A | 250,000 | 245,625 | 0.02 |
| USD | 500,000 | ASTON ESCROW CORP 9.5% 15/8/21 144A | 500,000 | 245,000 | 0.02 |
| USD | 231,000 | PRIME SECRCV 9.25% 15/05/23 REGS | 234,575 | 244,283 | 0.02 |
| USD | 240,000 | AK STEEL CORP 7.5% 15/07/23 | 240,109 | 243,600 | 0.02 |
| USD | 235,000 | TESORO LOGISTIC LP 6.125% 15/10/21 | 236,713 | 243,225 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 235,000 | PARTY CITY HDG 6.125% 15/08/23 144A | 235,000 | 242,931 | 0.02 |
| USD | 245,000 | ZACHRY HDGS INC 7.5% 01/02/20 144A | 250,405 | 242,550 | 0.02 |
| USD | 245,000 | NEW ALBERTSONS 8.7% 01/05/30 | 165,375 | 241,938 | 0.02 |
| USD | 240,000 | CONCHO RESOURCES 5.5% 01/10/22 | 248,070 | 241,200 | 0.02 |
| USD | 290,000 | TALEN ENERGY SUPPLY 6.5% 01/06/25 | 286,819 | 240,700 | 0.02 |
| USD | 259,000 | CHS COMMUNITY 7.125% 15/07/20 | 259,697 | 240,116 | 0.02 |
| USD | 216,000 | PINNACLE MERGER SUB 9.5% 01/10/23 1 | 218,364 | 239,760 | 0.02 |
| USD | 290,000 | PINNACLE OPERATING 9% 15/11/20 144A | 292,756 | 239,250 | 0.02 |
| USD | 243,000 | MPG HOLDCO I 7.375% 15/10/22 | 243,028 | 238,748 | 0.02 |
| USD | 230,000 | PROJECT HOMESTAKE 8.875% 1/3/23 144 | 230,011 | 238,050 | 0.02 |
| USD | 235,000 | FIRST DATA CORP 5.375% 15/8/23 144A | 235,000 | 237,938 | 0.02 |
| USD | 316,000 | CLEAR CHANNEL COMM 9% 15/12/19 | 329,430 | 236,210 | 0.02 |
| USD | 270,000 | FREEPORT-MCMORAN 3.875% 15/03/23 | 190,683 | 234,225 | 0.02 |
| USD | 225,000 | CYRUSONE LP/FIN 6.375% 15/11/22 | 225,000 | 234,000 | 0.02 |
| USD | 225,000 | STANDARD IND 5.125% 15/02/21 144A | 225,000 | 231,188 | 0.02 |
| USD | 240,000 | TENET HEALTHCARE 6.75% 15/06/23 | 241,581 | 229,800 | 0.02 |
| USD | 225,000 | TESORO CORP 5.375% 01/10/22 | 230,063 | 229,500 | 0.02 |
| USD | 225,000 | MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21 | 225,000 | 229,500 | 0.02 |
| USD | 225,000 | SURGICAL CARE AFF 6% 01/04/23 144A | 225,850 | 229,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NEPTUNE FINCO 10.875% 15/10/25 144A | 208,000 | 227,900 | 0.02 |
| USD | 250,000 | CLEAR CHANNEL WORL 7.625% 15/3/20 A | 250,000 | 224,375 | 0.02 |
| USD | 225,000 | LENNAR CORP 4.875% 15/12/23 | 223,130 | 224,213 | 0.02 |
| USD | 220,000 | ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24 | 220,000 | 223,300 | 0.02 |
| USD | 325,000 | K HOVNANIAN ENT 8% 01/11/19 144A | 325,000 | 222,625 | 0.02 |
| USD | 250,000 | ASSOC MATERIAL 9.125% 01/11/17 | 194,219 | 222,500 | 0.02 |
| USD | 225,000 | ENERSYS 5% 30/04/23 144A | 225,000 | 222,188 | 0.02 |
| USD | 215,000 | GANNETT CO 5.125% 15/10/19 | 214,506 | 221,450 | 0.02 |
| USD | 250,000 | INTREPID AVIATION 6.875% 15/2/19 14 | 229,375 | 220,625 | 0.02 |
| USD | 225,000 | ICAHN ENTER 6% 01/08/20 | 223,680 | 220,500 | 0.02 |
| USD | 225,000 | KINDER MORGAN 5.4% 01/09/44 | 198,000 | 219,602 | 0.02 |
| USD | 180,000 | INTL LEASE FIN CORP 8.625% 15/01/22 | 193,690 | 219,150 | 0.02 |
| USD | 307,000 | EP ENERGY/EVER 9.375% 01/05/20 | 200,273 | 217,970 | 0.02 |
| USD | 211,000 | AES CORP 6% 15/05/26 | 212,438 | 215,220 | 0.02 |
| USD | 217,000 | LEVEL 3 FIN INC 5.125% 01/5/23 | 217,247 | 215,101 | 0.02 |
| USD | 210,000 | FIRST DATA CORP 7% 01/12/2023 REGS | 210,000 | 213,171 | 0.02 |
| USD | 225,000 | CRESTWOOD MIDSTREAM 6% 15/12/20 | 225,000 | 212,625 | 0.02 |
| USD | 200,000 | QORVO INC 7% 01/12/25 144A | 200,000 | 211,000 | 0.02 |
| USD | 225,000 | SPRINGLEAF FINANCE 6% 01/06/20 WI | 230,625 | 210,375 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NEPTUNE FINCO 6.625% 15/10/25 REGS | 200,000 | 210,000 | 0.02 |
| USD | 250,000 | SUNCOKE ENERGY 7.375% 01/02/20 144A | 255,000 | 210,000 | 0.02 |
| USD | 203,000 | HCA INC 5% 15/03/24 | 203,000 | 209,598 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TESORO LOGISTICS 5.5% 15/10/19 | 200,000 | 209,000 | 0.02 |
| USD | 205,000 | ADS WASTE HLDGS 8.25% 01/10/20 | 211,073 | 207,050 | 0.02 |
| USD | 205,000 | ALLY FINANCIAL INC 4.625% 19/05/22 | 207,050 | 206,538 | 0.02 |
| USD | 205,000 | MERCER INTL 7.75% 01/12/22 | 204,944 | 205,000 | 0.02 |
| USD | 195,000 | PINNACLE FOODS 5.875% 15/01/24 144A | 195,000 | 204,019 | 0.02 |
| USD | 250,000 | MARIPOSA BOR 8% 15/10/21 144A | 204,000 | 203,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | DIAMOND 1 FIN/2 5.875% 15/06/21 144 | 200,000 | 203,727 | 0.02 |
| USD | 210,000 | CEC ENTERTAINMENT 8% 15/02/22 WI | 213,934 | 203,175 | 0.02 |
| USD | 200,000 | IRON MOUNTAIN INC 5.75% 15/08/24 | 202,000 | 202,000 | 0.02 |
| USD | 205,000 | PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22 | 204,933 | 201,925 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENVISION HEALTH 5.125% 01/07/22 144 | 200,000 | 201,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CIT GROUP INC 3.875% 19/02/19 | 200,000 | 201,000 | 0.02 |
| USD | 209,000 | IASIS HEALTHCARE 8.375% 15/05/19 | 209,863 | 200,118 | 0.02 |
| USD | 195,000 | HILL-ROM HDG INC 5.75% 01/09/23 144 | 195,818 | 199,388 | 0.02 |
| USD | 200,000 | L BRANDS 6.75% 01/07/36 | 200,000 | 199,354 | 0.02 |
| USD | 200,000 | WILLIAM LYON HOME 7% 15/08/22 | 204,000 | 198,000 | 0.02 |
| USD | 197,000 | SPRINGLEAF FIN 8.25% 15/12/20 | 197,456 | 197,000 | 0.02 |
| USD | 185,000 | EMDEON INC 6% 15/02/21 144A | 185,000 | 196,100 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 185,000 | MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23 | 184,438 | 194,935 | 0.02 |
| USD | 189,000 | RSP PERMIAN 6.625% 01/10/22 | 191,663 | 194,670 | 0.02 |
| USD | 175,000 | MICROSEMI CORP 9.125% 15/04/23 144A | 175,000 | 192,500 | 0.02 |
| USD | 210,000 | KCG HOLDINGS 6.875% 15/03/20 144A | 207,820 | 189,525 | 0.01 |
| USD | 200,000 | HALCON RES CORP 8.625% 01/02/20 144 | 190,500 | 188,624 | 0.01 |
| USD | 178,000 | FRONTIER COMM 9.25% 01/07/21 | 178,590 | 188,458 | 0.01 |
| USD | 220,000 | NATIONSTAR MORT 6.5% 01/07/21 | 216,250 | 188,100 | 0.01 |
| USD | 185,000 | RICE ENERGY 7.25% 01/05/23 | 183,850 | 187,775 | 0.01 |
| USD | 185,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/09/20 | 197,634 | 186,850 | 0.01 |
| USD | 215,000 | HEXION US/NOVA 8.875% 01/02/18 | 192,095 | 186,513 | 0.01 |
| USD | 220,000 | SANCHEZ ENERY CORP 7.75% 15/6/21 | 232,429 | 185,900 | 0.01 |
| USD | 180,000 | KAISER ALUMINIUM 5.875% 15/05/24 14 | 182,119 | 184,950 | 0.01 |
| USD | 215,000 | VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144 | 221,192 | 184,900 | 0.01 |
| USD | 175,000 | US STEEL CORP 8.375% 01/07/21 144A | 179,550 | 183,313 | 0.01 |
| USD | 220,000 | CONTINENTAL RES 4.9% 01/06/44 WI | 158,175 | 181,500 | 0.01 |
| USD | 175,000 | SIRIUS XM RADIO 6% 15/07/24 144A | 180,969 | 180,688 | 0.01 |
| USD | 175,000 | MILACRON LLC/FIN 7.75% 15/02/21 144 | 176,885 | 180,250 | 0.01 |
| USD | 175,000 | CNO FINANCIAL GROUP 5.25% 30/05/25 | 176,550 | 180,250 | 0.01 |
| USD | 185,000 | NEWFIELD EXPL 5.375% 01/01/26 | 183,438 | 179,913 | 0.01 |
| USD | 184,000 | DISH DBS CORP 5.875% 15/07/22 | 178,381 | 178,940 | 0.01 |
| USD | 250,000 | NORTHERN OIL AND GAS 8% 01/06/20 | 237,500 | 178,750 | 0.01 |
| USD | 200,000 | GLOBAL SHIP LEASE 10% 01/04/19 144A | 200,250 | 178,500 | 0.01 |
| USD | 180,000 | ENSEMBLE S MERGER 9% 30/09/23 144A | 173,822 | 177,750 | 0.01 |
| USD | 240,000 | ONEX YORK ACQ 8.5% 01/10/22 144A | 240,000 | 177,000 | 0.01 |
| USD | 175,000 | ZEKELMAN/JMC STE 9.875% 15/06/23 14 | 175,000 | 176,750 | 0.01 |
| USD | 175,000 | FIRST CASH FIN 6.75% 01/04/21 | 175,000 | 176,750 | 0.01 |
| USD | 170,000 | MICHAEL STORES 5.875% 15/12/20 144A | 172,475 | 176,375 | 0.01 |
| USD | 475,000 | RUE21 INC 9% 15/10/21 144A | 390,125 | 176,344 | 0.01 |
| USD | 167,000 | UNVISION COMM 6.75% 15/09/22 144A | 173,893 | 176,185 | 0.01 |
| USD | 200,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 6% 15/07/23 144A | 208,250 | 175,000 | 0.01 |
| USD | 245,000 | AVAYA INC 7% 01/04/19 144A | 217,650 | 174,563 | 0.01 |
| USD | 190,000 | QEP RESOURCES 5.25% 01/05/23 | 170,577 | 173,850 | 0.01 |
| USD | 185,000 | ADT CORP 4.125% 15/06/23 | 166,558 | 172,513 | 0.01 |
| USD | 175,000 | ARAMARK SERV INC 4.75% 01/06/26 144 | 175,000 | 171,719 | 0.01 |
| USD | 175,000 | MPLX LP 4.875% 01/06/25 REGS | 173,296 | 171,049 | 0.01 |
| USD | 200,000 | WILLIAMS CIE INC 5.75% 24/06/44 | 157,068 | 170,500 | 0.01 |
| USD | 171,000 | M/I HOMES INC 6.75% 15/01/21 WI | 170,810 | 170,145 | 0.01 |
| USD | 169,000 | TRANSDIGM INC 6% 15/07/22 | 167,455 | 169,875 | 0.01 |
| USD | 165,000 | QUINTILES TRANS 4.875% 15/5/23 144A | 165,000 | 167,475 | 0.01 |
| USD | 175,000 | CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A | 175,000 | 166,688 | 0.01 |
| USD | 200,000 | CHEMOURS CO 7% 15/05/25 WI | 196,700 | 166,500 | 0.01 |
| USD | 165,000 | DAVITA HEALTHCARE 5% 01/05/25 | 164,913 | 161,205 | 0.01 |
| USD | 160,000 | CNH INDUS CAP 4.375% 06/11/20 | 159,130 | 159,520 | 0.01 |
| USD | 150,000 | LENNAR CORP 6.95% 01/06/18 | 143,505 | 158,625 | 0.01 |
| USD | 160,000 | STONEMOR PART 7.875% 01/06/21 | 156,531 | 158,400 | 0.01 |
| USD | 185,000 | SM ENERGY CO 5% 15/01/24 | 155,494 | 158,175 | 0.01 |
| USD | 150,000 | SPIRIT AEROSYS 5.25% 15/03/22 | 150,000 | 157,528 | 0.01 |
| USD | 150,000 | T-MOBILE USA INC 6.125% 15/01/22 | 150,000 | 157,500 | 0.01 |
| USD | 155,000 | JAGUAR HL/PPDI 6.375% 01/08/23 144A | 155,000 | 157,325 | 0.01 |
| USD | 150,000 | GLP CAP LP 5.375% 15/04/26 | 152,237 | 154,688 | 0.01 |
| USD | 150,000 | AECOM 5.875% 15/10/24 | 150,000 | 154,500 | 0.01 |
| USD | 150,000 | DIAMOND 1/2 FIN 4.42% 15/06/21 144A | 149,957 | 154,369 | 0.01 |
| USD | 223,000 | AHERN RENTALS 7.375% 15/5/23 144A | 217,236 | 153,870 | 0.01 |
| USD | 150,000 | ZF NA CAPITAL 4% 29/04/20 REGS | 149,160 | 153,188 | 0.01 |
| USD | 145,000 | NETFLIX INC 5.875% 15/02/25 | 145,444 | 152,069 | 0.01 |
| USD | 150,000 | BUMBLE BEE HDG 9% 15/12/17 REGS | 151,688 | 151,875 | 0.01 |
| USD | 150,000 | ZF NA CAPITAL 4.5% 29/04/22 REGS | 148,890 | 151,500 | 0.01 |
| USD | 160,000 | ENERGEN CORP 4.625% 01/09/21 | 148,425 | 150,400 | 0.01 |
| USD | 150,000 | KB HOME 4.75% 15/05/19 | 150,000 | 150,375 | 0.01 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 145,000 | DIAMOND 1/2 FIN 6.02% 15/06/26 144 | 144,930 | 150,295 | 0.01 |
| USD | 150,000 | ZF NA CAPITAL 4.75% 29/04/25 REGS | 148,530 | 150,161 | 0.01 |
| USD | 146,000 | INVENTIV HEALTH 9% 15/01/18 144A | 151,465 | 150,015 | 0.01 |
| USD | 162,000 | OASIS PETROLEUM 6.875% 15/03/22 | 131,542 | 149,546 | 0.01 |
| USD | 149,000 | AMERIGAS FIN 5.625% 20/05/24 | 149,000 | 149,373 | 0.01 |
| USD | 160,000 | CONTINENTAL RES 4.5% 15/04/23 | 132,656 | 149,200 | 0.01 |
| USD | 140,000 | SUMMIT MAT 8.5% 15/04/22 144A | 140,525 | 148,225 | 0.01 |
| USD | 150,000 | UNIVAR INC 6.75% 15/07/23 144A | 150,000 | 148,125 | 0.01 |
| USD | 149,000 | AMERIGAS FIN 5.875% 20/08/26 | 149,000 | 147,883 | 0.01 |
| USD | 175,000 | ADVANCED MICRO 7% 01/07/24 | 142,625 | 147,875 | 0.01 |
| USD | 145,000 | COMMUNICATION SALES 6% 15/04/23 144 | 141,663 | 147,826 | 0.01 |
| USD | 190,000 | SPRINT NEXTEL CORP 6% 15/11/22 | 125,875 | 146,963 | 0.01 |
| USD | 165,000 | GATES GLOBAL 6% 15/07/22 144A | 165,000 | 145,200 | 0.01 |
| USD | 142,000 | TENET HEALTHCARE 8% 01/08/20 | 155,490 | 145,195 | 0.01 |
| USD | 140,000 | EQUINIX INC 5.875% 15/01/26 | 140,000 | 144,200 | 0.01 |
| USD | 135,000 | EMDEON INC 6% 15/02/21 REGS | 132,750 | 143,100 | 0.01 |
| USD | 170,000 | SUPERVALU INC 7.75% 15/11/22 | 170,931 | 141,525 | 0.01 |
| USD | 140,000 | WESCO DISTRI 5.375% 15/12/21 | 136,088 | 141,050 | 0.01 |
| USD | 155,000 | DISH DBS CORP 5% 15/03/23 | 155,000 | 141,050 | 0.01 |
| USD | 135,000 | ALCOA INC 6.75% 15/01/28 | 147,223 | 139,050 | 0.01 |
| USD | 150,000 | WOODSIDE HOMES CO 6.75% 15/12/21 14 | 146,625 | 138,750 | 0.01 |
| USD | 180,000 | MIRANT AMERICAS 9.125% 01/05/31 | 171,167 | 138,600 | 0.01 |
| USD | 135,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.375% 01/05/25 14 | 134,716 | 137,025 | 0.01 |
| USD | 135,000 | SABRE INC 5.375% 15/04/23 144A | 135,500 | 137,025 | 0.01 |
| USD | 145,000 | SOUTHERN COPPER CORP 5.875% 23/4/45 | 118,426 | 135,764 | 0.01 |
| USD | 130,000 | HCA INC 4.25% 15/10/19 | 130,000 | 135,363 | 0.01 |
| USD | 150,000 | SOUTHWESTERN ENERGY 4.1% 15/03/22 | 119,125 | 133,125 | 0.01 |
| USD | 129,000 | ALBERTSONS 6.625% 15/6/24 REGS | 129,000 | 132,870 | 0.01 |
| USD | 135,000 | OMEGA US SUB 8.75% 15/07/23 144A | 135,000 | 132,300 | 0.01 |
| USD | 225,000 | CLAIRE'S ST 9% 15/03/19 144a | 141,750 | 131,625 | 0.01 |
| USD | 125,000 | T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/24 | 131,255 | 131,563 | 0.01 |
| USD | 135,000 | PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22 | 125,888 | 130,950 | 0.01 |
| USD | 140,000 | HILCORP ENERGY 5% 01/12/24 144A | 139,685 | 130,536 | 0.01 |
| USD | 125,000 | CENTURYLINK INC 5.625% 01/04/20 V | 126,949 | 130,122 | 0.01 |
| USD | 175,000 | AVAYA INC 9% 01/04/19 144A | 140,750 | 129,500 | 0.01 |
| USD | 750,000 | LINN ENERGY LLC 8.625% 15/4/20 | 473,567 | 129,375 | 0.01 |
| USD | 115,000 | AES CORPORATION 7.375% 01/07/21 | 116,914 | 129,375 | 0.01 |
| USD | 125,000 | CEDAR FAIR/CANA 5.375% 01/06/24 WI | 128,125 | 128,750 | 0.01 |
| USD | 125,000 | ALERIS INTL INC 9.5% 01/04/21 144A | 125,000 | 128,438 | 0.01 |
| USD | 125,000 | PARSLEY ENERGY 6.25% 01/06/24 144A | 125,000 | 126,563 | 0.01 |
| USD | 125,000 | REYNOLDS GRP ISS 5.125% 15/7/23 REG | 125,000 | 126,563 | 0.01 |
| USD | 550,000 | HALCON RESOURCES 9.75% 15/07/20 | 428,542 | 126,500 | 0.01 |
| USD | 125,000 | LEVEL 3 FIN INC 5.375% 15/08/22 WI | 125,000 | 126,250 | 0.01 |
| USD | 125,000 | WMG ACQUISITION 6.75% 15/04/22 144A | 125,000 | 125,938 | 0.01 |
| USD | 125,000 | POLYONE CORP 5.25% 15/03/23 WI | 125,000 | 125,938 | 0.01 |
| USD | 140,000 | ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144 | 139,304 | 125,650 | 0.01 |
| USD | 125,000 | REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/06/23 | 129,531 | 125,625 | 0.01 |
| USD | 125,000 | WILLIAMS CO INC 7.5% 15/01/31 A | 83,750 | 125,625 | 0.01 |
| USD | 125,000 | JC PENNEY CORP 5.875% 1/07/23 144A | 125,000 | 125,313 | 0.01 |
| USD | 125,000 | TRANSIGM INC 6.5% 15/05/25 | 123,750 | 125,313 | 0.01 |
| USD | 120,000 | UNITED RENTALS 6.125% 15/06/23 | 124,200 | 124,200 | 0.01 |
| USD | 125,000 | CARDTRONICS INC 5.125% 01/08/22 | 122,813 | 123,750 | 0.01 |
| USD | 120,000 | TARGA RESOURCES 6.75% 15/03/24 144A | 118,500 | 122,174 | 0.01 |
| USD | 175,000 | TMS INTL CORP 7.625% 15/10/21 144A | 175,000 | 121,625 | 0.01 |
| USD | 120,000 | APX GROUP INC 7.875% 01/12/22 144A | 120,000 | 121,200 | 0.01 |
| USD | 117,000 | HCA INC 3.75% 15/03/19 | 117,000 | 120,803 | 0.01 |
| USD | 125,000 | HILCORP ENERGY I 5.75% 01/10/25 REG | 125,000 | 119,375 | 0.01 |
| USD | 119,000 | CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 wi | 123,613 | 119,000 | 0.01 |
| USD | 125,000 | SUMMIT MID HDGS 7.5% 01/07/21 WI | 124,063 | 118,125 | 0.01 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 115,000 | ACADIA HEALTH 6.5% 01/03/24 REGS | 118,859 | 116,725 | 0.01 |
| USD | 110,000 | MPH ACQUISITION 7.125% 1/06/24 REGS | 110,000 | 115,500 | 0.01 |
| USD | 114,000 | TENET HEALTHCARE 4.5% 1/04/21 | 112,290 | 114,570 | 0.01 |
| USD | 110,000 | LIFEPOINT HEALTH 5.875% 01/12/23 | 110,150 | 114,400 | 0.01 |
| USD | 114,000 | FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 REGS | 114,600 | 112,290 | 0.01 |
| USD | 109,000 | CASELLA WASTE SYS 7.75% 15/02/19 | 107,376 | 111,248 | 0.01 |
| USD | 120,000 | ANADARKO FINANCE 4.5% 15/07/44 | 94,719 | 110,658 | 0.01 |
| USD | 475,000 | TRIANGLE USA PET 6.75% 15/7/22 144A | 475,000 | 109,250 | 0.01 |
| USD | 110,000 | CHS/COMM HEALTH 5.125% 01/08/21 | 110,000 | 108,758 | 0.01 |
| USD | 135,000 | VALEANT PHARM 5.5% 01/03/23 144A | 137,481 | 108,338 | 0.01 |
| USD | 105,000 | METROPCS WIRELESS 6.625% 15/11/20 | 103,800 | 108,281 | 0.01 |
| USD | 101,000 | GOODYEAR TIRE&RUBBER 7% 15/05/22 | 103,685 | 107,691 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DIAMOND 1/2 FIN 8.1% 15/07/36 144A | 99,927 | 107,337 | 0.01 |
| USD | 100,000 | WESTERN DIGITAL 7.375% 01/04/23 144 | 100,511 | 106,750 | 0.01 |
| USD | 105,000 | ALCOA INC 5.9% 01/02/27 | 106,619 | 106,575 | 0.01 |
| USD | 125,000 | VALEANT PHARMA 6.75% 15/08/21 144A | 130,781 | 106,563 | 0.01 |
| USD | 100,000 | FRONTIER COMM CORP 8.5% 15/04/20 | 103,438 | 106,125 | 0.01 |
| USD | 120,000 | FREEPORT MCMORAN 3.55% 01/03/22 | 79,881 | 105,600 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CALPINE CORP 7.875% 15/01/23 144A | 107,125 | 105,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | AMERICAN AXLE 6.625% 15/10/22 | 102,500 | 105,250 | 0.01 |
| USD | 255,000 | BONANZA CREEK 6.75% 15/04/21 | 233,052 | 104,550 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GLP CAP LP 5.375% 01/11/23 | 96,750 | 104,375 | 0.01 |
| USD | 140,000 | TRONOX FINANCE 6.375% 15/08/20 | 108,817 | 103,950 | 0.01 |
| USD | 99,000 | OWENS-BROCKWAY 5.875% 15/08/23 REGS | 103,052 | 103,764 | 0.01 |
| USD | 100,000 | HD SUPPLY INC 5.75% 15/04/24 144A | 100,281 | 103,500 | 0.01 |
| USD | 102,000 | LEVEL 3 COMM 5.75% 01/12/22 WI | 103,861 | 103,275 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GANNETT CO 5.5% 15/09/24 144A | 99,038 | 103,000 | 0.01 |
| USD | 97,000 | E TRADE FINANCIAL 5.375% 15/11/22 | 97,000 | 102,505 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CHENIERE CORP CHRIS 7% 30/6/24 REGS | 100,000 | 102,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | AECOM 5.75% 15/10/22 | 100,000 | 102,000 | 0.01 |
| USD | 95,000 | VIZIENT INC 10.375% 01/03/24 144A | 96,500 | 101,888 | 0.01 |
| USD | 105,000 | WYNN LAS VEGAS 5.5% 01/03/25 144A | 105,000 | 101,588 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DR HORTON INC 3.75% 01/03/19 | 100,000 | 101,500 | 0.01 |
| USD | 118,000 | BLUELINE RENTAL FIN 7% 01/02/19 144 | 122,694 | 100,890 | 0.01 |
| USD | 107,000 | JBS USA LLC 5.75% 15/06/25 REGS | 107,000 | 100,580 | 0.01 |
| USD | 115,000 | CONTINENTAL RES 3.8% 01/06/24 | 93,317 | 100,338 | 0.01 |
| USD | 95,000 | HCA INC 5.25% 15/04/25 | 95,000 | 99,275 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 144A | 100,000 | 99,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A | 100,000 | 99,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | NEW ALBERTSONS INC 8% 01/05/31 | 95,500 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | AMERICAN AIRLINES 5.5% 1/10/19 144A | 100,000 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 125,000 | SPRINT CORP 7.625% 15/02/25 | 124,999 | 98,906 | 0.01 |
| USD | 92,000 | NCI BUILDING SYS 8.25% 15/01/23 144 | 92,000 | 98,881 | 0.01 |
| USD | 100,000 | UNIVAR INC 6.75% 15/07/23 REGS | 100,000 | 98,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22 144a | 98,760 | 98,500 | 0.01 |
| USD | 140,000 | CENVEO CORP 8.5% 15/09/22 144A | 140,000 | 98,000 | 0.01 |
| USD | 95,000 | CLEAN HARBORS 5.125% 01/06/21 | 95,538 | 97,138 | 0.01 |
| USD | 159,000 | EP ENERGY/EVER 7.75% 01/09/22 | 159,000 | 96,990 | 0.01 |
| USD | 95,000 | JAGUAR HL/PPDI 6.375% 01/08/23 REGS | 95,000 | 96,425 | 0.01 |
| USD | 95,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 1/5/26 REGS | 95,000 | 96,378 | 0.01 |
| USD | 100,000 | HOCKEY MERG 7.875% 01/10/21 144A | 100,189 | 96,250 | 0.01 |
| USD | 95,000 | CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 R | 92,624 | 95,950 | 0.01 |
| USD | 98,000 | MPLX LP 4.875% 01/12/24 REGS | 98,000 | 95,581 | 0.01 |
| USD | 103,000 | ADVANCED MICRO 7.75% 01/08/20 | 104,961 | 95,533 | 0.01 |
| USD | 92,000 | WELLS ENTS INC 6.75% 01/02/20 144A | 93,687 | 95,220 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 144 | 77,750 | 94,500 | 0.01 |
| USD | 92,000 | TUTOR PERINI 7.625% 01/11/18 | 86,673 | 92,460 | 0.01 |
| USD | 89,000 | DIAMOND 1/2 FIN 5.45% 15/06/23 REGS | 88,962 | 92,323 | 0.01 |
| USD | 89,000 | DIAMOND 1/2 FIN 6.02% 15/06/26 REGS | 88,957 | 92,250 | 0.01 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|-----------|--------|---------|
| USD | 91,000 | DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/24 | 91,000 | 92,010 | 0.01 |
| USD | 90,000 | US FOODS INC 5.875% 15/06/24 144A | 90,000 | 91,800 | 0.01 |
| USD | 95,000 | PROVIDENT FDG ASS 6.75% 15/06/21 14 | 96,548 | 90,488 | 0.01 |
| USD | 88,000 | DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26 REGS | 88,000 | 90,420 | 0.01 |
| USD | 100,000 | ENDO 5.75% 15/01/22 144A | 99,490 | 90,000 | 0.01 |
| USD | 85,000 | STATION CASINO 7.5% 01/03/21 | 85,425 | 89,963 | 0.01 |
| USD | 86,000 | CINCINNATI BELL 8.375% 15/10/20 | 90,132 | 89,690 | 0.01 |
| USD | 8,925,000 | NEWPAGE CORP 10% 01/05/12 ESCROW | 5,161,232 | 89,250 | 0.01 |
| USD | 85,000 | BUILDING MATERIALS 6% 15/10/25 REGS | 88,550 | 89,144 | 0.01 |
| USD | 100,000 | SPRINT NEXTEL CORP 7% 15/08/20 | 90,125 | 89,000 | 0.01 |
| USD | 83,000 | CHOICE HOTELS INTL 5.75% 01/07/22 | 89,680 | 88,968 | 0.01 |
| USD | 105,000 | CHEMOURS CO 6.625% 15/05/23 | 93,109 | 88,725 | 0.01 |
| USD | 90,000 | AMC NETWORKS INC 5% 01/04/24 | 90,000 | 88,650 | 0.01 |
| USD | 100,000 | WEEKLEY HOMES LLC 6% 01/02/23 | 100,679 | 88,000 | 0.01 |
| USD | 88,000 | PILGRIM'S PRI 5.75% 15/03/25 144A | 88,000 | 87,780 | 0.01 |
| USD | 175,000 | 99 CENTS ONLY STORE 11% 15/12/19 WI | 147,875 | 87,500 | 0.01 |
| USD | 105,000 | GLOBAL PART/GLP FIN 6.25% 15/07/22 | 105,000 | 87,413 | 0.01 |
| USD | 84,000 | EQUINIX INC 5.375% 01/01/22 | 84,000 | 86,310 | 0.01 |
| USD | 85,000 | E*TRADE FINANCIAL 4.625% 15/09/23 | 85,000 | 86,063 | 0.01 |
| USD | 85,000 | SEMINOLE HARD 5.875% 15/05/21 144A | 85,425 | 85,213 | 0.01 |
| USD | 82,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.875% 1/4/24 RE | 82,000 | 85,075 | 0.01 |
| USD | 92,000 | WHITING PETROLEUM 5% 15/03/19 | 69,908 | 84,640 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CBC AMMO LLC 7.25% 15/11/21 144A | 98,515 | 84,500 | 0.01 |
| USD | 80,000 | BALL CORP 4.375% 15/12/20 | 80,000 | 84,150 | 0.01 |
| USD | 80,000 | T-MOBILE USA INC 6.633% 28/04/21 | 80,000 | 83,600 | 0.01 |
| USD | 80,000 | NEXSTAR BROADC 6.875% 15/11/20 WI | 80,081 | 83,500 | 0.01 |
| USD | 81,000 | HEADWATERS INC 7.25% 15/01/19 | 81,790 | 82,620 | 0.01 |
| USD | 80,000 | CCO HDG LLC/CAP 5.75% 15/2/26 REGS | 80,000 | 82,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | ENLINK MIDSTREAM 5.05% 01/04/45 | 75,250 | 82,007 | 0.01 |
| USD | 70,000 | BLUE CUBE SPINCO 9.75% 15/10/23 REG | 70,000 | 81,025 | 0.01 |
| USD | 80,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.125% 15/02/23 | 79,700 | 81,000 | 0.01 |
| USD | 80,000 | CDW LLC/FIN 5% 01/09/23 | 80,000 | 80,559 | 0.01 |
| USD | 80,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.75% 20/11/25 | 78,554 | 80,100 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18 | 103,500 | 79,500 | 0.01 |
| USD | 75,000 | CARROLS REST GRP 8% 01/05/22 | 75,000 | 79,125 | 0.01 |
| USD | 75,000 | MGP ESCROW 5.625% 01/05/24 144A | 75,000 | 78,750 | 0.01 |
| USD | 75,000 | DIAMOND 1/2 FIN 5.45% 15/06/23 144A | 74,968 | 77,800 | 0.01 |
| USD | 82,000 | US STEEL CORP 7.375% 01/04/20 | 72,292 | 77,158 | 0.01 |
| USD | 75,000 | EMI MUSIC PUB 7.625% 15/6/24 144A | 75,000 | 77,063 | 0.01 |
| USD | 75,000 | DIAMOND 1/2 FIN 3.48% 01/06/19 144A | 74,981 | 76,690 | 0.01 |
| USD | 85,000 | ENDO FINANCE LLC 5.75% 15/01/22 REG | 75,650 | 76,500 | 0.01 |
| USD | 80,000 | SPRINT CAP CORP 6.9% 01/05/19 | 73,800 | 76,400 | 0.01 |
| USD | 75,000 | ASBURY AUTO 6% 15/12/24 | 78,188 | 75,563 | 0.01 |
| USD | 155,000 | SYNVERSE HLDG 9.125% 15/01/19 | 167,506 | 75,369 | 0.01 |
| USD | 100,000 | MIRANT AMERICAS 8.5% 01/10/21 | 97,625 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | BMC SOFTWARE 8.125% 15/07/21 144A | 84,938 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | FIDELITY&GUARANTY 6.375% 1/4/21 144 | 79,500 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | ENERGIZER SPINCO 5.5% 15/06/25 144A | 75,000 | 74,625 | 0.01 |
| USD | 70,000 | WESTERN DIGITAL 10.5% 01/04/24 REGS | 70,000 | 74,550 | 0.01 |
| USD | 70,000 | CONSTELLATION BRAND 4.75% 01/12/25 | 70,000 | 73,763 | 0.01 |
| USD | 150,000 | CNG HLDG INC 9.375% 15/05/20 144A | 133,138 | 73,500 | 0.01 |
| USD | 73,000 | SUNOCO LP/FIN 6.25% 15/04/21 REGS | 73,000 | 72,818 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SPRINGLEAF FINANCE 7.75% 1/10/21 WI | 74,975 | 72,375 | 0.01 |
| USD | 73,000 | SIRIUS XM 5.375% 15/07/26 REGS | 73,000 | 72,088 | 0.01 |
| USD | 69,000 | ORBITAL ATK 5.25% 01/10/21 | 69,000 | 72,021 | 0.01 |
| USD | 650,000 | ENERGY XXI GULF 7.5% 15/12/21 | 650,636 | 71,500 | 0.01 |
| USD | 69,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23 | 70,569 | 71,415 | 0.01 |
| USD | 68,000 | IRON MOUNTAIN INC 6% 01/10/20 REGS | 68,000 | 71,145 | 0.01 |
| USD | 70,000 | POST HLDGS 6% 15/12/22 144A | 69,225 | 71,138 | 0.01 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|--------|---------|
| USD | 65,000 | SHINGLE SPRINGS 9.75% 01/09/21 144A | 71,988 | 70,850 | 0.01 |
| USD | 70,000 | TELEFLEX INC 5.25% 15/06/24 | 70,000 | 70,700 | 0.01 |
| USD | 65,000 | MERITAGE HOMES CORP 7% 01/04/22 | 70,406 | 70,200 | 0.01 |
| USD | 67,000 | TENNECO INC 5.375% 15/12/24 | 67,000 | 69,513 | 0.01 |
| USD | 66,000 | INFOR US INC 5.75% 15/08/20 REGS | 67,984 | 69,135 | 0.01 |
| USD | 70,000 | SUNOCO LP/FIN 5.5% 01/08/20 REGS | 70,000 | 69,125 | 0.01 |
| USD | 65,000 | HUNTINGTON INGALLS 5% 15/11/25 144A | 65,000 | 68,868 | 0.01 |
| USD | 72,000 | SM ENERGY CO 6.5% 15/11/21 | 71,134 | 67,320 | 0.01 |
| USD | 65,000 | CNO FINANCIAL GP 4.5% 30/05/20 | 65,000 | 67,275 | 0.01 |
| USD | 75,000 | FREEPORT-MCMORAN 4.55% 14/11/24 | 55,500 | 66,375 | 0.01 |
| USD | 64,000 | JC PENNEY CORP 8.125% 01/10/19 | 63,913 | 66,220 | 0.01 |
| USD | 65,000 | SABINE PASS LIQ 5.875% 30/6/26 REGS | 65,000 | 64,919 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SM ENERGY CO 5.625% 01/06/25 | 75,000 | 64,875 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GUITAR CENTER INC 6.5% 15/04/19 144 | 74,207 | 64,313 | 0.01 |
| USD | 59,000 | MICRON TECH INC 7.5% 15/09/23 REGS | 59,000 | 62,688 | 0.00 |
| USD | 60,000 | CENTENE ESC CORP 5.625% 15/02/21 RE | 60,000 | 62,550 | 0.00 |
| USD | 1,075,000 | SANDRIDGE ENERGY 7.5% 15/03/21 | 599,005 | 61,813 | 0.00 |
| USD | 83,000 | WEATHFORD BERMUDA 7% 15/03/38 | 65,390 | 61,420 | 0.00 |
| USD | 60,000 | COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 REGS | 60,000 | 61,327 | 0.00 |
| USD | 60,000 | FIRST DATA CORP 5.375% 15/8/23 REGS | 60,000 | 60,750 | 0.00 |
| USD | 59,000 | AXIALL CORP 4.875% 15/05/23 | 58,263 | 60,623 | 0.00 |
| USD | 59,000 | OSHKOSH CORP 5.375% 01/03/25 | 59,000 | 60,623 | 0.00 |
| USD | 60,000 | QEP RESOURCES INC 6.8% 01/03/20 | 62,025 | 60,450 | 0.00 |
| USD | 70,000 | CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22 | 71,526 | 60,200 | 0.00 |
| USD | 57,000 | SPECTRUM BRANDS 6.125% 15/12/24 | 57,000 | 60,135 | 0.00 |
| USD | 60,000 | ASHLAND INC 6.875% 15/05/43 | 60,161 | 59,400 | 0.00 |
| USD | 57,000 | SPECTRUM BRANDS 5.75% 15/07/25 | 57,000 | 59,280 | 0.00 |
| USD | 64,000 | QEP RESOURCES INC 5.375% 01/10/22 | 61,380 | 59,200 | 0.00 |
| USD | 51,000 | BLUE CUBE SPINCO 10% 15/10/25 REGS | 51,000 | 58,905 | 0.00 |
| USD | 56,000 | QORVO INC 6.75% 01/12/23 REGS | 56,000 | 58,240 | 0.00 |
| USD | 55,000 | CENTENE ESC CORP 6.125% 15/2/24 144 | 55,000 | 58,163 | 0.00 |
| USD | 56,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.875% 01/5/27 14 | 56,000 | 57,820 | 0.00 |
| USD | 55,000 | ANIXTER INC 5.5% 01/03/23 | 55,000 | 56,925 | 0.00 |
| USD | 54,000 | BOARDWALK PIPELINES 5.95% 01/06/26 | 53,868 | 56,496 | 0.00 |
| USD | 55,000 | NUANCE COMM 5.375% 15/08/20 144A | 56,149 | 55,481 | 0.00 |
| USD | 50,000 | POST HLDGS 8% 15/07/25 144A | 50,000 | 55,438 | 0.00 |
| USD | 61,000 | WESTERN REFINING 6.25% 01/04/21 | 61,000 | 54,900 | 0.00 |
| USD | 50,000 | ALLY FINANCIAL INC 8% 31/12/18 | 54,750 | 54,625 | 0.00 |
| USD | 55,000 | PNK ENTERTAINMENT 5.625% 1/5/24 144 | 55,000 | 54,588 | 0.00 |
| USD | 50,000 | TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20 | 50,000 | 52,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | HCA INC 5.875% 15/02/26 | 50,000 | 52,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | NETFLIX INC 5.5% 15/02/22 | 50,000 | 52,125 | 0.00 |
| USD | 50,000 | QORVO INC 6.75% 01/12/23 144A | 50,000 | 52,000 | 0.00 |
| USD | 55,000 | FREEPORT-MCMORAN 3.1% 15/03/20 | 44,180 | 51,975 | 0.00 |
| USD | 53,000 | TENET HEALTHCARE 6.75% 02/02/20 | 56,048 | 51,808 | 0.00 |
| USD | 58,000 | WINDSTREAM CORP 7.50% 01/04/23 | 54,546 | 51,765 | 0.00 |
| USD | 75,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.875% 15/11/20 | 68,250 | 51,750 | 0.00 |
| USD | 65,000 | MOMENTIVE PERF 3.88% 24/10/21 | 61,090 | 51,594 | 0.00 |
| USD | 50,000 | GREYSTAR REAL 8.25% 01/12/22 144A | 51,125 | 51,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | KB HOME 7.5% 15/09/22 | 51,283 | 51,250 | 0.00 |
| USD | 50,000 | EQUINIX INC 5.375% 01/04/23 | 51,668 | 51,250 | 0.00 |
| USD | 50,000 | TENET HEALTHCARE 4.75% 01/06/20 | 50,000 | 51,215 | 0.00 |
| USD | 225,000 | CLAIRE'S ST ESC 8.875% 15/3/19 | 223,740 | 51,188 | 0.00 |
| USD | 55,000 | SPRINGLEAF FIN CORP 5.25% 15/12/19 | 52,925 | 51,150 | 0.00 |
| USD | 50,000 | GOLDEN NUGGET ESC 8.5% 01/12/21 144 | 50,250 | 51,125 | 0.00 |
| USD | 50,000 | HILL-ROM HDG INC 5.75% 01/09/23 REG | 50,000 | 51,125 | 0.00 |
| USD | 50,000 | STEEL DYNAMICS 5.25% 15/04/23 | 45,250 | 51,000 | 0.00 |
| USD | 50,000 | KFC HOLD PIZZA 5% 01/06/24 REGS | 50,000 | 50,875 | 0.00 |
| USD | 50,000 | KFC HOLD PIZZA 5.25% 01/06/26 REGS | 50,000 | 50,875 | 0.00 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|--------|---------|
| USD | 50,000 | CENTENE CORP 4.75% 15/05/22 | 50,875 | 50,875 | 0.00 |
| USD | 50,000 | SCIENTIFIC GAMES INTL 7% 1/1/22 REG | 46,375 | 50,250 | 0.00 |
| USD | 50,000 | LIFEPOINT HEALTH 5.375% 1/5/24 REGS | 50,181 | 50,125 | 0.00 |
| USD | 50,000 | FIRST DATA CORP 5% 15/01/24 REGs | 49,750 | 50,063 | 0.00 |
| USD | 50,000 | WESCO DISTRI 5.375% 15/06/24 REGS | 50,000 | 50,000 | 0.00 |
| USD | 50,000 | SIX FLAGS ENT 4.875% 31/07/24 144A | 50,000 | 49,375 | 0.00 |
| EUR | 40,000 | PEMEX PROJ FDG MAS 5.5% 24/02/25 RE | 47,192 | 48,841 | 0.00 |
| USD | 44,000 | MICROSEMI CORP 9.125% 15/04/23 REGS | 44,000 | 48,400 | 0.00 |
| USD | 50,000 | CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 WI | 51,375 | 48,375 | 0.00 |
| USD | 45,000 | TEAM HEALTH INC 7.25% 15/12/23 REG | 45,000 | 48,155 | 0.00 |
| USD | 45,000 | SOLERA LLC/FINA 10.5% 01/03/24 REGS | 42,750 | 47,306 | 0.00 |
| USD | 50,000 | ISTAR FINANCIAL 6.5% 01/07/21 | 50,000 | 47,250 | 0.00 |
| USD | 45,000 | GOODYEAR TIRE&RUB 5.125% 15/11/23 | 45,000 | 46,463 | 0.00 |
| USD | 45,000 | EMI MUSIC PUB 7.625% 15/6/24 REGS | 45,000 | 46,238 | 0.00 |
| USD | 45,000 | COMMSCOPE 5% 15/06/21 144A | 45,000 | 45,968 | 0.00 |
| USD | 45,000 | COMM SALES & LEAS 6% 15/04/23 REGs | 44,663 | 45,675 | 0.00 |
| USD | 45,000 | INGLES MKTS 5.75% 15/06/23 | 45,000 | 45,450 | 0.00 |
| USD | 45,000 | TRANSDIGM INC 6.5% 15/07/24 | 43,425 | 45,225 | 0.00 |
| USD | 59,000 | PARKER DRILLING 7.5% 01/08/20 | 59,000 | 44,840 | 0.00 |
| USD | 41,000 | POST HLDGS 7.75% 15/03/24 REGS | 41,000 | 44,793 | 0.00 |
| USD | 50,000 | VALEANT PHARMACEUT 7% 01/10/20 144A | 53,000 | 44,625 | 0.00 |
| USD | 50,000 | ADVANCED MICRO 7.5% 15/08/22 | 42,375 | 44,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | MURPHY OIL CORP 4% 01/06/22 | 39,625 | 44,345 | 0.00 |
| USD | 43,000 | TRANSDIGM INC 5.5% 15/10/20 | 41,764 | 43,753 | 0.00 |
| USD | 45,000 | CLEARWATER PAP 4.5% 01/02/23 | 42,863 | 43,706 | 0.00 |
| USD | 40,000 | TREEHOUSE FOODS INC 6% 15/02/24 144 | 40,000 | 42,400 | 0.00 |
| USD | 40,000 | CENTENE ESC CORP 6.125% 15/02/24 RE | 40,000 | 42,300 | 0.00 |
| USD | 45,000 | NATIONSTAR MORT 7.875% 01/10/20 | 42,750 | 42,188 | 0.00 |
| USD | 50,000 | GLOBAL PART/GLP 7% 15/06/23 | 50,000 | 41,750 | 0.00 |
| USD | 125,000 | CLOUD PEAK ENERGY 6.375% 15/03/24 | 125,000 | 41,250 | 0.00 |
| USD | 42,000 | PBF HDG CO LLC 7% 15/11/23 REGS | 42,000 | 40,583 | 0.00 |
| USD | 40,000 | WPX ENERGY INC 8.25% 01/08/23 | 40,075 | 39,800 | 0.00 |
| USD | 40,000 | DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 REGS | 40,000 | 39,700 | 0.00 |
| USD | 40,000 | NRG ENERGY INC 7.25% 15/05/26 REGS | 40,000 | 39,700 | 0.00 |
| USD | 40,000 | BELDEN INC 5.25% 15/07/24 144A | 40,000 | 38,700 | 0.00 |
| USD | 38,000 | US CONCRETE 6.375% 1/6/24 REGS | 38,000 | 38,000 | 0.00 |
| USD | 37,000 | PULTEGROUP INC 5.5% 01/03/26 | 37,000 | 37,925 | 0.00 |
| USD | 38,000 | TRANSDIGM 6.375% 15/6/26 REGS | 38,000 | 37,715 | 0.00 |
| USD | 40,000 | FRONTIER COMM 6.25% 15/09/21 | 34,050 | 37,600 | 0.00 |
| USD | 35,000 | ANADARKO PETRO CORP 4.85% 15/03/21 | 34,991 | 37,117 | 0.00 |
| USD | 35,000 | DIAMOND 1 FIN/2 7.125% 15/06/24 REG | 35,000 | 36,442 | 0.00 |
| USD | 35,000 | PRESTIGE BRANDS 6.375% 01/03/24 REG | 35,000 | 36,313 | 0.00 |
| USD | 35,000 | US FOODS INC 5.875% 15/06/24 REGS | 35,000 | 35,700 | 0.00 |
| USD | 35,000 | DIAMOND 1 FIN/2 5.875% 15/06/21 REG | 35,000 | 35,652 | 0.00 |
| USD | 33,000 | WESTERN DIGITAL 7.375% 1/04/23 REGS | 33,000 | 35,228 | 0.00 |
| USD | 35,000 | NBTY INC 7.625% 15/05/21 REGS | 35,000 | 34,825 | 0.00 |
| USD | 36,000 | OASIS PETROLEUM 7.25% 01/02/19 | 31,055 | 34,560 | 0.00 |
| USD | 35,000 | TEMPUR SEALY 5.5% 15/6/26 REGS | 35,000 | 34,388 | 0.00 |
| USD | 33,000 | SIRUS XM RADIO 5.75% 01/08/21 144A | 33,595 | 34,279 | 0.00 |
| USD | 45,000 | HARDWOODS ACQUIS 7.5% 01/08/21 144A | 45,096 | 34,200 | 0.00 |
| USD | 35,000 | ONEMAIN FIN 6.75% 15/12/19 144A | 35,088 | 33,994 | 0.00 |
| USD | 35,000 | GENESIS ENERGY LP 6.75% 01/08/22 | 34,520 | 33,950 | 0.00 |
| USD | 32,000 | HD SUPPLY INC 5.75% 15/04/24 REGS | 32,000 | 33,120 | 0.00 |
| USD | 32,000 | STANDARD IND 5.5% 15/02/23 REGS | 32,000 | 32,720 | 0.00 |
| USD | 76,000 | STONE ENERGY CORP 7.5% 15/11/22 | 75,996 | 32,680 | 0.00 |
| USD | 33,000 | WEST CORP 4.75% 15/07/21 REGS | 33,000 | 32,588 | 0.00 |
| USD | 30,000 | TREEHOUSE FOODS INC 6% 15/02/24 REG | 30,000 | 31,800 | 0.00 |
| USD | 127,000 | W&T OFFSHORE INC 8.5% 15/06/19 | 128,302 | 31,750 | 0.00 |
| USD | 35,000 | WHITING PETR 6.25% 01/04/23 | 28,875 | 31,150 | 0.00 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|--------|---------|
| USD | 30,000 | REYNOLDS GRP ISS 7% 15/07/24 REGS | 30,000 | 30,885 | 0.00 |
| USD | 30,000 | DIAMOND 1/2 FIN 4.42% 15/06/21 REGS | 29,991 | 30,874 | 0.00 |
| USD | 30,000 | GRAY TELEVISION 5.875% 15/07/26 REG | 30,000 | 30,075 | 0.00 |
| USD | 30,000 | FIRST DATA CORP 5% 15/01/24 REGS | 30,000 | 30,038 | 0.00 |
| USD | 30,000 | LAREDO PETRO INC 7.375% 01/05/22 | 26,808 | 29,850 | 0.00 |
| USD | 30,000 | ARAMARK SERV 4.75% 1/06/26 REGS | 30,000 | 29,438 | 0.00 |
| USD | 33,000 | EXTERRAN PARTNERS 6% 01/10/22 | 32,462 | 29,205 | 0.00 |
| USD | 50,000 | APPVION INC 9% 01/06/20 144A | 29,125 | 28,875 | 0.00 |
| USD | 28,000 | VERISIGN INC 5.25% 01/04/25 | 28,000 | 28,700 | 0.00 |
| USD | 33,000 | US STEEL CORP 6.875% 01/04/21 | 25,735 | 28,628 | 0.00 |
| USD | 37,000 | AVAYA INC 7% 01/04/19 REGS | 33,700 | 26,363 | 0.00 |
| USD | 25,000 | T-MOBILE USA 6.25% 01/04/21 | 25,000 | 26,078 | 0.00 |
| USD | 25,000 | MATCH GRP 6.375% 1/6/24 REGS | 25,000 | 26,000 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 15/01/24 | 25,500 | 25,875 | 0.00 |
| USD | 25,000 | STANDARD IND 5.5% 15/02/23 144A | 25,000 | 25,563 | 0.00 |
| USD | 27,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21 | 29,126 | 25,313 | 0.00 |
| USD | 24,000 | ALERE INC 6.375% 01/07/23 REGS | 24,000 | 25,080 | 0.00 |
| USD | 26,000 | QUAPAW DOWNSTR 10.5% 01/07/19 144A | 25,155 | 25,058 | 0.00 |
| USD | 25,000 | KLX INC 5.875% 01/12/22 144A | 23,563 | 24,500 | 0.00 |
| USD | 25,000 | ALBERTSON'S INC 7.45% 01/08/29 | 24,500 | 24,250 | 0.00 |
| USD | 23,000 | US STEEL CORP 8.375% 01/07/21 REGS | 23,000 | 24,093 | 0.00 |
| USD | 25,000 | DYNEGY INC 7.625% 01/11/24 WI | 24,661 | 23,750 | 0.00 |
| USD | 25,000 | RANGE RES CORP 4.875% 15/05/25 | 22,148 | 23,750 | 0.00 |
| USD | 25,000 | HEXION INC 10% 15/04/20 | 22,125 | 23,625 | 0.00 |
| USD | 22,000 | STANDARD IND 5.125% 15/02/21 REGS | 22,000 | 22,605 | 0.00 |
| USD | 25,000 | US STEEL CORP 7.5% 15/03/22 | 20,063 | 21,867 | 0.00 |
| USD | 21,000 | APACHE CORP 4.75% 15/04/43 | 15,940 | 21,674 | 0.00 |
| USD | 20,000 | CABLEVISION SYSTEMS 7.75% 15/04/18 | 20,865 | 21,300 | 0.00 |
| USD | 22,000 | RUBY TUESDAY INC 7.625% 15/05/20 | 21,299 | 21,230 | 0.00 |
| USD | 20,000 | CITIZENS COMM 7.125% 15/03/19 | 19,965 | 21,150 | 0.00 |
| USD | 21,000 | HANESBRANDS INC 4.875% 15/5/26 REGS | 21,000 | 21,076 | 0.00 |
| USD | 20,000 | MGP ESCROW 5.625% 01/05/24 REGS | 20,000 | 21,000 | 0.00 |
| USD | 21,000 | HANESBRANDS INC 4.625% 15/5/24 REGS | 21,000 | 20,974 | 0.00 |
| USD | 20,000 | CCM MERGER INC 9.125% 01/05/19 144A | 20,700 | 20,950 | 0.00 |
| USD | 20,000 | PINNACLE FOODS 5.875% 15/01/24 REG | 20,000 | 20,925 | 0.00 |
| USD | 20,000 | BOYD GAMING CORP 6.375% 01/04/26 RE | 20,000 | 20,900 | 0.00 |
| USD | 20,000 | LAMAR MEDIA 5.75% 01/02/26 144A | 20,000 | 20,800 | 0.00 |
| USD | 21,000 | TOLL BROS FIN CORP 4.875% 15/11/25 | 21,000 | 20,790 | 0.00 |
| USD | 20,000 | REYNOLDS GRP ISS 5.75% 15/10/20 | 20,000 | 20,625 | 0.00 |
| USD | 20,000 | KAISER ALUMINIUM 5.875% 15/5/24 REG | 20,000 | 20,550 | 0.00 |
| USD | 21,000 | TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 REG | 21,000 | 19,845 | 0.00 |
| USD | 52,000 | BASIC ENERGY SVC 7.75% 15/10/22 | 51,009 | 19,760 | 0.00 |
| USD | 19,000 | T-MOBILE USA INC 6% 15/04/24 | 19,000 | 19,665 | 0.00 |
| USD | 19,000 | COMMSCOPE INC 4.375% 15/06/20 REGS | 19,000 | 19,619 | 0.00 |
| USD | 18,000 | DIAMOND 1/2 FIN 8.35% 15/07/46 REGS | 17,986 | 19,334 | 0.00 |
| USD | 20,000 | SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22 | 17,406 | 18,375 | 0.00 |
| USD | 15,000 | ANADARKO PETRO CORP 6.6% 15/03/46 | 14,988 | 17,847 | 0.00 |
| USD | 16,000 | POST HLDGS 8% 15/07/25 REGS | 16,000 | 17,740 | 0.00 |
| USD | 16,000 | D. R HORTON INC 4.375% 15/09/22 | 15,880 | 16,160 | 0.00 |
| USD | 16,000 | CONCHO RESOURCES 5.5% 01/04/23 | 15,360 | 16,100 | 0.00 |
| USD | 14,000 | APACHE CORP 6% 15/01/37 | 12,793 | 16,026 | 0.00 |
| USD | 250,000 | SEVENTY SEVEN ENER 6.5% 15/7/22 | 228,125 | 15,625 | 0.00 |
| USD | 15,000 | HD SUPPLY INC 5.25% 15/12/21 144A | 15,730 | 15,600 | 0.00 |
| USD | 15,000 | ALERIS INTL INC 9.5% 01/04/21 REGS | 15,000 | 15,413 | 0.00 |
| USD | 15,000 | GLP CAP LP 4.375% 15/04/21 | 15,000 | 15,338 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PERF FOOD GRP I 5.5% 01/06/24 REGS | 15,000 | 15,263 | 0.00 |
| USD | 15,000 | TARGA RES PAR 6.375% 01/08/22 | 15,000 | 15,038 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PNK ENTERTAINMENT 5.625% 1/5/24 REG | 15,000 | 14,888 | 0.00 |
| USD | 15,000 | NEWFIELD EXPL 5.625% 01/07/24 | 14,138 | 14,850 | 0.00 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------|-------------|---------|
| USD | 14,000 | D. R. HORTON 4.75% 15/02/23 | 14,264 | 14,508 | 0.00 |
| USD | 14,000 | VEREIT OPERAT PART 4.125% 01/06/21 | 14,000 | 14,254 | 0.00 |
| USD | 1,400,000 | MIDSTATES PETRO 9.25% 01/06/21 | 1,177,517 | 14,000 | 0.00 |
| USD | 13,000 | DIAMOND 1/2 FIN 8.1% 15/7/36 REGS | 12,991 | 13,954 | 0.00 |
| USD | 13,000 | ZEBRA TECH 7.25% 15/10/22 | 13,000 | 13,780 | 0.00 |
| USD | 13,000 | MOBILE MINI INC 5.875% 01/07/24 REG | 13,000 | 13,358 | 0.00 |
| USD | 60,000 | AVAYA INC 10.5% 01/03/21 144A | 57,625 | 13,200 | 0.00 |
| USD | 11,000 | APACHE CORP 3.25% 15/04/22 | 9,539 | 11,267 | 0.00 |
| USD | 10,000 | ANADARKO PETRO CORP 5.55% 15/03/26 | 9,969 | 11,085 | 0.00 |
| USD | 10,000 | DISH DBS CORP 7.875% 01/09/19 | 10,953 | 11,025 | 0.00 |
| USD | 13,000 | FREEMPORT-MCMORAN 5.4% 14/11/34 | 7,963 | 10,335 | 0.00 |
| USD | 10,000 | UNIVISION COMM 5.125% 15/05/23 144A | 9,975 | 9,938 | 0.00 |
| USD | 486,000 | SABINE OIL GAS CORP 9.75% 15/02/17 | 335,290 | 9,720 | 0.00 |
| USD | 9,000 | OWENS-BROCKWAY 6.375% 15/08/25 REGS | 9,000 | 9,405 | 0.00 |
| USD | 9,000 | SABRE INC 5.25% 15/11/23 REGS | 9,000 | 9,158 | 0.00 |
| USD | 18,000 | CALIFORNIA RES 6% 15/11/24 | 18,000 | 8,775 | 0.00 |
| USD | 10,000 | CVR REF LLC/COFF 6.5% 01/11/22 | 8,600 | 8,600 | 0.00 |
| USD | 7,000 | TELEFLEX INC 4.875% 01/06/26 | 7,000 | 7,026 | 0.00 |
| USD | 6,000 | FRONTIER COMM 8.875% 15/09/20 | 6,000 | 6,394 | 0.00 |
| USD | 6,000 | VEREIT OPERAT PART 4.875% 01/06/26 | 6,000 | 6,150 | 0.00 |
| USD | 10,000 | CALIFORNIA RES 5% 15/01/20 | 10,000 | 5,250 | 0.00 |
| USD | 175,000 | QUICKSILVER RES 9.125% 15/8/19 | 179,135 | 4,813 | 0.00 |
| USD | 5,000 | OASIS PETROLEUM 6.875% 15/01/23 | 3,550 | 4,550 | 0.00 |
| USD | 4,000 | QWEST CAPITAL FDI 6.875% 15/7/28 | 3,630 | 3,240 | 0.00 |
| USD | 975,000 | WARREN RESOURCES 9% 01/08/22 | 964,715 | 2,438 | 0.00 |
| USD | 11,000 | AVAYA INC 10.5% 01/03/21 REGS | 7,783 | 2,420 | 0.00 |
| USD | 2,000 | SAFEWAY INC 5% 15/08/19 | 1,825 | 1,970 | 0.00 |
| USD | 175,000 | MIDSTATES PETRO 10.75% 01/10/20 | 108,750 | 1,750 | 0.00 |
| USD | 1,000,000 | HAWKER BEECHCRAFT 9.75% 01/4/17 ESC | 597,500 | 0 | 0.00 |
| USD | 230,000 | MOMENTIVE PERF ESC 8.875% 15/10/20 | 0 | 0 | 0.00 |
| | | | 329,979,038 | 308,153,073 | 24.27 |
| TBA取引 | | | | | |
| USD | 5,300,000 | FNCL 30YR TBA 3.5% 14/07/16 REG A | 5,555,734 | 5,593,156 | 0.44 |
| USD | 5,200,000 | FNCL 30YR TBA 3.5% 11/08/16 | 5,472,391 | 5,481,125 | 0.43 |
| | | | 11,028,125 | 11,074,281 | 0.87 |
| 優先証券 | | | | | |
| — | 62,290 | GMAC CAP TST 1 PFD FRN 15/02/40 | 1,536,428 | 1,549,152 | 0.12 |
| — | 8,450 | GENERAL FIN PFD 8.125% 31/07/21 | 211,250 | 196,040 | 0.02 |
| — | 6,917 | COWEN GROUP PFD 8.25% 15/10/21 | 172,925 | 182,609 | 0.01 |
| | | | 1,920,603 | 1,927,801 | 0.15 |
| ワラント | | | | | |
| — | 2,626,883 | IPAYMENT WTS22 | 1,813,792 | 1,379,114 | 0.11 |
| — | 94,777 | NEBRASKA BOOK WTS 29/06/19 B | 7,216,615 | 0 | 0.00 |
| — | 44,229 | NEBRASKA BOOK WTS 29/06/19 A | 3,367,734 | 0 | 0.00 |
| — | 8,250 | IPAYMENT HDGS INC 144A WTS18 | 0 | 0 | 0.00 |
| | | | 12,398,141 | 1,379,114 | 0.11 |
| | | 合計：アメリカ | 399,284,313 | 356,504,590 | 28.07 |
| 国債 | | | | | |
| | | ウルグアイ | | | |
| USD | 120,000 | REP OF URUGUAY 7.875% PIK 15/01/33 | 169,208 | 163,050 | 0.01 |
| UYU | 2,345,000 | REP OF URUGUAY 3.7% 26/06/37 CPI | 138,771 | 119,010 | 0.01 |
| | | | 307,979 | 282,060 | 0.02 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|---------------------------------------|-------------------|------------------|-------------|
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,030,000 | REP OF URUGUAY 4.375% 27/10/27 | 1,021,141 | 1,084,075 | 0.09 |
| USD | 758,123 | REP OF URUGUAY 4.5% 14/08/24 | 805,079 | 822,563 | 0.06 |
| USD | 161,000 | REP ORIENT URUGUAY 7.625% 21/03/36 | 223,080 | 217,149 | 0.02 |
| USD | 140,000 | REP ORIENT URUGUAY 5.1% 18/06/50 | 131,343 | 138,950 | 0.01 |
| | | | <u>2,180,643</u> | <u>2,262,737</u> | <u>0.18</u> |
| | | 合計：ウルグアイ | <u>2,488,622</u> | <u>2,544,797</u> | <u>0.20</u> |
| ベネズエラ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,542,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 7/5/28 * | 2,397,323 | 1,514,206 | 0.13 |
| USD | 2,731,000 | BOL REP OF VZLA 8.25% 13/10/24 REGS * | 1,801,531 | 1,129,951 | 0.09 |
| USD | 907,200 | REP OF VENEZUELA 11.75% 21/10/26 | 611,913 | 427,518 | 0.03 |
| USD | 927,500 | REP OF VENEZUELA 9% 07/05/23 | 550,310 | 391,869 | 0.03 |
| USD | 680,000 | REP OF VENEZUELA 7.65% 21/04/25 | 364,925 | 274,550 | 0.02 |
| USD | 529,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 15/09/27 | 433,218 | 253,920 | 0.02 |
| USD | 487,000 | REP OF VENEZUELA 7.75% 13/10/19 REG | 384,538 | 216,106 | 0.02 |
| USD | 528,000 | REP OF VENEZUELA 6% 09/12/20 REGS | 188,257 | 212,520 | 0.02 |
| USD | 340,000 | REP OF VENEZUELA 9.375% 13/01/34 | 118,000 | 146,200 | 0.01 |
| USD | 140,000 | REP OF VENEZUELA 7% 31/03/38 | 52,360 | 55,300 | 0.00 |
| | | | <u>6,902,375</u> | <u>4,622,140</u> | <u>0.37</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 2,999,400 | PETROLEOS VENEZ 8.5% 02/11/17 | 1,261,546 | 1,401,519 | 0.10 |
| USD | 2,130,000 | PETROLEOS VENEZ 6% 16/05/24 REGS | 688,350 | 750,612 | 0.05 |
| USD | 2,035,000 | PETROLEOS VENEZU 6% 15/11/26 REGS | 673,795 | 712,047 | 0.06 |
| USD | 1,379,800 | REP OF VENEZUELA 11.95% 5/8/31 | 794,681 | 645,057 | 0.05 |
| USD | 1,062,678 | PETROLEOS VENEZU 9% 17/11/21 REGS | 425,941 | 462,265 | 0.04 |
| USD | 564,207 | PETROLEOS VENEZ 9.75% 17/05/35 REGS | 321,922 | 227,093 | 0.02 |
| USD | 398,000 | BOL REP OF VZLA 12.75% 23/08/22 | 333,085 | 201,985 | 0.02 |
| USD | 182,000 | PETROLEOS VENEZU 12.75% 17/02/22 RE | 196,016 | 92,274 | 0.01 |
| | | | <u>4,695,336</u> | <u>4,492,852</u> | <u>0.35</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 760,000 | PETROLEOS VENEZUELA 5.25% 12/04/17 | 534,622 | 476,519 | 0.04 |
| USD | 209,465 | PETROLEOS DE VEN 5.125% 28/10/16 | 158,061 | 189,566 | 0.01 |
| USD | 204,000 | PETROLEOS VENEZUELA 5.375% 12/04/27 | 134,001 | 70,870 | 0.01 |
| | | | <u>826,684</u> | <u>736,955</u> | <u>0.06</u> |
| | | 合計：ベネズエラ | <u>12,424,395</u> | <u>9,851,947</u> | <u>0.78</u> |
| ベトナム | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 465,000 | REP SOCIAL VIETNAM 6.75% 29/1/20 | 521,818 | 515,409 | 0.04 |
| USD | 319,000 | REP OF VIETNAM 4.8% 19/11/24 REGS | 319,000 | 328,758 | 0.03 |
| | | | <u>840,818</u> | <u>844,167</u> | <u>0.07</u> |
| | | 合計：ベトナム | <u>840,818</u> | <u>844,167</u> | <u>0.07</u> |
| ザンビア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 600,000 | REP OF ZAMBIA 5.375% 20/09/22 REGS | 563,574 | 468,060 | 0.04 |
| | | | <u>563,574</u> | <u>468,060</u> | <u>0.04</u> |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------|----------------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------|--------------|
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF ZAMBIA 8.97% 30/07/27 REGS | <u>169,250</u> | <u>173,020</u> | <u>0.01</u> |
| | | 合計：ザンビア | <u>169,250</u> | <u>173,020</u> | <u>0.01</u> |
| | | | <u>732,824</u> | <u>641,080</u> | <u>0.05</u> |
| | | 組入資産合計 | <u>1,188,277,191</u> | <u>1,113,836,684</u> | <u>87.70</u> |

*部分的にデリバティブのために担保として差し入れられている有価証券

⁽¹⁾ 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記

2016年6月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数、額面は通貨を欄左側に表示)

注記1－外国為替先渡し契約

2016年6月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は日本円クラス、資源国通貨クラス、及びアジア通貨クラスの投資目的とヘッジ目的で用いられた。

| 購入通貨 | 購入金額 | 売却通貨 | 売却金額 | 満期日 | 未実現損益(米ドル) |
|------|-----------------|------|-------------|------------|-------------|
| BRL | 315,246,132 | USD | 91,900,000 | 2016年8月2日 | 4,371,797 |
| BRL | 348,326,299 | USD | 102,100,000 | 2016年8月2日 | 4,274,023 |
| BRL | 244,947,681 | USD | 71,600,000 | 2016年8月2日 | 3,203,626 |
| JPY | 7,063,961,864 | USD | 66,086,707 | 2016年7月15日 | 2,728,341 |
| BRL | 123,208,803 | USD | 35,700,000 | 2016年8月2日 | 1,926,261 |
| ZAR | 2,121,891,636 | USD | 141,057,897 | 2016年7月15日 | 1,525,547 |
| JPY | 8,006,097,370 | USD | 76,834,242 | 2016年7月29日 | 1,193,269 |
| BRL | 54,175,755 | USD | 15,773,398 | 2016年8月2日 | 771,126 |
| JPY | 3,789,836 | USD | 35,447 | 2016年7月15日 | 1,472 |
| JPY | 1,992,269 | USD | 19,140 | 2016年7月15日 | 268 |
| ZAR | 323,088 | USD | 21,604 | 2016年7月15日 | 106 |
| AUD | 29,016 | USD | 21,604 | 2016年7月15日 | (66) |
| JPY | 2,842,907 | USD | 27,974 | 2016年7月29日 | (267) |
| JPY | 2,843,802 | USD | 27,974 | 2016年7月15日 | (271) |
| AUD | 193,060,690 | USD | 143,563,790 | 2016年7月15日 | (259,556) |
| AUD | 220,933,271 | USD | 165,092,387 | 2016年7月29日 | (1,186,399) |
| ZAR | 2,329,965,470 | USD | 157,300,432 | 2016年7月29日 | (1,196,913) |
| USD | 311,012 | JPY | 31,616,679 | 2016年7月15日 | 3,012 |
| USD | 311,012 | JPY | 31,606,725 | 2016年7月29日 | 2,973 |
| USD | 64,811 | JPY | 6,646,193 | 2016年7月29日 | 38 |
| USD | 64,811 | JPY | 6,649,142 | 2016年7月15日 | 38 |
| USD | 25,064 | AUD | 33,820 | 2016年7月29日 | (26) |
| USD | 25,064 | AUD | 33,802 | 2016年7月15日 | (26) |
| USD | 25,064 | ZAR | 383,398 | 2016年7月29日 | (622) |
| USD | 25,064 | ZAR | 382,286 | 2016年7月15日 | (623) |
| USD | 220,484 | AUD | 298,257 | 2016年7月29日 | (786) |
| USD | 220,484 | AUD | 298,102 | 2016年7月15日 | (789) |
| USD | 59,889 | JPY | 6,254,756 | 2016年7月15日 | (1,042) |
| USD | 59,889 | JPY | 6,252,570 | 2016年7月29日 | (1,048) |
| USD | 530,287 | AUD | 717,337 | 2016年7月29日 | (1,891) |
| USD | 530,287 | AUD | 716,965 | 2016年7月15日 | (1,898) |
| USD | 50,129 | BRL | 172,062 | 2016年8月2日 | (2,416) |
| USD | 220,484 | ZAR | 3,367,253 | 2016年7月29日 | (5,115) |
| USD | 220,484 | ZAR | 3,357,751 | 2016年7月15日 | (5,144) |
| USD | 530,287 | ZAR | 8,098,579 | 2016年7月29日 | (12,303) |
| USD | 530,287 | ZAR | 8,075,728 | 2016年7月15日 | (12,372) |
| USD | 440,969 | BRL | 1,492,389 | 2016年8月2日 | (14,786) |
| USD | 1,060,575 | BRL | 3,589,346 | 2016年8月2日 | (35,561) |
| USD | 35,643,365 | GBP | 24,628,000 | 2016年7月14日 | 2,486,508 |
| IDR | 698,044,737,862 | USD | 50,967,051 | 2016年7月26日 | 1,748,075 |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 購入通貨 | 購入金額 | 売却通貨 | 売却金額 | 満期日 | 未実現損益(米ドル) |
|------|------------|------|------------|------------|------------|
| USD | 65,653,153 | EUR | 57,730,000 | 2016年7月14日 | 1,446,572 |
| USD | 1,948,039 | GBP | 1,365,000 | 2016年7月29日 | 110,173 |
| USD | 1,876,557 | GBP | 1,315,000 | 2016年7月29日 | 106,013 |
| USD | 1,613,185 | GBP | 1,130,000 | 2016年7月29日 | 91,729 |
| USD | 5,183,289 | EUR | 4,618,000 | 2016年7月14日 | 47,208 |
| USD | 2,584,352 | EUR | 2,276,000 | 2016年9月21日 | 46,491 |
| USD | 765,307 | MXN | 13,490,000 | 2016年7月20日 | 38,829 |
| USD | 3,059,416 | EUR | 2,715,000 | 2016年7月29日 | 38,121 |
| USD | 3,014,077 | EUR | 2,675,000 | 2016年7月29日 | 37,294 |
| USD | 2,952,216 | EUR | 2,620,000 | 2016年7月29日 | 36,638 |
| USD | 2,935,287 | EUR | 2,605,000 | 2016年7月29日 | 36,402 |
| USD | 2,879,142 | EUR | 2,555,000 | 2016年7月29日 | 35,897 |
| USD | 2,839,536 | EUR | 2,520,000 | 2016年7月29日 | 35,239 |
| USD | 1,283,387 | CHF | 1,231,000 | 2016年7月14日 | 25,329 |
| USD | 1,133,614 | EUR | 997,638 | 2016年7月15日 | 24,013 |
| USD | 880,505 | EUR | 776,488 | 2016年7月15日 | 16,873 |
| EUR | 1,692,150 | USD | 1,867,000 | 2016年7月29日 | 16,052 |
| GBP | 318,000 | USD | 420,563 | 2016年7月14日 | 7,562 |
| EUR | 785,000 | USD | 865,730 | 2016年7月14日 | 7,336 |
| MXN | 13,490,000 | USD | 720,504 | 2016年7月20日 | 5,975 |
| USD | 245,169 | EUR | 216,000 | 2016年7月14日 | 4,937 |
| USD | 187,540 | EUR | 165,000 | 2016年7月29日 | 3,926 |
| EUR | 370,000 | USD | 407,854 | 2016年7月29日 | 3,887 |
| USD | 197,692 | EUR | 174,000 | 2016年9月21日 | 3,673 |
| USD | 138,376 | EUR | 121,189 | 2016年7月15日 | 3,586 |
| EUR | 430,000 | USD | 475,055 | 2016年7月29日 | 3,456 |
| GBP | 120,000 | USD | 158,685 | 2016年7月29日 | 2,885 |
| USD | 167,098 | GBP | 122,000 | 2016年7月14日 | 2,849 |
| ZAR | 940,000 | USD | 59,880 | 2016年9月21日 | 2,402 |
| USD | 109,401 | EUR | 96,000 | 2016年9月21日 | 2,356 |
| USD | 176,844 | MXN | 3,265,000 | 2016年9月21日 | 2,152 |
| EUR | 433,000 | USD | 479,976 | 2016年7月14日 | 1,601 |
| GBP | 60,000 | USD | 79,352 | 2016年7月29日 | 1,433 |
| GBP | 130,000 | USD | 173,617 | 2016年7月14日 | 1,402 |
| USD | 124,383 | ZAR | 1,857,000 | 2016年9月21日 | 1,343 |
| USD | 101,664 | EUR | 90,000 | 2016年9月21日 | 1,310 |
| USD | 14,648 | GBP | 10,000 | 2016年7月29日 | 1,184 |
| USD | 121,486 | UYU | 3,842,000 | 2016年9月28日 | 973 |
| EUR | 95,000 | USD | 104,806 | 2016年7月29日 | 912 |
| GBP | 250,000 | USD | 335,731 | 2016年7月29日 | 874 |
| USD | 67,614 | EUR | 60,000 | 2016年7月29日 | 845 |
| USD | 63,025 | ZAR | 941,000 | 2016年9月21日 | 677 |
| GBP | 25,000 | USD | 33,016 | 2016年7月29日 | 644 |
| EUR | 85,000 | USD | 94,809 | 2017年3月15日 | 632 |
| USD | 17,125 | EUR | 15,000 | 2016年9月21日 | 400 |
| EUR | 25,000 | USD | 27,551 | 2016年9月21日 | 325 |
| EUR | 65,000 | USD | 72,258 | 2016年7月29日 | 75 |
| EUR | 632 | USD | 707 | 2016年7月15日 | (4) |
| EUR | 312 | USD | 354 | 2016年7月15日 | (8) |
| PEN | 193,000 | USD | 58,255 | 2016年9月21日 | (61) |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 購入通貨 | 購入金額 | 売却通貨 | 売却金額 | 満期日 | 未実現損益(米ドル) |
|------|---------------|------|-------------|------------|------------|
| USD | 60,780 | ZAR | 907,000 | 2016年7月20日 | (102) |
| EUR | 5,000 | USD | 5,677 | 2016年9月21日 | (103) |
| GBP | 50,000 | USD | 67,448 | 2016年7月29日 | (127) |
| USD | 81,688 | ZAR | 1,219,000 | 2016年7月20日 | (137) |
| EUR | 380,000 | USD | 423,346 | 2016年7月29日 | (476) |
| USD | 589,193 | EUR | 530,000 | 2016年7月29日 | (599) |
| USD | 73,421 | PEN | 246,000 | 2016年9月21日 | (754) |
| USD | 73,090 | PEN | 245,000 | 2016年9月21日 | (783) |
| EUR | 65,000 | USD | 73,438 | 2016年7月29日 | (1,106) |
| USD | 428,060 | EUR | 386,000 | 2016年7月14日 | (1,244) |
| USD | 421,549 | EUR | 380,000 | 2016年7月29日 | (1,321) |
| USD | 274,332 | EUR | 248,000 | 2016年7月14日 | (1,490) |
| USD | 411,262 | THB | 14,534,000 | 2016年9月21日 | (1,526) |
| EUR | 133,000 | USD | 149,875 | 2016年9月21日 | (1,574) |
| USD | 428,705 | THB | 15,168,000 | 2016年9月21日 | (2,088) |
| EUR | 130,000 | USD | 146,927 | 2016年7月29日 | (2,261) |
| USD | 46,343 | BRL | 160,000 | 2016年8月17日 | (2,285) |
| EUR | 610,013 | GBP | 506,000 | 2016年7月29日 | (2,457) |
| EUR | 144,000 | USD | 163,409 | 2016年7月14日 | (3,254) |
| EUR | 298,000 | USD | 334,915 | 2016年7月14日 | (3,483) |
| EUR | 475,000 | USD | 537,201 | 2017年3月15日 | (3,855) |
| GBP | 230,000 | USD | 313,846 | 2016年7月29日 | (4,169) |
| EUR | 363,000 | USD | 408,058 | 2016年7月14日 | (4,335) |
| EUR | 195,000 | USD | 223,451 | 2017年3月15日 | (4,499) |
| USD | 309,360 | TRY | 927,000 | 2016年9月21日 | (5,257) |
| EUR | 640,000 | USD | 721,194 | 2016年7月29日 | (8,992) |
| EUR | 539,039 | USD | 608,773 | 2016年7月15日 | (9,239) |
| USD | 306,140 | BRL | 1,035,000 | 2016年8月2日 | (9,934) |
| GBP | 151,000 | USD | 215,330 | 2016年7月14日 | (12,038) |
| GBP | 120,000 | USD | 176,139 | 2016年7月29日 | (14,569) |
| GBP | 140,000 | USD | 205,627 | 2016年7月29日 | (17,128) |
| USD | 887,893 | GBP | 674,000 | 2016年7月29日 | (19,594) |
| USD | 3,332,056 | EUR | 3,020,000 | 2016年7月29日 | (28,648) |
| INR | 3,327,329,016 | USD | 49,066,964 | 2016年7月26日 | (30,195) |
| USD | 811,678 | EUR | 755,000 | 2017年3月15日 | (36,062) |
| USD | 851,052 | BRL | 3,210,000 | 2016年8月17日 | (124,546) |
| USD | 15,930,000 | EUR | 14,438,110 | 2016年7月29日 | (136,963) |
| USD | 27,300,417 | GBP | 20,474,796 | 2016年7月29日 | (267,297) |
| GBP | 4,031,000 | USD | 5,697,536 | 2016年7月14日 | (270,571) |
| CNY | 334,853,895 | USD | 51,232,236 | 2016年7月21日 | (884,871) |
| USD | 168,595,496 | EUR | 152,399,127 | 2016年7月29日 | (996,720) |

20,840,320

注記2－先物契約

2016年6月30日現在、ファンドは以下の未決済先物契約を有していた。

| 通貨 | 契約数 | 銘柄名 | 満期日 | 評価金額 (米ドル) | 未実現損益 (米ドル) |
|------------------|-------|---------------------------|---------|---------------|----------------|
| 買い持ちポジション | | | | | |
| EUR | 53 | FUT EURO BOBL 5YR 6% | 2016年9月 | 7,871,019 | 82,559 |
| EUR | 82 | FUT EURO SCHATZ 2YR 6% | 2016年9月 | 10,214,861 | 25,522 |
| USD | 53 | FUT US ULTRA BOND 30YR 6% | 2016年9月 | 9,959,031 | 692,341 |
| USD | 39 | FUT US 2YR NOTE 6% | 2016年9月 | 8,552,578 | 55,848 |
| | | | | 36,597,489 | 856,270 |
| 売り持ちポジション | | | | | |
| EUR | (18) | FUT EURO BUND 10YR 6% | 2016年9月 | (3,343,871) | (76,481) |
| EUR | (5) | FUT EURO BUXL 30YR 4% | 2016年9月 | (1,090,257) | (74,788) |
| GBP | (60) | FUT LONG GILT 10YR 4% | 2016年9月 | (10,378,395) | (479,383) |
| USD | (17) | FUT US LONG BD 20YR 6% | 2016年9月 | (2,950,563) | (160,539) |
| USD | (64) | FUT US NOTE 10YR 6% | 2016年9月 | (8,525,000) | (205,272) |
| USD | (125) | FUT US NOTE 5YR 6% | 2016年9月 | (15,272,461) | (250,091) |
| USD | (107) | FUT US ULTRA NOTE 10YR 6% | 2016年9月 | (15,628,688) | (368,490) |
| USD | (47) | FUT 90 DAY EURODOLLAR | 2016年9月 | (11,674,800) | (11,750) |
| | | | | (68,864,035) | (1,626,794) |
| | | | | | (770,524) |

注記3 クレジット・デフォルト・スワップ契約

2016年6月30日現在、ファンドは以下の未決済クレジット・デフォルト・スワップ契約を有していた。

| 通貨 | 額面 | 銘柄名 | 満期日 | 未実現損益(米ドル) |
|-----------------------|------------|-------------------------------------|-------------|------------|
| プロテクション買いポジション | | | | |
| USD | 3,250,000 | CDS BOFA 100BP 1% 20/03/18 | 2018年3月20日 | 26,579 |
| USD | 3,255,000 | CDS CITIGROUP 100BP 1% 20/03/18 | 2018年3月20日 | 26,425 |
| USD | 1,630,000 | CDS GS 100BP 1% 20/03/18 | 2018年3月20日 | 12,344 |
| USD | 1,630,000 | CDS MS 100BP 1% 20/03/18 | 2018年3月20日 | 11,579 |
| USD | 540,000 | CDS REP COLOMBIA 100BP 1% 20/06/21 | 2021年6月20日 | (27,606) |
| USD | 220,000 | CDS REP STH AFRICA 1% 5Y 20/06/21 | 2021年6月20日 | (18,329) |
| USD | 175,000 | CDS REP STH AFRICA 100B 1% 20/12/20 | 2020年12月20日 | (11,976) |
| USD | 516,000 | CDS RUSSIA FED 100BP 1% 5Y 20/06/21 | 2021年6月20日 | (31,805) |
| USD | 255,000 | CDS RUSSIA FED 100BP 1% 5Y 20/12/20 | 2020年12月20日 | (12,478) |
| USD | 710,000 | CDS UTD MEXICAN 100BP 1% 20/06/21 | 2021年6月20日 | (21,562) |
| USD | 4,804,000 | CDX NA HY 25 5Y 500 BP 5% 20/12/20 | 2020年12月20日 | 177,118 |
| USD | 14,115,000 | CDX NA HY 26 5Y 500BP 5% 20/06/21 | 2021年6月20日 | 388,584 |
| | | | | 518,873 |
| プロテクション売りポジション | | | | |
| USD | 390,000 | CDS BOL REP VEN 500BP 5% 20/03/19 | 2019年3月20日 | 217,806 |
| USD | 125,000 | CDS FED REP BRAZIL 1% 5Y 20/06/21 | 2021年6月20日 | 12,269 |
| USD | 325,000 | CDS UTD MEXICAN 100BP 1% 20/06/18 | 2018年6月20日 | (1,596) |
| USD | 6,350,000 | CDX EM 25 5Y V2 100BP 1% 20/06/21 | 2021年6月20日 | 486,057 |
| EUR | 2,216,000 | CDX ITRAX EUROPE 25 5Y 1% 20/06/21 | 2021年6月20日 | (18,015) |
| EUR | 1,165,000 | CDX ITRAXX XOVER 25 S1 5% 20/06/21 | 2021年6月20日 | (72,904) |
| USD | 3,988,000 | CDX NA IG 26 5Y 100BP 1% 20/06/21 | 2021年6月20日 | (35,569) |
| | | | | 588,048 |
| | | | | 1,106,921 |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年8月19日）

作成対象期間（2015年8月20日～2016年8月19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 | 本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。 |

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 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-----|-----|-------|--------|--------|
| | | 騰 | 落 | | | |
| | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| 10期(2012年8月20日) | 10,181 | | 0.1 | 100.7 | — | 2,216 |
| 11期(2013年8月19日) | 10,191 | | 0.1 | 80.9 | — | 5,297 |
| 12期(2014年8月19日) | 10,199 | | 0.1 | 59.7 | — | 8,648 |
| 13期(2015年8月19日) | 10,206 | | 0.1 | 44.7 | — | 22,034 |
| 14期(2016年8月19日) | 10,211 | | 0.0 | 68.6 | — | 19,722 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

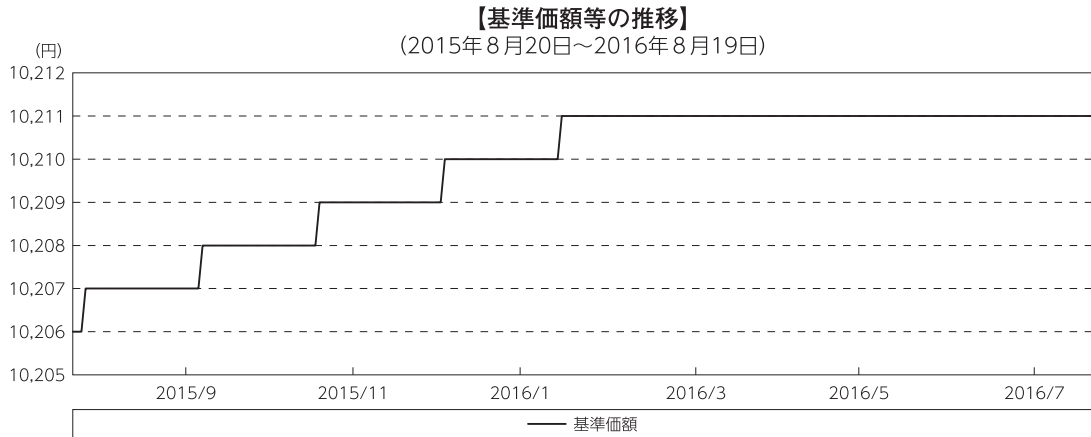
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|----------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2015年8月19日 | 円 10,206 | | % — | % 44.7 | % — |
| 8月末 | 10,207 | | 0.0 | 48.6 | — |
| 9月末 | 10,207 | | 0.0 | 43.6 | — |
| 10月末 | 10,208 | | 0.0 | 44.4 | — |
| 11月末 | 10,209 | | 0.0 | 48.8 | — |
| 12月末 | 10,209 | | 0.0 | 48.5 | — |
| 2016年1月末 | 10,210 | | 0.0 | 51.8 | — |
| 2月末 | 10,211 | | 0.0 | 49.1 | — |
| 3月末 | 10,211 | | 0.0 | 40.8 | — |
| 4月末 | 10,211 | | 0.0 | 39.9 | — |
| 5月末 | 10,211 | | 0.0 | 62.4 | — |
| 6月末 | 10,211 | | 0.0 | 58.0 | — |
| 7月末 | 10,211 | | 0.0 | 65.1 | — |
| (期末) 2016年8月19日 | 円 10,211 | | % 0.0 | % 68.6 | % — |

*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



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

国内経済は、足許の企業収益に弱さがみられるものの、企業収益の水準としては依然として高水準にある事や雇用環境の改善などを受け、基調としては緩やかな回復を続けました。しかしながら、新興国を中心とした海外経済には弱さが見られ、また個人消費の不振が長引く中で物価見通しについても低下するなど、国内経済の下押しリスクがより認識されるようになりました。

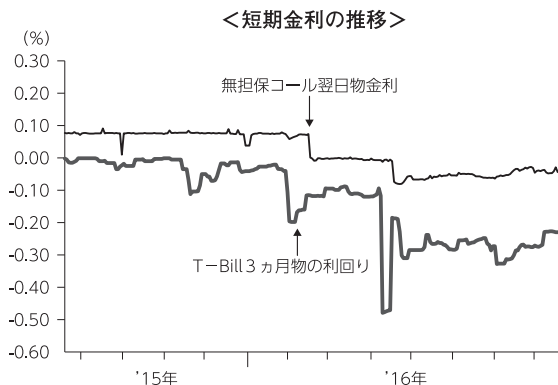
このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

・無担保コール翌日物金利の推移

2016年2月半ば頃まで概ね0.07%台で推移しました。日本銀行当座預金の一部へのマイナス金利の適用が開始された2月16日以降は、概ねゼロ%近傍のマイナス圏で推移しました。無担保コール取引による資金の運用ニーズが高まった4月18日以降、そのマイナス幅は深まりました。

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外からの資金流入に伴う需給ひっ迫などにより、期を通じて利回りはマイナス圏で推移しました。日本銀行がマイナス金利導入を決定した2016年1月末以降、利回りは低下し、4月以降についてはマイナス幅が一段と深まりました。



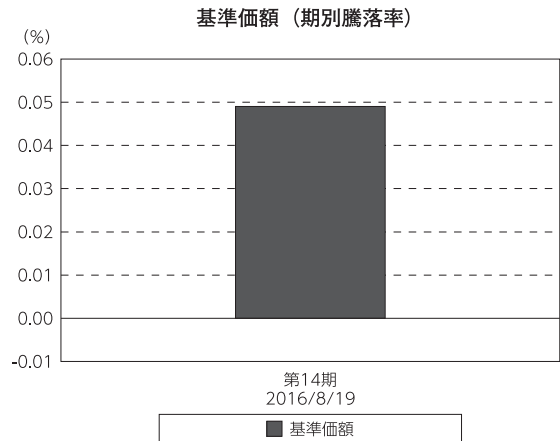
○当ファンドのポートフォリオ

- (1) 残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図るという方針のもと、運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、残存期間の短い高格付けの公社債等によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローン等により運用してまいりました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

今後も、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用してまいります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年8月20日～2016年8月19日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|---------------|-----------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 円 0 (0) | % 0.001 (0.001) | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 0 | 0.001 | |
| 期中の平均基準価額は、10,209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8月20日～2016年8月19日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|----------------|------------------|---------------------------------|
| 国 内 | 国債証券 | 千円 42,008,214 | 千円 38,608,278 (4,580,000) |
| | 地方債証券 | 8,739,283 | — (7,094,300) |
| | 特殊債券 | 18,846,302 | — (15,866,000) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 3,709,487 | — (3,400,000) |

*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。

その他有価証券

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|-------------|-----------------|------------------------|
| 国 内 | コマーシャル・ペーパー | 千円 5,898,732 | 千円 — (7,200,000) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2015年8月20日～2016年8月19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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 34,695 | 4,630 | 13.3 | — | — | — |
| 預金 | 231,734 | 231,734 | 100.0 | 231,734 | 231,734 | 100.0 |

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証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)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B B格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 2,898,010 | 2,904,779 | 14.7 | — | — | — | 14.7 |
| | (2,898,010) | (2,904,779) | (14.7) | (—) | (—) | (—) | (14.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 5,325,000 | 5,333,466 | 27.0 | — | — | — | 27.0 |
| | (5,325,000) | (5,333,466) | (27.0) | (—) | (—) | (—) | (27.0) |
| 金融債券 | 3,780,000 | 3,783,502 | 19.2 | — | — | — | 19.2 |
| | (3,780,000) | (3,783,502) | (19.2) | (—) | (—) | (—) | (19.2) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1,500,000 | 1,501,704 | 7.6 | — | — | — | 7.6 |
| | (1,500,000) | (1,501,704) | (7.6) | (—) | (—) | (—) | (7.6) |
| 合 計 | 13,503,010 | 13,523,452 | 68.6 | — | — | — | 68.6 |
| | (13,503,010) | (13,523,452) | (68.6) | (—) | (—) | (—) | (68.6) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*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。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当期末 | | | 償還年月日 |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 東京都 公募第637回 | 1.81 | 200,000 | 200,273 | 2016/9/20 |
| 東京都 公募第638回 | 1.9 | 600,000 | 600,929 | 2016/9/20 |
| 北海道 公募平成18年度第7回 | 2.0 | 1,500 | 1,505 | 2016/10/31 |
| 北海道 公募平成18年度第10回 | 1.9 | 200,000 | 201,375 | 2016/12/28 |
| 北海道 公募(5年)平成23年度第12回 | 0.38 | 5,000 | 5,007 | 2017/1/31 |
| 北海道 公募(5年)平成23年度第14回 | 0.35 | 200,000 | 200,477 | 2017/3/23 |
| 神奈川県 公募第143回 | 1.77 | 100,000 | 100,596 | 2016/12/20 |
| 神奈川県 公募(5年)第49回 | 0.37 | 101,700 | 101,728 | 2016/9/20 |
| 大阪府 公募第294回 | 2.0 | 12,000 | 12,024 | 2016/9/28 |
| 大阪府 公募第295回 | 1.9 | 1,000 | 1,003 | 2016/10/28 |
| 大阪府 公募(5年)第77回 | 0.42 | 100,000 | 100,071 | 2016/10/28 |
| 兵庫県 公募平成18年度第8回 | 2.1 | 200,000 | 200,060 | 2016/8/24 |
| 埼玉県 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.41 | 200,000 | 200,098 | 2016/9/29 |
| 福岡県 公募平成18年度第3回 | 1.9 | 1,000 | 1,003 | 2016/10/31 |
| 千葉県 公募平成18年度第4回 | 1.8 | 8,600 | 8,626 | 2016/10/25 |
| 群馬県 公募第3回 | 1.9 | 9,000 | 9,042 | 2016/11/25 |
| 大分県 公募平成18年度第1回 | 1.8 | 198,000 | 198,709 | 2016/10/31 |
| 共同発行市場地方債 公募第41回 | 2.0 | 6,000 | 6,001 | 2016/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第43回 | 1.8 | 4,000 | 4,012 | 2016/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第44回 | 1.8 | 100,000 | 100,476 | 2016/11/25 |
| 島根県 公募平成23年度第1回 | 0.38 | 2,500 | 2,502 | 2016/11/25 |
| 熊本県 公募平成18年度第2回 | 1.8 | 7,500 | 7,524 | 2016/10/27 |
| 名古屋市 公募第456回 | 1.82 | 16,000 | 16,024 | 2016/9/20 |
| 京都市 公募平成23年度第3回 | 0.364 | 4,000 | 4,001 | 2016/9/29 |
| 横浜市 公募平成18年度第3回 | 1.87 | 200,000 | 201,260 | 2016/12/20 |
| 札幌市 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.4 | 12,900 | 12,903 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募(5年)第29回 | 0.36 | 12,200 | 12,203 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募(5年)第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,002 | 2017/3/17 |
| 北九州市 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.36 | 7,000 | 7,002 | 2016/9/28 |
| 福岡市 公募平成23年度第3回 | 0.39 | 300,000 | 300,041 | 2016/8/26 |
| 広島市 公募平成18年度第1回 | 1.82 | 6,000 | 6,037 | 2016/12/26 |
| 仙台市 公募平成23年度第1回 | 0.36 | 59,410 | 59,484 | 2017/1/27 |
| さいたま市 公募第4回 | 1.8 | 5,000 | 5,030 | 2016/12/26 |
| 鹿児島県 公募平成18年度第1回 | 1.9 | 7,200 | 7,226 | 2016/10/31 |
| 鹿児島県 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.37 | 8,500 | 8,505 | 2016/10/31 |
| 小計 | | 2,898,010 | 2,904,779 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券(4年)第2回 | 0.13 | 200,000 | 200,017 | 2016/8/30 |
| 日本政策投資銀行債券 政府保証第13回 | 2.0 | 290,000 | 290,093 | 2016/8/25 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第17回 | 2.0 | 100,000 | 100,067 | 2016/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第19回 | 1.8 | 700,000 | 701,332 | 2016/9/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第21回 | 1.8 | 125,000 | 125,645 | 2016/11/30 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第19回 | 0.445 | 300,000 | 300,482 | 2016/12/20 |
| 日本政策投資銀行債券 財投機関債第27回 | 1.98 | 100,000 | 100,172 | 2016/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第15回 | 2.05 | 100,000 | 100,177 | 2016/9/20 |
| 地方公共団体金融機構債券(5年)第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,251 | 2017/4/28 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|--------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 地方公共団体金融機構債券(2年) | 第2回 | 0.1 | 200,000 | 200,179 | 2017/3/28 |
| 公営企業債券 | 第24回財投機関債 | 1.94 | 100,000 | 100,650 | 2016/12/20 |
| 首都高速道路 | 第8回 | 0.439 | 140,000 | 140,048 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 | 第20回財投機関債 | 0.471 | 900,000 | 900,378 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 | 第43回財投機関債 | 0.101 | 200,000 | 200,076 | 2016/11/18 |
| 関西国際空港社債 | 財投機関債第31回 | 0.504 | 70,000 | 70,030 | 2016/9/20 |
| 中部国際空港社債 | 財投機関債第2回 | 0.489 | 1,300,000 | 1,303,478 | 2017/2/24 |
| 日本学生支援債券 | 財投機関債第38回 | 0.1 | 300,000 | 300,206 | 2017/2/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第10回 | 1.99 | 100,000 | 100,176 | 2016/9/20 |
| 小 | 計 | | 5,325,000 | 5,333,466 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 | 利付第736回い号 | 0.45 | 300,000 | 300,133 | 2016/9/27 |
| 商工債券 | 利付第737回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,156 | 2016/10/27 |
| 商工債券 | 利付第738回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,239 | 2016/11/25 |
| 農林債券 | 利付第735回い号 | 0.45 | 150,000 | 150,012 | 2016/8/26 |
| 農林債券 | 利付第736回い号 | 0.5 | 750,000 | 750,407 | 2016/9/27 |
| 農林債券 | 利付第737回い号 | 0.5 | 80,000 | 80,063 | 2016/10/27 |
| 農林債券 | 利付第739回い号 | 0.5 | 500,000 | 500,885 | 2016/12/27 |
| 農林債券 | 利付第742回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,540 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第261回 | 0.45 | 500,000 | 500,073 | 2016/8/26 |
| しんきん中金債券 | 利付第262回 | 0.45 | 100,000 | 100,045 | 2016/9/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第263回 | 0.5 | 100,000 | 100,093 | 2016/10/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第266回 | 0.45 | 300,000 | 300,618 | 2017/1/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第164回 | 0.2 | 200,000 | 200,036 | 2016/9/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第166回 | 0.2 | 100,000 | 100,052 | 2016/11/25 |
| 商工債券 | 利付(3年)第171回 | 0.2 | 100,000 | 100,142 | 2017/4/27 |
| 小 | 計 | | 3,780,000 | 3,783,502 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| アサヒグループホールディングス | 第1回特定社債間限定同順位特 | 0.52 | 200,000 | 200,181 | 2016/10/21 |
| みずほコーポレート銀行 | 第27回特定社債間限定同順位特約付 | 0.515 | 500,000 | 500,431 | 2016/10/20 |
| 三菱東京UFJ銀行 | 第129回特定社債間限定同順位特約付 | 0.465 | 100,000 | 100,078 | 2016/10/20 |
| 三菱東京UFJ銀行 | 第148回特定社債間限定同順位特約付 | 0.195 | 100,000 | 100,041 | 2016/10/31 |
| 三井住友銀行 | 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 100,083 | 2016/10/20 |
| トヨタファイナンス | 第23回社債間限定同等特約付 | 1.97 | 100,000 | 100,166 | 2016/9/20 |
| 三菱UFJリース | 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.66 | 400,000 | 400,720 | 2016/12/14 |
| 小 | 計 | | 1,500,000 | 1,501,704 | |
| 合 | 計 | | 13,503,010 | 13,523,452 | |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

| 区 分 | 当 期 末 | |
|-------------|-----------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 1,199,980 | % 6.1 |

*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。

○投資信託財産の構成

(2016年8月19日現在)

| 項目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 13,523,452 | 65.9 |
| その他有価証券 | 1,199,980 | 5.8 |
| コール・ローン等、その他 | 5,800,725 | 28.3 |
| 投資信託財産総額 | 20,524,157 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月19日現在)

| 項目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 20,524,157,958 |
| コール・ローン等 | 5,763,236,241 |
| 公社債(評価額) | 13,523,452,183 |
| その他有価証券 | 1,199,980,051 |
| 未収利息 | 16,503,055 |
| 前払費用 | 20,986,428 |
| (B) 負債 | 801,532,052 |
| 未払金 | 801,524,000 |
| 未払利息 | 8,052 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 19,722,625,906 |
| 元本 | 19,315,765,955 |
| 次期繰越損益金 | 406,859,951 |
| (D) 受益権総口数 | 19,315,765,955口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 10,211円 |

(注) 期首元本額は21,588,342,274円、期中追加設定元本額は3,803,787,310円、期中一部解約元本額は6,076,363,629円、1口当たり純資産額は1.0211円です。

○損益の状況 (2015年8月20日～2016年8月19日)

| 項目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 92,619,318 |
| 受取利息 | 92,152,370 |
| その他収益金 | 1,948,259 |
| 支払利息 | △ 1,481,311 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 83,175,377 |
| 売買益 | 14,438 |
| 売買損 | △ 83,189,815 |
| (C) 保管費用等 | △ 214,563 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,229,378 |
| (E) 前期繰越損益金 | 445,681,696 |
| (F) 追加信託差損益金 | 79,665,282 |
| (G) 解約差損益金 | △127,716,405 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 406,859,951 |
| 次期繰越損益金(H) | 406,859,951 |

*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。

○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

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---|---------------|
| | 円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF30(非課税適格機関投資家専用) | 5,423,785,404 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF50(適格機関投資家販売制限付) | 4,206,288,588 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用) | 4,181,906,577 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用) | 2,296,160,091 |
| 日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家販売制限付) | 1,186,053,936 |
| 野村DC重信用戦略ファンド | 379,067,282 |
| ネクストコア | 343,183,624 |
| 野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 317,657,897 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|-------------|
| | 円 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 151,953,753 |
| バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06 | 146,986,772 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型 | 113,781,191 |
| バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09 | 98,039,216 |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド) | 84,639,967 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型 | 49,578,893 |
| 野村高金利国際機関債投信(毎月分配型) | 49,354,623 |
| 野村新エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型 | 47,082,117 |

| ファンド名 | 当期末 | 円 |
|---------------------------------------|------------|---|
| | 元本額 | |
| 野村ビクテ・ジェネリック&グノム マネープール・ファンド | 33,758,750 | |
| 野村新中国株投資 マネープール・ファンド | 17,198,352 | |
| 野村世界業種別投資シリアルズ(マネープール・ファンド) | 10,016,716 | |
| 米国変動好金利ファンド Aコース | 8,829,589 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネープールファンド)年2回決算型 | 8,788,959 | |
| 野村グローバルCB投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 6,157,226 | |
| 野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド | 5,393,879 | |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 4,553,821 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネープールファンド)年2回決算型 | 4,315,818 | |
| コインの未来(毎月分配型) | 3,965,894 | |
| 野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド | 3,607,923 | |
| 野村・グリーン・テクノロジ マネープール・ファンド | 1,511,406 | |
| コインの未来(年2回分配型) | 991,474 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型 | 984,834 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,834 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,834 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型 | 984,834 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,834 | |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,834 | |
| 野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型 | 984,543 | |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,543 | |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,543 | |
| 野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型 | 984,543 | |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,543 | |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,543 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型 | 984,252 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 984,252 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 984,252 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型 | 984,252 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 984,252 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 984,252 | |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 983,768 | |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 983,768 | |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型 | 983,768 | |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 983,768 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型 | 983,672 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型 | 983,672 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型 | 983,672 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型 | 983,672 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型 | 983,672 | |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型 | 983,672 | |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース | 983,381 | |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース | 983,381 | |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース | 983,381 | |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型 | 983,091 | |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 983,091 | |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型 | 983,091 | |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 983,091 | |
| ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現物通貨建て債券 Aコース) | 982,995 | |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型 | 982,898 | |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,898 | |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,898 | |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型 | 982,898 | |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,898 | |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型 | 982,801 | |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース) | 982,609 | |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース) | 982,609 | |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース) | 982,609 | |
| 野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型 | 982,609 | |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 982,609 | |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 982,609 | |

| ファンド名 | 当期末 | 円 |
|-------------------------------------|---------|---|
| | 元本額 | |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 982,609 | |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型 | 982,609 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,609 | |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,609 | |
| 野村新世界高金利通貨投資 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村PMICO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(円コース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(インドネシアレアルコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(円コース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村新エマージング債券投資(中国元コース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村アジアCB投信(毎月分配型) | 982,608 | |
| 野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村グローバルREITプレミアム(Aコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,608 | |
| 野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,608 | |
| 野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,607 | |
| 野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,607 | |
| 野村新エマージング債券投資(中国元コース)毎月分配型 | 982,607 | |
| 野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(円コース)毎月分配型 | 982,607 | |
| 野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 982,607 | |
| 第12回 野村短期公社債ファンド | 982,607 | |
| 野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型 | 982,415 | |
| 野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,415 | |
| 野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型 | 982,415 | |
| 野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,415 | |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型 | 982,029 | |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,029 | |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型 | 982,029 | |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,029 | |
| 野村カルミニヤック・ファンド Aコース | 981,547 | |
| 野村カルミニヤック・ファンド Bコース | 981,547 | |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース)毎月分配型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 981,451 | |
| 野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 981,451 | |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型 | 981,451 | |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 野村エマージング債券プレミアム年2回決算型 | 981,451 |
| ノムラ THE USA Aコース | 981,258 |
| ノムラ THE USA Bコース | 981,258 |
| 米国変動好金利ファンド Bコース | 981,066 |
| 野村グローバルボンド投信 Bコース | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース | 980,489 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 毎月分配型 | 980,297 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 毎月分配型 | 980,297 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 年2回決算型 | 980,297 |
| ノムラ THE ASIA Bコース | 979,912 |
| グローバル・ストック Bコース | 979,528 |
| グローバル・ストック Dコース | 979,528 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 毎月分配型 | 588,871 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型 | 491,401 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 毎月分配型 | 294,436 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 年2回決算型 | 294,436 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 年2回決算型 | 196,925 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型 | 196,291 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 年2回決算型 | 196,291 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型 | 98,262 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型 | 98,261 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース | 98,261 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 第1回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第2回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第3回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第4回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第5回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第6回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第8回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第11回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型 | 98,260 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|-------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| 野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース | 98,260 |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース) | 98,260 |
| 第9回 野村短期公社債ファンド | 98,260 |
| 第10回 野村短期公社債ファンド | 98,260 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型 | 98,146 |
| ノムラ THE EUROPE Aコース | 98,117 |
| ノムラ THE EUROPE Bコース | 98,117 |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース | 98,049 |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース | 98,049 |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース | 98,049 |
| ノムラ THE ASIA Aコース | 97,992 |
| グローバル・ストック Aコース | 97,953 |
| グローバル・ストック Cコース | 97,953 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型 | 48,092 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型 | 13,741 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け) | 10,000 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型 | 9,826 |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 9,826 |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース | 9,818 |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース | 9,818 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型 | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型 | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型 | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型 | 9,809 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 9,808 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型 | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型 | 9,808 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型 | 9,807 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型 | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 9,807 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型 | 9,805 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型 | 9,805 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 9,805 |
| 野村新米國ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型 | 9,805 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 毎月分配型 | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 年2回決算型 | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 年2回決算型 | 9,803 |
| 野村新興国高配当株トリプルウィング プラジリアル毎月分配型 | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース) | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース) | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース) | 9,803 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け) | 9,801 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け) | 9,801 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 年2回決算型 | 4,908 |
| 野村高金利国際機関債投信(年2回決算型) | 1,967 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型 | 1,963 |

〇お知らせ

該当事項はございません。

〈「野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(バスケット通貨選択型)」(マネープールファンド(年2回決算型)を除く)の
お申し込み時の留意点〉

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日(以下「申込不可日」といいます。)があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようお願いいたします。

(2017年3月15日現在)

| 年 月 | ファンド名 「円コース」 「資源国通貨コース」 | 「アジア通貨コース」 |
|---------|-------------------------------|-----------------------|
| 2017年3月 | — | 28 |
| 4月 | 14、17 | 3、4、14、17、24 |
| 5月 | 1、25、29 | 1、11、25、29、30 |
| 6月 | 5、23 | 1、5、23、26、27、28、29、30 |
| 7月 | 4 | 4 |
| 8月 | 15、28 | 15、17、28 |
| 9月 | 4 | 1、4、21 |
| 10月 | — | 2、3、4、5、6、19、20 |
| 11月 | 1 | 1 |
| 12月 | 25、26 | 1、25、26 |

※2017年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。